

# 運用報告書(全体版)

第8期 <決算日 2023年1月11日>

## 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型

### 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	2015年10月30日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。
主要投資対象	<p>投資のソムリエ リスク抑制型</p> <p>国内債券・バッシブ・ファンド・マーケット</p> <p>国内株式・バッシブ・ファンド・マーケット</p> <p>為替・フル・ヘッジ・外債券・バッシブ・ファンド・マーケット</p> <p>海外の株式を主要投資対象とします。</p> <p>海外の株式・バッシブ・ファンド・マーケット</p> <p>J-REIT・インテックス・ファンド・マーケット</p> <p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定)不動産投資信託証券を主要投資対象とします。</p> <p>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。</p> <p>※海外の証券取引所に上場(これに準ずるものと含みます。)されている不動産投資信託証券とします。</p> <p>イマージン債券・バッシブ・マーケット</p> <p>新興国債券を主要投資対象とします。</p> <p>イマージン株式・バッシブ・マーケット</p> <p>海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。 ※DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
運用方法	<p>国内外の公債券、株式および不動産投資信託証券(リート)に実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。</p> <p>外債建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行い、一部または全部の為替ヘッジを軽減します。</p> <p>基準価額の変動リスクを年率2%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。</p> <p>※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を示すものであり、当ファンドが年率2%程度の収益を目指すことを意味するものではありません。</p> <p>基本配分戦略(月次)では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスクが当ファンドが受ける影響が均等になるように各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。</p> <p>機動的配分戦略(日次)では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。</p> <p>各マーケットアンドリターンへの実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p>
組入制限	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	<p>決算日(原則として1月11日、休業日の場合は翌営業日)に、終業時総合後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。</p>

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター: 0120-104-644

受付時間: 営業日の午前9時から午後5時まで

お客様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。

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、「投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型」は、2023年1月11日に第8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。

**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

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

## 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株組比率	式入率	株先比	式物率	債組比率	券入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債先比	券物率	投資信託受益証券、投資証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率											
4期(2019年1月11日)	円 10,394	円 0	% △1.8	% 3.0	% 0.2	% 75.8	% —	% —	% —	% —	% —	% 3.3	百万円 6,536	
5期(2020年1月14日)	11,162	0	7.4	15.0	1.2	67.3	—	—	—	—	—	4.5	12,208	
6期(2021年1月12日)	11,475	0	2.8	11.5	0.9	77.3	—	—	—	—	—	5.5	19,406	
7期(2022年1月11日)	11,420	0	△0.5	14.6	0.8	64.4	—	—	—	—	—	5.4	31,855	
8期(2023年1月11日)	10,296	0	△9.8	13.7	0.8	47.1	—	—	—	—	—	6.5	41,621	

(注1) 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」、「新株予約権付社債(転換社債)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2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指數先物を含めて表示しています。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドのコンセプトに適した指數が存在しないため、ベンチマークおよ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)。

## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	株組比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	債組比	券 入 率	新株予約権付社債(転換社債)比	債 先 比	券 物 率	投 資 信 記
											投 資 受 益 証 券、投 資 証 券 組 入 比 率
(期 首) 2022年1月11日	円 11,420	% —	% 14.6	% 0.8	% 64.4	% —	% —	% —	% —	% 5.4	
1月末	11,305	△1.0	7.5	0.3	71.8	—	—	—	—	2.6	
2月末	11,129	△2.5	7.9	0.3	70.9	—	—	—	—	2.2	
3月末	10,931	△4.3	14.2	0.7	40.6	—	—	—	—	5.5	
4月末	10,833	△5.1	7.1	△2.1	60.5	—	—	—	—	6.3	
5月末	10,762	△5.8	5.7	0.3	75.8	—	—	—	—	2.9	
6月末	10,519	△7.9	11.8	0.5	55.0	—	—	—	—	4.2	
7月末	10,757	△5.8	18.6	0.7	56.5	—	—	—	—	6.5	
8月末	10,684	△6.4	19.3	0.8	61.9	—	—	—	—	7.0	
9月末	10,393	△9.0	9.7	△1.9	62.1	—	—	—	—	2.9	
10月末	10,389	△9.0	9.8	0.7	62.6	—	—	—	—	6.1	
11月末	10,460	△8.4	9.4	0.9	46.4	—	—	—	—	6.8	
12月末	10,250	△10.2	12.2	0.7	69.5	—	—	—	—	6.0	
(期 末) 2023年1月11日	10,296	△9.8	13.7	0.8	47.1	—	—	—	—	6.5	

(注1) 謄落率は期首比です。

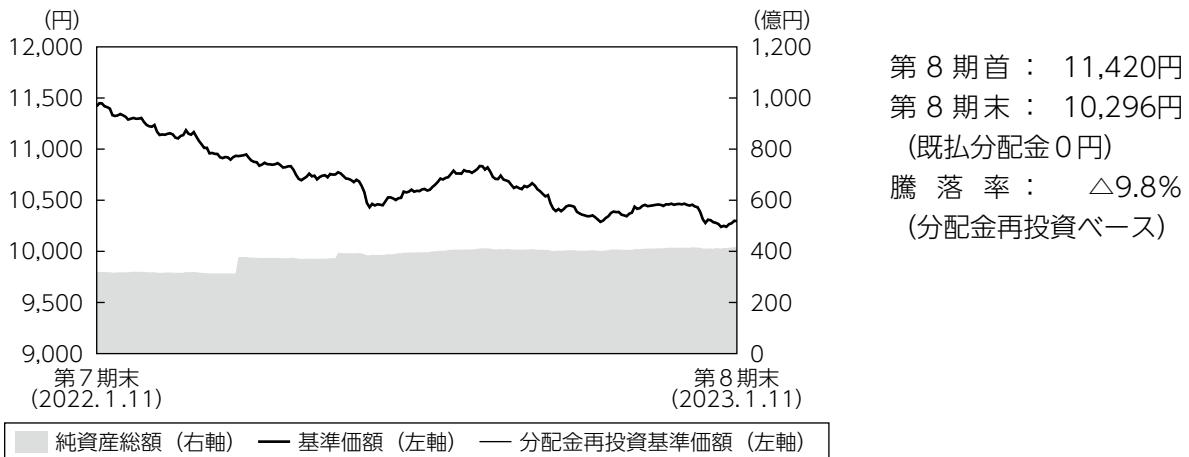
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、賃建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注4) 債券先物比率は、賃建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過 (2022年1月12日から2023年1月11日まで)

### 基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(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

当期は、欧米各国の金融引き締めや景気後退懸念を受け、債券市場・株式市場ともに下落する展開となりました。為替市場では、国内外の金利差拡大などを背景に、円は主要通貨に対して大幅に下落しましたが、期末にかけては政府・日銀の為替介入や日銀の金融政策修正等を受けて下落幅を縮小しました。当ファンドは日次戦略を活用した積極的な配分調整を行いましたが、市場全体が下落する中で、基準価額も下落しました。

### ◆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
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△5.0%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	△1.7%
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△14.4%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	△1.1%
J-R-E-I-Tインデックスファンド・マザーファンド	△4.1%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△9.3%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	△11.3%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	△3.3%

## 投資環境

国内債券市場では、債券価格は下落（利回りは上昇）しました。期初から2022年12月中旬の局面では、欧米の主要中央銀行による金融引き締めに伴う世界景気の減速懸念や、米長期金利の上昇につれた動きなどが交錯し、国内債券市場の利回りは横ばいとなりました。2022年12月下旬から期末にかけては、日銀が長期金利の変動幅を従来の±0.25%から±0.5%に拡大したことなどから利回りは上昇（債券価格は下落）しました。

国内株式市場は、期初から2022年3月半ばまでは、新型コロナウイルスの国内新規感染者数の拡大、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアによるウクライナ侵攻を要因として、下落しました。その後も、米国での金融引き締め、日銀の金融政策への疑惑、為替の動き、インフレ動向、国内の新型コロナウイルスの感染状況やウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式は一進一退の展開となりました。

先進国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りはともに上昇しました。米国債は、2022年9月のCPI（消費者物価指数）が市場予想を上回ったことなどから、インフレ抑制のためにFRB（米連邦準備理事会）が積極的な利上げを継続したことを背景に利回りは上昇しました。ドイツ債についてもドイツの生産者物価指数の伸び加速や米国債の利回りの上昇、 ECB（欧州中央銀行）の金融引き締め観測などを受けて利回りは上昇しました。

先進国株式市場は前期末比で下落しました。期前半は物価高騰によるFRBの断続的な利上げや、ロシアによるウクライナ侵攻に伴う天然ガス価格の高騰を受けた欧州の景気後退懸念から調整しました。その後2022年10月の米CPIの伸びが鈍化したこと、米国の利上げペースの減速期待から底堅く推移して期末を迎えました。

国内リート市場は下落しました。政府による新型コロナウイルスの水際対策緩和や日銀の金融緩和姿勢維持などがプラス要因となる一方で、ウクライナ情勢の緊迫化や米国の金融引き締め加速懸念などがマイナス要因となり、不安定な相場展開が続きました。期末にかけては、2022年12月に日銀が長期金利の変動幅を拡大すると事実上の利上げと受け止められて急落しましたが、押し目買いと見られる資金流入などからやや反発しました。

外国リート市場は多くの国で下落しました。米国リート市場はCPIの伸び加速を受けてFRBの利上げへの警戒感が強まり下落しました。欧州リート市場は英国の経済対策への懸念に伴う金利急騰などを背景にイタリア、オランダを除く市場で下落しました。オーストラリアリート市場は米国におけるCPIの伸び加速を背景とした長期金利の上昇が、オーストラリアの長期金利へも波及したことなどが嫌気され下落しました。

新興国債券市場では、債券価格は大幅に下落しました。2022年2月後半にロシアがウクライナに軍事侵攻したことで市場は急落しました。その後も経済・金融面での対ロシア制裁や、インフレ懸念による米長期金利の上昇、米中央銀行による金融引き締めなどにより、下落基調で推移しました。期末にかけては、米国物価統計の落ち着きなどにより新興国債券もやや値を戻しました。対米国債スプレッド（利回り格差）は3月にかけて急拡大し、その後テクニカル要因で縮小しました。期を通じては小幅に縮小しました。

新興国株式市場（円換算ベース）は前期末比で下落しました。2022年2月下旬のロシアによるウクライナ侵攻を受け、米欧などの制裁強化によりロシア株を中心に下落しました。3月中旬以降は和平交渉の進展期待から反発した後、不安定な展開が続きました。8月に中国の予想外の利下げにより新興国株式市場は上昇しましたが、9月には米CPIの伸び加速からFRBの大幅利上げ継続が嫌気され下落しました。その後は中国によるゼロコロナ政策の緩和期待から下げ幅を縮小して期末を迎えました。

為替市場では、欧米各国の中央銀行がインフレ率の上昇を受けて利上げを行う中、日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示したことで国内外の金利差が拡大し、ドルやユーロなどの主要通貨に対して円安が進みました。期末にかけては、政府・日銀が為替介入を行ったことや日銀による金融政策の修正により円の下落幅は縮小しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

#### 【基本配分戦略（月次）】

8つのマザーファンドおよび為替ヘッジに関する基本配分比率を月次で決定し、リバランスを行いました。期を通じ、安定資産へ55～70%程度、リスク性資産へ20～35%程度配分しました。

#### 【機動的配分戦略（日次）】

今期は市場が下落するリスクが高まったと判断したことから、期間の多くでリスク性資産・安定資産の配分を下げ、現金等の配分を高める運用を行いました。

### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BP I 総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

### ●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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、為替ヘッジあり）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。

### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（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したポートフォリオを構築しました。

### ●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

配当落ち以外の場合ではリートの組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマークと同等のリスク特性を維持しました。

### ●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。

### ●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

## ●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス(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したポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

#### ○資産配分

#### 期首(前期末)

資産		比率
安定資産	国内債券	27.6%
	為替ヘッジ先進国債券	30.4%
リスク性資産	新興国債券	6.9%
	国内株式	9.1%
	先進国株式	3.3%
	新興国株式	3.0%
	国内リート	2.4%
	先進国リート	2.9%
	現金等	14.3%



#### 期末

資産		比率
安定資産	国内債券	18.8%
	為替ヘッジ先進国債券	21.2%
リスク性資産	新興国債券	7.5%
	国内株式	2.5%
	先進国株式	5.7%
	新興国株式	6.3%
	国内リート	4.4%
	先進国リート	2.0%
	現金等	31.5%

※1 比率は純資産総額に対する割合です。

※2 国内債券：国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、為替ヘッジ先進国債券：為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、新興国債券：エマージング債券パッシブ・マザーファンド、国内株式：国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、先進国株式：外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、新興国株式：エマージング株式パッシブ・マザーファンド、国内リート：J-REITインデックスファンド・マザーファンド、先進国リート：外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

### 分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。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	当期	
	2022年1月12日 ～2023年1月11日	
当期分配金(税引前)	－円	
対基準価額比率	－%	
当期の収益	－円	
当期の収益以外	－円	
翌期繰越分配対象額	1,143円	

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下四捨五入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

基本戦略である基本配分戦略（月次）および機動的配分戦略（日次）に基づき、各マザーファンドの組入比率および為替ヘッジ比率を定め、安定した収益の獲得をめざします。

### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに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。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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目標としたパッシブ運用を行います。

### ●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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。

### ●外国株式パッシブ・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概ね一致させることで、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。

### ●J－R E I T インデックスファンド・マザーファンド

引き続き、リートの組入比率を高め、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。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマークと同等のリスク特性を維持するよう努めます。

### ●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。

### ●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

### ●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。また、保有しているロシア関連銘柄につきましては、売却可能となり次第、速やかに売却する方針です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第8期		項目の概要	
	(2022年1月12日 ～2023年1月11日)			
	金額	比率		
(a) 信託報酬	69円	0.649%	(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10,708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)	(33)	(0.308)		
(販売会社)	(33)	(0.308)		
(受託会社)	( 4)	(0.033)		
(b) 売買委託手数料	1	0.005	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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)	(0.003)		
(先物・オプション)	( 0)	(0.002)		
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)		
(投資証券)	( 0)	(0.000)		
(c) 有価証券取引税	1	0.007	(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	
(株式)	( 1)	(0.005)		
(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	0.021	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数	
(保管費用)	( 1)	(0.013)	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)	( 0)	(0.003)	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)	( 1)	(0.006)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等	
合計	73	0.682		

(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。

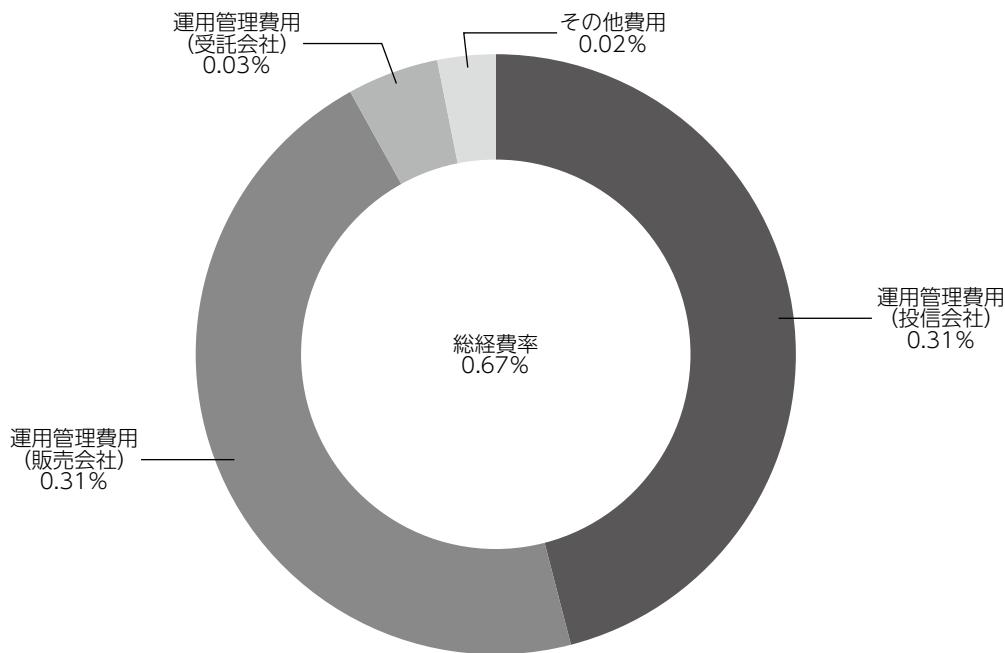
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.67%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。

## ■売買及び取引の状況 (2022年1月12日から2023年1月11日まで)

### 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円 -	百万円 -	百万円 2,749	百万円 2,692

(注) 金額は受渡代金です。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2022年1月12日から2023年1月11日まで)

	設定		解約	
	□ 数	金額	□ 数	金額
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 46,907,592	千円 59,516,910	千口 47,341,228	千円 59,747,000
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	3,882,354	12,396,000	4,439,668	14,082,785
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	23,940,446	31,550,830	23,521,681	30,700,000
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,092,742	6,520,500	871,575	4,984,991
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	2,390,943	5,741,250	1,917,539	4,487,401
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,253,805	3,928,710	2,251,220	3,840,328
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	3,997,701	7,949,840	3,388,139	6,712,001
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3,164,910	4,494,500	1,943,056	2,714,782

## ■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		
	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	784,818,914千円	440,314,838千円	129,415,334千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	376,648,169千円	700,123,852千円	70,794,835千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	2.08	0.62	1.82

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2022年1月12日から2023年1月11日まで)

【投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型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		当期							
区分	分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C		
金	銭	信	託	百万円 0.580	百万円 0.580	% 100.0	百万円 0.580	百万円 0.580	% 100.0

(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		当期
売買委託手数料総額 (A)		2,042千円
うち利害関係人への支払額 (B)		3千円
(B)/(A)		0.2%

(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。

【国内債券パッシブ・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状況

決算期		当期							
区分	分	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		
公	社	債	百万円 1,473,942	百万円 104,110	% 7.1	百万円 1,368,552	百万円 111,131	% 8.1	
金	銭	信	託	6	6	100.0	6	6	100.0

平均保有割合 1.8%

(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ペビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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		当期							
区分	分	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 352,099	百万円 231,022	% 65.6	百万円 432,719	百万円 229,125	% 53.0		
金	銭	信	託	1	1	100.0	1	1	100.0

平均保有割合 0.5%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ペ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	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 2,872	百万円 3,307	百万円 3,618

(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	百万円
株式		3

**【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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状況

決算期	当期						期
	区分	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	
金銭信託		百万円 0.216	百万円 0.216	% 100.0	百万円 0.216	百万円 0.216	% 100.0

平均保有割合 2.9%

(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。

**【外国株式パッシブ・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状況

決算期	当期						期
	区分	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	
金銭信託		百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0

平均保有割合 0.2%

(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。

【J-REITインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当期					
区分		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 18,173	百万円 4,474	% 24.6	百万円 18,344	百万円 -	% -
投資証券		190,846	14,611	7.7	173,856	23,688	13.6
金銭信託		0.406	0.406	100.0	0.406	0.406	100.0

平均保有割合 0.6%

(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ペ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		
投資証券	百万円 5,386		

【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状況

決算期		当期					
区分		買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金銭信託		百万円 0.012	百万円 0.012	% 100.0	百万円 0.012	百万円 0.012	% 100.0

平均保有割合 1.2%

(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ペビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

【エマージング債券パッシブ・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状況

決算期		当期					
区分		買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金銭信託		百万円 0.072	百万円 0.072	% 100.0	百万円 0.072	百万円 0.072	% 100.0

平均保有割合 1.8%

(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ペビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

【エマージング株式パッシブ・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状況

決算期		当期					
区分	分	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
		百万円 0.022	百万円 0.022	% 100.0	百万円 0.022	百万円 0.022	% 100.0
平均保有割合 1.7%							

(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ペビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ信託銀行、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

## ■組入資産の明細

### 親投資信託残高

	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 6,762,239	千口 6,328,603	千円 7,814,559
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	881,862	324,548	1,049,915
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,852,628	7,271,393	8,804,930
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	178,752	399,920	2,360,568
J-R-E-I-Tインデックスファンド・マザーファンド	323,195	796,599	1,840,223
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	534,439	537,024	851,022
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	999,776	1,609,338	3,135,796
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	650,595	1,872,449	2,638,843

## ■投資信託財産の構成

2023年1月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券パッジブ・ファンド・マザーファンド	7,814,559	18.7
国内株式パッジブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,049,915	2.5
為替フルヘッジ外国債券パッジブ・ファンド・マザーファンド	8,804,930	21.1
外国株式パッジブ・ファンド・マザーファンド	2,360,568	5.6
J-R E I T インデックスファンド・マザーファンド	1,840,223	4.4
外国リート・パッジブ・ファンド・マザーファンド	851,022	2.0
エマージング債券パッジブ・マザーファンド	3,135,796	7.5
エマージング株式パッジブ・マザーファンド	2,638,843	6.3
コール・ローン等、その他	13,297,434	31.8
投 資 信 託 財 産 総 額	41,793,293	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2023年1月11日現在、547,982千円、1.3%、為替フルヘッジ外国債券パッジブ・ファンド・マザーファンドは252,437,143千円、98.1%、外国株式パッジブ・ファンド・マザーファンドは802,795,507千円、99.9%、外国リート・パッジブ・ファンド・マザーファンドは65,447,819千円、98.7%、エマージング債券パッジブ・マザーファンドは124,385,915千円、98.1%、エマージング株式パッジブ・マザーファンドは98,281,118千円、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充賀相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年1月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=132.40円、1カナダ・ドル=98.59円、1オーストラリア・ドル=91.33円、1香港・ドル=16.95円、1シンガポール・ドル=99.44円、1ニュージーランド・ドル=84.37円、1台湾・ドル=4.343円、1イギリス・ポンド=160.99円、1イスラエル・シェケル=38.217円、1スイス・フラン=143.62円、1トルコ・リラ=7.049円、1デンマーク・クローネ=19.13円、1ノルウェー・クローネ=13.28円、1スウェーデン・クローネ=12.72円、1メキシコ・ペソ=6.948円、1フィリピン・ペソ=2.411円、100チリ・ペソ=15.976円、100コロンビア・ペソ=2.763円、1クウェート・ディナール=433.67円、1カタール・リアル=36.22円、1サウジアラビア・リアル=35.34円、1インド・ルピー=1.63円、100インドネシア・ルピア=0.85円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=36.11円、1ブラジル・レアル=25.428円、1チェコ・コルナ=5.931円、100韓国・ウォン=10.64円、1オフショア・人民元=19.51円、1マレーシア・リンギット=30.264円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.94円、1ポーランド・ズロチ=30.312円、100ハンガリー・フォリント=35.711円、1ユーロ=142.25円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年1月11日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資 産	コ ー ル・ロ ー ン 等	49,005,965,956円
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	12,603,386,270
	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	7,814,559,099
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,049,915,287
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	8,804,930,749
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,360,568,234
	J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	1,840,223,677
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	851,022,493
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	3,135,796,020
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	2,638,843,183
	未 収 入 金	7,358,738,548
	差 入 委 託 証 券 金	547,982,396
(B) 負 債	未 払 金	7,384,798,680
	未 払 解 約 金	7,214,457,384
	未 払 信 託 報 酬	36,367,780
	そ の 他 未 払 費 用	133,373,805
(C) 純 資 産 総 額(A-B)		41,621,167,276
元 本		40,425,094,758
次 期 繰 越 損 益 金		1,196,072,518
(D) 受 益 権 総 口 数		40,425,094,758口
1万口当たり基準価額(C/D)		10,296円

(注) 期首における元本額は27,895,013,337円、当期中ににおける追加設定元本額は17,155,827,515円、同解約元本額は4,625,746,094円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年1月12日 至2023年1月11日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		2,663,488円
受 取 利 息		48,648
そ の 他 収 益 金		5,270,293
支 払 利 息		△2,655,453
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		△3,320,502,287
売 買 益		1,384,450,204
売 買 損		△4,704,952,491
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益		73,972,564
取 引 益		93,301,578
取 引 損		△19,329,014
(D) 信 託 報 酬 等		△248,393,490
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)		△3,492,259,725
(F) 前 期 繰 越 損 益 金		449,906,942
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		4,238,425,301
(配 当 等 相 当 額)		(3,548,130,373)
(売 買 損 益 相 当 額)		(690,294,928)
(H) 合 計(E+F+G)		1,196,072,518
次 期 繰 越 損 益 金(H)		1,196,072,518
追 加 信 託 差 損 益 金		4,238,425,301
(配 当 等 相 当 額)		(3,563,578,072)
(売 買 損 益 相 当 額)		(674,847,229)
分 配 準 備 積 立 金		1,060,899,622
繰 越 損 益 金		△4,103,252,405

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

(注4) 分配金の計算過程

項	目	当 期
(a) 経 費 控 除 後 の 配 当 等 収 益		285,482,450円
(b) 経 費 控 除 後 の 有 価 証 券 売 買 等 損 益		0
(c) 収 益 調 整 金		3,563,578,072
(d) 分 配 準 備 積 立 金		775,417,172
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)		4,624,477,694
(f) 1万口当たり当期分配対象額		1,143.96
(g) 分 配 金		0
(h) 1万口当たり分配金		0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

（2022年3月15日）

■当ファンドが投資対象とする「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

（2022年3月15日）

■当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、東京証券取引所の市場区分の再編に伴い、主要投資対象を「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。

（2022年4月4日）

### その他のお知らせ

■機動的配分戦略（日次戦略）における資産配分に関するルールを変更しました。

（2022年10月12日）

# 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第19期 (決算日 2022年2月14日)  
 (計算期間 2021年2月16日～2022年2月14日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第19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3日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	NOMURA-BPI総合		債券組入比率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	純資産額
		期中騰落率	(ベンチマーク)				
15期 (2018年2月14日)	円 12,855	% 1.0	ポイント 380.56	% 1.0	% 99.5	% —	百万円 355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	292,112
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	222,859
18期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	273,346
19期 (2022年2月14日)	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	—	553,303

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等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）。

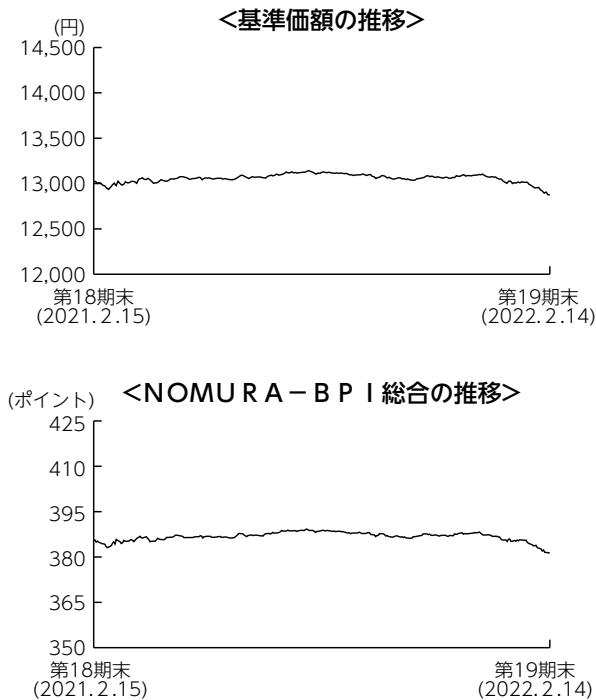
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	NOMURA-BPI総合		債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率
		騰 落 率 (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2021年 2月 15日	円 13,022	% —	ポイント 385.59	% —	% 99.2	% —
2 月 末	12,936	△0.7	383.06	△0.7	99.5	—
3 月 末	13,025	0.0	385.72	0.0	99.7	—
4 月 末	13,049	0.2	386.44	0.2	99.8	—
5 月 末	13,054	0.2	386.62	0.3	99.9	—
6 月 末	13,061	0.3	386.90	0.3	99.8	—
7 月 末	13,125	0.8	388.81	0.8	99.7	—
8 月 末	13,114	0.7	388.46	0.7	99.4	—
9 月 末	13,069	0.4	387.12	0.4	105.3	—
10 月 末	13,054	0.2	386.72	0.3	100.2	—
11 月 末	13,086	0.5	387.65	0.5	99.6	—
12 月 末	13,057	0.3	386.84	0.3	100.4	—
2022年 1 月 末	12,964	△0.4	384.06	△0.4	99.3	—
(期 末) 2022年 2 月 14日	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	—

(注1) 謄落率は期首比です。

(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 (2021年2月16日から2022年2月14日まで)



は上昇) しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手するとの観測が広がり基準価額は下落しました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI 総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 基準価額の推移

当期末の基準価額は12,872円となり、前期末比で1.2%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初は株式市場の上昇などを受けて基準価額は下落しました。2021年3月から8月にかけては新型コロナウイルスの感染収束が見通せず、国内景気の先行き不透明感が意識され基準価額は上昇しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手するとの観測が広がり基準価額は下落しました。

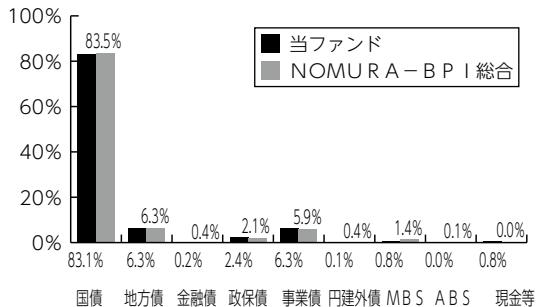
### 投資環境

国内債券市場は下落(利回りは上昇)しました。期初は株式市場の上昇などを受けて利回りは上昇しました。2021年3月から8月にかけては新型コロナウイルスの感染収束が見通せず、国内景気の先行き不透明感が意識され利回りは低下(価格

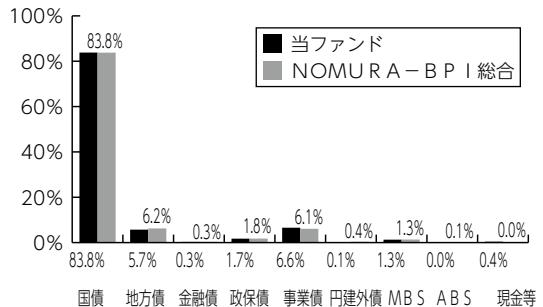
## 【運用状況】（注）比率は純資産総額に対する割合です。

### ○セクター別構成比

期首（前期末）

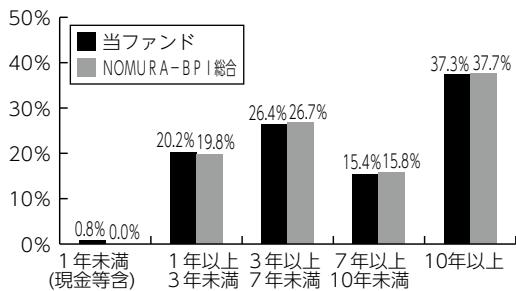


期末

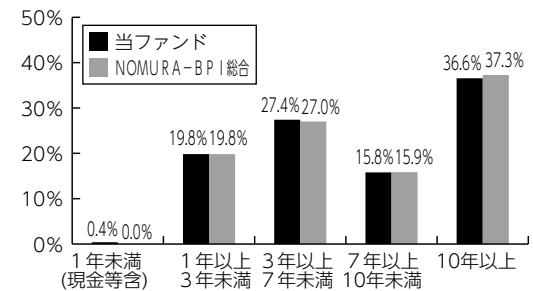


### ○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



### ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI 総合は、前期末比で1.1%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

### 今後の運用方針

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、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。

## ■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

## ■ 売買及び取引の状況 (2021年2月16日から2022年2月14日まで)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 717,343,530	千円 471,488,133 (-)
	地方債証券	18,975,569	4,218,721 (-)
	特殊債券	14,592,716	2,073,694 (297,842)
	社債券	19,760,179	2,338,632 (-)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2021年2月16日から2022年2月14日まで)

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当期				
区分	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
公社債	百万円 770,671	百万円 100,563	% 13.0	百万円 480,119	百万円 73,234	% 15.3

### (2) 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	額
公社債		百万円 304

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、みずほ証券です。

## ■組入資産の明細

### 公社債

#### (A) 債券種類別開示

##### 国内（邦貨建）公社債

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年末満
国債証券	447,045,000	463,797,306	83.8	—	53.6	19.7	10.5
地方債証券	30,445,330	31,523,404	5.7	4.7	3.6	1.4	0.7
特殊債券	25,151,985	26,325,307	4.8	0.0	3.3	0.8	0.6
金融債券	1,800,000	1,796,652	0.3	—	—	0.3	0.0
普通社債券	27,481,000	27,644,946	5.0	0.1	2.4	1.9	0.7
合計	531,923,315	551,087,616	99.6	4.8	63.0	24.2	12.5

(注1) 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。

(注2) 無格付銘柄については、B格以下に含めて表示しています。

#### (B) 個別銘柄開示

##### 国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
423回 利付国庫債券(2年)	0.0050	3,000,000	3,002,670	2023/04/01
424回 利付国庫債券(2年)	0.0050	3,100,000	3,102,976	2023/05/01
425回 利付国庫債券(2年)	0.0050	2,000,000	2,002,060	2023/06/01
136回 利付国庫債券(5年)	0.1000	4,850,000	4,861,058	2023/06/20
329回 利付国庫債券(10年)	0.8000	8,350,000	8,447,027	2023/06/20
426回 利付国庫債券(2年)	0.0050	2,100,000	2,102,163	2023/07/01
427回 利付国庫債券(2年)	0.0050	2,400,000	2,402,448	2023/08/01
428回 利付国庫債券(2年)	0.0050	2,500,000	2,502,500	2023/09/01
137回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,610,000	3,619,205	2023/09/20
330回 利付国庫債券(10年)	0.8000	3,460,000	3,507,194	2023/09/20
331回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,950,000	1,970,377	2023/09/20
64回 利付国庫債券(20年)	1.9000	30,000	30,936	2023/09/20
429回 利付国庫債券(2年)	0.0050	2,000,000	2,002,100	2023/10/01
430回 利付国庫債券(2年)	0.0050	2,000,000	2,002,040	2023/11/01
431回 利付国庫債券(2年)	0.0050	4,000,000	4,003,920	2023/12/01
138回 利付国庫債券(5年)	0.1000	5,000,000	5,013,800	2023/12/20
332回 利付国庫債券(10年)	0.6000	3,880,000	3,926,172	2023/12/20
65回 利付国庫債券(20年)	1.9000	60,000	62,153	2023/12/20
432回 利付国庫債券(2年)	0.0050	3,400,000	3,403,162	2024/01/01
139回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,750,000	3,760,950	2024/03/20
333回 利付国庫債券(10年)	0.6000	3,630,000	3,678,206	2024/03/20
67回 利付国庫債券(20年)	1.9000	50,000	52,023	2024/03/20
140回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,490,000	3,500,609	2024/06/20
334回 利付国庫債券(10年)	0.6000	4,240,000	4,302,582	2024/06/20
70回 利付国庫債券(20年)	2.4000	50,000	52,841	2024/06/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
71回 利付国庫債券(20年)	2.2000	40,000	42,086	2024/06/20
141回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,610,000	3,621,227	2024/09/20
335回 利付国庫債券(10年)	0.5000	4,700,000	4,763,403	2024/09/20
72回 利付国庫債券(20年)	2.1000	460,000	485,313	2024/09/20
142回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,530,000	3,541,543	2024/12/20
336回 利付国庫債券(10年)	0.5000	2,100,000	2,130,765	2024/12/20
337回 利付国庫債券(10年)	0.3000	3,010,000	3,036,969	2024/12/20
73回 利付国庫債券(20年)	2.0000	380,000	401,724	2024/12/20
74回 利付国庫債券(20年)	2.1000	40,000	42,400	2024/12/20
143回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,200,000	3,210,880	2025/03/20
338回 利付国庫債券(10年)	0.4000	6,030,000	6,106,400	2025/03/20
75回 利付国庫債券(20年)	2.1000	180,000	191,710	2025/03/20
76回 利付国庫債券(20年)	1.9000	70,000	74,121	2025/03/20
77回 利付国庫債券(20年)	2.0000	40,000	42,478	2025/03/20
144回 利付国庫債券(5年)	0.1000	5,400,000	5,418,954	2025/06/20
339回 利付国庫債券(10年)	0.4000	6,510,000	6,598,080	2025/06/20
78回 利付国庫債券(20年)	1.9000	250,000	265,830	2025/06/20
79回 利付国庫債券(20年)	2.0000	50,000	53,333	2025/06/20
80回 利付国庫債券(20年)	2.1000	90,000	96,300	2025/06/20
145回 利付国庫債券(5年)	0.1000	4,350,000	4,365,616	2025/09/20
340回 利付国庫債券(10年)	0.4000	4,410,000	4,473,371	2025/09/20
81回 利付国庫債券(20年)	2.0000	400,000	428,676	2025/09/20
82回 利付国庫債券(20年)	2.1000	140,000	150,540	2025/09/20
146回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,900,000	3,914,235	2025/12/20
341回 利付国庫債券(10年)	0.3000	3,820,000	3,863,280	2025/12/20

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
83回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	75,621	2025/12/20
84回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	182,998	2025/12/20
147回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	4,000,000	3,999,160	2026/03/20
342回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,980,000	3,994,606	2026/03/20
85回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	590,000	640,415	2026/03/20
86回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	131,235	2026/03/20
87回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	130,744	2026/03/20
148回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	3,900,000	3,898,284	2026/06/20
343回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,350,000	4,366,008	2026/06/20
88回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	590,000	648,504	2026/06/20
89回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	10,948	2026/06/20
149回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	4,200,000	4,196,136	2026/09/20
344回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,790,000	5,809,917	2026/09/20
90回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	470,000	516,910	2026/09/20
91回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	121,484	2026/09/20
150回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,300,000	1,298,102	2026/12/20
345回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,190,000	5,206,296	2026/12/20
92回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,160,000	1,275,826	2026/12/20
346回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,740,000	4,754,409	2027/03/20
93回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	370,000	406,837	2027/03/20
94回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	670,000	740,108	2027/03/20
347回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,030,000	5,044,737	2027/06/20
95回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	550,000	616,099	2027/06/20
96回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	120,000	133,142	2027/06/20
348回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,990,000	5,003,872	2027/09/20
97回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	660,000	739,160	2027/09/20
98回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	160,000	178,297	2027/09/20
349回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,430,000	4,441,606	2027/12/20
99回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	750,000	839,340	2027/12/20
350回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,210,000	5,221,045	2028/03/20
100回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	830,000	937,783	2028/03/20
101回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	230,000	262,657	2028/03/20
351回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,600,000	4,608,694	2028/06/20
102回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	500,000	573,740	2028/06/20
103回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	160,000	182,587	2028/06/20
104回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	124,138	2028/06/20
352回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,440,000	4,447,281	2028/09/20
105回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	640,000	725,280	2028/09/20
106回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	500,000	569,905	2028/09/20
353回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,810,000	4,816,541	2028/12/20
107回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	600,000	682,722	2028/12/20
108回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	690,000	775,739	2028/12/20
354回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,060,000	4,064,263	2029/03/20
109回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	350,000	394,908	2029/03/20
110回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	440,000	502,660	2029/03/20
355回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,310,000	4,311,551	2029/06/20
111回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	460,000	530,794	2029/06/20
112回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	740,000	848,491	2029/06/20
356回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,640,000	3,637,233	2029/09/20
1回 利付国庫債券 (30年)	2.8000	110,000	132,286	2029/09/20

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
113回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,170,000	1,345,862	2029/09/20
357回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,690,000	3,684,243	2029/12/20
114回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	820,000	946,895	2029/12/20
115回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	360,000	418,510	2029/12/20
2回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	100,000	118,144	2030/02/20
358回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,550,000	3,541,444	2030/03/20
116回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	530,000	618,329	2030/03/20
117回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,070,000	1,239,744	2030/03/20
359回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,260,000	4,245,942	2030/06/20
118回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	555,000	640,653	2030/06/20
119回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	470,000	534,775	2030/06/20
120回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	670,000	751,277	2030/06/20
360回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,040,000	4,022,830	2030/09/20
121回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	790,000	908,073	2030/09/20
122回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	570,000	650,352	2030/09/20
4回 利付国庫債券 (30年)	2.9000	200,000	247,670	2030/11/20
361回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,000,000	3,977,320	2030/12/20
123回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,050,000	1,228,164	2030/12/20
124回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	600,000	696,576	2030/12/20
362回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,750,000	4,715,990	2031/03/20
125回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	600,000	709,350	2031/03/20
126回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	510,000	593,813	2031/03/20
127回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	540,000	623,905	2031/03/20
363回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,800,000	4,760,304	2031/06/20
128回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,370,000	1,587,227	2031/06/20
129回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	760,000	873,521	2031/06/20
364回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,400,000	4,356,528	2031/09/20
130回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	910,000	1,048,047	2031/09/20
131回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	790,000	902,401	2031/09/20
6回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	242,360	2031/11/20
365回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,300,000	1,285,583	2031/12/20
132回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	830,000	950,184	2031/12/20
133回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,030,000	1,189,093	2031/12/20
134回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	800,000	925,224	2032/03/20
135回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	640,000	733,862	2032/03/20
136回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	660,000	750,274	2032/03/20
137回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	800,000	918,800	2032/06/20
138回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,340,000	1,511,908	2032/06/20
139回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	920,000	1,047,318	2032/06/20
140回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,290,000	2,634,072	2032/09/20
8回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	200,000	232,380	2032/11/22
141回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,580,000	1,819,938	2032/12/20
142回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,500,000	1,743,615	2032/12/20
143回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	1,480,000	1,691,033	2033/03/20
144回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,310,000	1,482,697	2033/03/20
111回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	250,000	288,867	2033/06/20
145回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,350,000	2,715,354	2033/06/20
12回 利付国庫債券 (30年)	2.1000	230,000	276,696	2033/09/20
146回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,280,000	2,639,122	2033/09/20
13回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	150,000	179,062	2033/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	2,350,000	2,696,319	2033/12/20
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	422,810	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,210,000	2,512,084	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	327,298	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,270,000	2,583,441	2034/06/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	302,973	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	2,440,000	2,750,685	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	338,447	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,460,000	2,713,675	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	497,632	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,340,000	2,582,494	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	349,154	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	2,620,000	2,926,068	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	420,977	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,690,000	2,969,356	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	388,023	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	2,460,000	2,650,133	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	371,727	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,550,000	2,538,142	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	449,694	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	2,430,000	2,346,553	2036/06/20
24回 利付国庫債券(30年)	2.5000	270,000	347,706	2036/09/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,690,000	2,706,543	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	416,394	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,480,000	2,526,475	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	792,521	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	2,010,000	2,073,676	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,890,000	1,919,654	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	805,206	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,820,000	1,846,317	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,070,000	2,097,303	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	1,003,825	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,680,000	2,668,074	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,310,000	2,296,116	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,112,083	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,830,000	1,873,151	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,970,000	1,950,300	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,126,734	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,680,000	1,632,976	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,950,000	1,858,096	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	912,038	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,420,000	1,348,971	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,740,000	1,649,206	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,248,263	2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,510,000	1,453,586	2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,120,000	2,036,472	2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,462,456	2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,990,000	1,907,454	2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,930,000	1,879,820	2040/12/20
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,532,796	2041/03/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
176回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,080,000	2,021,843	2041/03/20
177回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,300,000	2,191,785	2041/06/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,460,000	1,818,371	2041/09/20
178回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,100,000	2,036,391	2041/09/20
179回 利付国庫債券(20年)	0.5000	800,000	776,176	2041/12/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	2,170,000	2,712,239	2042/03/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	2,260,000	2,788,297	2042/09/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	1,550,000	1,885,854	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,220,000	1,510,055	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	940,000	1,145,784	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,080,000	1,295,665	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,120,000	1,344,560	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,120,000	1,345,489	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,130,000	1,358,395	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,270,000	1,474,444	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,670,000	1,939,404	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	1,310,000	1,549,651	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,640,000	1,870,567	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,460,000	1,665,422	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,660,000	1,675,222	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	1,350,000	1,211,233	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,510,000	1,418,358	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,200,000	1,151,448	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,450,000	1,454,553	2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,520,000	1,523,207	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,230,000	1,231,303	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,300,000	1,300,000	2047/12/20
1回 利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	151,087	2048/03/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,670,000	1,666,392	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,520,000	1,478,884	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	1,130,000	1,149,729	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,140,000	1,102,619	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	630,000	836,621	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,070,000	981,050	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,160,000	1,032,724	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,180,000	1,048,418	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,010,000	895,567	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	720,835	2050/03/20
66回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,090,000	965,631	2050/03/20
67回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,550,000	1,446,615	2050/06/20
68回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,340,000	1,249,992	2050/09/20
69回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,450,000	1,388,360	2050/12/20
4回 利付国庫債券(40年)	2.2000	720,000	966,996	2051/03/20
70回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,420,000	1,359,224	2051/03/20
71回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,600,000	1,531,040	2051/06/20
72回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,500,000	1,434,915	2051/09/20
73回 利付国庫債券(30年)	0.7000	600,000	573,792	2051/12/20
5回 利付国庫債券(40年)	2.0000	1,010,000	1,311,889	2052/03/20
6回 利付国庫債券(40年)	1.9000	1,030,000	1,317,009	2053/03/20
7回 利付国庫債券(40年)	1.7000	1,190,000	1,463,473	2054/03/20

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
8回 利付国庫債券(40年)	1.4000	1,310,000	1,505,792	2055/03/20
9回 利付国庫債券(40年)	0.4000	1,950,000	1,675,966	2056/03/20
10回 利付国庫債券(40年)	0.9000	1,820,000	1,829,755	2057/03/20
11回 利付国庫債券(40年)	0.8000	1,480,000	1,441,638	2058/03/20
12回 利付国庫債券(40年)	0.5000	1,400,000	1,228,892	2059/03/20
13回 利付国庫債券(40年)	0.5000	1,730,000	1,512,244	2060/03/20
14回 利付国庫債券(40年)	0.7000	1,700,000	1,585,624	2061/03/20
小計	—	447,045,000	463,797,306	—
(地方債証券)	%	千円	千円	
719回 東京都公募公債	0.8600	200,000	201,858	2023/03/20
121回 共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	503,335	2023/04/25
25年度4回 愛知県公募公債	0.8560	300,000	303,270	2023/05/30
720回 東京都公募公債	0.8700	300,000	303,474	2023/06/20
1回 東京都公募公債 20年	1.5400	100,000	102,059	2023/06/20
25年度4回 札幌市公募公債	0.8000	200,000	202,128	2023/06/20
25年度2回 横浜市公募公債	0.8880	400,000	404,956	2023/07/14
374回 大阪府公募公債	0.9380	300,000	304,038	2023/07/28
25年度5回 千葉県公募公債	0.8400	200,000	202,532	2023/08/25
25年度6回 千葉県公募公債	0.8000	100,000	101,271	2023/09/25
29回1号 宮城県公募公債 10年	0.6800	100,000	101,134	2023/10/25
127回 共同発行市場公募地方債	0.6800	100,000	101,134	2023/10/25
128回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	303,459	2023/11/24
25年度2回 島根県公募公債	0.6700	106,000	107,246	2023/11/27
726回 東京都公募公債	0.7300	400,000	405,316	2023/12/20
25年度8回 埼玉県公募公債	0.7030	100,000	101,289	2023/12/25
25年度11回 福岡県公募公債	0.6940	200,000	202,736	2024/02/26
25年度2回 新潟県公募公債	0.6700	100,000	101,322	2024/02/28
132回 共同発行市場公募地方債	0.6600	100,000	101,345	2024/03/25
208回 神奈川県公募公債	0.5510	300,000	303,723	2024/06/20
26年度4回 札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	101,219	2024/06/20
1回 兵庫県公募公債 (12年)	1.1000	300,000	307,608	2024/06/26
26年度4回 神戸市公募公債	0.6060	100,000	101,402	2024/07/18
26年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	405,720	2024/07/29
488回 名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	456,633	2024/09/20
26年度1回 相模原市公募公債	0.5290	100,000	101,295	2024/09/20
26年度1回 長崎県公募公債	0.5540	100,000	101,361	2024/09/30
26年度1回 静岡市公募公債	0.5150	100,000	101,332	2024/11/25
26年度11回 京都府公募公債	0.4760	350,000	354,382	2024/12/19
26年度1回 三重県公募公債	0.4560	100,000	101,188	2024/12/25
26年度1回 浜松市公募公債	0.3350	100,000	100,866	2025/01/23
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	504,480	2025/01/24
26年度3回 広島市公募公債	0.4290	100,000	101,177	2025/02/25
26年度17回 兵庫県公募公債	0.4600	200,000	202,544	2025/02/26
5回 東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	106,390	2025/03/19
213回 神奈川県公募公債	0.5340	100,000	101,524	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	405,336	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	610,044	2025/05/23
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	508,730	2025/07/25
7回 東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	107,575	2025/09/19
1回 静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	107,627	2025/09/19

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	101,571	2025/11/27
153回 共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,575	2025/12/25
27年度9回 千葉県公募公債	0.0950	100,000	100,122	2026/03/25
157回 共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	120,074	2026/04/24
9回 東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	220,570	2026/06/19
159回 共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,998	2026/06/25
1回 兵庫県公募公債 15年	1.6600	200,000	214,114	2026/07/29
28年度6回 北海道公募公債	0.0700	100,000	99,977	2026/08/31
760回 東京都公募公債	0.0450	100,000	99,862	2026/09/18
10回 東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	330,960	2026/09/18
4回 京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	111,143	2026/09/18
413回 大阪府公募公債 10年	0.0210	100,000	99,723	2026/10/28
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	502,335	2027/01/25
28年度8回 福岡県公募公債	0.2400	100,000	100,725	2027/02/24
419回 大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	100,392	2027/04/27
2回 静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	106,848	2027/06/25
5回 兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	103,010	2027/07/07
29年度4回 大阪市公募公債	0.1500	200,000	199,998	2027/09/21
174回 共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,972	2027/09/24
24年度1回 福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	106,797	2027/11/29
178回 共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	100,471	2028/01/25
179回 共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	502,535	2028/02/25
29年度6回 広島市公募公債	0.2300	300,000	301,341	2028/02/25
29年度13回 京都府公募公債	0.2000	109,330	109,626	2028/03/16
5回 兵庫県公募公債 15年	1.3100	300,000	321,342	2028/05/26
783回 東京都公募公債	0.2200	110,000	110,413	2028/06/20
4回 静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	107,343	2028/06/23
30年度7回 神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	301,740	2028/09/20
第91回 川崎市公募公債	0.1850	200,000	200,260	2028/09/20
7回 静岡県公募公債 20年	2.3200	300,000	342,096	2028/09/21
30年度3回 広島県公募公債	0.2540	100,000	100,581	2028/09/25
30年度3回 堺市公募公債	0.1950	100,000	100,067	2028/12/19
237回 神奈川県公募公債	0.1350	200,000	199,458	2028/12/20
20回2号 福岡県公募公債	0.2050	100,000	112,685	2028/12/20
6回 大阪市公募公債 20年	2.2100	200,000	227,612	2028/12/20
17回 横浜市公募公債 20年	0.2070	100,000	112,820	2028/12/20
6回 北九州市公募公債 20年	0.2030	100,000	112,474	2028/12/20
30年度6回 福岡県公募公債	0.2000	200,000	200,406	2028/12/21
189回 共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	100,237	2028/12/25
30年度14回 北海道公募公債	0.1950	400,000	400,132	2028/12/28
18回 東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	114,282	2029/03/19
30年度19回 愛知県公募公債	0.1150	200,000	199,016	2029/03/28
30年度3回 岐阜県公募公債 10年	0.1500	200,000	199,508	2029/03/29
194回 共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	298,275	2029/05/25
6回 川崎市公募公債 20年	2.2100	200,000	228,986	2029/05/25
令和元年度1回 福岡県公募公債	0.0290	200,000	197,594	2029/06/21
9回 兵庫県公募公債 15年	1.0200	100,000	105,986	2029/07/13
11回 神奈川県公募公債 20年	2.0800	100,000	113,800	2029/07/20
796回 東京都公募公債	0.0400	200,000	197,530	2029/09/20
令和元年度9回 静岡県公募公債	0.0500	200,000	197,680	2029/09/20

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
令和元年度3回 横浜市公募公債	0.0500	400,000	395,316	2029/10/16
令和元年度16回 兵庫県公募公債	0.0500	200,000	197,652	2029/10/23
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	115,284	2029/12/20
17回 さいたま市公募公債	0.1100	200,000	198,376	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	0.1350	200,000	198,670	2030/01/30
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	2.2300	100,000	115,890	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	99,013	2030/02/25
802回 東京都公募公債	0.1300	400,000	396,980	2030/03/19
511回 名古屋市公募公債 10年	0.0750	200,000	197,608	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公募公債	0.1350	400,000	397,116	2030/04/12
令和2年 2回 大阪市公募公債	0.1310	300,000	297,588	2030/05/22
9回 埼玉県公募公債 20年	2.1500	100,000	115,631	2030/05/24
8回 静岡県公募公債 15年	0.8280	200,000	209,836	2030/06/07
令和2年度 10回 静岡県公募公債	0.1350	100,000	99,073	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公募公債	0.1350	100,000	99,022	2030/10/23
36回2号 宮城県公募公債 10年	0.1350	250,000	247,550	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公募公債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公募公債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
22年度1回 愛知県公募公債	0.0870	300,000	347,595	2030/12/13
9回 京都市公募公債 20年	2.1430	200,000	232,738	2030/12/17
813回 東京都公募公債	0.1790	300,000	297,897	2030/12/20
16回 神奈川県公募公債 20年	0.2090	300,000	348,129	2031/01/24
464回 大阪府公募公債 10年	0.0720	200,000	196,622	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公募公債	0.1450	100,000	98,897	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公募公債	0.2140	200,000	199,184	2031/03/12
令和2年 7回 広島県公募公債	0.2140	200,000	199,182	2031/03/19
251回 神奈川県公募公債 10年	0.1990	200,000	198,826	2031/03/20
令和2年度 14回 静岡県公募公債	0.1400	200,000	197,780	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	0.1900	200,000	198,682	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公募公債	0.1750	100,000	99,165	2031/04/25
467回 大阪府公募公債 10年	0.1640	200,000	197,956	2031/04/28
469回 大阪府公募公債 10年	0.1280	200,000	197,136	2031/06/27
令和3年 5回 千葉県公募公債	0.1050	200,000	196,712	2031/09/25
472回 大阪府公募公債 10年	0.1000	200,000	196,436	2031/09/29
19回 神奈川県公募公債 20年	1.8180	100,000	114,954	2032/01/30
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	1.6350	300,000	340,239	2032/08/16
10回 大阪府公募公債 20年	1.7200	200,000	228,482	2032/09/24
24年度12回 神戸市公募公債	1.7110	200,000	228,902	2032/12/17
14回 千葉県公募公債 20年	1.1370	100,000	108,398	2033/04/15
13回 埼玉県公募公債 20年	1.5990	100,000	113,533	2033/05/20
1回 東京都公募公債 30年	2.2100	200,000	240,730	2033/06/20
14回 埼玉県公募公債 20年	1.5460	300,000	340,266	2034/05/08
29回 横浜市公募公債 20年	1.5280	100,000	113,263	2034/05/26
16回 名古屋市公募公債 20年	1.5200	100,000	113,143	2034/06/09
5回 群馬県公募公債 20年	1.5290	100,000	113,268	2034/06/16
17回 北九州市公募公債 20年	1.5290	100,000	113,146	2034/06/20
15回 埼玉県公募公債 20年	1.1660	100,000	108,996	2035/02/16
2回 横浜市公募公債 30年	2.4900	100,000	125,684	2035/03/20
18回 千葉県公募公債 20年	1.1380	100,000	108,681	2035/04/13
17回 名古屋市公募公債 20年	1.2030	100,000	109,504	2035/05/28

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
13回 大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	109,382	2035/09/28
14回 大阪府公募公債 20年	0.5400	100,000	100,067	2036/09/29
21回 千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	98,557	2036/10/15
3回 神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	129,747	2037/03/19
29年度2回 広島市公募公債 20年	0.6160	200,000	201,596	2037/08/18
29年度5回 札幌市公募公債 20年	0.5970	300,000	301,374	2037/09/18
30年度2回 仙台市公募公債 20年	0.7290	100,000	101,875	2038/10/18
30年度7回 福岡市公募公債	0.7010	200,000	202,748	2038/10/19
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	0.2860	100,000	94,215	2039/07/29
2回 兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	128,860	2040/03/19
22年度8回 福岡市公募公債	0.2800	100,000	127,719	2040/09/20
令和2年 2回 広島県公募公債	0.4640	100,000	96,353	2040/09/21
23年度7回 札幌市公募公債 30年	2.0970	100,000	125,408	2041/09/20
5回 川崎市公募公債 30年	2.0970	100,000	125,839	2042/03/20
24年度12回 愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	126,252	2042/09/19
14回 東京都公募公債 30年	2.0500	100,000	125,309	2043/06/19
27年度8回 愛知県公募公債 30年	1.5790	150,000	174,357	2045/06/20
27年度2回 広島県公募公債 30年	0.7110	100,000	97,493	2046/03/22
6回 埼玉県公募公債 30年	0.9570	200,000	204,822	2046/12/20
令和元年度1回 岩手県公募公債	0.2900	200,000	189,308	2049/09/17
5回 京都市公募公債 30年 定時償還	0.2900	200,000	189,826	2049/09/17
令和3年度6回 舟戸市公募公債 30年	0.7130	200,000	189,564	2051/06/20
小計	—	30,445,330	31,523,404	—
(特殊債券)	%	千円	千円	
19回 政保日本政策投資銀行社債	0.6680	100,000	100,742	2023/03/15
55回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	504,550	2023/03/20
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	503,365	2023/04/28
18回 国際協力機構債券	0.8680	100,000	101,155	2023/06/20
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	506,195	2023/06/30
50回 政保地方公共団体金融機関債券	0.9110	500,000	506,570	2023/07/14
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	430,000	435,835	2023/07/31
116回 高速道路機構債	0.7220	100,000	101,136	2023/09/20
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6990	105,000	106,289	2023/10/31
56回 政保地方公共団体金融機関債券	0.7470	542,000	550,010	2024/01/19
7回 広島県 - 広島市折半保証広島高速道路債券	0.6940	100,000	101,052	2024/02/28
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	101,364	2024/02/29
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	101,533	2024/05/31
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6440	200,000	203,092	2024/06/28
64回 政保地方公共団体金融機関債券	0.5440	300,000	304,170	2024/09/13
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	101,219	2024/09/20
71回 鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	101,362	2024/11/27
21回 政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	101,357	2025/03/17
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	506,870	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機関債券	0.3910	100,000	101,199	2025/04/25
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,941	2025/06/20
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	101,487	2025/08/29
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,949	2025/09/19
85回 中日本高速道路債券	0.0700	300,000	299,841	2025/10/21
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,676	2025/11/20
23回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	107,806	2025/12/19

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
6 1 回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	106,809	2025/12/19
4 0 回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,957	2026/03/13
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	110,249	2026/03/20
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	100,104	2026/04/20
8 3 回 地方公共団体金融機関債券 10年	0.0900	400,000	400,416	2026/04/28
8 0 回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	106,928	2026/09/18
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	498,510	2026/09/18
7 9 回 政保地方公共団体金融機関債券	1.5070	300,000	320,157	2026/11/06
9 1 回 政保地方公共団体金融機関債券	0.0850	100,000	100,168	2026/12/14
3 0 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	100,296	2027/01/29
F 1 4 7 回 地方公共団体金融機関債券	1.2910	200,000	211,904	2027/03/19
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	301,767	2027/04/13
3 0 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	801,656	2027/04/30
7 2 回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	199,734	2027/06/18
9 8 回 政保地方公共団体金融機関債券	0.1600	100,000	100,269	2027/07/16
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	301,113	2027/11/19
1 0 3 回 政保地方公共団体金融機関債券	0.1550	100,000	100,231	2027/12/17
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	107,376	2027/12/20
7 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	299,130	2027/12/20
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	301,425	2028/02/18
1 1 3 回 政保地方公共団体金融機関債券	0.2190	100,000	100,521	2028/10/16
9 回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	213,926	2028/12/20
1 回 地方公共団体金融機関債券 20年	2.0700	200,000	225,488	2028/12/20
9 3 回 都市再生債券	1.1020	100,000	106,336	2029/06/20
1 回 地方公共団体金融機関債券 20年	2.2660	300,000	344,622	2029/06/28
2 回 地方公共団体金融機関債券 20年	2.2660	300,000	345,489	2029/08/28
1 2 回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	212,340	2029/09/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	228,672	2029/09/20
9 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	114,896	2029/12/28
7 8 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	104,386	2030/05/28
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	210,748	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	228,104	2030/10/29
1 2 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	567,995	2030/10/31
1 3 回 地方公共団体金融機関債券 20年	2.1320	100,000	116,328	2031/01/28
9 0 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	198,172	2031/05/30
7 5 回 住宅金融支援機構債券	0.20660	350,000	406,605	2031/06/13
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	115,414	2031/09/19
1 5 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	114,749	2031/12/26
1 9 回 地方公共団体金融機関債券	1.8400	200,000	229,494	2031/12/26
2 3 回 地方公共団体金融機関債券 20年	1.6800	100,000	113,574	2032/07/28
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	114,784	2032/09/14
1 5 回 國際協力機構債	1.7240	100,000	113,908	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機関債券 20年	1.7020	200,000	227,792	2032/09/28
1 8 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	111,437	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	637,360	2033/12/20
1 2 4 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	112,737	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機関債券 20年	1.5660	100,000	113,297	2034/04/28
2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	327,033	2035/02/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	107,835	2035/05/18
1 5 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	110,076	2035/06/20

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
4 4 回 地方公共団体金融機関債券 20年	1.2980	200,000	220,534	2035/06/28
2 5 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	110,643	2035/06/29
1 7 2 回 高速道路機関債	0.2880	200,000	192,904	2036/06/20
5 9 回 地方公共団体金融機関債券 20年	0.6690	100,000	101,313	2037/04/28
6 1 回 貸付債権担保 S種住宅金融公庫債券	2.2600	29,607	29,689	2037/05/10
8 2 回 貸付債権担保 S種住宅金融公庫債券	2.1500	20,706	20,925	2037/05/10
9 9 回 貸付債権担保 S種住宅金融公庫債券	2.1900	31,623	31,961	2037/05/10
3 1 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	202,422	2037/07/31
2 6 6 回 高速道路機関債	2.6700	200,000	261,262	2037/09/18
2 2 回 貸付債権担保 S種住宅金融支援機構債券	2.2700	33,411	34,022	2037/11/10
3 3 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	100,279	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	99,389	2038/04/20
2 1 0 回 高速道路機関債	0.6770	100,000	100,551	2038/09/17
2 8 8 回 政保地方公共団体金融機関債券	1.4370	300,000	336,891	2040/07/27
1 1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	119,376	2040/08/31
4 0 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	50,096	51,467	2041/03/10
4 3 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	11,209	11,425	2041/06/10
4 4 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	53,795	54,809	2041/07/10
5 1 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	32,226	32,671	2042/02/10
1 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	53,085	53,678	2042/05/10
4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	10,979	11,161	2042/08/10
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	306,622	2043/12/18
2 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	18,671	19,689	2044/08/10
2 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	112,585	119,648	2044/10/10
3 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	173,976	183,008	2045/05/10
1 5 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	115,645	2045/06/20
3 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	24,221	25,431	2045/07/10
2 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	224,626	2045/10/31
1 6 9 回 高速道路機関債	1.2000	100,000	106,929	2045/12/20
2 6 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	109,865	2046/01/31
4 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	21,048	22,067	2046/06/10
5 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	25,107	26,249	2046/09/10
5 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	26,331	27,540	2046/10/10
1 9 回 高速道路機関債	2.7500	150,000	211,822	2047/03/20
6 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	35,764	37,405	2047/05/10
6 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	80,552	83,805	2047/09/10
7 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	34,953	36,402	2048/09/10
8 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,074	42,429	2049/03/10
8 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	41,755	43,162	2049/05/10
8 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	45,545	47,063	2049/07/10
9 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	47,705	48,980	2049/11/10
9 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	52,914	53,535	2050/02/10
9 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	59,393	60,561	2050/05/10
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	93,581	2050/06/20
1 6 5 回 都市再生機関債券	0.7090	200,000	187,562	2050/06/20
9 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	61,621	63,305	2050/08/10
4 1 8 回 高速道路機関債	0.6300	200,000	186,310	2051/08/31
4 2 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	189,248	2051/10/31
1 1 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	228,276	226,942	2051/11/10
1 1 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,473	77,568	2052/02/10

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
118回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	77,103	77,288	2052/03/10
119回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,191	77,317	2052/04/10
126回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	241,122	240,948	2052/11/10
128回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	241,002	240,671	2053/01/10
130回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	163,316	163,084	2053/03/10
131回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,409	244,643	2053/04/10
132回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,211	244,521	2053/05/10
137回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	424,330	425,004	2053/10/10
139回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	84,346	84,415	2053/12/10
142回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	87,002	86,223	2054/03/10
154回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	276,159	273,005	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	122,990	2055/03/19
156回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	369,132	366,160	2055/05/10
160回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	283,044	281,119	2055/09/10
168回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	290,907	289,478	2056/05/10
170回 賃貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	881,010	873,486	2056/07/10
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	183,480	2061/02/28
<b>小計</b>	—	25,151,985	26,325,307	—
<b>(金融債券)</b>	%	千円	千円	
342回 利附信金中金債(5年)	0.1100	100,000	100,077	2023/05/26
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,101	2024/05/27
い第843号 利付商工債	0.1200	100,000	100,002	2025/08/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	399,584	2025/08/27
い第851号 利付商工債	0.0900	300,000	299,247	2026/04/27
377回 利附信金中金債(5年)	0.0400	300,000	299,247	2026/04/27
い第854号 利付商工債	0.0800	300,000	299,070	2026/07/27
い第855号 利付商工債	0.0800	200,000	199,324	2026/08/27
<b>小計</b>	—	1,800,000	1,796,652	—
<b>(普通社債券)</b>	%	千円	千円	
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	201,960	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	100,813	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	201,714	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	101,144	2023/03/24
5回 ファーストリテリング社債	0.1100	100,000	100,014	2023/06/06
23回 東京瓦斯社債	0.0100	300,000	303,507	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	200,000	202,124	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	202,312	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	101,399	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	406,036	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	309,228	2023/09/20
26回 ランス相馬信託銀行(BFCM)引当債(2018)	0.4430	100,000	100,225	2023/10/12
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	101,521	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	101,166	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	203,762	2023/11/24
56回 中日本高速道路社債	0.7590	100,000	101,345	2023/12/20
13回 東海旅客鉄道社債	0.20150	200,000	206,906	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	304,485	2023/12/20
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	407,364	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	407,084	2024/02/23
13回 新生銀行社債	0.1500	200,000	199,664	2024/03/12

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>(普通社債券)</b>	%	千円	千円	
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	202,226	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	104,259	2024/03/19
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	101,598	2024/04/25
2回 BPCE SA円貸付債(ジョーパルボンド)	0.3670	100,000	99,964	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	101,795	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	101,123	2024/09/03
25回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,909	2024/09/20
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	105,384	2024/09/20
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	101,361	2024/10/28
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	202,522	2024/10/28
4回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,794	2024/10/31
6回 クレディ・アグリコル・エス・エ-四国社債	0.8650	200,000	202,624	2024/11/28
25回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	202,578	2024/12/20
11回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	202,466	2024/12/20
321回 北海道電力社債	0.8860	261,000	265,865	2024/12/25
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	101,257	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,738	2025/05/21
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,822	2025/06/11
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,975	2025/06/20
39回 東日本旅客鉄道社債	0.2050	300,000	318,549	2025/06/20
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	102,562	2025/06/20
13回 電源開発社債	0.2040	200,000	212,108	2025/06/20
12回 新生銀行社債	0.3600	400,000	400,780	2025/07/09
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	213,564	2025/09/19
27回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	399,540	2025/12/19
14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,792	2025/12/19
26回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	199,146	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,840	2026/03/24
96回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,565	2026/04/15
163回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,954	2026/04/15
28回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	298,170	2026/04/21
493回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,520	2026/05/25
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,410	2026/05/26
24回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,954	2026/06/03
40回 ライカミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,434	2026/06/03
35回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,050	2026/06/05
11回 クレディ・アグリコル・エス・エ-四国社債(2016)	0.4000	100,000	99,418	2026/06/10
57回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	100,064	2026/06/19
79回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	299,349	2026/06/19
83回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	199,566	2026/06/19
69回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	298,221	2026/06/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	131,178	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	103,449	2026/06/25
90回 中日本高速道路債券	0.0500	200,000	199,556	2026/07/27
20回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	299,763	2026/07/27
91回 中日本高速道路債券	0.0400	500,000	498,510	2026/09/17
62回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	498,510	2026/09/18
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,801	2026/09/18
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,999	2026/10/23
33回 西日本高速道路債券	0.2700	300,000	302,304	2026/12/14

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>(普通社債券)</b>				
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	201,988	2027/02/16
12回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	109,385	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	110,997	2027/04/20
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	302,142	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	301,983	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,320	2027/05/07
30回 東レ社債	0.3750	300,000	299,919	2027/07/16
32回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	111,110	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	102,875	2027/09/24
25回 フランク相馬信託組合銀行 (BFCM) 附社債 (2017)	0.5100	300,000	300,165	2027/10/12
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,776	2027/10/22
525回 東北電力社債	0.2200	200,000	198,714	2027/10/25
541回 電源開発社債	0.3800	100,000	100,062	2027/11/19
17回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	300,276	2027/12/20
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	301,581	2028/01/18
12回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	396,368	2028/06/02
7回 フーストリティーリング社債	0.4050	200,000	200,934	2028/06/06
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	100,028	2028/10/25
21回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	113,448	2029/03/21
23回 三井住友ファイナンス＆リース社債	0.3900	100,000	99,654	2029/04/12
14回 ブリヂストン社債	0.3750	300,000	299,688	2029/04/19
80回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	106,046	2029/04/27
530回 関西電力社債	0.4050	400,000	398,716	2029/06/20
73回 三井物産社債	0.2900	400,000	397,692	2029/07/11
532回 中部電力社債	0.2240	200,000	197,242	2029/07/25
80回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	197,254	2029/10/19
65回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	114,048	2029/12/21
67回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	199,608	2030/01/31
19回 パナソニック社債	0.3700	100,000	99,336	2030/03/05
147回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	99,442	2030/04/22
60回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	198,552	2030/05/21
521回 東北電力社債	0.4500	400,000	400,636	2030/05/24
425回 中国電力社債	0.3700	100,000	99,435	2030/06/25
31回 三井住友ファイナンス＆リース社債	0.3900	200,000	198,448	2030/08/09
18回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	399,996	2030/09/20
71回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	113,148	2030/09/27
17回 ダイセル社債	0.5000	300,000	300,510	2030/12/13

銘柄	当期末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>(普通社債券)</b>				
86回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	297,459	2030/12/20
73回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	230,196	2030/12/20
23回 パナソニック社債	0.3900	200,000	198,218	2030/12/20
30回 光通信社債	0.9800	200,000	201,078	2031/01/31
74回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	98,948	2031/04/22
491回 九州電力社債	0.3400	300,000	296,484	2031/04/25
541回 関西電力社債	0.3700	300,000	296,946	2031/09/19
16回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	493,755	2031/10/14
75回 電源開発社債	0.3500	200,000	197,668	2031/10/20
396回 中国電力社債	0.5540	200,000	201,890	2032/01/23
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	99,513	2036/06/02
23回 三ヶ島ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	202,224	2036/06/09
41回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	197,974	2036/11/28
527回 中部電力社債	0.8060	100,000	101,283	2037/10/23
127回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	99,688	2038/01/26
26回 豊田通商社債	0.8970	100,000	100,776	2038/03/05
350回 北海道電力社債	0.7540	200,000	198,848	2038/03/25
463回 九州電力社債	0.7920	100,000	100,101	2038/05/25
8回 フーストリティーリング社債	0.8800	200,000	200,640	2038/06/04
43回 江浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	97,663	2038/07/12
466回 九州電力社債	0.7200	100,000	98,977	2038/07/23
52回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	95,902	2039/05/23
531回 関西電力社債	0.6720	200,000	193,860	2039/06/20
55回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	92,270	2039/09/13
37回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	94,387	2040/01/27
165回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	193,374	2041/04/15
75回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	192,742	2041/04/22
492回 九州電力社債	0.6500	100,000	96,298	2041/04/25
107回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	109,475	2045/01/27
125回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	103,649	2047/07/26
70回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	93,961	2049/12/24
171回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	189,550	2051/07/14
71回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	93,754	2059/12/24
47回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	91,698	2060/09/17
160回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	93,516	2060/12/17
小計	—	27,481,000	27,644,946	—
合計	—	531,923,315	551,087,616	—

## ■投資信託財産の構成

2022年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	551,087,616	91.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	50,748,215	8.4
投 資 信 託 財 産 総 額	601,835,832	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

(2022年2月14日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	一 ル . □ 一 ナ ン 等 産	601,835,832,511円
公 収 利 息 用 債	49,696,366,967	
未 払 費 額(評価額)	551,087,616,706	
前	809,631,617	
（B）負 払 約 債	242,217,221	
未 払	48,532,656,000	
（C）純 資 産 総 額(A-B)	48,532,656,000	
元	553,303,176,511	
次 期 繰 越 損 益 金	429,840,166,151	
（D）受 益 権 総 □ 数	123,463,010,360	
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	429,840,166,151口	
	12,872円	

(注1) 期首元本額 209,919,027,595円  
追加設定元本額 611,239,283,321円  
一部解約元本額 391,318,144,765円

(注2) 期末における元本の内訳

D IAM国内債券パッジ・ファンド 23,682,506,030円  
MITO ラップ型ファンド (安定型) 83,095,931円  
MITO ラップ型ファンド (中立型) 153,860,446円  
MITO ラップ型ファンド (積極型) 119,506,919円  
グローバル8資産ラップファンド (安定型) 687,384,295円  
グローバル8資産ラップファンド (中立型) 133,587,952円  
グローバル8資産ラップファンド (積極型) 23,739,893円  
たわらノーロード 国内債券 15,834,399,947円  
たわらノーロード バランス (8資産均等型) 2,521,507,162円  
たわらノーロード バランス (堅実型) 886,604,365円  
たわらノーロード バランス (標準型) 1,507,222,733円  
たわらノーロード バランス (積極型) 189,908,936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) 74,774,735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) 1,322,091,006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) 1,225,069,364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) 327,185,576円  
たわらノーロード 最適化バランス (保守型) 22,506,242円  
たわらノーロード 最適化バランス (標準型) 17,145,320円  
たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 13,611,444円  
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 90,707,115円  
たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 5,060,786円  
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 414,272円  
D IAM国内債券イントゥックスファンド<DC年金> 14,277,651,015円  
Oneグローバルバランス 8,911,633円  
D IAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型 8,982,923,753円  
D IAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型 12,483,500,015円  
D IAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型 5,178,995,984円  
D IAM DCバランス30インデックスファンド 2,189,166,701円  
D IAM DCバランス50インデックスファンド 2,329,357,704円  
D IAM DCバランス70インデックスファンド 390,282,840円  
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 87,660,620円  
マネックス資産設計ファンド (育成型) 3,040,981,442円  
マネックス資産設計ファンド (エボリューション) 11,707,847円  
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 4,303,183,204円  
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 1,576,117,456円  
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 340,130,669円  
投資のソムリエ 86,470,476,048円  
グルーズコントロール 331,216,116円  
投資のソムリエ<DC年金> 5,215,918,149円  
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> 4,612,393,810円  
D IAMコア資産設計ファンド (堅実型) 738,611,977円  
D IAMコア資産設計ファンド (積極型) 1,459,012円  
D IAMコア資産設計ファンド (積極型) 4,619,684円  
投資のソムリエ<DC年金> リスク抑制型 6,424,858,123円  
リスク抑制世界8資産バランスファンド 44,101,884,740円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 35,684,515円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 17,735,957円  
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 53,072,038円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 176,635,602円  
4資産分散投資・スタンダード<DC年金> 2,235,253,084円  
リスクコントロール世界資産分散ファンド 8,448,159,838円  
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 5,330,495,531円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 37,377,953円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 15,418,280円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 12,877,158円  
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> 327,852,051円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) 851,076円  
D IAMエマージング債券ファンド 9,450,010円  
イカル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) 1,570,192,380円  
イカル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) 1,607,821,940円  
マルチアセット・イカルム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) 1,368,128,834円  
イカル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) 982,094,880円  
イカル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) 1,551,466,786円  
イカルム重視マルチアセット運用ファンド11 (適格機関投資家限定) 2,239,773,338円  
マルチアセット・イカルム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06 1,216,964,056円  
イカル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) 1,398,783,514円  
D IAM国内債券パッジ・ファンド (適格機関投資家向け) 8,901,727,961円  
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定) 463,351,202円  
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 2,068,944,514円  
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略 (債券型のアロケーション) 379,250,637円  
D IAMアーノルドバランス25VA (適格機関投資家限定) 276,996,912円  
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド1 (適格機関投資家限定) 3,244,504,751円  
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド11 (適格機関投資家限定) 3,251,938,545円  
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド11 (適格機関投資家限定) 3,223,328,742円  
イカル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) 2,685,688,185円  
リスクリードワールド資産バランスファンド (FoF S型) (適格機関投資家専用) 51,300,165円  
D IAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 165,802,939円  
D IAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 98,585,137円  
D IAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 27,788,034円  
D IAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 97,096,530円  
D IAM国際重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 34,365,367円  
D IAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 4,318,042円  
D IAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 25,972,068円  
D IAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 126,573,725円  
D IAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 3,587,635,563円  
D IAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 2,301,884,615円  
D IAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 4,374,149,034円  
D IAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) 113,772,335円  
D IAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) 190,263,848円  
D IAMアグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家専用) 2,187,234,764円  
D IAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家専用) 180,904,488円  
D IAM世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 10,231,460円  
D IAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 2,254,611,473円  
D IAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 49,059,889円  
D IAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 354,407,860円  
D IAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 558,346,963円  
D IAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定) 950,183,773円  
D IAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 298,351,041円  
D IAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定) 101,646,068円  
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定) 1,043,766,730円  
コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定) 382,409,178円  
動的パッケージファンド<DC年金> 333,573,020円  
コア資産形成ファンド 227,460,602円  
MHAM日本債券インデックスファンド (ファンドラップ) 42,573,117,520円  
MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定) 46,106,741,798円  
MHAM日本債券パッジ・ファンド (適格機関投資家限定) 14,232,766,343円  
MHAM動的パッケージ4資産ファンド (適格機関投資家限定) 1,641,455,600円  
期末元本合計 429,840,166,151円

## ■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月14日

項	目	当期
(A) 配 当 等 収 益		2,936,984,033円
受 取 利 息		2,933,836,057
そ の 他 収 益		4,106,122
支 払 利 息		△958,146
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		△10,450,257,321
売 買 益		660,402,300
売 買 損		△11,110,659,621
(C) 当 期 損 益 金(A+B)		△7,513,273,288
(D) 前 期 繰 越 損 益 金		63,427,095,992
(E) 解 約 差 損 益 金		△119,188,902,023
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金		186,738,089,679
(G) 合 計(C+D+E+F)		123,463,010,360
次 期 繰 越 損 益 金(G)		123,463,010,360

(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) (E)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) (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。

# 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第20期（決算日 2022年2月7日）  
(計算期間 2021年2月9日～2022年2月7日)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年10月30日から無期限です。
運用方針	主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）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	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物比率	純資産額
		期騰落率	(配当込み)(ベンチマーク)			
16期（2018年2月7日）	円 26,432	% 17.8	ポイント 2,547.46	% 17.9	% 98.1	% 0.8 百万円 289,238
17期（2019年2月7日）	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5 279,184
18期（2020年2月7日）	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4 269,760
19期（2021年2月8日）	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3 318,586
20期（2022年2月7日）	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5 397,336

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（株東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（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）。

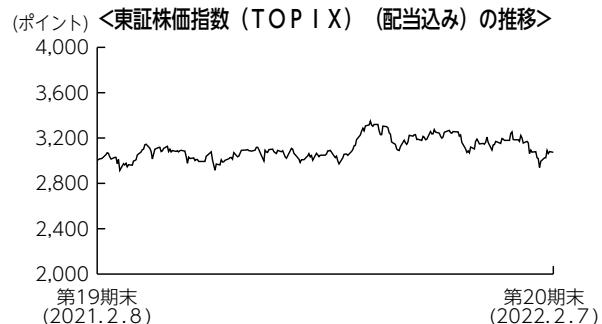
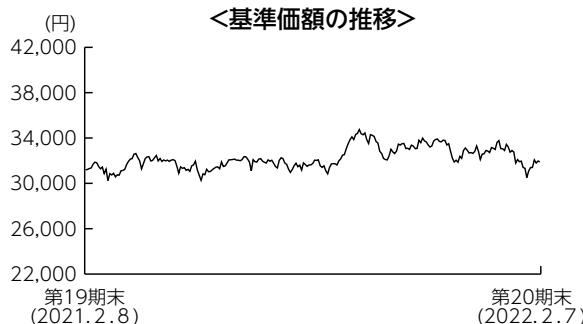
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	東証株価指数(T O P I X)		株式組入比	株式先物比率
		騰 落 率	(配当込み) (バンチマーク)		
(期 首) 2021年 2月 8日	円 31,202	% —	ポイント 3,006.47	% —	% 97.7
2 月 末	30,248	△3.1	2,914.58	△3.1	99.0
3 月 末	31,972	2.5	3,080.87	2.5	96.2
4 月 末	31,068	△0.4	2,993.46	△0.4	96.5
5 月 末	31,493	0.9	3,034.76	0.9	96.6
6 月 末	31,864	2.1	3,070.81	2.1	96.0
7 月 末	31,172	△0.1	3,003.91	△0.1	97.2
8 月 末	32,156	3.1	3,099.08	3.1	97.1
9 月 末	33,562	7.6	3,234.08	7.6	96.3
10 月 末	33,082	6.0	3,188.28	6.0	96.8
11 月 末	31,886	2.2	3,073.26	2.2	84.8
12 月 末	32,994	5.7	3,179.28	5.7	97.1
2022年 1 月 末	31,401	0.6	3,025.69	0.6	95.8
(期 末) 2022年 2 月 7 日	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4
					2.5

(注1) 謄落率は期首比です。

(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（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

2021年9月には菅前首相の自民党総裁選への不出馬表明を受けて、新たな政策への期待の高まりから基準価額は上昇しました。その後は、中国不動産開発大手の中国恒大集団の信用リスク懸念、米国での金融引き締めによる金利上昇への警戒感の高まり、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大等を要因として基準価額は下落しました。

### 投資環境

期初から2021年8月までは、国内の感染状況や米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月には、菅前首相の退陣表明を受けて上昇しました。その後、中国恒大集団の信用リスク懸念や米国の金利上昇などを要因として反落しました。その後も、新型コロナウイルスの感染拡大懸念や金融引き締めへの警戒感の高まりなどを受けて下落する場面もありましたが、期末にかけては好決算銘柄を中心に反発しました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数（TOP INDEX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

**【運用状況】** (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。  
(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

## ○組入上位10業種

### 期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	17.6%
2	情報・通信業	9.2
3	化学	7.3
4	輸送用機器	6.9
5	医薬品	5.6
6	機械	5.6
7	サービス業	5.5
8	銀行業	4.6
9	小売業	4.6
10	卸売業	4.4

### 期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	輸送用機器	8.5
3	情報・通信業	7.8
4	化学	6.4
5	サービス業	5.7
6	卸売業	5.5
7	銀行業	5.4
8	機械	5.1
9	医薬品	4.7
10	小売業	4.1

## ○組入上位10銘柄

### 期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.0%
2	ソニー	日本・円	2.8
3	ソフトバンクグループ	日本・円	2.7
4	キーエンス	日本・円	2.1
5	任天堂	日本・円	1.3
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.3
7	日本電産	日本・円	1.3
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.3
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	日本電信電話	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,183銘柄	

### 期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.3%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
6	東京エレクトロン	日本・円	1.3
7	日本電信電話	日本・円	1.3
8	任天堂	日本・円	1.2
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,174銘柄	

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.2%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマーク沿ったパフォーマンスとなりました。

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を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 (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32,238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 (2021年2月9日から2022年2月7日まで)

### (1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株 192,672.8 (6,584.913)	千円 479,219,336 (-)	千株 161,731.513	千円 395,856,402

(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 144,564	百万円 142,625	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	875,075,739千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	369,108,651千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	2.37

(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 (2021年2月9日から2022年2月7日まで)

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当期				
区分	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 479,219	百万円 130,245	% 27.2	百万円 395,856	百万円 59,442	% 15.0

### (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 3,678	百万円 3,163	百万円 3,133

### (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	額
株式		百万円 1,300

### (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)	7,278千円
うち利害関係人への支払額 (B)	148千円
(B)/(A)	2.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

## ■組入資産の明細

### (1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				<b>矢作建設工業</b>	千株	千株	千円	<b>DM三井製糖ホールディングス</b>	千株	千株	千円
極洋	5.4	7.2	22,824	ピーエス三菱	16.7	20.5	15,641	塩水港精糖	9.5	13.7	27,578
日本水産	148.6	199.7	103,844	日本カクホーリングス	12.2	15.4	9,548	日新製糖	14.4	19.9	4,258
マルハニチロ	25.2	31.4	78,468	大東建託	25.6	31.7	14,360	森永製菓	4.5	7.6	13,148
雪国いたけ	9.9	14.8	17,863	新日本建設	40.5	47.2	636,256	中村屋	27.8	34.8	128,412
カネコ種苗	4.6	4.9	7,408	N I P P O	15.9	19.9	15,004	江崎グリコ	2.5	2.6	8,710
サカタのタネ	19.2	24	78,600	東亜道路工業	30.8	—	—	名糖産業	32.7	40.7	153,846
ホワイト	13.6	17	33,320	前田道路	2.4	2.6	13,052	井村屋グループ	5.6	6.9	11,460
ホクリヨウ	2.3	3.4	2,363	日本道路	22.9	—	—	不二家	6.8	8.6	19,169
<b>鉱業 (0.3%)</b>				東亜建設工業	3.6	4.6	38,180	山崎製パン	7.6	8.5	19,371
住石ホールディングス	27.8	35.1	4,773	日本国土開発	9.9	11.5	27,933	第一屋製パン	89	110.7	179,887
日鉄鉱業	3.7	4.6	28,474	若築建設	6.7	7.7	13,213	モロゾフ	2.9	3.5	1,858
三井鈷鉱ホールディングス	6.7	8.3	12,640	東洋建設	41.6	51.7	29,882	亀田製菓	1.7	3.7	10,175
I N P E X	590.1	800.9	940,256	五洋建設	157.5	182.7	116,745	寿スピリッツ	6.9	8.6	33,669
石油資源開発	21	23.5	66,951	世紀東急工業	17.9	22.4	18,256	カルビー	54.1	67.3	164,817
K & O ナシグループ	7.7	9.9	15,246	福田組	4.3	5	21,950	森永乳業	21.9	27.4	149,604
<b>建設業 (2.3%)</b>				住友林業	87.2	118	240,602	六甲バター	8	11	16,280
ニキヨマガループ	4	4.5	9,929	日本基礎技術	11.7	12.7	7,975	ヤクルト本社	81.6	109.4	633,426
ショーボードホールディングス	22.9	28.5	143,925	巴コーポレーション	16.8	20.7	10,060	明治ホールディングス	78.5	97.6	704,672
ミライ・ホールディングス	55.7	64.4	121,265	大和ハウス工業	342.4	425.6	1,442,358	雪印メグミルク	28.6	35.6	73,407
タマホーム	9.7	12.1	29,717	ライ工業	21.3	29	53,679	プリマハム	16.8	18.6	44,807
サンヨーホームズ	2.2	2.5	1,827	積水ハウス	402.2	500	1,164,500	日本ハム	45.4	56.5	237,865
日本アクリア	6.4	8.1	5,070	日特建設	9.9	9.8	6,997	林兼産業	3.6	3.8	1,919
ファーストコーポレーション	4.9	6.4	4,454	北陸電気工事	6.6	9.8	8,065	丸大食品	11.8	14.8	22,555
ベスティラ	3	4	5,024	ユアテック	21.3	26.5	18,470	S F o o d s	10.7	13.3	43,424
Robot Home	29.9	33.3	7,425	日本リーテック	7.7	9.6	13,468	柿安本店	4.1	5.2	13,577
キャンディル	2.8	3.8	1,862	四電工	1.7	5.2	8,361	伊藤ハムホールディングス	76.7	95.7	64,310
スペースリューホールディングス	19.6	—	—	中電工	17.1	21.3	45,219	サッポロホールディングス	40.5	50.4	112,644
ダイセキ豪晴リューポレーション	3.1	3.9	4,555	関電工	60.4	75.2	65,424	アサヒグループホールディングス	259.3	347.2	1,656,144
第一カッターエンタ	4	5.1	7,063	さんでん	80.2	103.1	166,506	キリンホールディングス	503.3	542.4	1,020,796
安藤・間	102.9	99.1	86,514	東京エニシス	12.3	15.5	15,035	宝ホールディングス	87.9	100.4	111,845
東急建設	47	58.5	40,131	トエニック	3.8	4.7	15,110	オエノホールディングス	34.2	43	14,534
コムスホールディングス	56.9	64.4	175,683	住友電設	10.5	11.5	25,587	養命酒製造	4	5.1	8,981
ピーパー・ホールディングス	19	27.1	9,674	日本電設工業	20.4	25.4	37,134	ココ・ホーリングスホールディングス	90.8	103.7	141,757
高島コンストラクショングループ	10.1	12.6	25,263	エクシオグループ	56.2	69.8	162,424	サンリオ・食品・インターナショナル	79.5	98.7	443,163
東建コーポレーション	4.9	5.5	50,655	新日本空調	9.8	12.2	24,790	ダイドーグループホールディングス	6.7	7.7	37,345
ソネック	1.7	2.3	2,366	九電工	26.1	35.6	109,470	伊藤園	36.1	45	279,900
ヤマウラ	7.2	10.3	10,186	三機工業	26.3	30.2	42,823	キーコーヒー	11.8	14.8	30,532
オリエンタル白石	—	67.8	16,339	日揮ホールディングス	123.6	141.9	160,914	ユニカフェ	3.9	5	4,790
大成建設	115.4	133.2	50,158	中外炉工業	4.1	4.7	7,562	ジャパンフーズ	1.5	1.7	2,050
大林組	370.8	460.9	434,167	ヤマト	11.9	13.8	9,784	日清オリオグループ	15.3	18.7	56,287
清水建設	347.3	431.8	338,099	太平電業	8.2	10.4	28,797	不二製油グループ本社	29	32	74,560
飛島建設	10.5	12.3	13,161	高砂熱電工業	33.5	41.7	79,104	かどや製油	1	1.1	4,411
長谷工コーポレーション	121.3	137.3	200,183	三晃金属工業	1.6	1.7	4,236	J-オイルミルズ	5.6	14.2	24,026
松井建設	14.7	18.4	13,082	朝日工業社	2.1	3.3	9,543	キッコーマン	85.4	106.3	932,251
鏡高組	1.2	1.7	6,834	明星工業	24.1	29.9	20,989	味の素	282.3	325.9	1,055,590
鹿島建設	271.6	337.9	465,964	大氣社	18	22.6	63,777	ブルドックソース	—	6.4	12,524
不動テトラ	9.1	9.8	15,278	ダイヤン	8.2	10.3	23,257	キユーピー	66	77.6	186,007
大末建設	4.9	5	6,680	日比谷総合設備	12.2	14.9	28,161	ハウス食品グループ本社	44.4	55.3	161,531
鉄建建設	7.5	10.3	18,797	フィル・カンパニー	2.1	2.8	3,166	ガムゾ	48.5	56	161,840
西松建設	26.5	28	104,580	テスコロードホールディングス	—	8.5	11,313	焼津水産化学会業	4.8	5.1	4,625
三井住友建設	89.4	103.8	44,426	OSJBホールディングス	54.1	—	—	アリアケジャパン	10.9	13.5	77,625
大豊建設	8.1	6.8	25,092	東洋エンジニアリング	15.4	19.4	12,959	ピエトロ	1.2	1.2	2,152
前田建設工業	92.9	—	—	レイズネクスト	20	22.6	25,515	エバラ食品工業	2.4	2.5	7,075
佐田建設	6.7	10.2	4,773	ニッポン	35	43.5	72,949	やまみ	1.1	1.7	3,010
ナカノフード一建設	9.7	10.9	3,738	ニッポン	134.1	167	273,212	二チレイ	56.5	67.3	176,056
奥村組	20.4	27.1	86,584	日清粉製グループ本社	0.6	1.6	6,392	東洋水産	61	71	342,220
東鉄工業	16	21.5	52,481	日東富士製粉	10.1	14.3	38,181	イト・アンド・ホールディングス	4.2	5.7	13,110
イチケン	2.7	3.5	6,594	昭和産業	10.8	13.7	8,863	大冷	1.5	2	3,816
富士ピー・エス	5	5.9	2,891	鳥越製粉	14.6	16.7	16,983	ジムラ・フード・ホールディングス	6.7	7.9	4,005
浅沼組	4.4	5.2	28,132	中部飼料	16.2	20.2	14,503	日清食品ホールディングス	46.5	57.9	518,784
戸田建設	154.1	191.4	142,401	フィード・ワン	1.7	1.8	1,845	永谷園ホールディングス	6	6.9	13,461
熊谷組	17.1	23.5	69,842	東洋精糖	6.4	8.1	13,737	一正蒲鉾	4	6.2	4,811
北野建設	1.9	2.9	6,194	日本甜菜製糖	—	—	—	フジツコ	13	13.8	26,896
樺木組	1.6	4.1	6,076	—	—	—	ロック・フィールド	12.8	16	24,704	

銘柄	期首(前期末)	当期末	銘柄	期首(前期末)	当期末	銘柄	期首(前期末)	当期末	
株	株	数	株	株	数	株	株	数	
日本たばこ産業	千株 636.5	千株 791.4	千円 1,851,876	共和レザー	千株 6.8	千円 9.2	トリケミカル研究所	千株 9.8	千円 14.9
ケンコーマヨネーズ	7.3	8.5	11,517	昭和電工	87.9	124.8	A D E K A	53.3	44,342
わらべや日洋ホールディングス	7.8	9.6	18,240	住友化学	911.2	1,057.7	日油	43.6	167,473
などり	6.9	8.1	16,200	住友精化	5.7	6.4	新日本理化	19	252,888
イフジ産業	2.3	2.5	2,350	日産化学	63.9	78.4	ハリマ化成グループ	8.7	23.6
ピックルスコーレーション	2.8	7.2	11,419	ラサ工業	3.8	5	花王	283.1	5,923
フアーマフーズ	—	14	22,848	クレハ	9.9	11.5	第一工業製薬	3.9	8,987
ユーブーラ	51.2	75	54,750	多木化学	4.5	5.6	石原ケミカル	3	1,709,126
紀文食品	—	8.6	8,187	ティカ	8.4	10.8	日華化学	4.3	5,4
ミヨシ油脂	4.4	6.2	6,869	石原産業	20.6	23.8	ニイタカ	2.4	15,660
理研ビタミン	11.2	15.4	26,257	片倉コーポアグリ	2.4	2.5	三洋化成工業	6.9	9,915
<b>繊維製品 (0.5%)</b>				日本曹達	16.2	18.4	有機合成薬品工業	9.2	4,015
片倉工業	15.6	13.8	33,092	東ソー	178.9	207.7	大日本塗料	13.2	2,811
グンゼ	8.5	9.6	37,008	トクヤマ	34.3	46	日本ペイント	95.5	14,453
東洋紡	45.8	56.9	74,254	セントラル硝子	22	23.5	関西ペイント	130.1	45,478
ユニチカ	33.8	39.2	11,956	東亜合成	70.7	80.1	神東塗料	9.3	30,668
富士紡ホールディングス	5.6	6.4	24,288	大阪ソーダ	11.9	13.5	中国塗料	27.9	1,540
倉敷紡績	10.7	12.3	23,579	関東電化工業	27.3	31.6	日本特殊塗料	8.7	34
シキボウ	6.6	7.9	7,244	デンカ	42.2	52.4	藤倉化成	16	9,156
日本毛織	38.1	43.4	38,929	信越化学工業	214.1	247.4	太陽ホールディングス	16	8,820
ダイティウボウ	19.3	23.8	2,118	日本カーバイド工業	4.2	5.2	D I C	24.5	2,121
トアブコーポレーション	4.1	4.3	1,754	堺化学工業	8.1	10	サカタインクス	48.9	68,158
ダイドーリミテッド	16.6	20.5	2,870	第一希元素化学工業	11.7	13.4	東洋イシキホールディングス	27.3	18,211
帝国織維	13	16.3	32,811	エ・ウォーター	118.1	136.2	T & K T O K A	9.4	541.2
帝人	109	135.4	187,393	日本製紙ホールディングス	95.3	138.5	富士フイルムホールディングス	149.3	44,118
東レ	838.4	1,042.5	699,309	日本化学生業	3.2	4.6	資生堂	207.8	1,967,702
サカイオーベックス	3.1	—	—	東邦アセチレン	1.9	2.6	ライオン	235	273.9
住江織物	2.1	3.4	6,504	日本パーカライジング	58.4	72.6	高砂香料工業	153.7	1,642,578
日本フェルト	5.5	5.9	2,643	高圧ガス工業	18.5	23.1	マンダム	7.4	28.7
イチカワ	1.3	1.4	1,937	チタン工業	1.5	1.7	ミルボン	24.5	30.5
日東製綱	1.3	1.7	2,459	四国化成工業	15.5	19	ファンケル	9.4	58,712
アツギ	9.3	11.5	6,704	戸田工業	2.4	3.2	コーセー	22.2	10,120
ダイニック	3.6	3.8	2,728	ステラ・ケミファ	6.3	7.2	コタ	7	27.7
セーレン	28.5	29.6	61,952	保土谷化学工業	3.4	4.6	シーボン	9.4	304,146
ソトー	4	6.2	5,139	日本触媒	21	24.2	ボラ・オルビホールディングス	1.3	4,252
東海染工	1.3	1.4	1,605	大日精化工業	9.6	12	ノエティアホールディングス	50.5	62.8
小松マテー	19.1	23.6	29,877	カネカ	30	37.3	アジョバホールディングス	10	10,895
ワコールホールディングス	28.9	35.9	73,738	三菱瓦斯化学	116	133.8	新日本製薬	3	63,252
ホギメディカル	15.6	19.5	61,425	三井化学	100	130.8	エステー	2.4	3,846
クラディアホールディングス	2.4	2.5	590	J S R	116.2	134.4	アグロ・カネショウ	7.7	5,300
T S I ホールディングス	34.7	47.9	15,807	東京応化工業	19.9	23.3	コニシ	4.5	14,601
マツオカーポレーション	3.7	4.6	5,409	大阪有機化学生業	10.7	12.2	タカラバイオ	19.5	6,515
ワールド	15.1	18.9	22,264	三菱マカホールディングス	774.1	962.6	星光P M C	31	38,222
三陽商会	6	6.9	5,954	K H オネカム	19.1	23.7	小林制药	20.5	25.5
ナイガイ	3.8	4.1	1,160	ダイセル	155.5	207.2	荒川化学工業	6.9	61,786
オングードホールディングス	69.3	86.3	25,631	住友ベーライト	18.2	22.8	メック	9.9	5,633
ルックホールディングス	4	4.6	6,076	積水化学工業	244.9	301.3	日本高純度化学	8.1	12.3
キムラタン	68.3	79.9	1,518	日本ゼオン	104.5	129.8	タカラバイオ	31	38,846
ゴールドワイン	19.1	26	158,340	アイカ工業	32.2	40.1	J C U	7.7	75,613
デサント	19.8	28.1	97,085	宇部興産	58.4	67.8	新田ゼラチン	13.3	9,045
キンブ	4.6	6.7	3,463	積水樹脂	19.1	21.9	O A T アグリオ	7.7	3,2
ヤマニンターナショナル	10.6	13.3	3,790	タキヨンシーアイ	25.2	31.4	デクセリアルズ	3.3	6,425
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>				旭有機材	6.6	8.1	アース製薬	33	38,2
特種東海製紙	7.2	8.9	37,291	ニチバン	6.2	8.6	北興化学工業	8.9	118,420
王子ホールディングス	521.3	602.3	363,789	リケンテクノス	28.2	35.4	大成ラミック	10.9	71,027
日本製紙	51.1	69	81,213	大倉工業	5.5	7.5	クミアイ化学生業	3.7	10,874
三菱製紙	17.1	21.3	6,794	積水化成品工業	15.6	19.6	日本農薬	48.8	12,962
北越コーポレーション	82.9	94.7	74,244	群栄化学生業	2.2	3.5	アキレス	54.8	44,223
中越パルプ工業	4.7	5.6	5,538	ダイガースポリマー	6.7	8.5	有沢製作所	8.2	14,018
巴川製紙所	3.7	4.6	3,762	ミライアル	3.7	4.7	日東電工	16.5	11,637
大王製紙	56	69.6	133,284	ダイキヨーニシカワ	4.3	5.6	レック	75.7	21,414
阿波製紙	3	4	1,324	竹本容器	24.5	30.7	三光合成	14	775,190
レンゴー	119.4	136.3	117,763	森六ホールディングス	4.2	5.3	きもと	12.4	18,106
トーモク	7.2	9	15,849	扶桑化学工業	6.3	7.9	藤森工業	18.9	5,766
ザ・パック	8.7	11	29,931	恵和	1.7	3.6	前澤化成工業	10.6	4,854
<b>化学 (6.6%)</b>				日本化薬	71.6	113.4	未来工業	7.8	54,978
北の蓮コーポレーション	41.4	51.4	11,205	カーリットホールディングス	11.5	14.3	エフピコ	9.5	11,789
クラレ	182.3	210.4	217,764	日本精化	8.4	11.6	4,052	4.3	8,475
旭化成	767.5	954.1	1,064,775	扶桑化学工業	9.1	12.9	ウェーブロックホールディングス	7	3,931

銘柄	期首(前期末)				当期末				銘柄	期首(前期末)				当期末				銘柄	期首(前期末)					
	株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円	株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円		
天馬	8.9	11.6	30,206	千円	20.9	24	21,216	千円	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	日本精工ホールディングス	31.6	39.4	128,444	東邦亜鉛	6.5	8.1	19,658	千円		
信越ボリマー	18.2	26.4	29,409	千円	17.5	22	64,658	千円	三井金属鉱業	77.2	95.9	199,951	千円	三井金属鉱業	77.2	95.9	199,951	東邦亜鉛	6.5	8.1	19,658	千円		
東リ	31.1	38.8	8,691	千円	108.6	135.1	680,904	千円	住友金属鉱山	149.4	185.8	998,303	千円	住友金属鉱山	149.4	185.8	998,303	古河機械金属	19.3	24.1	30,438	千円		
ニフコ	43.4	49.1	168,413	千円	59.8	70.5	32,853	千円	DOWAホールディングス	29.6	39.7	205,646	千円	エス・サイエンス	54.7	69	1,587	大飯タニウム	12	16.7	14,345	千円		
バルカー	9.7	12	30,336	千円	2.1	2.5	5,107	千円	東邦タニウム	20.9	26.2	23,946	千円	東邦タニウム	20.9	26.2	23,946	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円		
ユニ・チャーム	250.8	283.4	1,248,377	千円	5.3	5.7	4,474	千円	UACJ	17.7	22.2	51,415	千円	CKサンエツ	2.1	3.2	12,848	古河電気工業	36.4	45.2	99,666	千円		
ショーエイボレーション	2.6	4	2,648	千円	43.8	59.1	166,130	千円	住友電気工業	407.9	543.6	848,559	千円	住友電気工業	407.9	543.6	848,559	エス・サイエンス	54.7	69	1,587	千円		
医薬品 (4.9%)		119	172.7	504,802	千円	オハラ	4.7	5.9	6,549	千円	大飯タニウム	12	16.7	14,345	千円	大飯タニウム	12	16.7	14,345	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円
協和キリン	983.7	1,155.5	3,978,386	千円	住友大阪セメント	21.3	27.3	96,505	千円	東京特殊電線	1.5	1.7	4,921	千円	東京特殊電線	1.5	1.7	4,921	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
武田薬品工業	1,025.1	1,274.7	2,576,806	千円	大太平洋セメント	70	83.5	192,634	千円	タツタ電線	20.6	25.7	11,590	千円	タツタ電線	20.6	25.7	11,590	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
アステラス製薬	87.6	90.9	112,897	千円	日本ヒューム	11	15.4	10,641	千円	古河電気工業	2.2	2.8	4,253	千円	古河電気工業	2.2	2.8	4,253	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
大日本住友製薬	148.7	184.8	1,475,443	千円	日本コンクリート工業	25.4	29.1	8,235	千円	リヨービ	14.2	17.9	20,083	千円	リヨービ	14.2	17.9	20,083	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
塩野義製薬	14.3	17.6	5,332	千円	三谷セキサン	5.5	6.9	44,988	千円	アーレースティ	14.6	15.4	5,836	千円	アーレースティ	14.6	15.4	5,836	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
わかもと製薬	13.4	—	—	千円	アシバ/アルホールディングス	18.5	23.3	10,298	千円	アサヒホールディングス	21.9	58.3	128,376	千円	アサヒホールディングス	21.9	58.3	128,376	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
あすか製薬	33.5	38.5	294,140	千円	東海カーボン	115.5	123.2	141,310	千円	金属製品 (0.6%)	6.7	8.3	10,665	千円	稻葉製作所	6.7	8.3	10,665	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
日本新薬	2.2	—	—	千円	日本カーボン	6.5	7.6	30,324	千円	宮地エンジニアリンググループ	3.8	4.6	14,628	千円	宮地エンジニアリンググループ	3.8	4.6	14,628	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
ビオフェルミン製薬	369.8	460	1,867,140	千円	日本カーボン	7	9.5	27,559	千円	トーカロ	30.2	37.6	49,632	千円	トーカロ	30.2	37.6	49,632	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
中外製薬	20.2	23.1	94,825	千円	リタケカバニリミテド	6.6	8.2	36,982	千円	アルファ	4.5	4.8	5,294	千円	アルファ	4.5	4.8	5,294	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
科研製薬	130.6	176.1	1,012,927	千円	TOTO	84.5	105	512,925	千円	SUMCO	149.6	223.9	444,217	千円	SUMCO	149.6	223.9	444,217	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
エーザイ	56.3	75.5	241,977	千円	日本鶴子	130	159.3	296,616	千円	川田テクノロジーズ	2.4	3	11,910	千円	川田テクノロジーズ	2.4	3	11,910	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
ロート製薬	271.5	337.6	955,576	千円	日本特殊陶業	90	111.9	246,739	千円	RS Technologies	3.8	4.7	26,555	千円	RS Technologies	3.8	4.7	26,555	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
小野薬品工業	34.4	38.8	142,784	千円	ダントホールディングス	8.6	9.5	3,344	千円	ジェイティックコーポレーション	1	1.6	2,529	千円	ジェイティックコーポレーション	1	1.6	2,529	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
久光製薬	16.4	18.7	69,564	千円	MA R UWA	4.1	5.1	70,482	千円	信和	6.4	9.1	7,543	千円	信和	6.4	9.1	7,543	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
持田製薬	205.7	274.1	362,086	千円	嵐川リフラクトリーズ	2.8	3.5	13,772	千円	東洋セメント	74.5	92.6	140,659	千円	東洋セメント	74.5	92.6	140,659	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
参天製薬	205.9	259	11,679	千円	黒崎播磨	2	2.7	11,947	千円	ホッカンホールディングス	6	8.2	11,627	千円	ホッカンホールディングス	6	8.2	11,627	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
扶桑薬品工業	3.8	5.2	11,679	千円	ヨータイ	8.6	9.4	12,097	千円	コロナ	6.8	8.6	7,731	千円	コロナ	6.8	8.6	7,731	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
日本ケミファ	1.2	1.2	2,547	千円	イソライト工業	5.3	6.6	7,906	千円	横河ブリッジホールディングス	20.1	25	51,000	千円	横河ブリッジホールディングス	20.1	25	51,000	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
ツムラ	39.5	45.7	153,552	千円	東京窯業	15.7	19.4	5,975	千円	駒井ハルティック	2.4	2.9	6,878	千円	駒井ハルティック	2.4	2.9	6,878	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
日医工	33.4	45.6	34,063	千円	ニッカト	5.4	6.8	4,168	千円	高田機工	0.8	0.7	1,989	千円	高田機工	0.8	0.7	1,989	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
キッセイ薬品工業	20.9	26.2	61,805	千円	ジイエイ ホールディングス	338.2	392.6	602,641	千円	三和ホールディングス	110.2	137.1	164,794	千円	三和ホールディングス	110.2	137.1	164,794	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
生化学工業	20.9	26	24,700	千円	日本製鐵	45.6	49.6	56,891	千円	文化協立山	34.6	46.4	47,699	千円	文化協立山	34.6	46.4	47,699	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
栄研化成	20.8	25.9	46,309	千円	共英製鋼	13.1	16.5	25,789	千円	アルインコ	7.8	10.9	9,919	千円	アルインコ	7.8	10.9	9,919	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
日水製薬	4.6	5.9	5,823	千円	東京鐵工	4.5	6.4	8,652	千円	LIXIL	161	228.9	575,912	千円	LIXIL	161	228.9	575,912	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
鳥居製品	7.4	8	25,120	千円	大阪製鐵	6.3	7.9	9,653	千円	日本フィルコン	8.5	10.9	5,831	千円	日本フィルコン	8.5	10.9	5,831	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
J C R ファーマ	33.3	41.5	84,328	千円	淀川製鐵所	15.9	19.3	50,373	千円	ノーリツ	24.3	28	45,780	千円	ノーリツ	24.3	28	45,780	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
東和薬品	17.1	21.1	61,823	千円	丸一鋼管	37.9	51.5	136,063	千円	関東製作所	12	14.9	28,980	千円	関東製作所	12	14.9	28,980	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
富士薬業工業	8.1	9.1	9,090	千円	モリ工業	3.5	4.5	11,403	千円	リンナイ	22.7	27.4	27,770	千円	リンナイ	22.7	27.4	27,770	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
沢井製薬	25.9	—	—	千円	大同特殊鋼	19.1	23.8	102,340	千円	ダイニチ工業	5.7	7.2	5,133	千円	ダイニチ工業	5.7	7.2	5,133	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
ゼリア新薬工業	21.5	26.9	51,325	千円	日本高周波鋼業	4	4.2	4,148	千円	日東精工	15.1	18.4	9,568	千円	日東精工	15.1	18.4	9,568	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
第一三共	1,015	1,155.4	2,727,321	千円	日本製鐵	17.1	23.1	10,418	千円	三洋工業	1.3	1.4	2,532	千円	三洋工業	1.3	1.4	2,532	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
ヨリーラ製薬ホールディングス	26.1	29.6	54,967	千円	共英製鋼	13.1	16.5	25,789	千円	岡部	24.1	27.8	20,822	千円	岡部	24.1	27.8	20,822	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
大幸製品	14.5	22.3	14,338	千円	東京鐵工	4.5	6.4	8,652	千円	ジーテクト	14.6	18.2	26,080	千円	ジーテクト	14.6	18.2	26,080	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
タイト	7.5	9.4	26,479	千円	東京鐵工	6.3	7.9	9,653	千円	東プレ	21.9	27.1	33,360	千円	東プレ	21.9	27.1	33,360	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
大冢ホールディングス	245.8	305.5	1,249,800	千円	山陽特殊製鋼	14	15	33,135	千円	高周波熱鍊	22.3	25.9	15,306	千円	高周波熱鍊	22.3	25.9	15,306	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
大正製ホールディングス	28.1	35	199,150	千円	山陽特殊製鋼	6.6	8.2	21,197	千円	東京機締	8.2	8.9	7,885	千円	東京機締	8.2	8.9	7,885	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
ペプチドリーム	60.1	77.1	155,742	千円	日立金属	2.9	3.6	3,880	千円	日本発条	116.4	133.7	120,330	千円	日本発条	116.4	133.7	120,330	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
あすか製薬ホールディングス	—	16.8	17,421	千円	日本金属	1.4	1.6	1,601	千円	中央発條	1	7.2	5,724	千円	中央発條	1	7.2	5,724	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
サワ/イグレーホールディングス	—	32.2	145,061	千円	日本金属	1.4	1.6	1,601	千円	エイチワ	11.6	14.4	9,432	千円	エイチワ	11.6	14.4	9,432	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
石油・石炭製品 (0.4%)	100.5	123.8	17,332	千円	栗本鐵工所	5.4	6.8	10,608	千円	アド耐クス	17.3	21.6	38,750	千円	アド耐クス	17.3	21.6	38,750	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
日本ゴーツクス	14	18.9	24,381	千円	モリテックスチール	9	11.4	3,693	千円	日本精工	11.6	14.4	9,432	千円	日本精工	11.6	14.4	9,432	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
ユシロ化学工業	6.8	7.9	8,500	千円	エイチワ	1.4	1.6	1,601	千円	コムギ	37.3	44.1	6,623	千円	コムギ	37.3	44.1	6,623	日本精工ホールディングス	31.9	36.7	65,582	千円	
ビーピー・カストロール	4.3	5.5	7,155	千円	日本精工	1.4	1.6	1,601	千円	日本製鋼	35.5	42.1	160,330	千円	日本製鋼	35								

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
三浦工業	千株	千株	千円	207,585	帝国電機製作所	千株	千株	千円	13,939	三菱重工業	千株	千株	千円	
タフマ	50.6	63	50.6	207,585	東京機械製作所	8.3	10.6	10.6	13,939	I H I	185.7	231	737,583	
ツガミ	39.6	49.2	70,060	新東工業	4.3	—	—	—	サノヤホールディングス	79.5	91.8	214,353		
オーフマ	24.2	31.9	41,629	アイコ-ボレーション	28.2	32.6	22,689	スター精密	15.5	17	2,227			
芝浦機械	13.6	16.9	81,458	小森コーポレーション	10.4	12.8	32,256	電気機器(18.0%)	18.2	22.8	33,288			
アマダ	12.2	16.5	50,902	鶴見製作所	20.5	21.7	17,967	日清防ホールディングス	72	89.8	88,812			
アイダエンジニアリング	171.2	229.4	251,651	住友精密工業	30.1	37.5	26,100	イビデン	56.8	77.2	465,516			
澁澤鉄工所	30.7	38.2	39,498	日本ギア工業	9.2	11.5	19,630	コニカミノルタ	239.4	320.9	159,808			
F U J I	3.9	4.8	5,726	酒井重工業	1.9	2.4	4,524	ブライタ工業	144.3	179.5	398,490			
牧野フライス製作所	46.6	67	168,103	西島製作所	6	6	1,578	ミネベアミツミ	203.7	253.4	67,831			
オースジー	13.7	16	60,320	北越工業	1.9	2.7	7,641	日立製作所	568.4	707.2	4,163,993			
ダイジェット工業	57.6	67.3	136,551	大同工業	12.2	13.5	12,433	東芝	—	256.9	1,233,120			
旭ダイヤモンド工業	1	1.1	1,083	木村化工機	12.4	14	12,600	三菱電機	1,182.4	1,470.1	2,072,841			
DMG森精機	31	38.3	23,133	タダノ	4.6	6.7	6,231	富士電機	71.2	88.6	526,284			
ソディック	25.6	32.2	25,599	アネスト岩田	9.8	12.2	9,064	東洋電機製造	4.7	5.9	5,658			
ディスコ	15.9	21.5	693,375	ダイキン工業	20	23	18,653	安川電機	127.3	158.4	760,320			
日東工業	5.7	8.1	13,024	オルガノ	65.1	81	690,930	シグニアテクノロジー	15.4	17.7	22,319			
日進工具	4.6	11.6	16,576	トヨカーネツ	4.4	5.5	14,069	明電舎	20	24.9	61,104			
パンチ工業	9.9	12.2	5,990	栗田工業	64	79.7	379,770	オリジン	2.6	4	5,032			
富士ダイス	6.4	6.8	4,182	椿本チエイン	16.9	19.4	62,856	山洋電気	5.7	6.6	32,802			
豊和工業	6.5	7.9	6,557	マクニカ	4.6	6.7	3,117	デンヨー	10.1	12.6	21,092			
O K K	4.8	5.6	4,244	アマノ	57	77	74,998	P H Cホールディングス	—	16.9	27,124			
石川製作所	3	3.9	5,752	フジテック	40.8	54.6	147,420	東芝テック	12.7	16	79,120			
東洋機械金属	8.4	9.9	5,613	C K D	27.4	43.4	89,317	芝浦メトロニクス	2.1	2.7	22,464			
津田駒工業	2.4	3.4	1,975	加藤製作所	6.4	6.9	5,837	マブチモーター	32.7	34.1	122,760			
エンシユウ	2.4	3.5	2,289	油研工業	1.7	1.8	3,117	日本電産	284.6	381.1	3,803,759			
島精機製作所	17.1	21.2	37,078	タダノ	57	77	74,998	ヨーナン・エクトロニクス	7	6.6	2,534			
オプトラン	14.6	18.3	42,016	フジテック	27.4	43.4	89,317	トヨク・セミコンダクター	6.4	7.5	19,740			
NCホールディングス	3.1	4.1	6,629	S A N K Y O	28	31.8	96,513	東光高岳	6	8.2	11,783			
イワキ	7.6	9.4	9,428	日本金銭機械	13.2	15	9,660	ダブル・スコープ	23.2	42.3	33,163			
フリュー	11.5	12.8	16,473	マスク	7.6	9.4	15,199	ダイヘン	12.9	16.1	64,319			
ヤマシンフィルタ	23.5	29.3	11,221	理想科学工業	9.2	12.3	27,416	ヤーマン	19.3	24	21,456			
日阪製作所	14.8	18.3	15,060	マクニカ	32.9	41.1	78,090	J V Cケンウッド	101.9	119.5	22,346			
やまびこ	22.6	28.3	29,994	平和	10	12.6	21,256	ミマキエンジニアリング	11	13.3	10,374			
野村マイクロ・サイエンス	—	3.9	16,282	トヨカーネツ	32.9	41.1	78,090	I - P E X	5.5	6.9	11,854			
平田機工	5.5	6.9	39,054	フクシマガリレイ	8.1	10.3	43,105	日新電機	27.7	34.7	50,696			
ベガサミン製造	12.2	15	8,565	オーディズ	5.1	5.4	2,133	大崎電気工業	23.4	26.8	12,810			
マルマエ	4.3	6	14,268	ダイコク電機	5.6	6.9	8,583	オムロン	98.4	122.4	1,006,984			
タツモ	4.9	6.9	9,694	竹内製作所	19.7	22.4	63,212	日東工業	17.3	19.6	30,830			
ナブテスコ	68.9	82.9	290,564	アマノ	31	38.5	84,199	I D E C	15.9	18.3	42,639			
三井海洋開発	12.4	15.5	18,693	J U K I	16.5	20.5	15,723	正興電機製作所	2.7	4.6	4,774			
レオン自動機	11.4	15.6	16,270	サンデン	16.5	20.4	3,957	不二電機工業	2.3	3.4	3,672			
S M C	34.6	43.1	2,754,521	ジャノメ	10.6	12.5	9,062	ジエス・コザ コーポレーション	42.4	47.9	108,733			
ホソカワミクロン	4.1	10.3	29,530	マックス	16.3	19.7	34,947	サクサホールディングス	2.8	2.9	3,822			
ユニオングンツール	4.4	5.5	20,405	グローリー	30.4	37.7	78,755	メルコホールディングス	4.1	3.3	12,490			
オイレス工業	16.5	20.5	33,066	新晃工業	11	13.8	25,267	テクノメディア	2.8	3.5	5,533			
日精ニ・エス・ピー機械	3.4	4.9	14,327	大和冷機工業	19	21.2	23,977	ダイキンエンジニアリング	3.4	4.1	4,374			
サトーホールディングス	15.4	19.3	39,121	セガミホールディングス	107.5	145.9	302,158	日本電気	150.2	186.9	949,452			
技研製作所	10.3	12.8	49,792	日本ピストンリング	4.5	5.4	7,225	富士通	106.4	132.4	2,133,626			
日本エアーテック	3.8	6.8	7,459	リケン	5.5	6.4	17,299	沖電気工業	47.9	59.8	53,521			
カワタ	3.2	4.7	5,010	T P R	16	19.9	29,631	岩崎通信機	4.4	6.3	5,134			
日精樹脂工業	9.2	10.4	10,649	ツバキ・ナカシマ	22.5	32.2	46,657	電気興業	5.7	7.9	18,264			
オカダブアイヨン	3.8	4.7	6,909	ホシザキ	37.2	43	373,240	サンケン電気	13.8	13.8	65,274			
ワエイハイホールディングス	4.6	5.7	7,022	大富工業	9.8	12	8,592	ナカヨ	1.9	2.2	2,494			
小松製作所	535.7	666.1	1,878,068	日本精工	242.6	276.6	206,620	アイホン	6.8	8.5	18,156			
住友重機械工業	67.6	84.1	249,356	N T N	272.6	314.8	73,348	ルネサスエレクトロニクス	508.7	796.7	1,000,655			
日立建機	55.3	58.9	12,577	ジェイテクト	113.3	140.9	147,663	セイコーエプソン	146.6	182.4	335,980			
日工	17.6	20.4	12,444	不二越	11	12.6	53,109	ワコム	85.5	114	101,688			
巴工業	4.8	5.9	13,044	日本トムソン	32.2	40.2	24,964	アルパック	21.8	29.3	172,870			
井関農機	11.8	13.7	18,303	T H K	73.7	83	233,977	アクセル	4.9	6.3	6,545			
T O W A	11	12.6	30,769	ユーシン精機	7.9	11.7	8,154	E I Z O	10	11.5	42,435			
丸山製作所	2.4	3.2	4,793	前澤給装工業	4.2	11.4	11,149	ジャパンディスプレイ	404	500	19,000			
北川鉄工所	5.5	6.8	9,526	イーグル工業	14.7	18.3	19,599	日本信号	27.6	37.5	33,975			
ローソフ	5.2	7.4	75,924	前澤工業	7.3	8.9	5,936	京三製作所	25.4	31.6	13,272			
タカキタ	4.3	5	3,050	日本ピラーア工業	12.1	14.9	46,190	能美美防災	15.7	19.5	40,540			
クボタ	621.2	712.6	1,707,745	キッソ	36.6	49.7	33,000	ホーチキ	8.6	10.9	13,178			
荏原実業	2.9	6.9	15,035	マキタ	154.2	179	711,883	星和電機	5.9	7.2	3,916			
三菱化工機	3.7	4.7	9,494	三井E & Sホールディングス	45.7	53	19,610	エレコム	13.5	33.7	46,000			
月島機械	21.8	27.3	28,310	日立造船	93.7	124.3	92,354	パソニック	1,260.9	1,568.1	1,884,072			

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
シャープ	千株 136.8	千株 167.6	千円 208,997		カシオ計算機	千株 95.1	千株 106.5	千円 148,780		本田技研工業	千株 930.9	千株 1,157.5	千円 3,938,972	
アンリツ	71	94.6	149,562		ファナック	103.8	129.1	2,875,057		スズキ	234.4	336.2	1,614,768	
富士通ゼネラル	36.2	39.9	97,994		日本シエムケイ	25.5	28.9	16,241		S U B A R U	338.8	421.2	847,665	
ソニーグループ	740.6	921.1	11,661,126		エンプラス	5.3	3.6	9,478		安永	5.7	7.2	6,278	
T D K	57.1	213	970,215		大真空	4	19.9	24,297		ヤマハ発動機	167.1	191.9	532,906	
帝国通信工業	5.6	6.7	9,112		ローム	49.2	65.8	60,044		T B K	11.8	16.9	6,929	
タムラ製作所	42.3	56.8	36,749		浜松ホニクス	84.8	105.5	612,955		エクセディ	16	22.3	37,664	
アルプスアルパイン	96.5	129.9	164,713		三井ハイテック	11.6	14.6	124,100		豊田合成	38.2	47.4	106,507	
池上通信機	4	5	3,215		新光電気工業	39.7	43.2	214,920		愛三工業	18.5	23.1	17,094	
日本電波工業	11.5	13.3	16,651		京セラ	180.2	206.9	1,416,437		盟和産業	1.6	1.7	1,723	
鈴木	5.3	6.8	5,882		太陽誘電	52.5	71.3	377,177		日本プラス	10.3	11.5	6,428	
マイコー	—	12	44,700		村田製作所	347.3	431.9	3,556,264		ヨロズ	10.2	13.9	14,011	
日本トリム	2.5	2.9	8,816		双葉電子工業	20.3	25.1	16,892		エフ・シー・シー	19.3	24	34,248	
ローランド ディー.ジー.	7	8.7	22,985		北陸電気工業	4.6	5.5	6,897		シマノ	44.3	59.1	1,533,054	
フォスター電機	12.4	14.8	11,928		ニチコン	37.1	46.3	55,467		ティ・エス・テック	27.4	62.1	97,000	
SMK	3.1	3.5	7,570		日本ケミコン	11.9	14	26,082		ジャムコ	7	8.6	7,146	
ヨコオ	8.7	10.9	28,656		K O A	16.3	22.3	32,290		精密機器 (2.7%)				
ティアップ	7.3	23.5	3,125		市光工業	17.6	17.7	9,062		テルモ	362.5	416	1,724,320	
ホシデン	32.2	35.4	42,480		小糸製作所	70.8	80.7	472,095		クリエートメディック	4.2	4.3	4,166	
ヒロセ電機	18.2	22.8	393,984		ミツバ	21.7	27	11,205		日機装	38.2	44.1	37,529	
日本航空電子工業	27	33.7	61,738		SCREENホールディングス	20.5	25.6	288,000		日本エム・ディ・エム	6.8	8.6	13,837	
T O A	14	16	12,432		キヤノン電子	10.9	13.7	22,084		島津製作所	152.2	189.3	779,916	
マクセル	23.4	29.3	36,039		キヤノン	587.5	730.5	2,043,939		J M S	10	12.3	7,576	
古野電気	15.1	17.4	18,339		リコー	300.7	408.1	400,754		クボテック	3.1	3.3	858	
ユニデホールディングス	3	3.3	11,913		象印マホービン	31.9	39.8	58,625		長野計器	8.5	10.8	14,450	
スマーダポーレーション	10	13.9	13,538		MUTOHホールディングス	1.2	1.2	2,510		ブイ・テクノロジー	5.5	6.4	21,760	
アイコム	4.9	5.5	12,980		東京エレクトロン	69.3	93.3	5,156,691		東京計器	7.5	9.4	9,559	
リオン	5	5.6	12,280		輸送用機器 (8.7%)					愛知計時電機	1.2	3.7	7,074	
本多通信工業	9.4	11.9	5,712		トヨタ紡織	34.5	60	130,800		インターラクション	5.9	7.5	14,685	
船井電機	13.4	—	—		芦森工業	2.4	2.5	2,242		オーパル	10.7	13.3	3,564	
横河電機	118.3	147.2	274,969		ユニプレス	19.3	21.9	17,936		東京精密	19.9	24.8	112,592	
新電元工業	4.5	5.6	18,900		豊田自動織機	95.7	119.2	1,060,880		マニー	47	58.6	96,865	
アズビル	80	86.2	359,023		モリタホールディングス	19	23.6	29,854		ニコン	180.4	224.5	292,972	
東亜ディーケーベー	6.1	7.6	6,878		三櫻工業	16.3	20.2	16,846		トプコン	59.5	69.1	102,682	
日本光電工業	48.9	60.9	188,790		デンソー	260.4	323.7	2,751,450		オリンパス	654.2	771.1	1,744,999	
チノー	3.8	4.8	7,862		東海理化電機製作所	31.2	38.8	59,946		理研計器	10.5	12	63,000	
共和電業	13	14.9	5,632		川崎重工業	91.9	107.3	233,055		タムロン	9.5	11.5	28,911	
日本電子材料	4.3	7.2	16,516		名古屋造船所	35.7	43.7	8,827		H O Y A	234.6	287	4,439,890	
堀場製作所	23.4	27.3	165,165		日本車輪製造	4.3	5.5	11,000		シード	5.2	6.9	3,608	
アドバンテスト	87.9	109.3	1,007,746		三菱ロジスネクスト	15.7	19.5	19,929		ノーリツ機器	10.6	13.2	27,508	
小野測器	4.3	6.9	3,312		近畿車輛	1.6	1.7	1,847		エー・アンド・ディ	9.9	13.4	12,730	
エスベック	10.5	12	24,168		日産自動車	1,394.4	1,733.9	1,038,432		朝日インテック	124.4	161.2	312,728	
キーエンス	116	133.2	7,826,832		いすゞ自動車	342.6	461.4	687,947		シチズン時計	149.2	172.1	86,910	
日置電機	5.7	7	44,240		トヨタ自動車	1,197.8	7,450.7	16,954,067		リズム	3.1	4.6	6,026	
シスメックス	92.2	124.4	1,316,774		日野自動車	147.7	183.6	194,616		大研医器	9.5	12	6,324	
日本マイクロニクス	206	25.6	38,476		三菱自動車工業	437.1	544.1	171,935		メニコン	18.1	48.8	132,540	
メカチップス	11.9	13.8	57,339		エフテック	8.4	10.3	5,562		シンシア	1.2	1.8	957	
O B A R A G R O U P	7	6.8	22,236		レシップホールディングス	4.6	5.7	3,192		松風	5.5	6.4	12,268	
澤藤電機	1.3	1.8	2,649		G M B	2.2	2.8	2,282		セイコーホールディングス	16.6	20.7	45,602	
原田工業	5	7.5	7,357		ファルテック	2.3	2.9	2,105		ニプロ	88.1	109.6	117,052	
コーセル	14.4	16.3	13,219		武藏精密工業	26.4	32.7	57,421		その他製品 (2.3%)				
イリソニ電子工業	9.9	12.3	52,152		日産車体	17.3	21.7	15,428		中本パックス	3.1	4.2	7,274	
オブテックスグループ	19.4	24	35,256		新明和工業	33.3	41.7	38,072		スノーピーク	7	19.3	44,544	
千代田インテグレ	5.1	6.4	11,936		極東開発工業	20.4	27.3	39,666		トランザクション	11.4	28.2	54,538	
アイ・オ・データ機器	4.4	5.5	4,713		トピー工業	9.8	12.1	13,467		粧美堂	6.4	8.1	8,245	
レーザーテック	51.9	64.5	1,435,447		ティラド	3.7	4.2	11,919		ニホンフランシ	10.1	12.6	13,393	
スタンレー電気	82.9	102.8	274,064		曙ブレーキ工業	64.1	80.6	13,863		前田工織	13	16.3	51,426	
岩崎電気	4.3	5.4	12,144		タチエス	18.1	25.7	31,122		永大産業	16.8	20.5	6,293	
ウシオ電機	60.6	75.3	139,079		N O K	57.2	71.2	91,207		アートネイチャー	11.6	12.7	8,801	
岡谷電機産業	8.9	9.3	2,929		フタバ産業	29.6	36.8	15,124		パナソニックホールディングス	97.8	131.8	1,124,385	
いのうテクノホールディング	11.2	12.9	3,715		K Y B	13.2	15.4	47,124		アイフイスジャパン	3.2	4.3	2,893	
エノモト	3.3	4	6,408		大同メタル工業	24.6	28.5	18,126		共立印刷	21.9	25.1	3,614	
日本セラミック	12	13.8	34,610		プレス工業	58.5	73	27,813		S H O E I	10.4	13.9	60,812	
遠藤照明	6.7	6.9	6,817		ミクニ	16.1	19.6	8,976		フランプスホールディングス	15.4	19.3	17,427	
古河電池	8.4	10.7	13,171		太平洋工業	24.8	30.8	33,140		バイロットコーポレーション	20.9	24.9	104,829	
双信電機	5.8	6.4	3,718		河西工業	16.2	17.7	5,557		萩原工業	6.7	9.6	11,529	
山一電機	7.6	10.8	23,630		アイシン	86.5	107.7	487,342		トップ・フォームズ	21.2	—	—	
図研	7.7	9.5	28,376		マツダ	370.8	461.4	406,954		フジシールインターナショナル	24.3	35.7	76,540	
日本電子	21.6	30.8	192,500		今仙電機製作所	10.4	9.6	5,712						

銘柄	期首(前期末)	当期	末	銘柄	期首(前期末)	当期	末	銘柄	期首(前期末)	当期	末
株	数	株	数	評価額	株	数	株	評価額	株	数	評価額
タカラトミー	千株	52.9	千株	61.5	千円	71,586	東日本旅客鉄道	千株	208.1	千円	7,945.954
広済堂ホールディングス	8.1	9	9	6,993	西日本旅客鉄道	105.3	千円	178.4	880,939	東海運	7.9
エヌティーアイホールディングス	4	4	4	2,552	東海旅客鉄道	98.3	千円	122.1	1,825,395	エーアイティー	8.6
タカノ	4.5	5.4	5.4	3,758	西武ホールディングス	142.4	千円	191.8	227,474	内外トランスライン	8.8
プロネクサス	10.3	11.5	12,443		鴻池運輸	19	千円	23.5	27,518	日本コンセプト	4.1
ホクシン	8.5	11	1,705		西日本鉄道	32.8	千円	40.7	103,296	情報・通信業(8.0%)	3.7
ウッドワン	3.4	4.6	4,590		ハマキヨウレックス	9.1	千円	10.6	30,390	NECネットエスアイ	4.6
大建工業	8	8.7	18,661		サカイ引起センター	5.5	千円	6.9	30,291	クロスキャット	3
凸版印刷	179.6	223.5	488,124		近畿グルーハルディングス	111.9	千円	139.3	475,709	システム	41.4
大日本印刷	142.8	173.8	476,038		阪急阪神ホールディングス	149.3	千円	174.1	600,645	デジタルアーツ	6.8
共同印刷	3.7	4.6	12,479		南海電気鉄道	53.1	千円	62.3	143,788	日鉄ソリューションズ	17.3
N I S S H A	24.3	30.2	44,877		京阪ホールディングス	49.9	千円	62.1	172,079	キューピッシュシステム	6.2
光村印刷	0.8	0.7	987		神戸電鉄	2.8	千円	3.3	10,741	WOW WORLD	1.8
TAKARA & COMPANY	5.8	7.4	13,912		名古屋鉄道	92.1	千円	114.5	209,420	コア	4.9
アシックス	104.6	129.9	310,720		山陽電気鉄道	8.1	千円	11	22,000	ラクーンホールディングス	8.2
ソシミ	3	3.8	7,079		アルプス物流	—	千円	9.9	10,038	ソリューションズ	5.8
ローランド	6.9	10.3	44,856		日本通運	38.8	千円	—	—	ソフテックワールディングス	4.5
小松オワール工業	3.7	4.3	7,942		ヤマトホールディングス	157	千円	195.2	484,681	T I S	116
ヤマハ	70.3	85.5	459,135		山九	28.7	千円	36.6	149,145	J N S ホールディングス	5.5
河合楽器製作所	3.3	4.1	12,209		丸運	7.6	千円	8.3	2,008	電算システム	4.3
クリナップ	11.4	14	7,462		丸全昭和運輸	9.1	千円	11.5	36,627	グリー	71.1
ビジョン	75.9	89	195,889		セシールホールディングス	61.9	千円	69.9	64,587	G M O ベパボ	0.8
オリバー	2.4	—	—		トナミホールディングス	2.3	千円	3.4	12,546	コエテクモワールディングス	23.7
兼松サステック	0.6	0.6	990		ニッコーホールディングス	37.6	千円	46.8	99,216	三菱総合研究所	5
キンブジム	10.2	12.3	10,750		日本石油輸送	0.9	千円	1.1	2,905	ボルテージ	2.8
リンクアップ	25.4	31.6	81,496		福山通運	14.4	千円	23	83,950	電算	1
イトーキ	23.3	26.8	9,326		セイホーホールディングス	83.9	千円	94.9	108,660	A G S	6.1
任天堂	67.7	83	4,854,670		エクスラン	3	千円	3.2	2,870	ファインデックス	9.7
三菱鉛筆	19.5	24.2	29,741		神奈川中央交通	2.5	千円	3.4	11,424	ブレインパッド	2.9
タカラスタンダード	24.5	30.5	41,541		立物运输	24.7	千円	26.9	144,184	K L a b	21.2
コクヨ	56.6	70.5	119,850		丸和運輸機関	23.6	千円	29.5	34,220	ボルトウェーブ	15.4
ナカバヤシ	12.1	14	7,224		C & F ジオホールディングス	11.4	千円	14.3	19,347	イーブン	1.9
グローブライド	5.7	13.2	35,970		九州旅客鉄道	86.4	千円	107.8	262,277	ネクソン	293.1
オカラム	45.4	50.6	60,517		S G ホールディングス	211.7	千円	263.3	622,441	アイスタイル	35.3
美津濃	11.7	14.7	33,236		N I P P O N EXPRESSホールディングス	—	千円	48.2	325,350	エムアーホールディングス	3
電気・ガス業(1.1%)					海運業(0.6%)					エイチーム	8
東京電力ホールディングス	1,002.3	1,100.2	392,771		日本郵船	93.6	千円	116.4	1,080,192	エニグモ	10.9
中部電力	361.8	449.8	504,675		商船三井	66.4	千円	77.1	669,999	テクノスジャパン	8.9
関西電力	448	557	595,990		川崎汽船	34.5	千円	42.9	288,717	e n i s h	5.9
中国電力	170.7	229.8	200,615		N S ユナイテッド海運	5.4	千円	7.7	27,373	コロプラ	38
北陸電力	108.1	134.6	71,607		明治海運	12.3	千円	16.5	13,447	オルトプラス	6.8
東北電力	276.8	343.8	249,255		飯野海運	52.4	千円	64.5	35,668	ブロードリーフ	57.4
四国電力	98.2	132.5	103,880		共栄タンカー	2.2	千円	2.5	2,310	クロス・マーケティンググループ	5.4
九州電力	261	303	249,369		乾汽船	5.9	千円	9.4	22,080	デジタルハーツホールディングス	5.3
北海道電力	110.3	127.8	64,283		空運業(0.4%)					システム情報	8.5
沖縄電力	23	31.4	44,117		日本航空	272.7	千円	319.2	730,968	メディアドウ	4.4
電源開発	94	125.2	246,644		ANAホールディングス	302.1	千円	353.8	914,926	じげん	28.2
エフソン	7.2	8.9	4,823		パスコ	2.2	千円	2.8	3,687	ブレイブ	6.3
イーレックス	17.3	21.7	31,877		倉庫・運輸関連業(0.2%)					イカクレージ・エクノロジ	2.2
レノバ	19.9	28.7	42,906		トランコム	3.4	千円	4	29,680	サイバーリンクス	3.8
東京瓦斯	227.3	281.8	647,858		日新	9	千円	11.3	18,825	ディー・エル・イー	9.2
大阪瓦斯	214.1	266.1	542,045		三菱倉庫	38.7	千円	44.1	123,921	フィックスターズ	12.2
東邦瓦斯	58.1	67.5	212,625		三井倉庫ホールディングス	11.9	千円	14.9	35,298	C A R T A H O L D I N G S	4.7
北海道瓦斯	6.6	7.6	11,384		住友倉庫	40.3	千円	49.2	102,483	オプティム	8.1
広島ガス	25.4	29.1	10,417		滋賀倉庫	6.3	千円	8.5	18,122	セレス	3.8
西部ガスホールディングス	13.3	16.6	36,188		東陽倉庫	16.8	千円	22.8	7,204	S H I F T	5.2
静岡ガス	33.5	38.4	38,246		日本トランシスティ	25.1	千円	30.8	19,681	ティーガイア	12.3
メタウォーター	13.4	15.3	30,890		ケイヒン	1.7	千円	2.8	3,875	セック	1.7
陸運業(3.0%)					中央倉庫	6.4	千円	8.8	8,544	日本アジアグループ	11.2
S B S ホールディングス	8.7	11	35,970		川西倉庫	2.1	千円	2.9	3,169	テクマトリックス	17.9
東武鉄道	123.2	143.6	407,680		安田倉庫	9.6	千円	12	11,520	プロシップ	3.4
相鉄ホールディングス	40.5	47	100,298		ファイホールディングス	2	千円	2.9	1,771	ガホー・オンライン・エンターテイメント	27.9
東急	298.1	370.8	579,931		東洋埠頭	3	千円	3.2	4,678	G M O ハイメントゲートウェイ	24.6
京浜急行電鉄	151.8	188.7	223,609		宇德	8.5	千円	—		ザッパラス	4.6
小田急電鉄	189.4	218.7	444,398		上組	62.4	千円	76.7	171,961	システムミラーサーチ	3.4
京王電鉄	66	76.3	392,945		サンリツ	2.3	千円	4	3,360	インターネット・ティーシャイア	30.9
京成電鉄	88.6	102.5	328,000		ギムラユニティー	3.5	千円	4	5,436	さくらインターネット	12.2
富士急行	16.1	17.6	68,552		キユーズー流通システム	2.9	千円	7.3	6,570	ヴィングス	3.2
新京成電鉄	3	3.4	6,810		近鉄エクスプレス	21.2	千円	26.3	78,374	G M O プロバクサン・ホールディングス	2.5
										S R A ホールディングス	6.2

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末
株	数	株	数	銘柄	株	数	株	銘柄	株	数	株
システムインテグレータ	千株	千株	千円	EDU LAB	千株	千株	千円	日本電信電話	千株	千株	千円
朝日ネット	3.2	4.8	2,654	東海ソフト	1.1	—	—	KDDI	1,357.1	1,509.2	5,054,310
e B A S E	9.4	13.3	8,246	ウイングアーク1st	1.4	2.4	2,198	ソフトバンク	930.4	1,051.8	3,938,991
アバント	13.8	17.2	9,718	ヒューミュニケーションズ・ホールディングス	—	8.2	11,422	光通信	1,054.5	2,185.1	3,148,729
アドシリル日進	12.4	15.5	17,654	サーバーワークス	2	3.4	6,613	エムティーアイ	13.7	16.6	234,558
ODKソリューションズ	4.1	5.1	8,445	東名	0.6	1.5	1,426	GMOインターネット	11.4	14.2	8,037
フリー・ピット	6.9	8.6	7,808	ヴィッツ	0.4	1.2	1,555	ファイバーゲート	41.5	51.1	127,443
コムチュア	10.7	16.2	47,968	トビラシステムズ	1.1	2.9	2,375	アドマーケティングソリューションズ	3.7	4.7	5,649
サイバーコム	2.1	2.4	2,613	Sansan	—	51.3	62,842	KADOKAWA	2.9	3.5	1,004
アステリア	8.3	10.4	9,318	LInK-U	0.7	2.7	2,033	学研ホールディングス	31.3	78.7	179,672
アイル	6.5	8	10,040	ギフティ	5.2	12.6	13,759	ゼンリン	15.6	20.2	21,593
マークライズ	4.8	7.4	17,915	ベース	1	2.6	11,414	昭文社ホールディングス	21	23.4	24,242
メディカル・データ・ビジョン	13.2	18.3	18,702	JMDC	—	13.5	66,892	インプラスホールディングス	4.4	4.6	2,014
gumi	16	20	11,720	フォーカスシステムズ	7.7	9.6	8,937	アイネット	10	11.7	2,468
ショーケース	2.4	3.4	1,557	クレスコ	7.9	10.7	18,136	松竹	6	7.6	9,750
モバイルファクトリー	2.4	3.3	3,392	ア・メディ・ホールディングス	120.1	139	174,167	東宝	7.6	9.5	114,570
テラスカイ	3.7	5.2	7,638	オービック	36.6	45.6	859,104	東映	68.5	85.2	405,978
デジタル・ソフト・マーケティング・テクノロジー	5.1	6.4	7,756	ジャストシステム	16.5	20.5	101,065	エヌ・ティ・ティ・データ	3.8	4.7	82,720
PCIホールディングス	4.4	6.6	6,903	TDCソフト	10.2	12.6	13,154	ピー・シー・エー	309	384.2	866,755
パイオードHD	2.4	2.8	7,210	Zホールディングス	1,593.8	2,096.9	1,214,314	ビジネスプレイン田畠和	1.7	8.6	13,261
アイビーシー	1.9	2.6	1,716	トレンドマイクロ	61.9	77.1	472,623	DTS	4	5.1	8,828
ネオジャパン	2.2	4	4,300	IDホールディングス	4.5	9.4	7,980	スカラ・エイクス・ホールディングス	24	27.7	71,743
P R T I M E S	2.4	3.2	8,995	日本オラクル	23.5	23.4	195,624	シーアイシー	49.5	67.1	397,903
ラクス	—	49.6	108,723	アルファシステムズ	3.1	3.3	12,292	カブコン	12.2	15.4	16,755
ランドコンピュータ	1.5	2.5	2,052	フューチャー	14	30.5	44,560	アイ・エス・ピー	49.7	136.1	393,737
ダブルスタンダード	1.5	4.5	11,101	CAC Holdings	7.5	8.6	11,567	ジャステック	5.3	6.8	6,283
オーブンドア	6.9	8.6	14,258	S Bテクノロジー	4.2	6.4	15,507	SCSK	7.3	8.6	8,969
マイネット	3.8	5.1	2,565	トーセ	3.3	4.5	3,253	日本システムウエア	26.8	100	195,600
アカツキ	4.6	6.4	18,835	オービックビジネスコンサルタント	11.9	13.9	60,395	アイネス	3.8	5.4	11,496
ベネフィットジャパン	0.9	1.1	2,327	伊藤園テクノリージョンズ	52.9	65.7	193,552	TCK	11.3	13.2	19,813
Ubicomホールディングス	3	3.9	8,853	アイティフォー	15.1	17.4	13,519	富士ソフト	9.8	24.4	72,614
カナミックネットワーク	10.6	15.4	6,976	東計電算	1.8	1.7	8,117	NSD	12.3	15.4	77,000
ノムラシステムコーポレーション	5.1	7.6	1,938	エックスネット	2.2	2.5	2,407	コナミホールディングス	37.3	46.5	96,487
チエンジ	16.2	26.5	37,683	大塚商会	62.8	78	333,450	翻訳コンピュータホールディングス	42.1	52.4	366,800
シンクロ・フード	6.9	7.5	2,347	サイボウズ	13.5	19.4	27,819	JBCホールディングス	5.3	6.7	19,999
オーフネット	6.1	7.7	11,711	電通国際情報サービス	14.4	20.8	72,696	ミクロ情報サービス	7.8	9.8	14,719
キャビリティ・セット・プランニング	1.5	2.9	2,293	ACCES	10.8	16.4	9,626	ソフトバンクグループ	11.5	12.7	16,344
セグエグレープ	2.9	3.8	2,200	デジタルガレージ	19.1	23.8	88,774	卸売業(5.6%)	920.5	865	4,627,750
エイトレッド	2.2	2.2	4,639	イエムシステムズ	19.2	24	15,696	ホウズイ	0.6	0.6	501
AOI TYO HOLDINGS	12	—	—	ウェザーニューズ	3.4	4.5	35,640	高千穂交易	4.7	5.9	9,410
マクロミル	23.6	29.5	32,509	C J I	7.9	9.8	7,947	オルハーストホールディングス	1.6	1.7	2,502
ビーグリー	2.3	3.4	3,910	ビジネスエンジニアリング	1.2	1.7	5,873	伊藤忠食品	2.4	3	14,835
オロ	3.6	4.6	10,718	日本エンタープライズ	11.6	14.9	2,547	エレマテック	9.4	11.7	12,296
ユーモーローカル	1.8	4.5	6,570	WOWOW	5.7	7	12,173	JALUX	3.3	4.1	10,487
テモナ	2.5	3.3	1,402	スカラ	10.3	12.7	8,509	あらた	9.3	11.6	44,660
ニーズウェル	2.2	3.4	2,077	インテリジェント ウェイブ	6.9	8.7	4,845	トーメンデバイス	1.6	2.4	15,408
マネーフォワード	—	22	109,340	IMAGICA GROUP	10	12.2	7,112	東邦エクソン・デバイス	3.8	4.2	22,638
サンインポスト	2.6	4.6	4,135	ネットワンシステムズ	47.3	55	150,315	フィールズ	10.2	12.6	6,363
電影システムホールディングス	—	6	15,768	システムソフト	25.5	30.8	3,172	双日	641.6	159.9	306,368
ソルクシーズ	4.4	12.2	5,099	アルゴグラフィックス	9	11.4	35,454	アルフレッサ ホールディングス	120.7	160.8	272,877
エフェス	3.6	4	2,664	マーベラス	18.2	22.8	16,507	横浜冷凍	30.8	41.4	35,728
プロトコラレーション	10.4	15.4	19,404	エイベックス	19.9	24.9	33,316	神栄	1.6	2	1,794
ハイマックス	2.9	4	4,788	日本ユニシス	40.3	45.1	141,388	テラ商事	6.5	8.2	8,495
野村総合研究所	211.8	278.9	1,126,756	兼松エクレクトニクス	6.4	8	30,800	アルコニックス	12.3	15.4	20,851
サイバネットシステム	8.2	10.3	6,509	都電電気	4.3	7.5	10,515	神戸物産	80.4	112.5	396,562
CEホールディングス	6.2	7.6	3,655	TBSホールディングス	76.9	87.7	159,877	ハイパー	2	2.3	1,101
日本システム技術	2.1	2.9	6,342	日本テレビホールディングス	96.6	120.4	159,891	アイ・ホールディングス	16.7	20.6	36,647
インターナショナルホールディングス	14.4	16.6	30,892	朝日放送グループホールディングス	12.1	14.9	10,549	ディープイエックス	4	4.8	4,992
東邦システムサイエンス	3	4.1	3,813	テレビ朝日ホールディングス	35.8	34.7	55,832	ダイワオカホールディングス	10.6	70.4	115,596
ソースネクスト	54.7	61.7	9,810	スカパー! SATホールディングス	76.3	122	55,022	マグロ・富士エレクトロニクス	27.7	34.5	93,046
インフォコム	10.6	15.9	30,925	テレ東京ホールディングス	8.5	10.6	21,571	ラクト・ジャパン	5.1	5	9,895
シンプル・ホールディングス	—	16.8	34,809	日本BS放送	4.1	5.3	5,803	グリムス	2.5	6.6	14,031
HEROZ	3.2	4	3,708	ビジョン	14.2	24.6	25,682	パラマーケット・ホールディングス	20.6	25.2	20,286
ラクスル	9.4	15.9	57,876	スマートバリュー	3.1	3.6	1,702	八洲電機	9.2	11	10,527
IPS	2.1	4	7,356	USEN-NEXT HOLDINGS	4.4	13.8	34,817	メディアスホールディングス	6.8	8.5	7,556
F I G	12.6	16	4,528	ワイヤレスゲート	4.8	5.5	1,826	レスター・ホールディングス	12.2	13.8	26,937
システムサポート	3.4	4.3	4,136	コネクシオ	6.7	10.4	14,653	ジューテックホールディングス	2.3	3.6	4,186
イーソル	6.2	8.7	4,732	日本通信	102	119.8	23,840	大光	4.9	6.8	4,583
アルテリア・ネットワークス	12.8	18.3	25,180	クロップス	2.3	2.9	2,549	OCHIホールディングス	3.5	3.6	4,755

銘柄	期首(前期末)	当期	末	銘柄	期首(前期末)	当期	末	銘柄	期首(前期末)	当期	末
株	株	数	評価額	株	株	数	評価額	株	株	数	評価額
TOKAIホールディングス	千株 56.6	千株 70.4	千円 63,219	OUGホールディングス	千株 1.8	千株 2.3	千円 6,175	J Kホールディングス	千株 10.7	千株 11.7	千円 11,629
黒谷	3.3	4	2,548	スター・ゼン	4.3	10.9	22,868	日伝	9.7	12.1	26,111
Cominix	1.7	1.8	1,317	山善	45.5	60.9	60,839	北沢産業	7.3	7.6	1,725
三洋貿易	11.6	14.7	15,199	椿本興業	1.7	2.3	9,487	杉本商事	5.9	6.6	14,242
ピューティガレージ	1.9	2.5	7,800	住友商事	734.9	913.9	1,678,377	因幡電機産業	31.1	38.7	99,962
ワイン・パートナーズ	8.5	10.9	10,823	内田洋行	4.6	6.3	28,948	東テック	3.9	4.6	11,145
ミタチ産業	3	4	3,604	三菱商事	709	1,085.1	4,289,400	ミスミグループ本社	146	181.7	630,499
シガルスホールディングス	20.6	46.5	119,551	第一実業	5.3	6.7	28,542	アルテック	8.8	10.3	3,162
明治電機工業	3.1	4.7	5,757	キヤノンマーケティングジャパン	28.9	35.9	89,821	タキヒヨー	4	4.1	5,781
デカワースホールディングス	5.2	6	3,222	西華産業	6.2	7.9	12,687	蔵王産業	1.9	2.2	4,037
スターハーホールディングス	2.3	3.4	2,590	佐藤商事	10	12.1	14,023	ズスケン	49.3	56.6	200,647
コメダホールディングス	25.4	31.6	67,782	菱洋エレクトロ	8.8	8.6	17,397	ジェコス	8.2	10.8	8,640
ピーバンドットコム	1.5	2.4	1,521	東京産業	11	13.2	9,438	グローセル	12.9	17.1	7,609
アセントテック	2.9	4.9	3,474	ユアサ商事	12	13.8	40,020	小売業(4.2%)			
富士興産	3.5	3.8	3,689	神鋼商事	2.7	3.4	12,750	ローソン	29.5	32.1	154,240
協栄産業	1.5	1.7	2,618	トルク	5.8	6	1,272	サンエー	8.8	11	44,935
フルサ・ミカホールディングス	—	14	30,716	阪和興業	23.2	28.9	95,370	カワチ薬品	8.1	11.3	26,577
ヤマヨリープホールディングス	—	9.8	10,201	正栄食品工業	7.5	9.4	38,352	エービーシー・マート	18.1	22.7	118,040
小野建	10.7	14.3	24,238	カナデン	9.6	12	12,060	ハーフコ・コーポレーション	5.4	6.9	5,319
南陽	2.1	2.3	4,473	菱洋商事	8.4	11.6	20,218	アスクル	10.1	32.7	54,249
佐鳥電機	7.4	9.1	8,399	フルサト工業	6.3	—	—	ゲオホールディングス	15.6	19.4	22,445
エコートレーディング	2.6	2.9	1,722	岩谷産業	27.9	34.8	183,744	アダストリア	16.1	15.5	27,125
伯東	7.1	8.7	19,783	ナイス	4.7	5.1	9,205	ジーフット	7.6	10	3,170
コンドーテック	9.2	11.6	11,982	昭光通商	3.4	—	—	ジー・ヴィ・エス・バイエリア	2	2.3	869
中山福	7.1	7.6	3,108	ニチモワ	1.6	2.4	6,182	くら寿司	6.9	15.1	55,115
ナガイレーベン	15.5	19.3	40,916	極東貿易	3	4.1	10,893	キャンドゥ	5.6	5.3	10,780
三菱食品	12.9	14.2	45,298	アステラホールディングス	15.2	20.3	8,363	アイケイ	2.5	4	1,544
松田産業	8.5	10.7	25,209	三愛石油	28.7	35.6	32,716	パルコ・ホールディングス	10.2	12.6	20,878
第一興商	17.3	27.5	91,850	稻畑産業	27.9	31.8	64,617	エディオン	49.3	66.3	73,924
メガバールホールディングス	116.7	156.2	339,266	G S I クレオス	2.8	6.9	7,741	サーラコ・コーポレーション	23.9	29.6	18,766
S P K	5.2	6	7,668	明和産業	10.8	13.3	14,856	ワッツ	5.2	7.2	4,960
萩原電気ホールディングス	4.4	5.4	10,675	クワガタホールディングス	4.4	4.6	2,865	ハローズ	4.4	6.7	18,900
アズワン	8.3	21.1	129,132	ヤマエクス	8.5	—	—	ファーフードグループ本社	9.8	12.3	16,605
ズズデン	3.5	5.3	10,732	キタ	22.9	31	31,434	あみきや亭	2.5	3.4	9,860
尾家産業	3	3.2	3,184	東邦ホールディングス	37.3	46.5	87,373	ひらまつ	21.9	30.8	5,821
シモジマ	6.5	9	9,117	サンゲツ	31.5	38.4	60,364	大黒天物産	2.7	4.7	22,419
ドウシシャ	11	13.8	20,920	ミクロ・グローバルホールディングス	17.1	21.3	21,917	ハニース・ホールディングス	9.1	11.5	11,879
小津産業	2.3	2.5	4,920	シナシ・ホールディングス	4.3	5.4	17,685	ファーマライズホールディングス	3.3	4	2,860
高速	6.3	8.8	12,944	伊藤忠エヌエス	26	32.1	33,448	アルペン	8.9	11.2	23,990
たけひし	3.5	5.6	8,092	サンリオ	32.6	44.9	105,290	ハブ	3.6	4.8	2,836
リックス	2.2	2.5	3,875	サンワ・テクノス	7.6	8.8	11,915	クオーラ・ホールディングス	15.7	17.8	23,745
丸文	10.6	12.7	9,258	リヨーサン	12.8	16	36,576	ジン・ホールディングス	6.2	9.9	66,528
ハピネット	9.7	12.1	18,452	新光商事	15.9	22	19,162	ピック・カメラ	69	85.7	88,271
橋本精業ホールディングス	2	3	6,027	トーホー	5.4	6.8	7,289	DCMホールディングス	71.9	89.3	98,587
日本ライフライン	37.6	42.9	42,942	三信電気	6.4	6.8	11,131	ペッパードードサービス	13.2	19.7	6,934
タカショード	7.4	11	7,271	東陽テクニカ	12.2	14.3	15,015	Mon o t a R O	82.8	183.1	337,087
マルカ	3.8	—	—	モスフードサービス	16.5	19.1	57,777	東京一番フーズ	2.6	4	2,372
I D O M	39.3	43.9	29,544	加賀電子	10.5	13.1	42,837	D Dホールディングス	5.2	7.7	4,365
進和	7	8.7	17,748	ソーダニッカ	11.3	15.1	13,423	きらりホールディングス	3.4	4.1	1,455
エスケイジャパン	2.7	3.3	1,382	立花レテック	8.7	11.7	18,532	アーフード・サービスホールディングス	9.7	10.8	23,727
ダイトロン	5	6.3	12,814	フォーパル	4.3	6.6	6,177	J . P . フロント・リテイリング	139	172.8	185,932
シーカス	14.8	20.6	27,047	P A L T A C	18.7	20.3	89,624	ドトール・日スホールディングス	18.4	25	40,125
田中商事	3.1	3.3	2,128	三谷産業	15.6	17.1	5,232	マツヨココカラ&カンパニー	48.1	89.1	363,528
オーハシテクニカ	6.2	8.2	11,693	太平洋興発	5.1	5.6	3,662	ブロンコビリー	6.1	8.3	18,467
白鶴	3.6	4.7	12,502	西日本システムホールディングス	2.6	3.4	10,642	Z O Z O	68.7	99.8	306,386
ダイコ一通産	1.1	1.7	2,012	ヤマシタルス・ホールディングス	1.1	1.2	2,354	トレジャー・ファクトリー	3.4	4.3	4,089
伊藤忠商事	814.6	1,012.8	3,766,603	コア商事ホールディングス	3.3	10.9	6,714	物語コーポレーション	3.1	7.2	45,216
丸紅	1,148.1	1,428.3	1,684,679	国際紙パルプ商事	25.5	30	9,450	ココカラフアイ	10.4	—	—
高島	1.6	2.3	5,444	ヤマタネ	5.3	6.9	11,102	三越伊勢丹ホールディングス	203.4	253.3	236,582
長瀬産業	65.5	79.6	144,872	丸紅建材リース	0.9	1.1	1,967	H a m e e	2.9	3.8	4,111
蝶理	7.5	8.2	14,678	日鉄物産	8.3	10.4	55,224	マーケットエクターブライズ	—	1.1	860
豊田通商	116.9	145.3	717,782	泉州電業	3.3	4.1	25,953	ウエルシアホールディングス	61.5	76.6	239,758
三共生興	18	19.6	11,074	ト拉斯コ中山	26.7	30.2	75,349	クリエイトS Dホールディングス	17.1	21.3	66,988
兼松	46.5	53.9	69,800	オートバックスセブン	43.2	48.8	68,954	丸善CHIホールディングス	15.4	18.9	6,898
ツカトヨーパーレーション	1.7	1.8	2,354	オートリット	9	10.9	7,957	ミサワ	2.4	3	1,965
三井物産	945.5	1,124.4	3,333,846	加藤産業	16.9	21	69,090	ティーライフ	1.7	2	2,630
日本パルプ商事	6.1	7.7	30,684	北恵	3.2	4	3,472	エ・ピ・ホールディングス	1.9	2.2	965
カメイ	15.2	17.1	17,698	イノテック	6.6	8.7	12,815	チムニー	3.5	4.6	5,349
東都水産	1.4	0.6	2,361	イエローハット	21.9	25.1	42,017	シュッピン	7.9	12	12,948

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	
株	株	数	評価額	株	株	数	評価額	株	株	数	評価額	
オイシックス・ラ・大地	千株	千株	千円	ピーシーポーラレーション	千株	千株	千円	パローホールディングス	千株	千株	千円	
ネクステージ	11.5	20.8	53,185	壱番屋	13.6	16.9	4,867	パローホールディングス	23.8	32.1	72,225	
ジョイフル本田	19.9	29.3	85,907	トップカルチャー	8.2	10.3	48,049	藤久	2.7	—	—	
鳥貴族ホールディングス	34.2	42.4	64,660	P L A N T	4.8	5.5	1,545	ベルク	5.8	6.4	34,496	
ホットランド	3.3	5.3	9,714	スピホールディングス	3.1	3.6	2,390	大庄	6.3	8	8,256	
すかいらーくホールディングス	8.6	11	14,069	薬王堂ホールディングス	23.2	28.9	194,786	ファーストリテイリング	15.6	19.4	1,242,570	
S F P ホールディングス	130.4	186.9	280,536	ヴィア・ホールディングス	5.1	7.3	17,571	サンドラッグ	43.8	54.5	162,628	
綿半ホールディングス	5.7	7.2	10,188	スワロール	14.2	19.3	2,952	サッカスバ・ホールディングス	10	13.8	7,120	
ヨシックスホールディングス	8.8	11	14,289	ヨンドシホールディングス	16.6	22.3	20,159	ヤマザワ	2.6	2.9	4,738	
コナミホールディングス	2.3	2.9	6,252	木曾路	10.8	13.3	23,368	やまや	2.5	3	7,482	
ゴルフダイジェスト・オンライン	33.9	42.3	45,684	千趣会	15.3	19.3	42,884	ベルーナ	25	31.1	23,418	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6	7.6	8,109	S R S ホールディングス	14.6	20	16,260	銀行業(5.6%)	島根銀行	4.3	4.5	2,533
B E E N O S	5.4	7.5	13,702	千趣会	20.9	26.4	9,794	じもとホールディングス	8	10.8	7,430	
あさひ	8.6	12	17,112	タカキュー	9.9	12.9	1,380	めぐみファンドルグループ	604.6	751.7	208,220	
日本調剤	7.1	8.8	12,883	リテールパートナーズ	14.1	17.6	22,792	東京むらじんファンドルグループ	14.6	18.3	30,707	
コスモス薬品	11.8	14.7	207,270	ケーヨー	21.6	26.9	22,918	九州ファンドルグループ	238	296.3	135,705	
トーアエル	5.7	6.8	5,861	上新電機	13.7	16.6	35,275	ゆうちょ銀行	330.8	342.8	402,447	
オントリー	2.6	—	—	日本瓦斯	19.2	70.4	117,004	富山第一銀行	28.6	35.7	11,424	
セブン・イ・ホールディングス	455.6	566.6	3,282,880	ロイヤルホールディングス	20.3	24.9	46,961	コンルート・ファンドルグループ	709.7	828	416,484	
クリエイト・ストラーナ・ホールディングス	62.5	77.1	58,596	東天紅	0.6	0.6	562	西日本ファンドルホールディングス	77.6	94.6	80,788	
ツルハホールディングス	25.4	31.6	288,192	いなげや	13	18	25,416	鹿児島・ファンドルホールグループ	54.8	—	—	
サンマルクホールディングス	9.1	11.5	18,285	チヨダ	12.2	14	10,668	三十三才ファンドルグループ	10.2	13.7	21,344	
フェリシモ	2.6	3.4	4,372	リヤコーカーポーラーション	8.8	13.5	41,242	第四才才ファンドルグループ	19	23.6	65,584	
トリニティホールディングス	28.8	35.9	83,682	リンガーハット	14.4	17.9	40,650	ひろざんホールディングス	172.2	214.3	150,652	
TOKYO B A S E	10.4	13.2	5,913	M r M a x H D	15.9	18.2	11,156	おさかわ・ファンドルグループ	—	13.1	30,418	
ワイルプラスホールディングス	1.9	2.5	2,425	テンアラアイド	11.7	15.3	4,758	十六才才ファンドルグループ	—	19.5	47,541	
JMホールディングス	8.8	9.8	16,787	AOKIホールディングス	23.1	28	16,856	北國・ファンドルホールディングス	—	13.4	42,880	
サンドラボホールディングス	1.5	7.4	4,684	オーツワフ	18.2	22.8	21,500	新生銀行	95.1	94.6	221,458	
アレンザホールディングス	6.7	11.2	12,208	コメリ	18	22.4	61,219	あおぞら銀行	69.4	81	222,912	
串カツ田中ホールディングス	3	3.9	8,037	青山商事	25.7	29.7	20,582	三義・才才・ファンドル・グループ	7,977.2	9,093.4	6,731,844	
ハッカジ・ジャパン・リテッド	8.1	10.6	9,508	しまむら	13.5	16.8	176,904	りそなホールディングス	1,267.6	1,659.4	901,386	
スクリューオキナホールディングス	11.6	14.4	98,928	はせがわ	5.2	8	2,408	三井住友ラート・ホールディングス	220.5	274.1	1,162,184	
力の源ホールディングス	5.4	7.7	4,319	高島屋	84.7	105.3	117,725	三井住友友・ファンドル・グループ	807.1	1,003.6	4,351,609	
FOOD & LIFE COMPANIES	63.9	84.7	300,685	松屋	25.4	29.1	21,155	千葉銀行	388.8	483.8	381,718	
マイカシス・システムワーク	10.2	14.2	7,668	イチ・ツー・オーリテイリング	55	68.5	56,992	群馬銀行	239.8	277.9	112,271	
一太郎ホールディングス	—	2.7	1,422	近鉄百貨店	4.5	5.5	14,756	武蔵野銀行	17.3	21.6	41,752	
藤久ホールディングス	—	3.5	2,688	丸井グループ	98.5	114.3	259,918	千葉興業銀行	29.8	34.5	10,005	
はるひホールディングス	6.1	6.9	3,519	アスクル・リテイリング	9.7	11.4	37,848	筑波銀行	48.4	56.9	11,778	
ノジマ	20.7	23.4	58,125	井筒屋	6.3	6.9	2,732	七十七銀行	36.6	45.5	73,164	
カッパ・クリエイト	16.4	20.4	27,478	イオン	448.1	557.2	1,481,594	青森銀行	9	11.3	22,249	
ライトオン	8.8	11.2	8,064	イズミ	23.6	26.3	86,395	秋田銀行	7.1	9.4	17,343	
ジーンズメイト	3.6	—	—	平和堂	21.5	26.8	52,474	山形銀行	13	16.3	16,348	
良品計画	154.5	166.7	293,892	フジ	14.1	17.6	32,929	岩手銀行	7.6	9.4	18,593	
三城ホールディングス	14.9	15.7	3,940	ヤオコー	13.2	16.5	109,560	東邦銀行	104.1	121.4	26,950	
アドヴァンブループ	12	14.9	14,125	セビオホールディングス	14	19.7	18,064	東北銀行	5.9	7.5	8,047	
アルビス	3.7	4.8	10,502	ケーズホールディングス	103.7	133.4	165,282	みちのく銀行	7.5	9.5	8,540	
コナカ	14.1	16.9	5,965	Olympicグループ	6	7.9	5,609	みやかわ・ファンドル・グループ	105.1	122	289,018	
ハウスマ・オーデ・ローゼ	1.2	1.2	2,026	日産京阪阪ホールディングス	14.3	22.8	5,198	静岡銀行	283.9	353.2	323,531	
G-7ホールディングス	6.9	16.2	24,526	シルバーライフ	1.6	3	3,264	十六銀行	14.6	—	—	
イオン北海道	15.6	25.7	29,400	一太郎・プロジェクト	1.1	—	—	スルガ銀行	101.6	127	63,627	
コジマ	19.9	24.8	13,392	Genky Drug Stores	5.1	6.4	22,848	八十二銀行	262.3	326	144,418	
ヒマラヤ	4.3	5.1	5,232	ナル・ヤ・インターナショナル	2.3	3.4	3,910	山梨中央銀行	13.6	16	15,472	
コーナン商事	16.6	20.6	72,821	ブタクオーブル・ホールディングス	6.8	8.8	9,160	大垣共立銀行	23	28.8	60,307	
エコス	4.3	5.4	11,334	ギフト	1.1	2.4	5,904	福井銀行	10	12.5	18,587	
ワタミ	15.3	17.6	16,227	アインホールディングス	16.9	19.4	115,818	北國銀行	10.9	—	—	
マルシェ	3	4	1,760	元気寿司	3.2	4.1	10,455	清水銀行	4.9	6.3	10,508	
かんかハイ・カーボ・ヨウカホールディングス	232.8	289.5	480,859	ヤマダホールディングス	390.2	528.8	210,462	富山銀行	1.9	2.2	4,818	
西松屋・チーン	25.5	31.7	47,264	アークランド・サカモト	18.2	22.8	34,884	滋賀銀行	23.3	27.3	62,844	
ゼンヨー・ホールディングス	62.5	70.8	195,903	ニトリホールディングス	46.3	57.6	936,000	南都銀行	17	22.8	46,603	
幸栄苑ホールディングス	7.3	9.2	12,493	グリムズ杵屋	8.4	12	12,144	百五銀行	105.2	140	51,380	
ハーツクレイ	2	6.3	3,024	愛眼	7.6	8.1	1,417	京都銀行	41.7	51.9	295,311	
サイゼリヤ	17.2	21.5	59,340	ケーユーホールディングス	6	7.9	8,121	紀陽銀行	41.3	49.2	74,390	
V T ホールディングス	43.9	54.6	24,897	吉野家ホールディングス	38.2	50.6	121,035	ほくほく・ファンドル・グループ	77.5	90.5	87,061	
魚力	3.5	3.9	7,979	松屋フーズホールディングス	5.6	7	25,375	山陰合同銀行	73.6	86.3	58,597	
ボブラー	3.3	4.6	648	サガミホールディングス	15.7	22.3	24,061	中国銀行	100.4	116	110,316	
フジ・コーポレーション	3.1	7.9	9,345	開西フードマーケット	8.8	11	11,506	鳥取銀行	4	4.2	5,191	
ユナイテッドアローズ	13.2	15.1	27,240	王将フードサービス	7.7	9.5	56,525	伊予銀行	154.6	192.3	120,956	
ハイディ日高	16.8	20.9	35,927	ブレナス	13.2	16.4	33,029	百十四銀行	12.2	15.4	27,273	
YU-WA CREATION HOLDINGS	6.4	8.6	1,720	ミニストップ	8.7	11.2	16,497	四国銀行	16.7	22.3	18,419	
コロワイド	38.6	59.5	100,436	アーカス	22.1	27.7	60,940					

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
阿波銀行	千株	千株	千円	千円	千株	千株	千円	千円	千円	千株	千株	千株	千円	
大分銀行	17.8	22.3	52,895	52,895	5.4	7.5	28,575	28,575	28,575	22.9	26.2	19,807	19,807	
宮崎銀行	6.8	8.6	17,277	17,277	68	92.9	122,999	122,999	122,999	2	2.3	8,878	8,878	
佐賀銀行	7.3	9.1	20,138	20,138	12.2	15.3	118,116	118,116	118,116	96.5	150.2	30,640	30,640	
沖縄銀行	6.7	8.6	13,330	13,330	18	22.6	74,015	74,015	74,015	13.8	19.9	50,426	50,426	
琉球銀行	10.7	—	—	—	27.1	28.1	165,228	165,228	165,228	13.6	17.2	11,438	11,438	
セブン銀行	25.4	31.6	26,923	26,923	49.4	57.1	51,332	51,332	51,332	12.1	15	8,220	8,220	
みずほフィナンシャルグループ	389	430.4	109,321	109,321	195.2	243	83,349	83,349	83,349	5.5	7	4,305	4,305	
高知銀行	1,584.6	1,854.4	3,001,346	3,001,346	9.2	12.8	48,960	48,960	48,960	4.6	5.7	9,707	9,707	
山口フィナンシャルグループ	4.2	4.3	3,388	3,388	10.3	12.8	—	—	—	17.6	23.6	11,634	11,634	
長野銀行	145.4	168.7	124,669	124,669	12.8	16.1	50,634	50,634	50,634	21.1	27.3	20,857	20,857	
名古屋銀行	3.9	4.9	6,443	6,443	315.1	391.5	48,154	48,154	48,154	48.6	61	19,398	19,398	
北洋銀行	9.4	10.9	34,989	34,989	27.5	—	—	—	—	6.6	7.7	6,545	6,545	
愛知銀行	176	218.8	58,200	58,200	723.4	880.3	2,175,661	2,175,661	2,175,661	58.4	72.7	121,336	121,336	
中京銀行	3.9	5.3	25,758	25,758	262.4	535.7	333,741	333,741	333,741	3.5	5.4	3,704	3,704	
大光銀行	4.3	5.3	9,227	9,227	6.5	7.9	4,771	4,771	4,771	5	5.6	6,552	6,552	
愛媛銀行	3.5	3.6	5,633	5,633	315	367.1	877,736	877,736	877,736	624.6	787.3	7,873	7,873	
トマト銀行	16.5	20.5	19,987	19,987	13.3	21.2	40,788	40,788	40,788	28.9	35.9	120,624	120,624	
京葉銀行	4.5	5.7	6,218	6,218	6.5	8	10,056	10,056	10,056	16.1	20	20,820	20,820	
栃木銀行	49.7	62.5	32,625	32,625	1.3	3.5	14,315	14,315	14,315	2.7	3.4	6,616	6,616	
北日本銀行	56.1	70.5	16,779	16,779	22.5	30	4,200	4,200	4,200	14.1	20	20,840	20,840	
東和銀行	3.7	4.7	8,347	8,347	247.2	346.1	374,134	374,134	374,134	11.6	14.6	14,483	14,483	
福島銀行	20.5	25.9	14,892	14,892	4.7	5.9	9,569	9,569	9,569	4.4	5.5	2,163	2,163	
大東銀行	13.2	16.8	4,233	4,233	115.5	158	21,488	21,488	21,488	1.1	1.2	1,452	1,452	
トモニホールディングス	5.9	7.4	5,624	5,624	6.1	8	—	—	—	3.8	5	5,290	5,290	
フィデアホールディングス	90.1	112.3	38,968	38,968	16.5	23.4	49,865	49,865	49,865	8.1	10.3	5,222	5,222	
池田東京ホールディングス	133.5	165.8	32,828	32,828	16.4	18.9	10,054	10,054	10,054	日本空港ビルディング	37.2	55.3	290,878	
<b>証券・商品取扱業 (0.8%)</b>					3.5	4.6	2,686	2,686	2,686	明豊ファシリティワークス	5.3	6.6	4,831	
F P G	35.8	48.8	43,724	43,724	7.3	9.1	1,583	1,583	1,583	日本工営	7.1	8.3	25,024	
ジャパンペイメントアドバイザ	5.9	11.3	13,164	13,164	1.2	1.2	1,455	1,455	1,455	L I F U L L	39.4	43	9,933	
マキヨウアイペイメント	4.8	—	—	—	6.2	7	6,818	6,818	6,818	ミクシィ	21.6	32.1	75,691	
マキヨウアホールディングス	—	5.1	2,789	2,789	3.5	4.6	3,716	3,716	3,716	ジェイエシーリーグルメント	7.5	11.5	23,230	
S B I ホールディングス	143	178.9	543,856	543,856	1.3	—	—	—	—	日本&セカンドホールディングス	92.6	230.5	398,073	
日本アジア投資	10.1	11.5	2,058	2,058	7.3	9.2	16,127	16,127	16,127	メンバーズ	3.3	4.2	11,806	
ジャフコ グループ	17.9	55.7	96,639	96,639	19.1	18.9	38,631	38,631	38,631	中広	1.2	1.2	4,622	
大和証券グループ本社	873.3	1,086	777,684	777,684	7.3	9.1	1,583	1,583	1,583	U T グループ	16.3	20.3	71,354	
野村ホールディングス	1,780.3	2,214.1	1,198,935	1,198,935	1.2	1.2	1,455	1,455	1,455	アイティメディア	3.7	6.7	10,994	
岡三証券グループ	99.2	113.8	44,268	44,268	6.2	7	6,818	6,818	6,818	タケエイ	12.5	—	—	
丸三証券	34.6	42.9	23,423	23,423	3.5	4.6	3,716	3,716	3,716	E・J ホールディングス	4.4	7.5	8,595	
東洋証券	38.2	46.8	7,394	7,394	1.3	1.4	830	830	830	夢裏ビニックスグループ	14.1	45.7	76,227	
東京証券	123.8	165.7	69,428	69,428	19	18.8	12,859	12,859	12,859	コシダカホールディングス	26.8	37.5	24,112	
光世証券	3	2.9	1,383	1,383	36.7	46.1	261,848	261,848	261,848	アルトナー	2.8	3.6	3,200	
水戸証券	31.2	38.7	10,874	10,874	316.7	426.9	277,485	277,485	277,485	パソナグループ	12.2	15.3	38,295	
いちごん証券	23.2	27.3	18,591	18,591	97.2	121	296,934	296,934	296,934	C D S	2.4	2.5	3,945	
松井証券	57.1	71.2	58,170	58,170	2.3	2.5	3,465	3,465	3,465	リンクアンドモチベーション	20.7	31	14,570	
マネックスグループ	104.4	118	62,658	62,658	7.3	9.4	4,587	4,587	4,587	G C A	14.6	—	—	
極東証券	15.7	19.5	14,917	14,917	5.4	9.9	4,732	4,732	4,732	エス・エム・エス	38.4	47.8	152,482	
岩井コスモホールディングス	11.9	13.7	19,289	19,289	2.2	3.5	2,845	2,845	2,845	サニーサイドアップグループ	4	5.1	3,717	
アイザワ証券グループ	21.1	24	22,056	22,056	5.6	7.2	6,148	6,148	6,148	パーソルホールディングス	113	140.5	417,285	
マネーパーナーズグループ	12.8	15.4	3,341	3,341	3	4	6,848	6,848	6,848	リニカル	6.5	8.1	5,532	
スパークス・グループ	53.8	66.7	17,342	17,342	1.9	1.7	2,703	2,703	2,703	クックパッド	35.6	44.1	11,554	
小林洋行	3	3.2	678	678	3.6	6.6	45,870	45,870	45,870	エスクリ	3.6	6.2	2,132	
<b>保険業 (2.3%)</b>					2.1	2.5	3,005	3,005	3,005	アイ・ケイ・ケイホールディングス	5.6	6.7	3,912	
かんぽ生命保険	144.5	145.9	315,435	315,435	5.5	6.4	7,046	7,046	7,046	学情	3.9	5.6	5,516	
S O M P ホールディングス	205.6	238.1	1,338,122	1,338,122	2.2	3	8,841	8,841	8,841	スタジオアリス	5.7	6.4	13,785	
アニコム ホールディングス	32.8	44.4	34,010	34,010	3.3	4.1	3,513	3,513	3,513	シミックホールディングス	5.6	8	12,528	
M S A D ブラックスブルーフォード	283.3	325.2	1,349,580	1,349,580	2	2.7	2,281	2,281	2,281	エブコ	2.8	3.3	2,336	
第一生命ホールディングス	616	713.7	1,973,737	1,973,737	—	1.4	1,789	1,789	1,789	N J S	2.8	2.9	5,713	
東京海上ホールディングス	386.6	477.6	3,384,751	3,384,751	62.5	77.8	134,905	134,905	134,905	綜合警備保障	45	55.9	228,072	
T & D ホールディングス	348.4	376.3	687,123	687,123	3.1	4	6,484	6,484	6,484	カカクコム	83.5	103.1	259,812	
アドバンスクリエイト	2.4	7	7,161	7,161	4.4	5.5	5,214	5,214	5,214	アイロムグループ	4	5	9,995	
<b>その他金融業 (1.2%)</b>					531.4	660.9	1,646,962	1,646,962	1,646,962	セントケア・ホールディング	8.3	9.1	7,034	
全国保証	30.3	34.7	176,623	176,623	766	952.8	1,609,279	1,609,279	1,609,279	サイネット	2.2	2.5	1,517	
あんしん保証	—	4.9	1,396	1,396	20	24.9	100,098	100,098	100,098	ルネサンス	7	9.8	10,495	
ジェイリース	3.8	4.9	7,967	7,967	114.9	143.1	247,133	247,133	247,133	ディップ	17.6	24.7	82,374	
イントラスト	3.3	6.3	3,893	3,893	30.1	—	—	—	—	デジタルホールディングス	7.8	9.6	12,758	
日本モーゲージサービス	5.9	8.2	8,724	8,724	20.1	22.6	31,504	31,504	31,504	新日本科学	13.7	17.1	28,659	
C A S A	3.2	5.1	4,309	4,309	262.1	304.3	1,082,699	1,082,699	1,082,699	ソワフホールディングス	26.7	—	—	
アルヒ	17.1	21.3	23,004	23,004										

銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末	銘柄	期首(前期末)	当期	期末
株	数	株	数	銘柄	株	数	株	銘柄	株	数	株
キャリアデザインセンター	千株	千株	千円	リソルホールディングス	千株	千株	千円	プロレド・パートナーズ	千株	千株	千円
ベネフィット・ワン	2.5	3.6	4,194	テクノプロ・ホールディングス	0.9	1.6	7,000	and factory	1.6	3	2,436
エムスリー	41.2	51.2	153,548	アトラルグループ	22.5	84.1	295,191	テノ・ホールディングス	1	3.3	1,214
ソラーホールディングス	199.3	247.9	1,042,667	インターワークス	2.5	2.6	676	フロティア・マネジメント	0.9	2	1,206
プラス	9.5	8.5	2,380	アイ・アールジャパンホールディングス	3.5	4.5	1,687	ピアラ	2	3.6	2,350
アウトソーシング	1.5	2.2	1,392	kee Pe r 技研	4.6	6.6	32,505	コプロ・ホールディングス	0.6	2.3	1,258
ウェルネット	64.7	80.5	108,514	ファーストロジック	7.3	9	16,929	ギーフクス	0.6	2.9	3,204
ワールドホールディングス	11.5	14.3	6,263	三機サービス	2.2	2.9	2,166	カーブスホールディングス	1.5	2.6	3,803
ディーエヌ・エー	3.9	5.6	13,484	Gunos y	2.3	3	2,907	LITALICO	31	38.7	27,244
情報館DYホールディングス	47.8	53.6	95,783	ペトトル	6.8	8.8	6,274	フォーラムエンジニアリング	5.8	9.9	8,613
ぐるなび	157.2	195.6	350,124	デザインパート・ジャパン	3.5	3.6	673	FAST FITNESS JAPAN	—	2	4,224
タカミヤ	19.6	22.9	8,724	イー・ガーディアン	4.9	5.6	14,795	ダイワマーケティング	4.4	15.2	21,964
ジャパンストレキューシステム	14.1	17.6	7,128	リブセントス	6.2	8.7	1,400	ボビンズホールディングス	2.3	3.4	8,493
ファンコミュニケーションズ	8.9	9.4	8,610	ジャパンマテリアル	34.8	43.2	71,625	LITALICO	—	11.5	35,190
ライフ	31.3	35.1	13,267	ウチヤマホールディングス	14	19.7	20,448	アドバンシスマネジメント	5.7	7.2	5,184
ビジネス・ブレーフスル	5.1	5.5	6,805	チャーム・ケア・コーポレーション	5.8	7.4	2,412	リロブレーブ	61.7	76.9	158,337
エスプール	28.9	39.7	39,342	キヤリアーリング	8.4	10.6	12,084	東洋	7.1	10.6	16,472
WDBホールディングス	5.2	6.6	18,513	IBJ	9.1	11.5	8,728	TREホールディングス	—	19.4	28,731
手間いらず	1.1	1.8	8,496	ASAンテ	4.1	6.4	10,419	人・夢・技術グループ	—	5.6	10,102
ティア	7.2	8.7	3,801	N・フィールド	7.6	—	—	エイチ・アイ・エス	16.4	31.3	64,165
CDG	1.3	1.4	1,912	バリューハー	4.5	5.6	13,904	ラックランド	3.2	4.1	11,836
アドウェイズ	13.7	20.9	15,863	M&キヤウドホールディングス	9.3	11.6	55,042	共立メンテナンス	18.7	25	103,875
バリューコマース	7.5	11.2	39,032	ラヂオ・エフエム・ジャパン	4.3	5.4	8,262	イチネンホールディングス	11.8	14.6	18,804
インフォマート	114.3	153.9	97,880	ERIホールディングス	2.8	4	4,660	建設技術研究所	7.3	8.5	20,102
J Pホールディングス	32.6	35.7	8,246	アピスト	1.8	2.2	6,435	スペース	7.7	10.4	9,505
エコナックホールディングス	20.7	26	2,288	シグマクシ・ホールディングス	6.2	8.6	19,049	長大	4.5	—	—
EPSホールディングス	15.3	—	—	ウイルブレーブ	8.2	10.4	13,176	燐ホールディングス	4.7	6.3	9,714
CLホールディングス	2.7	3	3,594	エスロード・エコシステム・ジャパン	16.6	18.9	3,553	スバル興業	0.7	0.7	5,537
プレステージ・インターナショナル	42.2	52.4	37,832	メドピア	5.3	10.9	30,498	東京テアトル	4.6	5.4	6,615
アミューズ	6.2	7.7	16,216	レジショブ	1.6	2.8	2,282	タナベ経営	2.2	4.8	3,028
ドリームインキュベータ	3.5	3.9	8,088	リクリートホールディングス	809.3	1,083.7	6,140,244	ナガワ	3.6	4.6	43,608
クイック	7	9.6	15,801	エラン	15.6	19.4	19,826	よみうりランド	0.6	—	—
TAC	6.3	8.6	1,952	土木管理総合試験所	5.7	6.9	2,187	東京都競馬	7.3	10.7	46,224
ケネディックス	32.3	—	—	ネットマーケティング	5.4	6.9	3,029	常磐興産	4.7	5.4	7,317
電通グループ	127	144.8	605,988	日本郵政	855.3	1,834.3	1,880,157	カナモト	19.9	24.8	57,015
テイクアンドギ・ニーズ	5.2	6.7	6,880	ペリシステム24ホールディングス	18.9	20.1	28,642	東京ドーム	44.5	—	—
びあ	3.2	4.9	16,415	鎌倉新書	11.4	16	8,400	西尾レントオール	10.4	12.9	36,894
イオンファンタジ	4.3	5.4	11,718	SMN	2.4	3.4	2,046	アゴラ あおぞらイ・グループ	71.2	75.2	1,654
シーティーエス	12.6	16	12,976	一蔵	1.7	2.3	899	トランク・コスモス	10.8	17.9	57,101
ネクシィーズグループ	3.5	5	3,445	LITALICO	4.6	—	—	乃村工藝社	48.3	60.2	57,671
H.U.グローブホールディングス	31.7	36.7	108,411	クローバーキッズCOMPANY	2.1	2.7	2,130	藤田観光	4.4	6.2	15,196
アルプス技研	10	12.6	23,347	エアトリ	6.1	9	27,270	KNT-CTホールディングス	6	8.7	12,754
サニックス	17.7	24.4	4,733	アトラエ	3.4	9.8	20,482	日本銀行	12.2	15.1	42,083
ダイオーズ	2.2	3.5	3,475	ストライク	4.2	5.3	21,995	トーカイ	11	12.5	22,887
日本空調サービス	12.2	15	11,730	ソラスト	27.7	34.5	36,570	白洋舎	1	1.7	2,050
オリエンタルランド	120.1	166.1	3,474,812	セラフ	3.5	4.6	5,602	セコム	111.3	138.5	1,147,749
タスキ	26.2	32.6	89,650	インソース	9.4	13.7	26,112	セントラル警備保障	5.4	6.8	16,109
明光ネットワーク・ジャパン	14.2	16.5	9,322	バーカント・コンサルティング	7.4	9.9	402,435	丹青社	21.1	28.7	20,635
ファルコホールディングス	5.4	6.8	14,048	Orchestra Holdings	2.5	2.8	7,834	メイティック	13.8	17	113,900
秀英予備校	2.8	3.6	1,519	アイモバイル	4	4	4,660	応用地質	13.2	16	34,160
田谷	1.7	1.8	991	キャリアインデックス	4.6	4.8	3,609	船井総研ホールディングス	23.1	28.8	66,643
ラウンドワン	38.5	39.2	57,310	MS-Japan	4.5	5.7	5,061	進学会ホールディングス	4.9	5.1	1,672
リゾートトラスト	51.7	64.4	123,390	船場	1.6	1.7	1,269	オオバ	7.9	10.2	7,405
ビー・エム・エル	14.6	18.2	66,339	グレイステクノロジー	5.7	—	—	いいであ	2.7	3.9	6,953
ワタバウェーディング	1.7	—	—	ジ・エス・エス・エス	32.5	44.5	71,422	学究社	3.4	4.7	7,219
りらいあコミュニケーションズ	17.1	21.3	21,917	フルテック	1.8	2.2	2,893	ベネッセホールディングス	41.4	46.8	106,516
リゾー教育	57.3	64.3	26,105	グリーンズ	4.2	5.3	2,501	イオンディライト	13.9	17.3	52,332
早稲田アカデミー	4.4	8	8,104	ツーブループ・ホールディングス	1.7	3.4	1,030	ナック	5.6	7.4	7,266
ユー・エス・エス	126.4	157.3	299,656	GAMEWIRTH	3.5	4.3	1,917	ダイセキ	18.9	26	127,270
東京個別指導学院	9.9	12.3	7,699	ソウルドアウト	2.7	3.5	3,174	ステップ	4.3	5.3	9,481
サイバーエージェント	69.6	346.2	508,221	MS&Consulting	1.9	2.4	1,576	千株	千株	千株	千円
楽天グループ	526.6	721.4	705,529	ウェルビー	—	9.1	11,129	合計	株数	金額	合計
クリーク・アンド・リバーソ	5.8	7.5	13,087	エル・ティー・エス	0.8	1.8	4,152	銘柄数	1,178	161,644	387,140,847
モーニングスター	12.4	24.7	14,424	ミダッソ・ホールディングス	2.4	6.2	15,710	比率	2,183銘柄	1,174銘柄	<97.4%>
テー・オ・ダ・ブリュ	19.8	24.8	7,489	日経工業	8.7	11	8,558				
山田コンサルティンググループ	6.6	7.5	8,565	キューピーネットホールディングス	5.2	6.6	11,180				
セントラルスポーツ	4.2	5.2	12,844	R P Aホールディングス	12.8	19.7	7,052				
フィルキャストホールディングス	9.8	12	26,460	スプリックス	3.2	4	5,788				
エン・ジャパン	20.1	22.9	66,341	マネジメントソリューションズ	5.5	6.9	22,770				

(注1) 銘柄欄の( )内は、期末の国内株式評価総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			
国内 T O P I X	百万円 10,035	百万円 -			

■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 387,140,847	% 96.9
コール・ローン等、その他	12,580,070	3.1
投資信託財産総額	399,720,917	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

(2022年2月7日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	一 ル ド ロ ー ナ ン プ (評価額)	399,670,143,174円
株	式	11,420,891,042
未	金	387,140,847,090
差	金	11,243,540
負	債	655,237,202
未	金	441,924,300
負	金	2,333,527,720
未	金	909,720
純	金	2,332,618,000
元	金	397,336,615,454
次	金	124,570,625,521
受	金	272,765,989,933
1	金	124,570,625,521
万	数	31,896円
口		
当		
た		
り		
基		
準		
価		
(C) 資	資 産 総 額(A - B)	397,336,615,454
産		124,570,625,521
(D)	期 繰 越 損 益 □	272,765,989,933
受	益	124,570,625,521
1	益	31,896円
万	益	
口		
当		
た		
り		
基		
準		
価		
(D)	額(C / D)	31,896円

(注1) 期首元本額  
追加設定元本額  
一部解約元本額

(注2) 期末における元本の内訳

MHAMスリュエイオープ  
MHAM TOPIXオープン  
MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ)  
One DC 国内株式インデックスファンド  
D IAM 国内株式バッジ・ファンド  
MITO ラップ型ファンド (安定型)  
MITO ラップ型ファンド (中立型)  
MITO ラップ型ファンド (積極型)  
グローバル 8 資産ラップファンド (安定型)  
グローバル 8 資産ラップファンド (中立型)  
グローバル 8 資産ラップファンド (積極型)  
たわらノーロード TOPIX  
たわらノーロード バランス (8資産均等型)  
たわらノーロード バランス (堅実型)  
たわらノーロード バランス (標準型)  
たわらノーロード バランス (積極型)  
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)  
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)  
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)  
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)  
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)  
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)  
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)  
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)  
D IAM 国内株式インデックスファンド<DC年金>  
Oneグローバルバランス  
D IAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型  
D IAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型  
D IAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型  
D IAM DC バランス30インデックスファンド  
D IAM DC バランス50インデックスファンド  
D IAM DC バランス70インデックスファンド  
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)  
マネックス資産設計ファンド (育成型)  
マネックス資産設計ファンド エボリューション  
D IAM DC 6 資産バランスファンド (新興国10)  
D IAM DC 8 資産バランスファンド (新興国20)  
D IAM DC 8 資産バランスファンド (新興国30)  
投資のソムリエ  
クルーズコントロール  
投資のソムリエ<DC年金>  
D IAM 8 資産バランスファンドN<DC年金>  
4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>  
D IAMコア資産設計ファンド (堅実型)  
D IAMコア資産設計ファンド (積極型)  
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型  
リスク抑制世界8資産バランスファンド  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)  
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)  
4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>  
リスクコントロール世界資産分散ファンド  
9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)  
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)

42,977,458円  
17,916,384円  
15,092,602円  
105,875,155円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)

985,477円

イカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家認定)

22,944,960円

イカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家認定)

23,431,080円

マルチアセット・イカム戦略ファンド20-06 (適格機関投資家認定)

21,508,092円

イカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家認定)

14,273,870円

イカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家認定)

22,637,856円

イカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 (適格機関投資家認定)

193,585,816円

マルチアセット・イカム戦略ファンド (シグナル・ラップ) 21-05

41,677,610円

マルチアセット・イカム戦略ファンド (内訳株券型) 21-06

84,110,969円

マルチアセット・イカム戦略ファンド (シグナル・ラップ) 21-07

68,984,011円

マルチアセット・イカム戦略ファンド (シグナル・ラップ) 21-08

47,924,787円

イカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家認定)

22,733,018円

マルチアセット・イカム戦略ファンド (シグナル・ラップ) 21-09

49,987,822円

マルチアセット・イカム戦略ファンド (シグナル・ラップ) 21-12

70,694,127円

投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家認定)

329,597,803円

AMアーノードバランス25VA (適格機関投資家認定)

34,825,039円

日本興業配当路線ファンド (内訳株券型) (角括弧省略)

116,640,502円

イカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家認定)

39,121,859円

リスクコントロール8資産 (ラップファンド) (FOF5用) (適格機関投資家専用)

7,907,522円

D IAMグローバル バランスファンド25VA (適格機関投資家認定)

57,045,218円

D IAMグローバル バランスファンド50VA (適格機関投資家認定)

101,888,672円

D IAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家認定)

4,956,036円

D IAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家認定)

26,722,846円

D IAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家認定)

5,712,676円

D IAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家認定)

1,338,373円

D IAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家認定)

7,152,634円

D IAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家認定)

34,835,196円

D IAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家認定)

557,427,217円

D IAMバランスファンド50VA (適格機関投資家認定)

634,827,723円

D IAMバランスファンド50VA (適格機関投資家認定)

1,809,585,772円

D IAMアーノード・アセット・バランスVA (適格機関投資家認定)

31,302,882円

D IAMグローバル・アセット・バランスVA (2) (適格機関投資家認定)

31,388,733円

D IAMアーノード・アセット・バランスVA (30VA) (適格機関投資家認定)

301,727,428円

D IAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家専向)

74,733,048円

D IAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家認定)

1,406,645円

D IAMアーノード・アセット・バランスファンドVA (適格機関投資家認定)

349,638,985円

D IAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家認定)

20,826,049円

D IAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家認定)

73,311,471円

D IAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家認定)

173,199,524円

D IAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家認定)

237,769,545円

D IAM世界バランス25VA (適格機関投資家認定)

38,321,734円

D IAM国内バランス30VA (適格機関投資家認定)

18,177,991円

D IAM世界アセットバランスファンド7VA (12) (適格機関投資家認定)

291,737,796円

D IAM世界アセットバランスファンド7VA (13) (適格機関投資家認定)

936,557,239円

D IAM世界アセットバランスファンド7VA (130) (適格機関投資家認定)

1,240,495,959円

D IAM世界アセットバランスファンド7VA (1306) (適格機関投資家認定)

49,936,951円

D IAM世界アセットバランスファンド7VA (1309) (適格機関投資家認定)

19,960,341円

動的バッケージファンド<DC年金>

13,478,680円

コア資産形成ファンド

692,612,483円

MHAMトピックスファンド

65,067,902円

MHAMトピックスファンド (適格機関投資家認定)

2,686,127,829円

MHAM日本株式バッジ・ファンド (適格機関投資家認定)

2,050,559,819円

期末元本合計

124,570,625,521円

担保資産

代用として担保を提供している資産はありません。

## ■損益の状況

当期　自2021年2月9日　至2022年2月7日

項	目	当期			
(A) 配 受 受 そ 支	当 取 取 の 払	等 配 利 他 利	収 当 息 益 金	益 金 息 金 息	7,296,744,510円 7,292,821,896 44,549 6,677,036 △2,798,971
(B) 有 売 売	価 証 券	売 買	買 買	買 賣	△7,496,155,473 39,449,298,775 △46,945,454,248
(C) 先 取 取	物 取 引	取 引 引	引 引	引 益	654,522,360 1,686,367,190 △1,031,844,830
(D) 当 (E) 前 (F) 解 (G) 追 (H) 合	期	損 益	益	金(A + B + C)	455,111,397
	期	損 益	益	金	216,481,029,551
	約	差 損	益	金	△309,165,756,529
	加	信 託	差 損	益	364,995,605,514
	次	計(D + E + F + G)		金(H)	272,765,989,933
	期	繰 越	損 益	金	272,765,989,933

(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算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。

# 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第15期 (決算日 2022年6月22日)

(計算期間 2021年6月23日～2022年6月22日)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2008年1月16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、為替ヘッジあり）」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	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジあり) (ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰落率	期騰落率			
11期 (2018年6月22日)	円 13,246	% △1.7	ポイント 381.67	% △1.6	% 98.0	% 290,732 百万円
12期 (2019年6月24日)	13,888	4.8	400.89	5.0	96.9	454,858
13期 (2020年6月22日)	14,658	5.5	424.77	6.0	100.6	337,333
14期 (2021年6月22日)	14,333	△2.2	415.85	△2.1	97.9	573,974
15期 (2022年6月22日)	12,469	△13.0	361.76	△13.0	104.3	375,850

(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、為替ヘッジあり）です（以下同じ）。

(注3) FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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おりません。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の一切の権利は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）。

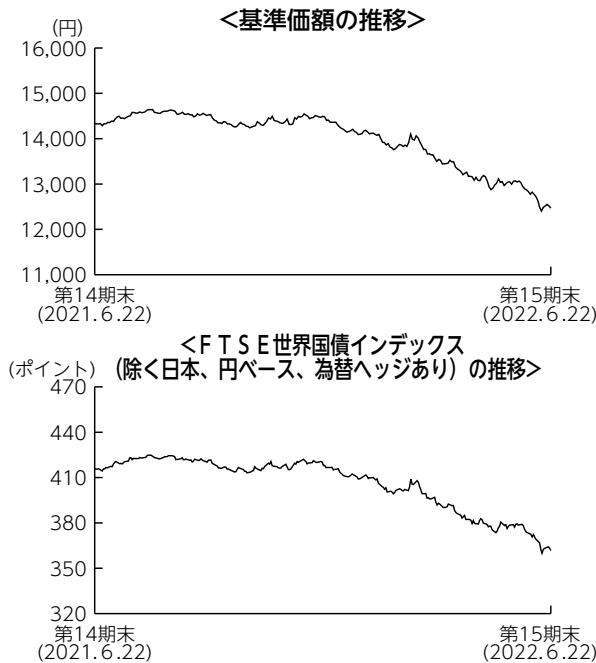
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	F T S E 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス	騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
			(除く日本、 円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)			
(期 首) 2021 年 6 月 22 日	円 14,333	% —	ポイント 415.85	% —	% 97.9	% —
6 月 末	14,329	△0.0	415.77	△0.0	97.6	—
7 月 末	14,578	1.7	423.02	1.7	97.4	—
8 月 末	14,582	1.7	423.13	1.8	98.5	—
9 月 末	14,352	0.1	416.47	0.2	90.9	—
10 月 末	14,346	0.1	416.21	0.1	100.5	—
11 月 末	14,435	0.7	418.85	0.7	96.7	—
12 月 末	14,304	△0.2	415.09	△0.2	100.4	—
2022 年 1 月 末	14,123	△1.5	409.98	△1.4	97.7	—
2 月 末	13,830	△3.5	401.33	△3.5	98.1	—
3 月 末	13,459	△6.1	390.67	△6.1	102.4	—
4 月 末	13,160	△8.2	382.14	△8.1	134.0	—
5 月 末	13,032	△9.1	378.13	△9.1	98.7	—
(期 末) 2022 年 6 月 22 日	12,469	△13.0	361.76	△13.0	104.3	—

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、賃建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2021年6月23日から2022年6月22日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は12,469円となり、前期末比で13.0%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

記録的なインフレに収束の兆しが見えない中、F R B (米連邦準備理事会)が2022年6月に通常の3倍となる0.75%の利上げを実施したことなどを背景に米国債やドイツ国債の利回りが上昇（価格は下落）したことが基準価額の下落要因となりました。

### 投資環境

外国債券市場では、米国債やドイツ国債の利回りは上昇する展開となりました。米国債は、F R B 高官からインフレを抑制するため利上げペースを早める旨の発言が相次いだことの他、ロシアによるウクライナへの侵攻を受けて利回りは上昇しました。ドイツ国債についてもE C B (欧州中央銀行)の利上げ観測や、ユーロ圏インフレ率の加速などを受けて利回りは上昇しました。

### ポートフォリオについて

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、為替ヘッジあり）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。

### 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13.0%下落しました。  
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で0.0%と、ほぼ同程度の運用成果となりました。

### 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) (その他)	2円 (2) (0)	0.016% (0.014) (0.002)	(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
合計	2	0.016	
期中の平均基準価額は13,992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 (2021年6月23日から2022年6月22日まで)

### 公社債

		買付額	売付額
外 国	アメリカ	千アメリカ・ドル 4,914,654	千アメリカ・ドル 5,494,081 (-)
	カナダ	千カナダ・ドル 251,989	千カナダ・ドル 291,768 (-)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 229,921	千オーストラリア・ドル 296,314 (-)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 57,753	千シンガポール・ドル 65,595 (-)
	イギリス	千イギリス・ポンド 441,626	千イギリス・ポンド 526,508 (-)
	イスラエル	千イスラエル・シュケル 128,140	千イスラエル・シュケル 156,134 (-)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 292,058	千デンマーク・クローネ 343,759 (-)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 224,531	千ノルウェー・クローネ 263,883 (-)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 254,669	千スウェーデン・クローネ 311,356 (-)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 1,475,444	千メキシコ・ペソ 1,754,228 (-)

			買付額	売付額
外	中 国	国債証券	千オフショア・人民元 812,249	千オフショア・人民元 410,496 (-)
	マ レ ー シ ア	国債証券	千マレーシア・リンギット 193,451	千マレーシア・リンギット 224,237 (-)
	ポ ー ラ ン ド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 196,938	千ポーランド・ズロチ 242,904 (-)
ユ イ 国 ロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 64,945	千ユーロ 77,716 (-)
	オ ラ ン ダ	国債証券	166,662	191,731 (-)
	ベ ル ギ 一	国債証券	195,612	227,273 (-)
	フ ラ ン ス	国債証券	899,229	1,038,475 (-)
	ド イ ツ	国債証券	675,576	785,447 (-)
	ス ペ イ ン	国債証券	535,122	613,902 (-)
	イ タ リ ア	国債証券	803,076	935,537 (-)
	フィンランド	国債証券	51,778	60,641 (-)
	オ ー ス ト リ ア	国債証券	125,003	143,931 (-)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■利害関係人との取引状況等（2021年6月23日から2022年6月22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BB格以下組入比率	残存期間別組入比率			
	外貨建金額	邦貨換算金額	千円			%	%	%	
アメリカ	千アメリカ・ドル 1,610,280	千アメリカ・ドル 1,464,100	199,835,047	53.2	—	23.2	19.5	10.4	
カナダ	千カナダ・ドル 84,590	千カナダ・ドル 75,656	7,974,905	2.1	—	1.0	0.6	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 69,660	千オーストラリア・ドル 62,081	5,879,760	1.6	—	1.1	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 18,370	千シンガポール・ドル 17,637	1,735,324	0.5	—	0.3	0.2	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 120,060	千イギリス・ポンド 116,205	19,420,263	5.2	—	3.9	0.7	0.6	
イスラエル	千イスラエル・シェケル 40,350	千イスラエル・シェケル 39,620	1,565,167	0.4	—	0.2	0.2	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 78,970	千デンマーク・クローネ 77,252	1,490,202	0.4	—	0.3	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 63,300	千ノルウェー・クローネ 58,971	814,395	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 81,210	千スウェーデン・クローナ 79,682	1,070,927	0.3	—	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 481,838	千メキシコ・ペソ 445,355	3,012,696	0.8	—	0.4	0.4	—	
中国	千オフショア・人民元 399,450	千オフショア・人民元 402,732	8,203,301	2.2	—	1.0	1.0	0.2	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 66,970	千マレーシア・リンギット 65,034	2,017,579	0.5	—	0.4	0.2	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 67,350	千ポーランド・ズロチ 53,359	1,651,407	0.4	—	0.2	0.2	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	19,810	18,137	2,602,024	0.7	—	0.5	0.2	0.0	
オランダ	48,210	46,466	6,666,083	1.8	—	1.1	0.5	0.2	
ベルギー	56,600	54,720	7,850,197	2.1	—	1.6	0.5	0.0	
フランス	246,200	238,979	34,284,051	9.1	—	5.6	2.7	0.9	
ドイツ	183,330	179,638	25,770,977	6.9	—	4.1	1.8	1.0	
スペイン	149,420	143,687	20,613,341	5.5	—	3.4	1.5	0.5	
イタリア	235,800	225,079	32,289,916	8.6	—	4.9	2.5	1.2	
フィンランド	15,780	14,438	2,071,402	0.6	—	0.3	0.1	0.1	
オーストリア	37,160	35,232	5,054,427	1.3	—	0.8	0.5	0.1	
合計	—	—	391,873,402	104.3	—	54.2	33.9	16.1	

(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	当 期		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)						
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	% 千アメリカ・ドル	1,280	1,246	170,141 2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000		6,000	5,879	802,433 2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500		6,160	6,073	829,020 2024/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000		10,000	9,900	1,351,357 2024/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24	国債証券	0.1250		10,000	9,542	1,302,519 2024/01/15
US T N/B 0.875 01/31/24	国債証券	0.8750		6,000	5,785	789,701 2024/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000		13,290	12,216	1,667,418 2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500		10,000	9,035	1,233,208 2029/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500		10,270	8,875	1,211,420 2028/01/31
US T N/B 1.125 01/15/25	国債証券	1.1250		2,940	2,782	379,774 2025/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6,0000		1,810	1,970	268,953 2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250		1,310	1,214	165,713 2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250		2,760	2,538	346,428 2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000		5,270	4,300	587,018 2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000		890	898	122,652 2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750		2,290	2,639	360,325 2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000		1,410	1,610	219,799 2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500		2,470	2,878	392,941 2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250		5,660	5,620	767,161 2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000		5,450	4,986	680,583 2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500		11,790	9,265	1,264,681 2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750		1,890	2,128	290,564 2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250		2,790	3,215	438,850 2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750		9,980	8,179	1,116,447 2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750		13,740	9,818	1,340,158 2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250		7,900	7,416	1,012,269 2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000		4,440	3,630	495,512 2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000		6,430	5,783	789,456 2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000		5,830	5,280	720,701 2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500		3,470	3,447	470,493 2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000		9,000	8,695	1,186,855 2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250		7,530	7,184	980,636 2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500		9,000	8,693	1,186,567 2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500		8,770	8,329	1,136,932 2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250		5,000	4,915	670,906 2024/02/29
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000		5,520	5,346	729,762 2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500		6,290	6,199	846,180 2025/02/28
US T N/B 2.375 02/29/24	国債証券	2.3750		5,800	5,725	781,530 2024/02/29
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250		14,250	11,932	1,628,618 2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750		6,540	4,958	676,805 2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000		8,510	6,290	858,624 2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750		13,520	11,926	1,627,868 2032/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250		3,840	3,463	472,671 2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000		8,730	7,658	1,045,312 2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750		6,690	6,251	853,301 2027/02/28
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250		4,870	4,634	632,587 2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250		4,820	4,547	620,721 2025/02/28
US T N/B 1.5 02/29/24	国債証券	1.5000		8,520	8,287	1,131,142 2024/02/29
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250		12,380	10,931	1,491,993 2028/02/29
US T N/B 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750		10,000	9,105	1,242,805 2029/02/28
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000		10,350	9,307	1,270,411 2026/02/28
US T N/B 1.5 02/15/25	国債証券	1.5000		9,580	9,130	1,246,281 2025/02/15

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	10,900	10,702	1,460,775	2024/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	4,430	4,349	593,644	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	7,000	6,715	916,541	2026/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	2,630	2,309	315,289	2027/03/31
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	10,000	9,508	1,297,774	2024/03/15
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	9,000	8,321	1,135,847	2025/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	6,880	6,108	833,774	2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	10,640	9,640	1,315,821	2026/03/31
US T N/B 2.25 03/31/24	国債証券	2.2500	2,510	2,468	336,955	2024/03/31
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	9,400	9,032	1,232,788	2027/03/31
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	6,100	5,848	798,309	2025/03/15
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	3,920	3,866	527,767	2025/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	6,860	6,714	916,424	2024/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	4,280	4,122	562,658	2026/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	5,000	4,915	670,933	2024/04/30
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	11,000	9,746	1,330,254	2028/04/30
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	7,740	7,356	1,004,147	2024/04/15
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	5,560	4,840	660,629	2027/04/30
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	8,290	7,495	1,023,081	2026/04/30
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	6,870	6,314	861,828	2025/04/30
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	2,280	2,235	305,106	2025/04/15
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6,2500	2,000	2,402	327,853	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	2,770	3,092	422,058	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	870	964	131,576	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	3,270	2,966	404,950	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	2,000	2,209	301,621	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	3,820	3,368	459,761	2043/05/15
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	13,620	10,974	1,497,942	2051/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	3,580	3,418	466,531	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,930	1,727	235,807	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	2,810	2,528	345,063	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	360	293	40,080	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	5,440	5,059	690,530	2048/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	5,610	3,765	513,922	2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	4,730	4,231	577,608	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	2,140	2,440	333,163	2038/05/15
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	5,460	4,401	600,729	2041/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	9,050	8,931	1,219,022	2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	10,000	9,659	1,318,408	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	11,000	10,686	1,458,576	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	9,450	8,862	1,209,619	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	5,000	4,765	650,433	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5,0000	1,450	1,737	237,136	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	10,000	9,339	1,274,795	2026/05/15
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	5,460	5,393	736,181	2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	8,440	8,250	1,126,146	2024/05/31
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	9,150	5,528	754,647	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	5,000	4,764	650,246	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	14,320	12,467	1,701,668	2031/05/15
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	7,220	7,205	983,533	2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	4,550	4,489	612,732	2025/05/31
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	4,830	4,195	572,591	2027/05/31
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	10,850	9,597	1,309,916	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	10,750	10,167	1,387,771	2024/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	12,420	10,104	1,379,142	2030/05/15

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 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	7,000	6,314	861,827	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	8,970	8,189	1,117,761	2025/05/31
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	6,710	6,552	894,382	2024/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,150	1,129	154,192	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	4,920	4,638	633,101	2026/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	6,760	6,564	896,001	2024/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	5,170	4,481	611,630	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	10,000	8,830	1,205,270	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	8,990	8,186	1,117,377	2025/06/30
US T N/B 0.25 06/15/24	国債証券	0.2500	11,000	10,375	1,416,115	2024/06/15
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	6,250	5,655	771,921	2026/06/30
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	6,170	6,033	823,524	2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	8,400	8,236	1,124,212	2023/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	3,270	3,222	439,836	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	5,000	4,708	642,595	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	8,000	7,757	1,058,821	2024/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	8,860	8,832	1,205,522	2023/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	9,000	8,728	1,191,365	2023/07/15
US T N/B 0.125 07/31/23	国債証券	0.1250	1,850	1,792	244,635	2023/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	10,670	9,262	1,264,292	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	5,000	4,296	586,427	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	8,980	8,152	1,112,687	2025/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	8,000	7,149	975,775	2026/07/31
US T N/B 0.375 07/15/24	国債証券	0.3750	9,000	8,489	1,158,736	2024/07/15
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6,2500	2,390	2,479	338,494	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3,7500	3,000	3,053	416,763	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3,8750	2,580	2,690	367,192	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2,7500	3,000	2,602	355,215	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3,1250	3,650	3,338	455,725	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4,5000	2,510	2,856	389,936	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3,6250	4,000	3,971	542,121	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2,0000	15,110	11,145	1,521,315	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2,8750	2,400	2,102	286,936	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2,0000	10,000	9,589	1,308,917	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2,7500	4,900	4,209	574,594	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2,2500	7,430	5,830	795,847	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2,5000	5,000	4,970	678,397	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2,3750	4,000	3,927	536,128	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2,2500	5,510	4,274	583,375	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3,0000	8,070	7,327	1,000,104	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2,2500	6,190	5,850	798,537	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1,5000	7,990	7,396	1,009,530	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2,8750	8,860	8,590	1,172,549	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2,7500	3,000	2,943	401,824	2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	7,880	7,726	1,054,618	2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	8,400	7,478	1,020,757	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	7,030	6,830	932,313	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2,7500	7,030	7,008	956,601	2023/08/31
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	14,040	10,316	1,408,045	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1,1250	6,760	4,500	614,297	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	11,760	7,356	1,004,079	2050/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1,2500	17,690	14,831	2,024,414	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	16,280	13,156	1,795,699	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	4,750	4,371	596,714	2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	5,400	5,173	706,182	2024/08/31

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	9,920	8,979	1,225,669	2025/08/31
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	10,000	9,408	1,284,232	2024/08/15
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	8,310	8,037	1,097,103	2023/08/15
US T N/B 0.125 08/31/23	国債証券	0.1250	11,040	10,665	1,455,757	2023/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	9,870	8,616	1,176,025	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	9,520	8,210	1,120,668	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	10,000	8,966	1,223,878	2026/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	2,000	1,977	269,844	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,400	2,344	319,975	2024/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	7,810	7,788	1,063,072	2023/09/30
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	6,120	5,903	805,723	2023/09/15
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	7,670	6,557	895,040	2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	3,820	3,550	484,568	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	10,000	8,785	1,199,192	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	10,000	9,026	1,232,035	2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	6,490	6,239	851,563	2024/09/30
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	10,000	9,382	1,280,660	2024/09/15
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	6,560	6,415	875,718	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	3,620	3,576	488,149	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	5,100	4,730	645,659	2026/10/31
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	10,000	9,615	1,312,436	2023/10/15
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	7,000	6,190	844,883	2028/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	8,000	7,679	1,048,157	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	6,000	5,149	702,848	2027/10/31
US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	0.6250	10,000	9,417	1,285,458	2024/10/15
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	7,500	6,750	921,387	2025/10/31
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5,2500	1,700	1,880	256,722	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6,1250	3,000	3,396	463,532	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	40	35	4,886	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4,2500	3,320	3,632	495,859	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2,7500	4,920	4,258	581,241	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3,1250	80	74	10,140	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3,7500	4,000	4,051	553,040	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2,7500	4,880	4,200	573,341	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	8,770	5,873	801,721	2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	11,990	8,580	1,171,131	2051/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3,0000	2,370	2,125	290,147	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2,8750	4,030	3,539	483,059	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2,2500	10,000	9,757	1,331,843	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4,3750	1,200	1,341	183,084	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3,3750	5,050	4,938	674,035	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2,3750	3,120	2,519	343,939	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2,2500	7,560	7,281	993,854	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3,1250	7,380	7,256	990,376	2028/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2,7500	2,500	2,487	339,545	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2,0000	10,580	9,968	1,360,579	2026/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2,2500	8,040	7,578	1,034,451	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2,1250	8,000	7,886	1,076,479	2023/11/30
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2,1250	6,670	6,495	886,561	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2,8750	4,140	4,070	555,577	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2,8750	8,670	8,639	1,179,208	2023/11/30
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1,3750	10,970	7,619	1,040,035	2040/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2,0000	6,400	4,913	670,643	2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1,6250	5,310	4,922	671,848	2026/11/30
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1,7500	6,900	6,192	845,174	2029/11/15

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	千円		
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	20,420	17,237	2,352,726	2031/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	18,710	15,388	2,100,441	2030/11/15
US T N/B 0.25 11/15/23	国債証券	0.2500	12,280	11,806	1,611,410	2023/11/15
US T N/B 0.5 11/30/23	国債証券	0.5000	2,000	1,925	262,860	2023/11/30
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	8,510	7,331	1,000,639	2027/11/30
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	7,000	6,230	850,407	2028/11/30
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	7,100	6,802	928,423	2024/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	9,020	8,133	1,110,141	2025/11/30
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	4,040	3,803	519,109	2024/11/15
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	8,000	7,891	1,077,119	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,000	1,949	266,038	2025/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	7,210	7,032	959,874	2024/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	4,990	4,647	634,340	2026/12/31
US T N/B 0.75 12/31/23	国債証券	0.7500	4,940	4,765	650,398	2023/12/31
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	9,100	8,280	1,130,225	2026/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	6,900	6,094	831,857	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	8,400	7,558	1,031,595	2025/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	10,160	8,740	1,192,974	2027/12/31
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	9,760	9,224	1,259,082	2024/12/15
小計	—	—	1,610,280	1,464,100	199,835,047	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	4,010	3,850	405,886	2024/02/01
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	2,400	2,359	248,735	2024/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	2,200	2,082	219,522	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	2,200	1,963	206,954	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	2,380	2,157	227,468	2027/03/01
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	2,600	2,464	259,807	2024/04/01
CANADA 1.5 04/01/25	国債証券	1.5000	2,080	1,976	208,381	2025/04/01
CANADA 1.5 05/01/24	国債証券	1.5000	1,000	967	101,948	2024/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,900	1,770	186,609	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,440	1,642	173,177	2029/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5,0000	1,190	1,391	146,646	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2,5000	1,090	1,073	113,153	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4,0000	600	640	67,526	2041/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1,5000	1,110	1,092	115,208	2023/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2,2500	1,260	1,221	128,803	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1,0000	1,610	1,435	151,353	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2,2500	1,910	1,768	186,454	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1,2500	5,690	4,808	506,896	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1,5000	7,200	6,094	642,398	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2,0000	1,500	1,311	138,265	2032/06/01
CANADA 0.25 08/01/23	国債証券	0.2500	810	784	82,642	2023/08/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1,5000	800	769	81,098	2024/09/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2,0000	2,220	2,187	230,636	2023/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	3,990	3,647	384,457	2025/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1,0000	1,660	1,505	158,698	2026/09/01
CANADA 0.75 10/01/24	国債証券	0.7500	3,250	3,067	323,329	2024/10/01
CANADA 0.5 11/01/23	国債証券	0.5000	3,490	3,362	354,423	2023/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3,5000	1,920	1,926	203,098	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2,7500	1,120	988	104,166	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2,0000	7,720	5,722	603,220	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1,7500	2,650	1,816	191,456	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2,7500	780	666	70,307	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	4,500	3,514	370,453	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1,5000	4,310	3,621	381,716	2031/12/01
小計	—	—	84,590	75,656	7,974,905	—

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	
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	3,690	2,975	281,770	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	1,440	1,428	135,276	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	2,760	2,877	272,574	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	2,100	2,084	197,469	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	3,170	3,232	306,109	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	3,500	3,359	318,184	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	3,290	3,407	322,751	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	1,830	1,740	164,830	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	2,000	1,828	173,215	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	4,540	4,083	386,710	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	1,890	1,523	144,262	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	3,220	2,487	235,583	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	2,670	2,353	222,870	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	2,320	1,877	177,844	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	1,140	978	92,681	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	810	474	44,924	2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	3,290	2,874	272,252	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	950	888	84,162	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	2,120	2,007	190,143	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	2,060	1,898	179,845	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	3,000	2,697	255,433	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	2,190	1,759	166,683	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	3,470	2,646	250,678	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	3,500	3,120	295,526	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	4,500	4,175	395,486	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	4,210	3,299	312,490	2030/12/21
小計	—	—	69,660	62,081	5,879,760	—
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	750	743	73,201	2024/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	1,430	1,462	143,907	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	1,100	1,027	101,085	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	770	600	59,093	2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	1,160	1,090	107,328	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	1,180	1,156	113,754	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	1,140	1,125	110,740	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	1,380	1,339	131,772	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	1,330	1,312	129,157	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	260	233	22,946	2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	660	662	65,171	2023/07/01
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	400	354	34,830	2031/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	1,120	1,004	98,850	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	1,050	1,055	103,888	2024/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	1,200	1,179	116,001	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	1,600	1,634	160,808	2033/09/01
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	400	317	31,215	2051/10/01
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500	830	772	76,053	2026/11/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	610	564	55,516	2025/11/01
小計	—	—	18,370	17,637	1,735,324	—
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	3,080	3,240	541,625	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	3,530	3,866	646,178	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	2,340	3,015	503,901	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	1,300	1,030	172,247	2049/01/22
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	2,970	1,939	324,064	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	1,360	1,043	174,462	2039/01/31

銘柄	当期				末	
	種類	利率	額面金額	評価額	償還年月	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 1.0 01/31/32	国債証券	1.0000	770	662	110,659	2032/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	5,940	5,730	957,700	2024/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	1,550	1,364	228,104	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,790	1,579	264,037	2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25	国債証券	0.2500	960	907	151,632	2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,740	1,609	268,979	2026/01/30
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	2,270	2,424	405,101	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	2,120	2,456	410,613	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	2,490	2,432	406,559	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	2,960	3,377	564,399	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	2,110	2,010	335,961	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	2,980	2,245	375,253	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	1,270	870	145,530	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	2,160	2,554	426,973	2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53	国債証券	1.5000	670	488	81,633	2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	2,210	1,696	283,582	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	2,150	2,034	339,987	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	1,970	2,371	396,334	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	2,780	2,691	449,795	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	2,000	1,898	317,260	2027/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	3,400	3,345	559,160	2023/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	2,560	2,112	353,064	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,680	1,363	227,826	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	2,920	2,211	369,550	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	1,720	2,036	340,382	2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	910	908	151,897	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	2,000	2,015	336,847	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2,0000	1,800	1,780	297,585	2025/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	3,760	3,236	540,906	2037/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	2,120	1,587	265,327	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	1,810	846	141,448	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	2,440	1,746	291,855	2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73	国債証券	1.1250	710	411	68,700	2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	2,590	1,961	327,790	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	1,430	818	136,843	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	1,320	1,263	211,175	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	3,120	2,794	467,067	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	2,240	1,886	315,201	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	3,340	3,065	512,285	2026/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	1,450	1,759	294,124	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	2,060	2,567	429,002	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	3,010	3,743	625,670	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	2,060	2,542	424,946	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	3,170	4,153	694,115	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	3,000	3,284	548,825	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,190	1,418	236,985	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	2,500	2,932	490,102	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	2,280	2,866	478,991	2049/12/07
小計	—	—	120,060	116,205	19,420,263	—
(イスラエル)		%	千イスラエル・シュケル	千円		
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	2,330	2,983	117,847	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国債証券	0.5000	3,170	2,913	115,095	2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	5,110	5,183	204,773	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	360	346	13,683	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	3,360	3,439	135,861	2024/03/31

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	
(イスラエル)		%	千イスラエル・シュケル	千円		
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	2,810	2,424	95,761	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	国債証券	1.3000	2,690	2,283	90,207	2032/04/30
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	4,380	4,121	162,826	2025/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	1,370	1,071	42,311	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,330	2,260	89,290	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	1,620	1,557	61,517	2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	3,700	4,208	166,254	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	国債証券	0.4000	5,490	5,209	205,803	2024/10/31
ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	国債証券	1.5000	1,630	1,618	63,934	2023/11/30
小計	—	—	40,350	39,620	1,565,167	—
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千円		
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	7,060	3,939	75,991	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	18,120	23,727	457,700	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	6,330	6,353	122,566	2025/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	3,600	3,626	69,962	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	5,450	5,062	97,656	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	18,520	16,608	320,371	2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	8,860	7,278	140,410	2031/11/15
DENMARK 0.0 11/15/24	国債証券	0.0000	11,030	10,655	205,543	2024/11/15
小計	—	—	78,970	77,252	1,490,202	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千円		
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	4,220	3,975	54,905	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	9,840	9,219	127,328	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	12,770	12,800	176,774	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	1,250	1,205	16,643	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	13,360	12,553	173,357	2028/04/26
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	5,560	4,992	68,943	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	8,130	7,017	96,915	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	5,720	5,157	71,231	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,450	2,048	28,294	2031/09/17
小計	—	—	63,300	58,971	814,395	—
(スウェーデン)		%	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	6,290	7,714	103,684	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	12,680	11,752	157,947	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	16,220	16,349	219,743	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	6,650	5,687	76,436	2031/05/12
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	7,530	7,796	104,783	2032/06/01
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	5,230	5,205	69,961	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	21,800	20,773	279,197	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	4,810	4,402	59,172	2029/11/12
小計	—	—	81,210	79,682	1,070,927	—
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千円		
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	63,554	56,014	378,924	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	20,000	17,032	115,219	2027/03/04
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	19,510	17,383	117,593	2025/03/06
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	47,501	45,711	309,223	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	63,290	57,776	390,840	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	54,445	50,476	341,458	2027/06/03
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	38,590	37,354	252,693	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	24,328	21,114	142,833	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	37,956	33,559	227,019	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	41,653	39,190	265,108	2038/11/18
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	16,011	14,312	96,819	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	55,000	55,429	374,962	2024/12/05
小計	—	—	481,838	445,355	3,012,696	—

銘柄	当期				末	
	種類	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(中国)		%	千オフショア・人民元	千円		
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	国債証券	2.3700	25,000	24,759	504,326	2027/01/20
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	17,000	16,888	343,999	2032/02/17
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	52,000	51,861	1,056,381	2025/02/24
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	18,000	18,012	366,896	2029/03/24
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	国債証券	2.2800	25,000	25,008	509,395	2024/03/17
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	12,950	13,855	282,223	2051/04/12
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	10,000	9,950	202,679	2027/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	21,500	21,773	443,504	2031/05/27
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国債証券	3.0100	22,000	22,404	456,361	2028/05/13
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	23,500	23,253	473,660	2030/05/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	56,500	56,740	1,155,762	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	34,000	34,124	695,077	2024/09/02
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	24,400	25,349	516,337	2051/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	15,500	15,697	319,748	2028/10/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	国債証券	2.5600	18,600	18,699	380,897	2023/10/21
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	23,500	24,353	496,050	2027/12/03
小計	—	—	399,450	402,732	8,203,301	—
(マレーシア)		%	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	1,370	1,362	42,255	2027/03/15
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	1,480	1,439	44,652	2046/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	2,030	2,067	64,131	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	3,050	3,085	95,732	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	3,510	3,302	102,459	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	3,640	3,655	113,417	2037/04/07
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	2,090	1,829	56,746	2031/04/15
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	200	195	6,051	2027/05/31
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	3,750	3,287	102,002	2040/05/22
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	1,370	1,318	40,911	2035/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	5,090	4,951	153,619	2028/06/15
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	4,200	4,156	128,951	2031/06/30
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	1,030	1,048	32,523	2038/06/08
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,830	1,832	56,845	2024/06/14
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	4,520	3,877	120,303	2050/06/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	3,500	3,558	110,389	2024/07/15
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	2,400	2,381	73,880	2048/07/06
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	1,810	1,808	56,094	2026/07/15
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,860	1,712	53,117	2034/07/05
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	3,910	3,808	118,153	2029/08/15
MALAYSIA 3.8 08/17/23	国債証券	3.8000	1,070	1,082	33,584	2023/08/17
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	4,750	4,783	148,399	2025/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	580	583	18,101	2043/09/30
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	1,920	1,944	60,319	2024/09/30
MALAYSIA 4.696 10/15/42	国債証券	4.6960	920	904	28,047	2042/10/15
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	3,090	3,078	95,511	2026/11/30
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	2,000	1,978	61,374	2027/11/16
小計	—	—	66,970	65,034	2,017,579	—
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千円		
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	11,010	8,483	262,562	2028/04/25
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	2,200	1,282	39,688	2032/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	7,510	6,832	211,451	2024/04/25
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	8,370	6,932	214,564	2025/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	9,000	7,309	226,215	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,440	2,133	66,030	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	6,690	5,193	160,720	2027/07/25
POLAND 07/25/24	国債証券	0.0000	2,220	1,892	58,555	2024/07/25

銘柄	種類	利 率	額面金額	当期		末償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千円		
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	1,070	1,023	31,673	2023/10/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	4,360	3,190	98,746	2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	4,690	4,149	128,414	2024/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	6,690	4,138	128,089	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,100	797	24,695	2026/10/25
小計	—	—	67,350	53,359	1,651,407	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	2,460	2,172	311,611	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	1,420	1,323	189,871	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	60	62	8,955	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	1,170	1,295	185,832	2025/03/13
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	50	34	4,916	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	80	60	8,639	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	70	62	8,943	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	2,610	2,675	383,898	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	100	94	13,498	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	420	394	56,584	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	4,980	4,869	698,510	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	130	116	16,735	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	3,670	2,818	404,366	2035/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	930	750	107,645	2031/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	1,660	1,408	202,014	2030/10/18
小計	—	—	19,810	18,137	2,602,024	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	2,410	2,958	424,380	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	3,480	3,840	550,972	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	2,240	1,177	168,957	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	980	1,171	168,062	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	3,260	3,985	571,738	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,620	1,683	241,538	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	1,660	1,173	168,357	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,450	1,082	155,302	2040/01/15
NETHERLANDS 0.1/15/24	国債証券	0.0000	4,330	4,263	611,643	2044/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	990	875	125,575	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	2,860	2,647	379,846	2027/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	680	687	98,629	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	2,000	1,914	274,625	2026/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	3,960	4,024	577,379	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	3,770	3,633	521,314	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	4,460	4,191	601,323	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	2,330	2,219	318,354	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,110	991	142,186	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	3,640	3,123	448,053	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	980	821	117,841	2031/07/15
小計	—	—	48,210	46,466	6,666,083	—
(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	2,140	2,571	368,924	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,860	2,243	321,855	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	2,200	2,435	349,342	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	1,950	2,240	321,455	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	3,430	4,355	624,783	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	2,400	2,152	308,765	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	2,240	2,576	369,591	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	630	486	69,850	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	2,650	2,046	293,623	2050/06/22

銘柄	種類	当期			期末	
		利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	160	110	15,850	2053/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	870	750	107,665	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	740	608	87,348	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	1,040	443	63,613	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	3,000	2,923	419,426	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	850	873	125,321	2024/06/22
BELGIUM 1.06/22/31	国債証券	1.0000	2,110	1,899	272,503	2031/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	2,000	1,879	269,676	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	1,120	747	107,167	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	2,400	2,225	319,201	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	1,540	1,618	232,211	2034/06/22
BELGIUM 1.96/22/38	国債証券	1.9000	2,120	1,908	273,850	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	2,750	2,692	386,277	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	3,830	3,643	522,759	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	310	263	37,858	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	3,100	2,638	378,550	2030/06/22
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	5,100	5,006	718,222	2024/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	3,190	2,582	370,416	2031/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	70	69	9,963	2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	800	725	104,122	2027/10/22
小計	—	—	56,600	54,720	7,850,197	—
(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	1,640	1,506	216,186	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	8,050	7,582	1,087,723	2026/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	5,000	4,922	706,180	2024/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	国債証券	0.0000	3,500	3,364	482,607	2025/02/25
FRANCE OAT 0.3/25/24	国債証券	0.0000	2,000	1,964	281,792	2024/03/25
FRANCE OAT 0.3/25/25	国債証券	0.0000	2,310	2,217	318,190	2025/03/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	6,430	6,871	985,819	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	5,040	6,349	910,913	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	4,040	5,018	719,952	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	3,110	3,930	563,835	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5,5000	4,460	5,457	782,953	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	4,900	6,120	878,100	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	4,690	5,095	731,033	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	4,280	3,697	530,431	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	5,420	4,111	589,786	2050/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	3,610	2,133	306,023	2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	1,420	817	117,237	2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	1,930	1,425	204,499	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	1,510	603	86,532	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	6,880	7,021	1,007,373	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	8,620	8,905	1,277,614	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,900	5,515	791,273	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	8,910	8,427	1,209,061	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	7,760	7,537	1,081,263	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	13,600	12,293	1,763,672	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	3,300	2,884	413,790	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	6,220	5,940	852,176	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	8,000	7,690	1,103,234	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	2,270	1,572	225,529	2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	5,240	4,447	637,993	2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	1,160	955	137,008	2038/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	1,200	954	136,895	2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	5,750	5,102	731,987	2039/06/25

銘柄	当期				末	
	種類	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	2,880	1,831	262,723	2044/06/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	8,000	8,373	1,201,259	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	6,320	7,234	1,037,895	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	6,390	6,677	957,972	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	3,530	4,198	602,324	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	7,690	10,104	1,449,629	2032/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	6,990	7,056	1,012,363	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	6,200	6,077	871,870	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	7,530	7,045	1,010,697	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	9,010	8,342	1,196,767	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	7,570	6,133	879,915	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	9,180	7,656	1,098,465	2030/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	6,760	5,809	833,491	2029/11/25
小計	—	—	246,200	238,979	34,284,051	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	1,180	1,279	183,500	2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	2,200	2,669	383,023	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	2,930	3,880	556,686	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	3,340	4,345	623,358	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	4,600	5,788	830,362	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	4,330	4,244	608,975	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	6,490	6,283	901,373	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	5,540	5,068	727,062	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	4,470	4,207	603,630	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	3,000	3,041	436,264	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	4,650	4,390	629,918	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	3,300	2,853	409,378	2031/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	5,210	4,400	631,306	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	3,490	3,077	441,540	2030/02/15
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	国債証券	0.0000	1,930	1,898	272,334	2024/03/15
BUNDESOBL 04/05/24	国債証券	0.0000	3,490	3,429	492,032	2024/04/05
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	4,620	4,457	639,440	2025/04/11
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	3,100	2,937	421,409	2026/04/10
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	2,000	1,857	266,476	2027/04/16
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	4,280	4,316	619,307	2024/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	90	70	10,071	2035/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	4,350	3,320	476,338	2036/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6,5000	1,670	2,066	296,449	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	2,000	2,361	338,843	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,990	2,638	378,533	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	2,740	3,322	476,680	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2,5000	4,840	5,325	764,003	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	2,810	3,976	570,487	2040/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	3,150	4,132	592,900	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2,5000	4,590	5,110	733,165	2046/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	1,950	1,084	155,623	2052/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	5,220	4,494	644,829	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1,0000	6,640	6,568	942,362	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	5,000	4,738	679,791	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	3,680	3,466	497,310	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	3,500	3,222	462,362	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2,0000	3,730	3,788	543,540	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1,0000	6,600	6,578	943,715	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	3,930	3,499	502,093	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	3,660	2,131	305,716	2050/08/15

銘柄	当期					末償還年月日	
	種類	利 率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	5,610	4,795	687,960	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	2,370	1,383	198,481	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	5,000	4,368	626,748	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	820	717	102,906	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	1,000	856	122,883	2031/08/15	
BUNDESSCHAT 0.0 09/15/23	国債証券	0.0000	3,000	2,974	426,765	2023/09/15	
BUNDESOBL 10/13/23	国債証券	0.0000	3,940	3,905	560,275	2023/10/13	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	3,720	3,489	500,610	2026/10/09	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	2,000	1,916	274,918	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	4,500	4,135	593,259	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	3,000	2,710	388,833	2028/11/15	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	国債証券	0.0000	2,080	2,057	295,132	2023/12/15	
小計	—	—	183,330	179,638	25,770,977	—	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,140	1,394	200,121	2029/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	3,360	3,817	547,647	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	3,650	3,491	500,903	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	2,000	1,810	259,791	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	3,000	2,639	378,605	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	3,690	3,434	492,711	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	3,790	3,775	541,590	2025/04/30	
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	4,220	4,407	632,351	2024/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	4,340	4,210	604,031	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	2,770	2,765	396,764	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	3,530	3,357	481,718	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	3,930	3,691	529,638	2029/04/30	
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	5,090	4,162	597,166	2032/04/30	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	4,540	3,892	558,444	2030/04/30	
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	2,890	2,296	329,399	2031/04/30	
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	2,740	2,668	382,798	2024/05/31	
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	2,000	1,894	271,790	2025/05/31	
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	3,100	3,574	512,854	2026/07/30	
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	3,210	3,985	571,718	2040/07/30	
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	2,890	3,532	506,716	2041/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	2,460	2,401	344,575	2066/07/30	
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,250	1,356	194,587	2025/07/30	
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	3,660	3,495	501,528	2030/07/30	
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	4,810	6,076	871,765	2032/07/30	
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	470	448	64,392	2033/07/30	
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	5,000	4,733	679,032	2028/07/30	
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	3,850	3,363	482,551	2035/07/30	
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	3,060	2,982	427,835	2024/07/30	
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	270	268	38,532	2023/07/30	
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	1,810	1,309	187,841	2037/07/30	
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	1,180	797	114,469	2042/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	4,500	4,192	601,477	2027/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	1,000	890	127,693	2029/07/30	
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	3,100	3,189	457,561	2024/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	3,520	4,089	586,710	2028/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,220	1,598	229,269	2044/10/31	
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	3,480	3,267	468,747	2046/10/31	
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,650	1,476	211,861	2048/10/31	
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	780	553	79,348	2052/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	1,900	984	141,285	2071/10/31	
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	3,270	1,881	269,891	2050/10/31	

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	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	4,460	4,502	645,968	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	5,000	4,799	688,584	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	3,540	3,430	492,185	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	2,530	2,215	317,774	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	6,420	6,702	961,543	2023/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	3,000	2,445	350,829	2031/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,580	1,140	163,612	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	4,770	4,287	615,121	2030/10/31
小計	—	—	149,420	143,687	20,613,341	—
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	3,000	2,755	395,304	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	1,850	1,806	259,222	2024/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/30/24	国債証券	0.0000	3,000	2,926	419,835	2024/01/30
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	2,890	3,399	487,734	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	6,440	6,638	952,430	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	4,200	3,999	573,802	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	2,810	2,685	385,289	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	4,100	3,814	547,283	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	5,000	4,175	598,945	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	2,650	2,194	314,779	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	2,180	2,045	293,402	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	5,190	5,446	781,354	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	1,440	1,113	159,812	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	1,380	883	126,743	2072/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,620	1,741	249,907	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	3,220	3,450	494,969	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	30	25	3,628	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3,1000	2,770	2,516	361,059	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	3,000	2,880	413,246	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	3,860	3,922	562,694	2030/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	2,050	1,551	222,598	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	3,570	2,613	374,946	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	2,210	1,518	217,811	2037/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	4,610	3,934	564,396	2028/03/15
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	2,130	1,394	200,025	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	4,000	3,454	495,532	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	3,770	3,026	434,159	2031/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	3,420	3,097	444,366	2026/04/01
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	2,000	1,840	264,023	2027/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6,0000	4,300	5,118	734,269	2031/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	2,800	2,805	402,463	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	5,490	5,362	769,323	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	3,790	3,654	524,302	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	5,910	5,780	829,280	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	2,060	2,001	287,075	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	3,250	2,523	362,039	2032/06/01
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	国債証券	0.6000	3,500	3,492	501,100	2023/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2,1000	3,540	3,466	497,343	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,000	998	143,226	2024/07/01
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,500	1,290	185,192	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	3,250	3,201	459,344	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5,0000	690	773	110,984	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5,0000	4,170	4,800	688,740	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	5,830	6,064	869,993	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2,0500	3,000	2,882	413,507	2027/08/01

銘柄	当期				末	
	種類	利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	4,790	4,716	676,666	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	3,000	2,310	331,509	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	4,750	3,917	561,979	2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	3,710	3,681	528,090	2023/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	国債証券	0.0000	1,000	960	137,778	2024/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	2,000	1,793	257,223	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	2,240	2,022	290,211	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	2,810	3,192	458,053	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3,2500	1,940	1,774	254,501	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	5,480	5,988	859,101	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	2,950	3,408	488,931	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2,4500	1,770	1,346	193,160	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	3,660	2,312	331,739	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2,4500	2,960	2,621	376,064	2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2,1500	1,180	811	116,415	2052/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3,7500	2,000	2,078	298,168	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3,8500	1,800	1,793	257,324	2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2,2500	2,260	1,896	272,117	2036/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	2,000	1,812	260,035	2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	3,840	3,810	546,636	2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2,4500	1,240	1,258	180,534	2023/10/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6,5000	3,400	4,018	576,439	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5,2500	6,440	7,308	1,048,421	2029/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1,4500	1,000	985	141,344	2024/11/15
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2,5000	3,000	3,008	431,570	2025/11/15
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2,0000	3,610	3,557	510,358	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1,2500	3,020	2,838	407,185	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2,5000	4,090	4,129	592,374	2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2,8000	4,660	4,579	657,041	2028/12/01
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	70	55	7,925	2031/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1,6500	3,660	3,174	455,361	2030/12/01
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	国債証券	0.0000	3,000	2,845	408,150	2024/12/15
小計	—	—	235,800	225,079	32,289,916	—
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券	0.1250	420	214	30,830	2052/04/15
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2,0000	3,460	3,523	505,452	2024/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	980	872	125,099	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1,3750	330	263	37,861	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	2,900	2,778	398,623	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1,1250	1,900	1,656	237,687	2034/04/15
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券	0.5000	100	66	9,561	2043/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	180	131	18,869	2036/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4,0000	290	312	44,819	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2,7500	160	167	24,050	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2,6250	1,720	1,737	249,196	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	1,060	951	136,494	2029/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	90	82	11,800	2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	10	9	1,339	2027/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	1,020	684	98,268	2040/09/15
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	180	149	21,404	2031/09/15
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	880	739	106,062	2030/09/15
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	100	97	13,981	2024/09/15
小計	—	—	15,780	14,438	2,071,402	—
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	1,640	2,084	299,028	2062/01/26

銘柄	種類	当期			末	
		利 率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	490	398	57,234	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	3,200	2,896	415,569	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	1,930	1,806	259,228	2028/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	1,000	825	118,461	2031/02/20
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000	1,500	1,317	189,066	2032/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	2,760	2,351	337,322	2030/02/20
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	2,360	2,842	407,836	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	740	470	67,487	2051/03/20
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	130	62	8,923	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	4,010	3,769	540,748	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	890	854	122,603	2025/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	1,660	1,668	239,317	2034/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	390	157	22,666	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	920	1,016	145,857	2044/06/20
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	20	19	2,802	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	970	754	108,266	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	3,600	3,638	521,960	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	3,230	3,100	444,789	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	500	495	71,045	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	1,540	1,122	161,100	2036/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	3,280	3,323	476,837	2023/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	400	252	36,272	2086/11/02
小計		—	—	37,160	35,232	5,054,427
合計		—	—	—	—	391,873,402

## ■投資信託財産の構成

2022年6月22日現在

項目	当期			末	
	評価額	千円	%	比率	比
公社債	391,873,402			98.5	
コール・ローン等、その他	5,999,761			1.5	
投資信託財産総額	397,873,163			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、396,133,568千円、99.6%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、2022年6月22日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル=136.49円、1 カナダ・ドル=105.41円、1 オーストラリア・ドル=94.71円、1 シンガポール・ドル=98.39円、1 イギリス・ポンド=167.12円、1 イスラエル・シェケル=39.504円、1 デンマーク・クローネ=19.29円、1 ノルウェー・クローネ=13.81円、1 スウェーデン・クローネ=13.44円、1 メキシコ・ペソ=6.764円、1 オフショア・人民元=20.369円、1 マレーシア・リンギット=31.023円、1 ポーランド・ズロチ=30.948円、1 ユーロ=143.46円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月22日)現在

項	目	当 期 末
<b>(A) 資</b>	<b>産</b>	<b>788,924,148,833円</b>
コ 一 ル 一 口 一 シ 等	債(評価額)	3,634,753,446
公 社		391,873,402,035
未 収 入 金		391,051,521,204
未 収 利 息		1,445,393,884
前 払 費 用		919,078,264
	<b>債</b>	<b>413,073,939,788</b>
<b>(B) 負</b>	<b>債</b>	<b>413,067,141,788</b>
未 払 金		413,067,141,788
未 払 約 金		6,798,000
<b>(C) 純 資 産 総 額(A-B)</b>	<b>375,850,209,045</b>	
元 本		301,416,347,543
次 期 繰 越 損 益 金		74,433,861,502
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>301,416,347,543口</b>	
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)		<b>12,469円</b>

(注1) 期首元本額 400,458,673,144円  
 追加設定元本額 896,564,854,783円  
 一部解約元本額 995,607,180,384円

(注2) 期末における元本の内訳

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	7,983,267,042円
たわらノーロード バランス（堅実型）	922,989,511円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,397,639,042円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,142,290,705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）	51,823,060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）	1,480,060,981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）	1,839,784,196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）	585,887,924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）	296,552,475円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	8,098,987円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	21,432,813円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	196,275,572円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	13,786,350円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	20,674,350円
投資のソムリエ	154,657,465,328円
投資のソムリエ<DC年金>	9,674,975,477円
投資のソムリエ<DC年金>/リスク抑制型	9,729,805,477円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	49,791,164,842円
ワールドアセットバランス（基本コース）	2,318,936,250円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,473,306,935円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	464,088,184円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	234,326,172円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	64,705,631円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	1,502,094,089円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,690,173,872円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,045,976,355円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	564,248,623円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	239,455,331円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	154,826,999円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	27,056,178円
外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）	(適格機関投資家限定)
	19,895,820,997円
先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）	(適格機関投資家限定)
	8,036,406,080円

投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	4,004,181,571円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	178,452,757円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	854,354,230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）	525,449,535円
D I AM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	48,155,676円
D I AM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	334,162,100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）	639,323,897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）	899,271,353円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA (1212)（適格機関投資家限定）	698,032,316円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA (1303)（適格機関投資家限定）	2,403,879,369円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA (1306)（適格機関投資家限定）	3,179,279,422円
D I AM世界アセットバランスファンド7VA (1309)（適格機関投資家限定）	126,409,489円

期末元本合計 301,416,347,543円

## ■損益の状況

当期 自2021年6月23日 至2022年6月22日

項	目	当期
(A) 配 当 等 収 益		9,182,555,387円
受 取 利 息		9,184,824,272
そ の 他 収 益		241,313
支 払 利 息		△2,510,198
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		△73,578,958,793
売 買 益		118,689,796,094
売 買 損		△192,268,754,887
(C) そ の 他 費 用		△77,317,894
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		△64,473,721,300
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		173,515,474,368
(F) 解 約 差 損 益 金		△383,745,218,616
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		349,137,327,050
(H) 合 計(D + E + F + G)		74,433,861,502
次 期 繰 越 損 益 金(H)		74,433,861,502

(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。

# 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第20期 (決算日 2022年2月15日)  
(計算期間 2021年2月16日～2022年2月15日)

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年9月2日から無期限です。
運用方針	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（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めざして運用を行います。
主要投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 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	MSCIコクサイ・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期騰落率	(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)			
16期(2018年2月15日)	円 33,302	% 10.0	ポイント 1,070,930.74	% 10.2	% 95.7	% 2.2 百万円 284,448
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0 349,689
18期(2020年2月17日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7 370,420
19期(2021年2月15日)	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5 477,565
20期(2022年2月15日)	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1	1.8 642,642

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス（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數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4) MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指數の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています（以下同じ）。

(注5) △（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

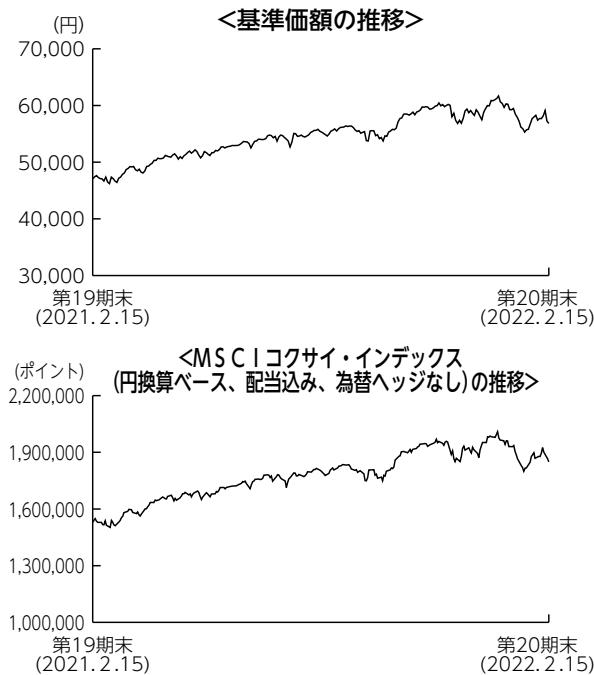
年 月 日	基 準 価 額	MSCIコクサイ・インデックス		株式組入比 率	株式先物比 率
		騰 落 率	(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		
(期 首) 2021 年 2 月 15 日	円 47,083	% —	ポイント 1,529,401.79	% —	% 95.5
2 月 末	46,501	△1.2	1,513,956.06	△1.0	95.5
3 月 末	49,621	5.4	1,611,609.95	5.4	94.8
4 月 末	51,949	10.3	1,687,947.89	10.4	94.9
5 月 末	52,709	11.9	1,713,776.65	12.1	95.8
6 月 末	54,024	14.7	1,757,211.68	14.9	94.2
7 月 末	54,788	16.4	1,782,621.67	16.6	95.5
8 月 末	56,137	19.2	1,826,693.61	19.4	95.9
9 月 末	54,830	16.5	1,784,539.69	16.7	90.4
10 月 末	58,844	25.0	1,915,338.44	25.2	95.7
11 月 末	58,620	24.5	1,907,177.99	24.7	94.2
12 月 末	61,010	29.6	1,986,097.70	29.9	95.7
2022 年 1 月 末	56,736	20.5	1,847,457.63	20.8	95.5
(期 末) 2022 年 2 月 15 日	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1
					1.8

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過 (2021年2月16日から2022年2月15日まで)



決算や新型コロナウイルスへの警戒感後退などから堅調に推移しました。期末にかけては金融緩和策の急速な転換への懸念や、ウクライナ情勢の緊迫化を受け不安定な値動きとなりました。

為替市場では、米ドルは新型コロナウイルス変異株の感染拡大による景気悪化への懸念などからリスク回避姿勢が強まり、対円で弱含む局面もありましたが、経済活動正常化やインフレ率上昇により金融緩和策の転換が意識されたことなどから対円で上昇しました。ユーロやイギリスポンドなども対円で上昇しました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス (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したポートフォリオを構築しました。

### 基準価額の推移

当期末の基準価額は56,820円となり、前期末比で20.7%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

金融緩和策の急速な転換への懸念や新型コロナウイルス変異株の感染拡大などにより、先進国株式市場が調整する場面はあったものの、新型コロナウイルスへの警戒感後退や経済活動正常化への期待などから主要国の株式市場が上昇したことにより、為替市場でも米ドルなど多くの通貨が対円で上昇したことがプラス寄与となり、当ファンドの基準価額は上昇しました。

### 投資環境

先進国株式市場は上昇しました。前半は新型コロナウイルスのワクチン接種進展による経済活動正常化や、米国の経済対策法案への期待などから堅調に推移しました。その後はインフレ加速への懸念や、新型コロナウイルス変異株の感染拡大などから下落する場面もありましたが、良好な企業

## 【運用状況】

### ○組入株式上位10業種

#### 期首（前期末）

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	12.1%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.6
3	メディア・娯楽	7.1
4	資本財	6.2
5	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.1
6	小売	5.8
7	銀行	5.6
8	ヘルスケア機器・サービス	5.1
9	半導体・半導体製造装置	4.6
10	各種金融	4.4

(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。

#### 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20.9%上昇しました。

当ファンドはベンチマーク比で△0.3%と、配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

#### 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。

#### 期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.8%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.5
3	銀行	6.4
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.3
5	メディア・娯楽	6.1
6	資本財	5.8
7	小売	5.1
8	各種金融	4.7
9	半導体・半導体製造装置	4.6
10	ヘルスケア機器・サービス	4.5



## ■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) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券)	3円 (3) (0) (1) (0) (0)	0.006% (0.005) (0.000) (0.001) (0.000) (0.000)	(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、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 (株式) (投資信託受益証券) (投資証券)	14 (14) (0) (0)	0.025 (0.025) (0.000) (0.000)	(b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、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)	22 (0) (22)	0.040 (0.000) (0.040)	(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	39	0.071	
期中の平均基準価額は54,626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 (2021年2月16日から2022年2月15日まで)

### (1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	アメリカ	百株 204,724.74 (△1,530.59)	千アメリカ・ドル 2,595,140 (△5,237)	百株 172,588.72	千アメリカ・ドル 2,211,299
	カナダ	百株 24,833.91 (423.14)	千カナダ・ドル 166,598 (△95)	百株 22,900.88	千カナダ・ドル 140,622
	オーストラリア	百株 42,059.1 (683.68)	千オーストラリア・ドル 102,911 (△235)	百株 41,195.94	千オーストラリア・ドル 88,861
	香港	百株 47,840 (511.64)	千香港・ドル 227,627 (△99)	百株 42,535.6	千香港・ドル 192,452
	シンガポール	百株 17,787 (2,093.13)	千シンガポール・ドル 11,615 (△444)	百株 14,922.13	千シンガポール・ドル 9,359
	ニュージーランド	百株 2,577.86 (-)	千ニュージーランド・ドル 1,704 (-)	百株 1,816.58	千ニュージーランド・ドル 1,007
	イギリス	百株 196,421.44 (△153.18)	千イギリス・ポンド 115,835 (1,106)	百株 178,461.82	千イギリス・ポンド 102,958

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 ユ 国 ロ	イスラエル	百株 1,689.86 (-)	千イスラエル・シュケル 7,297 (-)	百株 1,206.41	千イスラエル・シュケル 5,097
	イスラス	百株 12,180.84 (-)	千イス・フラン 103,265 (△222)	百株 11,124.7	千イス・フラン 89,715
	デンマーク	百株 3,322.56 (1,469.61)	千デンマーク・クローネ 197,176 (-)	百株 3,551.28	千デンマーク・クローネ 179,121
	ノルウェー	百株 3,334.59 (-)	千ノルウェー・クローネ 49,197 (-)	百株 2,771.78	千ノルウェー・クローネ 38,408
	スウェーデン	百株 20,824.18 (6,804.24)	千スウェーデン・クローナ 405,047 (-)	百株 17,585.4	千スウェーデン・クローナ 316,601
	アイルランド	百株 749.41 (-)	千ユーロ 5,589 (-)	百株 631.07	千ユーロ 4,649
	オランダ	百株 11,228.93 (950.19)	千ユーロ 62,517 (△86)	百株 9,414.88	千ユーロ 51,688
	ベルギー	百株 1,043.4 (-)	千ユーロ 6,196 (-)	百株 889.01	千ユーロ 5,172
	ルクセンブルグ	百株 1,209.38 (-)	千ユーロ 2,642 (-)	百株 854.02	千ユーロ 1,800
	フランス	百株 17,424.9 (1,088.41)	千ユーロ 102,391 (-)	百株 17,283.63	千ユーロ 91,357
国 ロ	ドイツ	百株 16,409.95 (1,451.76)	千ユーロ 87,638 (△343)	百株 15,207.49	千ユーロ 77,479
	ポルトガル	百株 824.54 (-)	千ユーロ 856 (-)	百株 406.68	千ユーロ 507
	スペイン	百株 31,251.38 (22,513.82)	千ユーロ 23,204 (△77)	百株 49,233.07	千ユーロ 19,370
	イタリア	百株 35,574.5 (-)	千ユーロ 17,142 (△2)	百株 36,788.57	千ユーロ 14,890
	フィンランド	百株 5,643.53 (-)	千ユーロ 8,720 (-)	百株 5,301.59	千ユーロ 7,189
オーストリア		百株 497.64 (-)	千ユーロ 2,000 (-)	百株 365.79	千ユーロ 1,468

(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) 新株予約権証券

	買付		売付	
	証券数	金額	証券数	金額
外国スイス	証券 —	千スイス・フラン —	証券 87,844 (—)	千スイス・フラン 28 (—)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 投資信託受益証券、投資証券

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,915 (—)	1,611 (—)	6,133 (—)	1,247 (—)
BOSTON PROPERTIES INC	4.07 (—)	473 (—)	2,216 (—)	274 (—)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	— (—)	— (—)	22,693 (—)	657 (—)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	81.1 (—)	686 (—)	58,509 (—)	493 (—)
PROLOGIS INC	46,303 (—)	6,342 (—)	40,623 (—)	5,636 (—)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,677 (—)	2,226 (—)	8,65 (—)	2,022 (—)
CAMDEN PROPERTY TRUST	12,453 (—)	1,811 (—)	11,656 (—)	1,653 (—)
EQUINIX INC	6,083 (—)	4,781 (—)	5,373 (—)	4,212 (—)
DUKE REALTY TRUST	12,617 (—)	708 (—)	9,24 (—)	546 (—)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28,217 (—)	5,245 (—)	25,02 (—)	4,595 (—)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,092 (—)	988 (—)	2,464 (—)	802 (—)
EQUITY RESIDENTIAL	30,821 (—)	2,566 (—)	31,532 (—)	2,583 (—)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23,858 (—)	795 (—)	19,455 (—)	665 (—)
SBA COMMUNICATIONS CORP	6,199 (—)	2,128 (—)	5,486 (—)	1,933 (—)
WELLTOWER INC	32,254 (—)	2,651 (—)	29,921 (—)	2,444 (—)
IRON MOUNTAIN INC	3,849 (—)	175 (—)	— (—)	— (—)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22,487 (—)	1,784 (—)	22,001 (—)	1,743 (—)
HOST HOTELS & RESORTS INC	44,413 (—)	716 (—)	32,749 (—)	518 (—)
MID AMERICA	5,789 (—)	1,109 (—)	4,944 (—)	931 (—)
REALTY INCOME CORP	41,631 (18.05)	2,829 (—)	35.88 (—)	2,454 (—)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
REGENCY CENTERS CORP	3,639	260	3,473	270
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	38,514	2,062	37,282	1,986
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	21,117	2,879	17,329	2,452
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	10,449	3,254	9,007	2,855
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	5.79	1,099	4,394	857
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	19,098	1,052	13,711	712
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	23,728	1,062	21,319	914
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	48,016	1,759	39,928	1,479
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	8,076	1,464	6,463	1,122
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	19.54	3,025	15,672	2,491
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	76,011	1,576	75,842	1,601
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGNC INVESTMENT CORP	50,845	783	52,553	814
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	23,054	1,081	17,984	838
	(△25,604)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	28,174	7,568	23,609	6,307
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	20,944	1,621	17,027	1,295
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	47,749	1,885	43,017	1,704
	(-)	(-)	(-)	(-)
ORION OFFICE REIT INC	-	-	5,738	100
	(5,738)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	43,226	1,246	32,427	906
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	4,337	241	4,071	223
	(-)	(-)	(-)	(-)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
MIRVAC GROUP	84,707	247	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	49.06	236	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	49,463	231	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	119.11	1,246	126.88	1,329
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	122.45	2,770	112,622	2,653
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	179,768	543	120.66	390
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
香港 LINK REIT	千口 212.6 (-)	千香港・ドル 14,716 (-)	千口 213.1 (-)	千香港・ドル 14,405 (-)
シンガポール CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	千口 295.4 (57,741)	千シンガポール・ドル 611 (89)	千口 291.6 (-)	千シンガポール・ドル 604 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INV'T	478 (-)	1,446 (△6)	522 (-)	1,533 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	- (-)	- (-)	192.1 (-)	272 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	473 (-)	849 (△4)	258.6 (-)	480 (-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	- (-)	- (△1)	- (-)	- (-)
イギリス BRITISH LAND CO PLC	千口 76,052 (-)	千イギリス・ポンド 389 (-)	千口 70,101 (-)	千イギリス・ポンド 371 (-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	18,185 (-)	127 (-)	- (-)	- (-)
SEGRO PLC	53.28 (-)	602 (-)	33,876 (-)	385 (-)
ユーロ(フランス) GECINA SA	千口 1,093 (-)	千ユーロ 145 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
KLEPIERRE	- (-)	- (△17)	- (-)	- (-)

(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。

#### (4) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円 213,419	百万円 216,105	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	744,105,008千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	572,165,051千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	1.30

(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 (2021年2月16日から2022年2月15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) 外国株式

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
AMAZON.COM INC	380.64	444.06	137,806	15,905,674	インターネット販売・通信販売		
ABBOTT LABORATORIES	1,585.92	1,727.2	21,206	2,447,661	ヘルスケア機器・用品		
AES CORP	567.35	654.52	1,404	162,118	独立系発電事業者・エネルギー販売業者		
ABIOMED INC	39.87	42.71	1,240	143,170	ヘルスケア機器・用品		
INT'L BUSINESS MACHINES CORP	798.02	873.09	11,363	1,311,548	情報技術サービス		
ADVANCED MICRO DEVICES	1,053.11	1,223.07	13,976	1,613,112	半導体・半導体製造装置		
ADOBE INC	429.77	464.19	22,003	2,539,594	ソフトウェア		
CHUBB LTD	406.4	429.3	8,674	1,001,252	保険		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	198.54	216.51	5,271	608,471	化学		
ALLEGHANY CORP	12.63	12.56	844	97,447	保険		
SAREPTA THERAPEUTICS INC	60.52	—	—	—	バイオテクノロジー		
ALLSTATE CORP	283.81	305.8	3,816	440,487	保険		
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	627.86	674.78	12,597	1,453,999	コングロマリット		
AMGEN INC	524.53	552.91	12,400	1,431,220	バイオテクノロジー		
HESS CORP	247.76	269.32	2,551	294,467	石油・ガス・消耗燃料		
AMERICAN EXPRESS CO	616.15	655.69	12,612	1,455,699	消費者金融		
AMERICAN ELECTRIC POWER	450.17	484.16	4,172	481,588	電力		
AFLAC INC	582.83	624.14	4,008	462,629	保険		
AMERICAN INT'L GROUP	754.5	830.45	4,898	565,422	保険		
AMERCO	9.29	9.29	536	61,889	陸運・鉄道		
ANALOG DEVICES	335.79	518.67	7,986	921,799	半導体・半導体製造装置		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	192.19	—	—	—	バイオテクノロジー		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	653.14	696.42	4,631	534,532	建設関連製品		
VALERO ENERGY CORP	374	422.88	3,794	437,912	石油・ガス・消耗燃料		
ANSYS INC	79.7	83.94	2,661	307,237	ソフトウェア		
APPLE INC	15,286.24	16,106.99	272,014	31,395,953	コンピュータ・周辺機器		
APPLIED MATERIALS INC	818.51	881.06	11,617	1,340,909	半導体・半導体製造装置		
ALBEMARLE CORP	95.36	111.8	2,545	293,797	化学		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	517.45	544.75	4,146	478,604	食品		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	92.78	—	—	—	電力		
AMEREN CORP	222.73	254.36	2,165	249,926	総合公益事業		
ARROW ELECTRONICS INC	66.51	62.95	784	90,508	電子装置・機器・部品		
AUTOLIV INC	75.7	—	—	—	自動車部品		
AUTODESK INC	198.42	214.23	4,860	561,042	ソフトウェア		
AUTOMATIC DATA PROCESSING	386.31	413.9	8,359	964,905	情報技術サービス		
AUTOZONE INC	21.6	20.86	4,014	463,378	専門小売り		
AVERY DENNISON CORP	76.27	80.95	1,471	169,841	容器・包装		
BALL CORP	288.47	315.98	2,915	336,548	容器・包装		
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,250.78	1,292.71	40,627	4,689,201	各種金融サービス		
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	702.98	794.62	4,884	563,772	資本市場		
BAXTER INTERNATIONAL INC	443.26	484.18	4,137	477,529	ヘルスケア機器・用品		
BECTON DICKINSON & CO	260.87	280.24	7,535	869,765	ヘルスケア機器・用品		
AMETEK INC	200.08	226.36	2,946	340,062	電気設備		
VERIZON COMM INC	3,685.67	4,048.08	21,564	2,488,930	各種電気通信サービス		
WR BERKLEY CORP	125.11	128.04	1,145	132,251	保険		
BEST BUY CO INC	215.6	212.38	2,137	246,697	専門小売り		
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	18.59	23.24	1,443	166,569	ライフサイエンス・ツール/サービス		
YUM! BRANDS INC	273.93	286.66	3,480	401,667	ホテル・レストラン・レジャー		

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
FIRSTENERGY CORP	478	518.27	2,111	243,701		電力	
BOEING CO	481.42	542.08	11,385	1,314,154		航空宇宙・防衛	
ROBERT HALF INTL INC	111.11	112.38	1,343	155,106		専門サービス	
BORGWARNER INC	219.38	209.23	894	103,262		自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,290.98	1,387.96	5,930	684,527		ヘルスケア機器・用品	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	117.19	123.82	1,104	127,492		航空貨物・物流サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	106.87	107.92	1,803	208,104		娯楽	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	22.08	22.29	3,156	364,326		医薬品	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,018.55	2,157.51	14,414	1,663,701		石油・ガス・消耗燃料	
ONEOK INC	392.84	420.2	2,643	305,158		保険	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	80.93	74.44	1,011	116,694		商社・流通業	
UNITED RENTALS INC	61.81	69.35	2,172	250,737		総合公益事業	
SEMPRA ENERGY	261.13	310.48	4,195	484,246		航空貨物・物流サービス	
FEDEX CORP	224.18	247.48	5,653	652,576		情報技術サービス	
VERISIGN INC	87.62	103.4	2,208	254,871		電子装置・機器・部品	
AMPHENOL CORP	262.07	581.23	4,377	505,221		飲料	
BROWN-FORMAN CORP	260.85	297.33	1,973	227,767		メディア	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	971.36	971.36	599	69,174		陸運・鉄道	
CSX CORP	686.59	2,203.61	7,474	862,723		石油・ガス・消耗燃料	
COTERRA ENERGY INC	314.16	785.16	1,823	210,517		食品	
CAMPBELL SOUP CO	166.23	203.34	895	103,336		コンピュータ・周辺機器	
SEAGATE TECHNOLOGY	196.41	—	—	—		飲料	
CONSTELLATION BRANDS INC	146.75	164.21	3,840	443,218		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CARDINAL HEALTH INC	247.18	290.05	1,516	175,054		ホテル・レストラン・レジャー	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	471.45	763.02	1,629	188,112		機械	
CATERPILLAR INC	486.12	532.89	10,651	1,229,446		チェックポイント・ソフトウェア	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	98.65	102.58	1,330	153,538		シトリク・システムズ	
CITRIX SYSTEMS INC	99.33	115.3	1,175	135,687		ルメン・テクノロジーズ	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	804.24	921.88	913	105,445		各種電気通信サービス	
CERNER CORP	272.58	285.28	2,614	301,809		ヘルスケア・テクノロジー	
JPMORGAN CHASE & CO	2,725.45	2,913.79	44,432	5,128,385		銀行	
CHURCH & DWIGHT CO INC	212.87	245.63	2,396	276,616		家庭用品	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	128.72	144.65	1,728	199,477		保険	
CINTAS CORP	80.99	89.31	3,308	381,917		商業サービス・用品	
CISCO SYSTEMS INC	3,769.58	4,107.04	21,841	2,520,915		通信機器	
CLOROX COMPANY	117.85	114.55	1,637	188,999		家庭用品	
COCA-COLA CO/THE	3,644.71	4,005.62	24,306	2,805,410		飲料	
COPART INC	186.28	203.22	2,494	287,871		商業サービス・用品	
COGNEX CORP	146.77	162.62	1,028	118,717		電子装置・機器・部品	
COLGATE-PALMOLIVE CO	712.97	784.14	6,215	717,346		家庭用品	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	256.86	265.14	4,542	524,311		ホテル・レストラン・レジャー	
MOLINA HEALTHCARE INC	52.03	55.04	1,692	195,352		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
NRG ENERGY, INC.	210.39	227.63	880	101,624		電力	
COMCAST CORP-CL A	4,081.73	4,460.29	21,141	2,440,183		メディア	
CONAGRA BRANDS INC	461.45	454.72	1,605	185,267		食品	
CONSOLIDATED EDISON INC	298.44	340.89	2,830	326,646		総合公益事業	
CMS ENERGY CORP	259.36	272.38	1,699	196,142		総合公益事業	
COOPER COS INC	50.31	47.32	1,851	213,742		ヘルスケア機器・用品	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	165.13	169.84	839	96,858		飲料	
CORNING INC	710.11	838.66	3,462	399,679		電子装置・機器・部品	
SEALED AIR CORP	138.7	133.82	847	97,785		容器・包装	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HEICO CORP-CL A	62.36	74.77	855	98,761		航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	137.18	139.26	3,055	352,714		機械
DR HORTON INC	322.07	327.87	2,719	313,905		家庭用耐久財
DANAHER CORP	572.81	625.65	16,986	1,960,569		ライフサイエンス・ツール／サービス
MOODY'S CORP	151.99	163.35	5,283	609,865		資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	470.43	512.62	4,420	510,252		情報技術サービス
TARGET CORP	449.86	474.94	9,905	1,143,330		複合小売り
DEERE & CO	267.97	286.89	11,110	1,282,327		機械
MORGAN STANLEY	1,216.65	1,330.94	13,651	1,575,650		資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	191.36	215.52	2,555	294,946		商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	34.38	412.01	2,718	313,810		専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,619.66	1,767.79	26,667	3,077,918		娯楽
DOLLAR TREE INC	219.16	231.67	3,172	366,222		複合小売り
DOVER CORP	126.52	141.72	2,283	263,614		機械
OMNICOM GROUP	196.63	203.13	1,721	198,675		メディア
DTE ENERGY CO	177.93	184.19	2,137	246,713		総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	642.05	753.03	7,526	868,712		電力
DARDEN RESTAURANTS INC	109.02	133.37	1,912	220,774		ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	614.91	628.16	3,654	421,817		インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	6,976.37	7,384.33	35,016	4,041,603		銀行
CITIGROUP INC	1,867.17	1,979.43	13,155	1,518,383		銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	122.29	133.26	1,608	185,631		化学
EATON CORP PLC	364.97	390.25	5,938	685,414		電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	246.39	268.13	3,809	439,702		ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	214.2	226.45	701	80,945		メディア
ECOLAB INC	230.5	252.97	4,627	534,056		化学
PERKINELMER INC	97.55	118.35	2,143	247,422		ライフサイエンス・ツール／サービス
ELECTRONIC ARTS INC	251.42	275.61	3,676	424,357		娯楽
SALESFORCE.COM INC	815.12	953.48	19,679	2,271,445		ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	22.43	22.43	411	47,526		保険
EMERSON ELECTRIC CO	522.99	583.88	5,486	633,277		電気設備
ATMOS ENERGY CORP	115.03	124.29	1,317	152,034		ガス
ENTERGY CORP	171.95	188.13	1,965	226,910		電力
EOG RESOURCES INC	540.41	567.51	6,436	742,858		石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	103.22	116.63	2,577	297,470		専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	202.15	226.64	6,886	794,834		パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	139.42	163.66	1,751	202,138		航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	3,789.44	4,127.07	32,595	3,762,184		石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	114.16	121.83	1,410	162,763		化学
NEXTERA ENERGY INC	1,752.42	1,911.83	14,323	1,653,210		電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	32.46	38.74	1,549	178,868		資本市場
FAIR ISAAC CORP	24.82	28.1	1,439	166,186		ソフトウェア
ASSURANT INC	55.23	55.23	894	103,262		保険
FASTENAL CO	504.82	549.13	2,851	329,071		商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	636.46	666.81	3,216	371,193		銀行
M&T BANK CORP	114.32	121.75	2,196	253,519		銀行
FISERV INC	514.04	576.52	5,643	651,379		情報技術サービス
FORD MOTOR CO	3,423.19	3,805.63	6,644	766,923		自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	237.13	276.05	839	96,859		資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	1,269.73	1,425.79	6,052	698,577		金属・鉱業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	11.92	917	105,937		銀行

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ARTHUR J GALLAGHER & CO	179.22	200.01	3,067	354,010		保険	
DENTSPLY SIRONA INC	183.86	202.22	1,082	124,963		ヘルスケア機器・用品	
GENERAL DYNAMICS CORP	215.99	231.98	4,898	565,410		航空宇宙・防衛	
GENERAL MILLS INC	538.66	588.18	3,977	459,124		食品	
GENUINE PARTS CO	133.93	136.11	1,729	199,608		販売	
GILEAD SCIENCES INC	1,130.1	1,218.49	7,446	859,439		バイオテクノロジー	
GARTNER INC	75.22	88.55	2,555	294,941		情報技術サービス	
MCKESSON CORP	142.89	150.01	4,060	468,642		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
NVIDIA CORP	552.38	2,433.72	59,059	6,816,599		半導体・半導体製造装置	
GENERAL ELECTRIC CO	7,857.77	1,070.26	10,338	1,193,294		コングロマリット	
W.W. GRAINGER INC	42.34	41.48	1,934	223,289		商社・流通業	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	—	309.23	1,708	197,194		ソフトウェア	
HALLIBURTON CO	774.83	838.43	2,713	313,152		エネルギー・設備・サービス	
MONSTER BEVERAGE CORP	345.68	386.22	3,189	368,076		飲料	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	293.78	329.9	11,884	1,371,687		資本市場	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	189.69	193.75	4,259	491,575		航空宇宙・防衛	
HASBRO INC	113.83	121.84	1,152	132,977		レジャー用品	
HENRY SCHEIN INC	115.16	143.58	1,088	125,599		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HEICO CORP	36.23	35.96	500	57,725		航空宇宙・防衛	
HERSHEY FOODS CORP	136.22	152.45	3,100	357,810		食品	
HP INC	1,251.84	1,162.73	4,245	489,972		コンピュータ・周辺機器	
F5 INC	55.29	55.57	1,076	124,301		通信機器	
CROWN HOLDINGS INC NPR	120.24	123.36	1,460	168,523		容器・包装	
JUNIPER NETWORKS INC	279.39	352.9	1,192	137,632		通信機器	
HOLOGIC INC	240.09	243.1	1,709	197,280		ヘルスケア機器・用品	
HOME DEPOT INC	963.81	1,028.3	36,150	4,172,538		専門小売り	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	162.88	198.15	1,783	205,857		バイオテクノロジー	
HORMEL FOODS CORP	262.54	290.21	1,377	158,972		食品	
CENTERPOINT ENERGY INC	490.65	611.05	1,644	189,789		総合公益事業	
LENNOX INTERNATIONAL INC	29.13	34.21	898	103,747		建設関連製品	
HUMANA INC	119.37	125.74	5,276	609,019		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	75.44	87.52	1,684	194,444		陸運・鉄道	
HUNTINGTON Bancshares INC	938.57	1,419.2	2,228	257,172		銀行	
BIOGEN INC	144.18	143.44	3,071	354,493		バイオテクノロジー	
IDEX CORP	72.94	73.32	1,405	162,211		機械	
ILLINOIS TOOL WORKS	275.8	307.86	6,747	778,781		機械	
INTUIT INC	233.97	266.2	14,083	1,625,495		ソフトウェア	
IDEXX LABORATORIES INC	77.82	82.25	4,157	479,914		ヘルスケア機器・用品	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	109.6	—	—	—		バイオテクノロジー	
TRANTE TECHNOLOGIES PLC	218.91	230.51	3,491	402,939		建設関連製品	
INTEL CORP	3,802.57	3,947.83	18,783	2,168,023		半導体・半導体製造装置	
INT'L FLAVORS & FRAGRANCES	199.06	239.91	3,157	364,433		化学	
INTERNATIONAL PAPER CO	319.83	343.88	1,589	183,489		容器・包装	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	353.17	369.48	1,296	149,599		メディア	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	110.33	131.48	1,586	183,121		専門サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	68.74	77.48	1,318	152,187		情報技術サービス	
INCYTE CORP	159.42	179.58	1,185	136,840		バイオテクノロジー	
JOHNSON & JOHNSON	2,351.55	2,569.27	42,547	4,910,787		医薬品	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	334.76	328	2,284	263,717		保険	
KLA CORPORATION	141.3	147.87	5,399	623,224		半導体・半導体製造装置	
DEVON ENERGY CORP	560.14	624.62	3,264	376,761		石油・ガス・消耗燃料	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
KELLOGG CO	219.54	265.78	1,720	198,629		食品	
KEYCORP	875.97	916.12	2,373	273,968		銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	308.61	326.7	4,324	499,137		家庭用品	
BLACKROCK INC/NEW YORK	136.68	147.89	11,244	1,297,808		資本市場	
KROGER CO	712.62	684.81	3,128	361,137		食品・生活必需品小売	
LAM RESEARCH CORP	130.86	138.76	7,746	894,075		半導体・半導体製造装置	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	33.02	44.17	1,841	212,560		電子装置・機器・部品	
PACKAGING CORP OF AMERICA	84.38	105.55	1,551	179,108		容器・包装	
AKAMAI TECHNOLOGIES	141.53	152.64	1,688	194,939		情報技術サービス	
PLUG POWER INC	—	526.24	1,129	130,405		電気設備	
LENNAR CORP	258.81	264.83	2,399	276,903		家庭用耐久財	
ELI LILLY & CO	771.11	791.98	18,586	2,145,309		医薬品	
BATH & BODY WORKS INC	—	269.67	1,483	171,282		専門小売	
LINCOLN NATIONAL CORP	180.9	170.02	1,206	139,210		保険	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	633.18	709.53	15,183	1,752,448		航空貨物・物流サービス	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	284.52	292.04	3,948	455,755		ライフサイエンス・ツール/サービス	
LOCKHEED MARTIN CORP	225.05	244.24	9,451	1,090,875		航空宇宙・防衛	
LOEWS CORP	217.59	223.94	1,368	158,003		保険	
LOWE'S COS INC	679.92	674.34	15,236	1,758,621		専門小売	
DOMINION ENERGY INC	733.73	787.03	6,197	715,357		総合公益事業	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	458.5	387	1,727	199,440		ホテル・レストラン・レジャー	
MCCORMICK & CO INC	215.14	249.05	2,500	288,603		食品	
MCDONALD'S CORPORATION	664.19	727.78	18,441	2,128,485		ホテル・レストラン・レジャー	
S&P GLOBAL INC	215.72	233.63	8,894	1,026,606		資本市場	
EVEREST RE GROUP LTD	34.16	42.82	1,255	144,868		保険	
MARKEL CORPORATION	12.01	14.47	1,787	206,344		保険	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	561.91	605.91	6,527	753,400		ヘルスケア機器・用品	
MARSH & MCLENNAN COS	442.08	495.58	7,518	867,778		保険	
MASCO CORP	231.51	232.33	1,330	153,518		建設関連製品	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	52.58	58.93	2,174	251,016		建設資材	
METLIFE INC	679.99	714.43	5,010	578,288		保険	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	235.91	—	—	—		半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC	1,200.14	1,313.85	13,441	1,551,475		ヘルスケア機器・用品	
ACTIVISION BLIZZARD INC	696.43	756.57	6,166	711,684		娯楽	
CVS HEALTH CORP	1,175.45	1,287.35	13,259	1,530,435		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MERCK & CO. INC.	2,257.06	2,465.91	18,856	2,176,453		医薬品	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	366.51	413.6	2,426	280,029		半導体・半導体製造装置	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	85.88	92.82	2,531	292,129		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MICROSOFT CORP	6,425.29	6,957.86	205,256	23,690,747		ソフトウェア	
MICRON TECH INC	999.6	1,090.85	9,802	1,131,390		半導体・半導体製造装置	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	218.94	533.22	3,795	438,133		半導体・半導体製造装置	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	612.87	—	—	—		半導体・半導体製造装置	
3M CO	515.39	566.66	8,953	1,033,446		コングロマリット	
MOHAWK INDUSTRIES INC	49.76	59.63	857	98,984		家庭用耐久財	
ENTEGRIS INC	—	136.39	1,719	198,413		半導体・半導体製造装置	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	—	54.58	1,787	206,274		ライフサイエンス・ツール/サービス	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	150.06	163.01	3,485	402,275		通信機器	
KANSAS CITY SOUTHERN	83.46	—	—	—		陸運・鉄道	
ILLUMINA INC	131.34	142.46	4,693	541,705		ライフサイエンス・ツール/サービス	
XCEL ENERGY INC	465.91	516.15	3,427	395,571		電力	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	80.58	97.13	840	96,995		バイオテクノロジー	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
NETAPP INC	198.04	212.2	1,862	215,016	コンピュータ・周辺機器		
NEWELL BRANDS INC	333.17	404.89	1,008	116,457	家庭用耐久財		
NEWMONT CORP	726.65	774.43	4,983	575,190	金属・鉱業		
NOVAVAX INC	—	78.86	631	72,916	バイオテクノロジー		
NVR INC	3.05	3.38	1,682	194,199	家庭用耐久財		
NIKE INC-CL B	1,116.09	1,245.17	17,630	2,034,896	繊維・アパレル・贅沢品		
NORDSON CORP	46.44	47.87	1,063	122,719	機械		
NORFOLK SOUTHERN CORP	229.57	242.35	6,598	761,594	陸運・鉄道		
EVERSOURCE ENERGY	305.69	328.72	2,702	311,911	電力		
NISOURCE INC	314.27	420.35	1,194	137,836	総合公益事業		
NORTHERN TRUST CORP	173.65	200.11	2,431	280,647	資本市場		
NORTHROP GRUMMAN CORP	136.98	148.6	5,804	669,934	航空宇宙・防衛		
WELLS FARGO & CO	3,503.46	4,001.7	23,149	2,671,953	銀行		
NUCOR CORP	288.6	282.85	3,319	383,107	金属・鉱業		
CHENIERE ENERGY INC	191.9	231.2	2,702	311,922	石油・ガス・消耗燃料		
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	417.51	430.6	6,680	771,043	消費者金融		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	852.06	902.66	3,721	429,554	石油・ガス・消耗燃料		
OLD DOMINION FREIGHT LINE	87.12	95.78	2,815	324,959	陸運・鉄道		
OGE ENERGY CORP	160.28	—	—	—	電力		
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	65.76	66.72	4,410	509,055	専門小売り		
ORACLE CORP	1,782.61	1,632.21	12,886	1,487,336	ソフトウェア		
PACCAR INC	304.46	359.38	3,341	385,677	機械		
PTC INC	94.33	110.92	1,241	143,271	ソフトウェア		
EXELON CORP	853.23	956.45	4,036	465,860	電力		
PARKER HANNIFIN CORP	119	125.93	3,792	437,702	機械		
PAYCHEX INC	298.42	313.87	3,718	429,216	情報技術サービス		
ALIGN TECHNOLOGY INC	65.29	73.03	3,692	426,235	ヘルスケア機器・用品		
PPL CORPORATION	713.2	734.82	2,083	240,444	電力		
PEPSICO INC	1,235.16	1,349.24	22,491	2,596,007	飲料		
PENTAIR PLC	155.64	163.39	963	111,189	機械		
PFIZER INC	4,971.81	5,460.72	27,194	3,138,775	医薬品		
ESSENTIAL UTILITIES INC	229.37	215.43	972	112,190	水道		
CONOCOPHILLIPS	1,233.91	1,306.12	11,957	1,380,137	石油・ガス・消耗燃料		
PG&E CORP	1,239.99	1,524.96	1,720	198,540	電力		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	181.44	222.38	4,982	575,071	石油・ガス・消耗燃料		
ALTRIA GROUP INC	1,673.74	1,796.13	8,996	1,038,412	タバコ		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	382.89	415.17	8,493	980,277	銀行		
BROWN & BROWN INC	203.08	217.93	1,437	165,962	保険		
GARMIN LTD	123.65	145.29	1,754	202,506	家庭用耐久財		
PPG INDUSTRIES INC	206.85	230.64	3,442	397,363	化学		
IPG PHOTONICS CORP	33.53	33.53	491	56,765	電子装置・機器・部品		
COSTCO WHOLESALE CORP	394.44	429.9	21,777	2,513,503	食品・生活必需品小売り		
T ROWE PRICE GROUP INC	200.07	218.51	3,149	363,527	資本市場		
QUEST DIAGNOSTICS	119.26	124.93	1,627	187,870	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		
PROCTER & GAMBLE CO	2,223.79	2,369.3	37,136	4,286,284	家庭用品		
PROGRESSIVE CORP	528.87	569.36	6,047	697,964	保険		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	445.03	490.59	3,177	366,752	総合公益事業		
PULTE GROUP INC	243.05	238.14	1,138	131,438	家庭用耐久財		
GLOBAL PAYMENTS INC	271.25	283.31	4,163	480,553	情報技術サービス		
QUALCOMM INC	1,010	1,096.16	18,100	2,089,204	半導体・半導体製造装置		
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	107.44	197.29	2,159	249,299	資本市場		

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EXACT SCIENCES CORP	139.11	179.82	1,408	162,572		バイオテクノロジー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	40.52	—	—	—		保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	95.04	101.93	6,355	733,568		バイオテクノロジー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	60.97	—	—	—		保険
RESMED INC	132.86	140.92	3,292	379,982		ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,226.62	1,379.88	7,985	921,670		銀行
SEAGEN INC	102.96	128.63	1,601	184,853		バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	343.83	370.32	1,719	198,409		保険
ROSS STORES INC	311.97	342.98	3,233	373,184		専門小売り
ROLLINS INC	185.67	191.56	590	68,186		商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	91.27	103.18	4,562	526,605		コングロマリット
ROCKWELL AUTOMATION INC	107.18	111.67	2,996	345,900		電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	158.79	212.92	1,761	203,359		ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	110.04	128.97	1,090	125,843		化学
ACCENTURE PLC-CL A	568.7	618.55	20,172	2,328,341		情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,278.63	1,364.94	9,027	1,041,978		食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	117.94	124.53	2,725	314,573		保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	221.48	241.52	4,124	476,042		保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	557.29	599.27	6,681	771,220		情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	36.87	39.84	10,141	1,170,579		ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,309.4	1,365.54	5,366	619,409		エネルギー・設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,376.29	1,406.74	12,342	1,424,598		資本市場
POOL CORP	35.32	43.36	1,955	225,677		販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	181.87	200.7	2,347	271,004		ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	133.04	135.81	1,369	158,052		食品
SEI INVESTMENTS CO	106.53	102.94	611	70,575		資本市場
ANTHEM INC	226.07	238.09	10,570	1,220,045		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	138.36	149.22	2,091	241,431		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	250.38	257.42	1,909	220,428		保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	73.88	243.75	6,592	760,958		化学
CENTENE CORP	509.9	563.86	4,624	533,726		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	45.32	56.17	3,491	402,946		銀行
SMITH (A.O.) CORP	113.51	140.37	999	115,403		建設関連製品
SNAP-ON INC	48.25	57.83	1,218	140,643		機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	372.26	375.64	4,349	502,066		保険
ADVANCE AUTO PARTS	62.26	56.94	1,277	147,397		専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	350.41	362.4	2,176	251,220		電力
SOUTHERN CO	923.98	1,035.27	6,817	786,847		電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,215.55	1,291.44	8,136	939,065		銀行
SOUTHWEST AIRLINES	117.91	132.2	599	69,243		旅客航空輸送業
AT&T INC	6,363.97	6,960.38	16,739	1,932,097		各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,721.63	1,886.45	25,782	2,975,771		石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	140.26	153.85	2,528	291,806		機械
STATE STREET CORP	324.04	351.58	3,469	400,437		資本市場
STARBUCKS CORP	1,049.03	1,144.57	10,718	1,237,175		ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	175.47	219.29	1,351	155,937		金属・鉱業
STRYKER CORP	304.36	331.3	8,297	957,686		ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	394.98	430.24	17,062	1,969,299		娯楽
NORTONLIFELOCK INC	489.55	552.31	1,628	187,927		ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	97.93	158.87	873	100,797		陸運・鉄道
SYNOPSYS INC	133.81	147.52	4,351	502,221		ソフトウェア

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SYSCO CORP	421.71	496.62	4,071	469,965		食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	105.44	346.96	9,754	1,125,856		ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	40.02	44.66	1,417	163,577		ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	883.22	1,057.57	901	103,999		医薬品
TERADYNE INC	142.84	154.54	1,735	200,327		半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	818.5	895.92	14,556	1,680,054		半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	194.86	206.83	1,418	163,668		航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	354.62	382.78	21,481	2,479,363		ライフサイエンス・ツール／サービス
GLOBE LIFE INC	105.78	91.68	953	110,081		保険
DAVITA INC	64.97	64.97	738	85,224		ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	104.62	109.61	2,388	275,707		専門小売り
BIO-TECHNE CORP	—	42.2	1,745	201,472		ライフサイエンス・ツール／サービス
TRIMBLE INC	224.42	260.37	1,714	197,891		電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	34.73	39.35	1,838	212,228		ソフトウェア
TYSON FOODS INC	249.8	277.88	2,636	304,307		食品
UGI CORP	200.72	184.69	692	79,917		ガス
UNION PACIFIC CORP	605.64	637.38	15,459	1,784,353		陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,372.1	1,472.36	13,776	1,590,126		航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	849.87	920.02	43,645	5,037,592		ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	61.53	77.37	1,022	118,073		ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	81.39	—	—	—		織維・アパレル・贅沢品
VF CORP	287.12	356.87	2,137	246,686		織維・アパレル
VIACOMCBS INC	493.63	570.34	1,997	230,597		メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	239.38	250.92	5,802	669,669		バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	121.7	126.76	2,330	269,042		建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	668.71	704.44	3,336	385,067		食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,264.14	1,502.63	20,127	2,323,142		食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	383.57	406.53	5,763	665,208		商業サービス・用品
WATERS CORP	52.11	57.5	1,828	211,078		ライフサイエンス・ツール／サービス
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	204.18	1,248	144,132		銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	70.09	71.03	2,725	314,551		ライフサイエンス・ツール／サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	103.06	99.44	1,366	157,733		食品
VAIL RESORTS INC	35.9	41.8	1,134	130,957		ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	258.67	293.01	1,548	178,768		コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	162.57	170.97	1,495	172,627		機械
WHIRLPOOL CORP	56.56	57.37	1,128	130,194		家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	153.31	159.24	2,145	247,626		半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	86.39	120.04	1,105	127,549		ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	100.97	110.34	1,897	218,960		資本市場
CME GROUP INC	321.8	348.92	8,345	963,193		資本市場
WILLIAMS COS INC	1,125.35	1,163.01	3,498	403,777		石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	236.91	287.85	1,547	178,643		販売
ALLIANT ENERGY CORP	228.29	238.72	1,357	156,694		電力
WEC ENERGY GROUP INC	290.02	305.23	2,735	315,763		総合公益事業
CARMAX INC	142.09	152.87	1,696	195,780		専門小売り
XILINX INC	214	253.18	4,934	569,595		半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	1,081.5	1,168.23	7,942	916,757		専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	45.61	56.09	2,391	276,060		電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,087	1,087	620	71,638		不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	206	204	1,228	141,815		コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	—	—	—		コングロマリット

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	102.39	108.82	1,617	186,717	バイオテクノロジー		
SIGNATURE BANK	—	56.1	1,858	214,564	銀行		
CBRE GROUP INC	296.17	323.38	3,175	366,564	不動産管理・開発		
LIBERTY GLOBAL PLC	127.32	145.97	404	46,634	各種電気通信サービス		
REGIONS FINANCIAL CORP	855.82	974.23	2,388	275,716	銀行		
DOMINO'S PIZZA INC	36.41	38.08	1,640	189,305	ホテル・レストラン・レジャー		
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	37.37	40.44	1,752	202,255	半導体・半導体製造装置		
T-MOBILE US INC	499.8	607.01	7,618	879,336	無線通信サービス		
LAS VEGAS SANDS CORP	302.77	367.69	1,699	196,109	ホテル・レストラン・レジャー		
MOSAIC CO/THE	325.92	385.15	1,718	198,353	化学		
MARKETAXESS HOLDINGS INC	32.09	39.59	1,466	169,221	資本市場		
CELANESE CORP	115.88	109.17	1,683	194,260	化学		
DEXCOM INC	87.06	93.5	3,805	439,225	ヘルスケア機器・用品		
DISCOVERY INC-A	153.62	130.68	384	44,374	メディア		
EXPEDIA GROUP INC	115.08	136.45	2,690	310,524	ホテル・レストラン・レジャー		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	202.05	1,443	166,649	化学		
AMERIPRISE FINANCIAL INC	106.14	108.96	3,279	378,479	資本市場		
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	340.23	943	108,933	各種電気通信サービス		
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	487.85	551.66	6,886	794,888	資本市場		
LIVE NATION	138.04	153.12	1,765	203,717	娯楽		
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	23.26	27.13	4,242	489,726	ホテル・レストラン・レジャー		
TRANSDIGM GROUP INC	47.45	50.93	3,212	370,770	航空宇宙・防衛		
MASTERCARD INC	798.24	858.46	32,120	3,707,306	情報技術サービス		
WESTERN UNION CO	353.67	448.68	888	102,537	情報技術サービス		
OWENS CORNING	99.65	97.4	881	101,705	建設関連製品		
LEIDOS HOLDINGS INC	128.66	123.03	1,074	124,052	専門サービス		
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	173.5	188	21,747	ホテル・レストラン・レジャー		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	99.59	117.8	1,706	196,931	情報技術サービス		
DELTA AIR LINES INC	147.23	147.23	617	71,320	旅客航空輸送業		
INSULET CORP	55.66	64.81	1,591	183,687	ヘルスケア機器・用品		
DISCOVER FINANCIAL	269.75	286.45	3,556	410,498	消費者金融		
TE CONNECTIVITY LTD	289.3	318.46	4,570	527,568	電子装置・機器・部品		
MASIMO CORP	45.05	54.04	1,213	140,083	ヘルスケア機器・用品		
LULULEMON ATHLETICA INC	108.17	114.58	3,593	414,783	繊維・アパレル・贅沢品		
VMWARE INC	74.64	213.2	2,634	304,100	ソフトウェア		
MERCADOLIBRE INC	40.41	43.13	4,826	557,050	インターネット販売・通信販売		
ULTA BEAUTY INC	45.38	52.74	1,912	220,754	専門小売り		
INVESCO LTD	334.43	369.04	842	97,200	資本市場		
MSCI INC	76.17	79.74	4,249	490,523	資本市場		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,392.7	1,520.6	16,611	1,917,245	タバコ		
VISA INC	1,505.8	1,644.41	37,055	4,276,903	情報技術サービス		
KEURIG DR PEPPER INC	484.8	709.52	2,703	312,011	飲料		
AMERICAN WATER WORKS CO INC	169.15	173.37	2,566	296,213	水道		
DISCOVERY INC-C	304.21	303.88	891	102,871	メディア		
MARATHON PETROLEUM CORP	595.87	618.96	4,899	565,521	石油・ガス・消耗燃料		
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	117.44	127.87	1,141	131,707	建設関連製品		
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,859.92	1,960.57	3,370	388,990	石油・ガス・消耗燃料		
XYLEM INC	172.22	170.83	1,524	175,995	機械		
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	246.36	261.91	2,623	302,749	化学		
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.84	34.82	631	72,847	航空宇宙・防衛		
SPLUNK INC	146.41	156.99	1,961	226,442	ソフトウェア		

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
EPAM SYSTEMS INC	53.33	53.99	2,310	266,678	情報技術サービス		
ZILLION GROUP INC	53.66	76.58	439	50,690	不動産管理・開発		
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	148.14	—	—	—	資本市場		
HCA HEALTHCARE INC	236.31	250.49	5,897	680,635	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		
VERISK ANALYTICS INC	136.44	146.24	2,805	323,756	専門サービス		
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	52.57	61.52	875	101,049	医薬品		
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	78.06	73.99	1,810	208,963	情報技術サービス		
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	149.86	169.47	2,910	335,986	銀行		
NXP SEMICONDUCTOR NV	243.75	258.51	4,805	554,614	半導体・半導体製造装置		
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	116.67	136.87	1,017	117,423	専門サービス		
LEAR CORP	46.81	52.16	872	100,683	自動車部品		
CBOE GLOBAL MARKETS INC	104.72	105.27	1,269	146,507	資本市場		
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	202.43	215.54	1,619	186,930	ソフトウェア		
DOLLAR GENERAL CORP	218.25	225.66	4,526	522,502	複合小売り		
FORTINET INC	121.46	134.08	4,161	480,282	ソフトウェア		
HORIZON PHARMA PLC	189.86	204.15	1,969	227,359	バイオテクノロジー		
TESLA INC	667.04	819.66	71,782	8,285,141	自動車		
GENERAC HOLDINGS INC	54.02	59.93	1,620	187,073	電気設備		
ENPHASE ENERGY INC	101.63	122.17	1,758	202,953	半導体・半導体製造装置		
GENERAL MOTORS CO	1,164.31	1,267.27	6,133	707,938	自動車		
XPO LOGISTICS INC	76.14	—	—	—	陸運・鉄道		
ALLY FINANCIAL INC	338.57	374.66	1,811	209,037	消費者金融		
VOYA FINANCIAL INC	135.03	—	—	—	各種金融サービス		
APTIV PLC	236.97	260.18	3,554	410,209	自動車部品		
PHILLIPS 66	399.51	424.28	3,840	443,280	石油・ガス・消耗燃料		
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	71.72	86.28	815	94,077	ソフトウェア		
META PLATFORMS INC	2,150.14	2,321.43	50,537	5,833,041	インターラクティブ・メディアおよびサービス		
IQVIA HOLDINGS INC	168.96	185.72	4,455	514,244	ライフサイエンス・ツール/サービス		
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	157.27	2,051	236,830	石油・ガス・消耗燃料		
SERVICENOW INC	172.89	192.63	11,164	1,288,600	ソフトウェア		
PALO ALTO NETWORKS INC	84.6	94.41	4,918	567,745	ソフトウェア		
WORKDAY INC	155.26	186.02	4,333	500,218	ソフトウェア		
ABBVIE INC	1,581.52	1,721.56	24,618	2,841,445	バイオテクノロジー		
ZOETIS INC	426.6	460.53	9,046	1,044,111	医薬品		
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	383.72	854	98,675	メディア		
CDW CORP	127.68	129.43	2,279	263,072	電子装置・機器・部品		
HOWMET AEROSPACE INC	381.27	404.34	1,377	159,001	航空宇宙・防衛		
TWILIO INC	119	158.35	3,099	357,694	情報技術サービス		
COUPA SOFTWARE INC	62.46	77.32	1,010	116,586	ソフトウェア		
SNAP INC	822.23	1,027.74	4,071	469,979	インターラクティブ・メディアおよびサービス		
TRADE DESK INC A	36.48	418.52	3,202	369,585	ソフトウェア		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	195.46	221.57	1,380	159,298	娯楽		
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	83.24	83.24	421	48,671	メディア		
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	142.05	143.46	725	83,767	メディア		
OKTA INC	106.51	116.92	2,214	255,607	情報技術サービス		
BLACK KNIGHT INC	130.42	167.75	1,099	126,877	ソフトウェア		
BAKER HUGHES CO	572.74	779.09	2,223	256,639	エネルギー設備・サービス		
LAMB WESTON HOLDINGS INC	131.81	—	—	—	食品		
ALTEL USA INC-A	215.06	—	—	—	メディア		
BROADCOM INC	360.27	398.94	23,081	2,664,109	半導体・半導体製造装置		
RINGCENTRAL INC-CLASS A	67.99	73.05	1,228	141,782	ソフトウェア		

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MONGODB INC	41.88	61.01	2,623	302,746		情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	56.02	68.61	1,540	177,852		専門小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	358.24	404.49	1,016	117,322		医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	118.32	132.96	3,030	349,786		ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	690.05	829.81	2,961	341,826		インターネット・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	132.14	159.85	906	104,647		電気設備
EVERGY INC	210.39	223.98	1,386	160,048		電力
ALLEGION PLC	90.22	89.24	1,055	121,880		建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	114.54	133.6	934	107,863		ソフトウェア
STERIS PLC	73.9	96.49	2,185	252,305		ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	152.47	185.2	2,236	258,176		ソフトウェア
WIX.COM LTD	49.18	55.67	626	72,363		情報技術サービス
DROPBOX INC	281.7	281.7	687	79,301		ソフトウェア
KKR & CO INC	472.67	503.37	3,048	351,905		資本市場
PERRIGO CO PLC	105.53	—	—	—		医薬品
FUTU HOLDINGS LTD ADR	—	47.58	209	24,229		資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	155.78	209	2,969	342,760		ソフトウェア
MODERNA INC	240.31	334.13	4,760	549,439		バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	258.78	266.16	4,030	465,195		ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	186.32	213.87	769	88,816		ホテル・レストラン・レジャー
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	—	571.24	1,013	117,030		娯楽
CIGNA CORP	331.16	331.11	7,457	860,793		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	205.86	277.83	1,628	187,913		コンピュータ・周辺機器
DOW INC	647.07	722.56	4,395	507,309		化学
AMCOR PLC	1,461.49	1,618.22	1,872	216,098		容器・包装
PINTEREST INC	420.97	521.77	1,289	148,810		インターネット・メディアおよびサービス
PELOTON INTERACTIVE INC	178.7	254.18	834	96,314		レジャー用品
FOX CORP-A	317.51	346.81	1,479	170,802		メディア
FOX CORP-B	130.09	150.8	584	67,445		メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	—	408.46	672	77,599		専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	130.78	182.31	3,292	380,022		ソフトウェア
CHEWY INC	65.86	90.68	477	55,084		インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	445.09	486.39	1,719	198,507		ライフサイエンス・ツール/サービス
LYFT INC	—	245.89	983	113,494		陸運・鉄道
DYNATRACE INC	159.49	194.17	829	95,740		ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	132.18	225.54	2,380	274,791		情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	70.65	98.86	815	94,067		資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	750.77	798.71	3,577	412,906		建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	375.35	422.26	3,367	388,679		機械
INMODE LTD	—	55.11	251	29,005		ヘルスケア機器・用品
UBER TECHNOLOGIES INC	838.27	1,191.09	4,119	475,528		陸運・鉄道
CORTEVA INC	686.39	717.05	3,649	421,258		化学
MATCH GROUP INC	215.66	253.22	2,881	332,540		インターネット・メディアおよびサービス
SLACK TECHNOLOGIES INC	325.12	—	—	—		ソフトウェア
BILL.COM HOLDINGS INC	—	78.3	1,879	216,897		ソフトウェア
BLACKSTONE INC	585.87	665.78	8,069	931,353		資本市場
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	32.02	263	30,379		インターネット販売・通信販売
CARLYLE GROUP INC	125.09	170.2	796	91,877		資本市場
10X GENOMICS INC	53.12	76.67	685	79,130		ライフサイエンス・ツール/サービス
DATADOG INC	130.21	183.67	3,018	348,408		ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	—	209.24	2,220	256,309		コンピュータ・周辺機器

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
UPSTART HOLDINGS INC	—	20.8	217	25,111		消費者金融
INGERSOLL RAND INC	312.82	405.29	2,180	251,668		機械
PAYCOM SOFTWARE INC	43.3	52.5	1,815	209,490		ソフトウェア
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	—	177.12	1,109	128,076		自動車
PPD INC	108.28	—	—	—		ライフサイエンス・ツール／サービス
ASANA INC	—	71.34	489	56,535		ソフトウェア
UNITY SOFTWARE INC	—	53.67	577	66,647		ソフトウェア
AON PLC	208.07	220.29	6,165	711,619		保険
SOFI TECHNOLOGIES INC	—	547.34	656	75,808		消費者金融
BENTLEY SYSTEMS INC	—	160.02	624	72,086		ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	—	39.76	776	89,602		資本市場
AFFIRM HOLDINGS INC	—	92.04	402	46,423		情報技術サービス
IAC/INTERACTIVECORP	70.64	72.5	954	110,189		インターネット・メディアおよびサービス
AIRBNB INC	—	227.11	3,853	444,730		ホテル・レストラン・レジャー
ZENDESK INC	100.21	119.15	1,386	160,062		ソフトウェア
CONSTELLATION ENERGY CORP	—	318.81	1,533	177,030		電力
ROYALTY PHARMA PLC	103.61	355.64	1,390	160,538		医薬品
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—	235.77	1,304	150,621		インターネット・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,128.66	1,248.58	1,876	216,598		医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	218.14	1,771	204,518		ホテル・レストラン・レジャー
DRAFTKINGS INC	146.71	334.59	742	85,732		ホテル・レストラン・レジャー
SNOWFLAKE INC	28.05	203.94	5,937	685,283		情報技術サービス
DOORDASH INC	—	109.22	1,060	122,418		インターネット販売・通信販売
OAK STREET HEALTH INC	—	91.44	155	17,973		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	50.42	218.59	2,684	309,870		通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	371.77	2,439	281,616		各種金融サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	—	1,532.71	2,032	234,576		ソフトウェア
IHS MARKIT LTD	344.11	367.14	3,957	456,805		専門サービス
FNF GROUP	245.67	254.51	1,216	140,415		保険
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	794.17	5,380	621,017		半導体・半導体製造装置
ROBINHOOD MARKETS INC	—	198.72	265	30,619		資本市場
LUCID GROUP INC	—	421.36	1,156	133,449		自動車
CATALENT INC	146.73	174.39	1,725	199,207		医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	454.91	599.85	2,641	304,840		消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	415.03	435.54	2,337	269,748		銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57	34.57	529	61,119		ソフトウェア
WAYFAIR INC	55.43	69.59	989	114,224		インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	174.07	174.12	2,889	333,468		電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	37.41	43.07	2,351	271,369		ソフトウェア
QORVO INC	101.68	111.07	1,436	165,771		半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	29.47	24.25	361	41,762		メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	131.89	145.2	2,207	254,786		メディア
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	170.18	—	—	—		化学
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	42.57	49.59	1,235	142,645		半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	145.4	165.74	1,332	153,745		情報技術サービス
KORNIT DIGITAL LTD	—	49.78	489	56,485		機械
ETSY INC	102.37	117.13	1,670	192,850		インターネット販売・通信販売
TRANSUNION	167.6	189.9	1,910	220,453		専門サービス
BLOCK INC	335.06	489.39	5,463	630,602		情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	477.57	506.8	4,019	463,981		化学
CARVANA CO	53.47	77.35	1,087	125,550		専門小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(アメリカ)				千アメリカ・ドル	千円	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	百株	百株	215.37	1,227	141,640	飲料
TELADOC HEALTH INC	182.96	104.54	147.9	1,047	120,928	ヘルスケア・テクノロジー
WESTROCK CO	227.78	262.97	1,204	1,204	138,981	容器・包装
KRAFT HEINZ CO	568.79	640.01	2,213	2,213	255,516	食品
NOVOCURE LTD	74.08	97.72	770	770	88,967	ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP	259.81	329.64	2,144	2,144	247,496	機械
WASTE CONNECTIONS INC	247.78	261.86	3,126	3,126	360,903	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	269	293.14	79,456	79,456	9,170,832	インターネット・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,162.57	1,231.01	2,076	2,076	239,694	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	1,000.53	1,086.55	12,399	12,399	1,431,174	情報技術サービス
SEA LTD ADR	—	132.32	1,709	1,709	197,273	娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC	352.77	343.46	1,165	1,165	134,545	各種金融サービス
SUNRUN INC	100	162.13	366	366	42,291	電気設備
ZILLOW GROUP INC-C	133.76	156.65	909	909	104,993	不動産管理・開発
ALPHABET INC-CL C	267.96	280.94	76,022	76,022	8,774,501	インターネット・メディアおよびサービス
ZSCALER INC	61.93	77.59	2,129	2,129	245,764	ソフトウェア
CABLE ONE INC	3.92	5.42	813	813	93,881	メディア
LINDE PLC	470.49	503.98	14,792	14,792	1,707,329	化学
ATHENE HOLDING LTD	118.47	—	—	—	—	保険
ROKU INC	95.87	119.01	1,892	1,892	218,432	娯楽
AVALARA INC	71.02	78.24	776	776	89,636	ソフトウェア
CHARTER COMMUNICATIONS INC	129.32	124.76	7,584	7,584	875,421	メディア
VISTRA CORP	380.32	397.58	858	858	99,119	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数	・金額				
	銘柄	・	率			
	278,491.28	309,096.71	3,769,273	435,049,586		
	592銘柄	608銘柄	—	<67.7%>		
(カナダ)				千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	百株	455.67	3,042	275,894	金属・鉱業	
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	205.78	—	—	—	食品・生活必需品小売	
BARRICK GOLD CORP	784.79	1,559.61	4,663	422,885	金属・鉱業	
ATCO LTD	71.93	1,736.87	—	—	総合公益事業	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	212.72	251	22,780	電気設備	
BANK OF MONTREAL	584.93	630.76	9,381	850,695	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	1,094.36	1,191.19	11,020	999,374	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	291.32	326	3,339	302,800	銀行	
BCE INC	149.59	72.75	483	43,836	各種電気通信サービス	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	1,159.24	1,379.3	9,951	902,415	資本市場	
BAUSCH HEALTH COS INC	281.92	281.92	888	80,604	医薬品	
SAPUTO INC	253.95	253.95	755	68,485	食品	
BLACKBERRY LTD	466.71	466.71	409	37,158	ソフトウェア	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	561.93	622.22	1,103	100,037	総合公益事業	
CGI INC	198.59	229.85	2,458	222,955	情報技術サービス	
CCL INDUSTRIES INC	153.58	153.58	981	89,019	容器・包装	
CAE INC	250.06	304.43	967	87,730	航空宇宙・防衛	
CAMECO CORP	326.27	346.76	959	87,006	石油・ガス・消耗燃料	
ROGERS COMM-CL B	315.43	373.08	2,458	222,979	無線通信サービス	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	409.56	436.21	7,043	638,742	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,007.58	1,152.17	7,725	700,530	石油・ガス・消耗燃料	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	48.62	58.89	1,068	96,912	複合小売	
CANADIAN UTILITIES LTD	91.19	97.93	343	31,116	総合公益事業	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	634.82	691.09	10,810	980,316	陸運・鉄道	
YAMANA GOLD INC	843.17	—	—	—	金属・鉱業	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	159.11	208.15	1,025	92,997	織維・アパレル・贅沢品		
OPEN TEXT CORP	252.61	258.68	1,456	132,063	ソフトウェア		
EMPIRE CO LTD	150.93	150.93	589	53,431	食品・生活必需品小売り		
KINROSS GOLD CORP	1,278.09	1,185.75	867	78,707	金属・鉱業		
ITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	99.63	94.52	690	62,637	商業サービス・用品		
FORTIS INC	452.28	452	2,584	234,406	電力		
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	496.94	569.14	2,014	182,646	金属・鉱業		
TELUS CORP	318.9	318.9	1,011	91,698	各種電気通信サービス		
GREAT WEST LIFECO INC	252.5	252.5	1,003	91,037	保険		
IMPERIAL OIL LTD	215.42	220.66	1,241	112,593	石油・ガス・消耗燃料		
ENBRIDGE INC	1,830.5	1,964.79	10,372	940,544	石油・ガス・消耗燃料		
IGM FINANCIAL INC	60.69	53.66	243	22,086	資本市場		
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,716.81	1,892.5	5,119	464,210	保険		
LOBLAW CO LTD	151.36	154.86	1,560	141,480	食品・生活必需品小売り		
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—	788.73	4,152	376,563	食品・生活必需品小売り		
MAGNA INTERNATIONAL INC	270.24	302.02	2,946	267,161	自動車部品		
SUN LIFE FINANCIAL INC	518.08	570.83	3,900	353,695	保険		
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	23.98	23.2	1,505	136,482	保険		
METRO INC	207.6	227.64	1,534	139,171	食品・生活必需品小売り		
EMERA INC	224.33	238.36	1,401	127,049	電力		
ONEX CORP	66.46	64.89	595	54,028	資本市場		
PAN AMERICAN SILVER CORP	187.66	187.66	572	51,901	金属・鉱業		
POWER CORP OF CANADA	465.51	564.39	2,363	214,337	保険		
QUEBECOR INC-B	160.42	160.42	493	44,760	メディア		
ROYAL BANK OF CANADA	1,270.82	1,394.86	20,225	1,834,045	銀行		
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	122.36	906.81	8,307	753,304	陸運・鉄道		
SHAW COMM INC-B	434.84	426.01	1,603	145,405	メディア		
SUNCOR ENERGY INC	1,308.06	1,431.08	5,415	491,050	石油・ガス・消耗燃料		
LUNDIN MINING CORP	643.1	643.1	767	69,629	金属・鉱業		
TECK RESOURCES LTD-CL B	410.16	438.24	1,997	181,172	金属・鉱業		
THOMSON REUTERS CORP	150.49	167.4	2,169	196,700	専門サービス		
TOROMONT INDUSTRIES LTD	74.17	93.88	1,066	96,699	商社・流通業		
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	1,612.38	1,778.19	18,896	1,713,564	銀行		
TC ENERGY CORP	824.24	949.79	6,328	573,863	石油・ガス・消耗燃料		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	72	92.98	1,158	105,064	紙製品・林産品		
WESTON (GEORGE) LTD	61.84	78.86	1,101	99,878	食品・生活必需品小売り		
INTACT FINANCIAL CORP	125.15	179.01	3,242	294,021	保険		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	409.93	470.07	2,539	230,265	金属・鉱業		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	18.64	19.31	4,105	372,330	ソフトウェア		
FRANCO-NEVADA CORP NPR	176.52	186.23	3,394	307,771	金属・鉱業		
B2GOLD CORP	1,016.75	—	—	—	金属・鉱業		
CI FINANCIAL CORP	202.85	—	—	—	資本市場		
TOURMALINE OIL CORP	—	323.64	1,497	135,762	石油・ガス・消耗燃料		
KEYERA CORP	166.68	237.72	737	66,911	石油・ガス・消耗燃料		
PARKLAND CORP	144.97	144.97	503	45,616	石油・ガス・消耗燃料		
ALTAGAS LTD	239.44	240.53	666	60,395	ガス		
PEMBINA PIPELINE CORP	504.1	564.42	2,386	216,447	石油・ガス・消耗燃料		
DOLLARAMA INC	269.06	264.38	1,684	152,738	複合小売り		
CENOVUS ENERGY INC W/I	1,197.09	1,344.22	2,683	243,300	石油・ガス・消耗燃料		
NORTHLAND POWER INC	175.68	234.9	853	77,364	独立系発電事業者・エネルギー販売業者		
TMX GROUP LTD	50.58	47.97	638	57,875	資本市場		

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)							
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	百株	百株	千カナダ・ドル	千円			
IVANHOE MINES LTD	218.4	—	—	—		金属・鉱業	
INTER PIPELINE LTD	—	619.3	699	63,402		金属・鉱業	
NUTRIEN LTD	418.63	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料	
TFI INTERNATIONAL INC	506.3	555.64	5,191	470,751		化学	
SSR MINING INC	—	89.99	1,223	110,963		陸運・鉄道	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	180	—	—	—		金属・鉱業	
WSP GLOBAL INC	—	113.46	415	37,676		ソフトウェア	
IA FINANCIAL CORP INC	101.94	129.91	2,103	190,733		建設・土木	
GFL ENVIRONMENTAL INC	122.78	116.6	947	85,939		保険	
NUVEI CORP	164.85	164.85	630	57,193		商業サービス・用品	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	—	49.6	391	35,496		情報技術サービス	
AIR CANADA	108.45	108.45	477	43,290		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	107.22	179.4	434	39,433		旅客航空輸送業	
SHOPIFY INC	251.76	264.43	1,922	174,299		ホテル・レストラン・レジャー	
FIRSTSERVICE CORP	97.39	109.46	11,810	1,070,947		情報技術サービス	
CANOPY GROWTH CORP	35.03	32.93	636	57,700		不動産管理・開発	
HYDRO ONE LTD	186.34	186.34	199	18,113		医薬品	
	273.4	357.38	1,151	104,448		電力	
小計	株数・金額	35,759.37	38,115.54	251,560	22,811,543		
	銘柄数<比率>	87銘柄	86銘柄	—	<3.5%>		
(オーストラリア)							
RAMSAY HEALTH CARE LTD	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円			
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	168.54	171.34	1,089	89,695		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
WESTPAC BANKING CORPORATION	2,577.13	2,757.53	7,776	640,061		銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	3,180.22	3,565.97	8,515	700,913		銀行	
TELSTRA CORP LTD	1,535.17	1,622.22	3,690	303,769		金属・鉱業	
AMP LTD	3,644.09	3,896.81	1,582	130,223		各種電気通信サービス	
ASX LTD	3,024.14	—	—	—		各種金融サービス	
BHP GROUP LTD	191.62	189.26	1,569	129,172		資本市場	
AMPOL LTD	2,637.49	3,064.96	14,812	1,219,254		金属・鉱業	
COMPUTERSHARE LT	209.46	209.46	677	55,773		石油・ガス・消耗燃料	
CSL LIMITED	380.4	516.04	1,189	97,947		情報技術サービス	
REA GROUP LTD	407.66	464.24	11,307	930,681		バイオテクノロジー	
TRANSURBAN GROUP	57.45	58.28	789	64,970		インターネット・メディアおよびサービス	
COCA-COLA AMATIL LTD	2,508.16	2,937.86	3,769	310,248		運送インフラ	
COCHLEAR LTD	526.93	—	—	—		飲料	
ORIGIN ENERGY LTD	55.33	58.75	1,116	91,912		ヘルスケア機器・用品	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,328.6	1,463.6	908	74,811		電力	
RIO TINTO LIMITED	1,589.4	1,728.88	17,295	1,423,610		銀行	
APA GROUP	338.59	359.15	4,366	359,410		金属・鉱業	
ARISTOCRAT LEISU	1,182.05	1,182.05	1,182	97,294		ガス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	517.17	620.13	2,494	205,345		ホテル・レストラン・レジャー	
TPG TELECOM LTD	2,251.8	2,694.3	1,271	104,674		保険	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	287.19	—	—	—		各種電気通信サービス	
ORICA LTD	398.39	462.46	2,159	177,725		建設資材	
CIMIC GROUP LTD	413.11	413.11	608	50,052		化学	
LEND LEASE CORP LTD	87.09	—	—	—		建設・土木	
BLUESCOPE STEEL LTD	621.16	621.16	623	51,332		不動産管理・開発	
SYDNEY AIRPORT	496.93	469.46	882	72,606		金属・鉱業	
MACQUARIE GROUP LTD	1,160.56	1,422.58	1,240	102,104		運送インフラ	
SUNCORP GROUP LTD	298.21	337.36	6,552	539,312		資本市場	
	1,174.54	1,202.9	1,411	116,139		保険	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,998.19	3,188.61	9,702	798,649		銀行	
NEWCREST MINING LTD	732.02	868.79	2,059	169,478		金属・鉱業	
OIL SEARCH LTD	1,978.95	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	622.82	1,074.83	570	46,977		旅客航空輸送業	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,448.68	1,336.24	1,697	139,682		保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	934.04	966.92	870	71,628		金属・鉱業	
REECE LTD	—	303.19	605	49,811		商社・流通業	
SANTOS LTD	1,596.18	3,333.93	2,573	211,848		石油・ガス・消耗燃料	
SONIC HEALTHCARE	401.48	406.13	1,523	125,390		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	84.06	247.11	655	53,940		石油・ガス・消耗燃料	
TABCORP HOLDINGS LTD	2,056.49	2,145.97	1,115	91,850		ホテル・レストラン・レジャー	
WESFARMERS LTD	1,015.75	1,094.81	5,897	485,443		複合小売り	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	861.96	906.41	2,486	204,645		石油・ガス・消耗燃料	
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,117.03	1,204.4	4,084	336,163		食品・生活必需品小売り	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	99.95	155.53	283	23,337		資本市場	
SEEK LTD	358.36	361.4	1,003	82,636		インターネット・メディアおよびサービス	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	—	60.86	615	50,664		ホテル・レストラン・レジャー	
AUSNET SERVICES	1,650.66	1,650.66	427	35,189		電力	
AGL ENERGY LTD	490.76	—	—	—		総合公益事業	
BRAMBLES LTD	1,271.66	1,300.28	1,224	100,818		商業サービス・用品	
CROWN RESORTS LTD	328.61	328.61	415	34,188		ホテル・レストラン・レジャー	
EVOLUTION MINING LTD	1,409.64	1,502.3	594	48,967		金属・鉱業	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,501.5	1,381.66	500	41,168		陸運・鉄道	
TREASURY WINE ESTATES LTD	576.67	759.03	806	66,411		飲料	
XERO LTD	104.98	140.63	1,532	126,170		ソフトウェア	
IDP EDUCATION LTD	—	228.52	627	51,650		各種消費者サービス	
AFTERPAY LTD	183.22	—	—	—		情報技術サービス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	—	1,195.74	749	61,710		食品・生活必需品小売り	
MEDIBANK PVT LTD	2,831.54	2,831.54	900	74,114		保険	
SOUTH32 LTD(AUD)	4,123.45	4,093.17	1,854	152,619		金属・鉱業	
COLES GROUP LTD	1,210.32	1,227.26	2,002	164,857		食品・生活必需品小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	136.04	136.04	621	51,116		ソフトウェア	
小計	株数・金額	65,373.59	66,920.43	146,885	12,090,177		
	銘柄数<比率>	58銘柄	55銘柄	—	<1.9%>		
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円		
ASM PACIFIC TECH	329	—	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	1,640	2,692	39,827		不動産管理・開発	
BANK OF EAST ASIA	1,038.6	—	—	—		銀行	
CLP HOLDINGS LTD	1,345	1,620	12,935	191,319		電力	
PCCW LTD	3,310	—	—	—		各種電気通信サービス	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	495	535	2,725	40,314		電力	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,090.4	1,164.4	50,930	753,267		資本市場	
MTR CORP	1,260	1,375	5,878	86,937		陸運・鉄道	
HANG SENG BANK LTD	657	758	12,726	188,229		銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,154.5	1,204.5	4,185	61,905		不動産管理・開発	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,345	1,460	7,285	107,751		電力	
HONG KONG & CHINA GAS	9,132.92	11,754.56	14,223	210,358		ガス	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,970	2,000	9,150	135,328		ホテル・レストラン・レジャー	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,175	3,535	11,241	166,258		銀行	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,630.66	1,630.66	5,348	79,105		不動産管理・開発	
SINO LAND CO	2,554	5,054	5,195	76,841		不動産管理・開発	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)							
SUN HUNG KAI PROPERTIES	百株	百株	千香港・ドル	千円			
SWIRE PACIFIC LTD A	1,085	1,385	13,510	199,822	不動産管理・開発		
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	495	495	2,393	35,397	不動産管理・開発		
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,285	1,320	17,608	260,434	機械		
SJM HOLDINGS LTD	1,660	1,660	3,585	53,031	建設関連製品		
WYNN MACAU LTD	1,560	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー		
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	1,244	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー		
AIA GROUP LTD	—	2,172	3,492	51,655	専門小売り		
HKT TRUST / HKT LTD	10,872.27	11,750.27	102,462	1,515,418	保険		
SANDS CHINA LTD	2,890	4,450	4,841	71,607	各種電気通信サービス		
SITC INTERNATIONAL CO LTD	1,988	2,520	5,544	81,995	ホテル・レストラン・レジャー		
SWIRE PROPERTIES LTD	—	1,330	4,176	61,765	海運業		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,042	1,042	2,188	32,363	不動産管理・開発		
ESR CAYMAN LTD	1,497.5	1,517.5	5,455	80,685	不動産管理・開発		
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	1,474	2,038	5,319	78,670	不動産管理・開発		
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	2,300	2,300	1,812	26,805	電力		
WH GROUP LTD	1,506	1,506	3,471	51,340	飲料		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	8,970	8,970	5,139	76,017	食品		
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,553.32	2,563.32	15,315	226,521	コングロマリット		
	2,248.32	1,863.32	9,745	144,130	不動産管理・開発		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	76,797.49	82,613.53	350,582	5,185,109		
		33銘柄	30銘柄	—	<0.8%>		
(シンガポール)							
SINGAPORE TECH ENG	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円			
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,250	1,095	418	35,843	航空宇宙・防衛		
CITY DEVELOPMENTS LTD	1,557	1,766	6,569	562,942	銀行		
SINGAPORE EXCHANGE LTD	364	364	259	22,270	不動産管理・開発		
CAPITALAND LTD	689	674	656	56,253	資本市場		
GENTING SINGAPORE LTD	3,088.15	—	—	—	不動産管理・開発		
KEPPEL CORP LTD	4,268	7,242	557	47,783	ホテル・レストラン・レジャー		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,349	1,349	814	69,819	コングロマリット		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,716.53	3,209.53	4,281	366,882	銀行		
SINGAPORE AIRLINES LTD	6,768.22	8,084.22	2,061	176,647	各種電気通信サービス		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,608.5	1,580.5	823	70,560	旅客航空輸送業		
UOL GROUP LIMITED	1,024	1,113	3,639	311,869	銀行		
VENTURE CORP LTD	405	405	295	25,334	不動産管理・開発		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	210	421	762	65,368	電子装置・機器・部品		
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	1,814	1,814	823	70,570	食品		
	—	2,952.15	1,068	91,575	不動産管理・開発		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	27,111.4	32,069.4	23,033	1,973,722		
		14銘柄	14銘柄	—	<0.3%>		
(ニュージーランド)							
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円			
RYMAN HEALTHCARE LTD	1,102.26	1,102.26	796	60,909	運送インフラ		
A2 MILK CO LTD	298.94	494.49	462	35,337	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		
FISHER & PAYKEL	550.91	—	—	—	食品		
SPARK NEW ZEALAND LTD	490.44	573.88	1,607	122,856	ヘルスケア機器・用品		
mighty RIVER POWER LTD	1,596.23	2,629.43	1,156	88,425	各種電気通信サービス		
MERIDIAN ENERGY LTD	617.34	617.34	357	27,319	電力		
	1,241.62	1,241.62	607	46,404	独立系発電事業者・エネルギー販売業者		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,897.74	6,659.02	4,988	381,252		
		7銘柄	6銘柄	—	<0.1%>		
(イギリス)							
ANTOFAGASTA PLC	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円			
	317.98	352.61	489	76,550	金属・鉱業		

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
		外 貨 建 金 額				
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASHTEAD GROUP	389.16	430.03	2,081	325,256	325,256	商社・流通業
SEVERN TRENT PLC	219.33	294.58	833	130,251	130,251	水道
BHP GROUP PLC	1,844.54	—	—	—	—	金属・鉱業
BARCLAYS PLC	16,088.89	16,512.19	3,228	504,363	504,363	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	822.83	922.35	570	89,174	89,174	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	7,955.07	8,502.62	1,638	255,992	255,992	各種電気通信サービス
BHP GROUP LTD	—	2,059.88	5,184	810,060	810,060	金属・鉱業
BUNZL PLC	288.34	355.08	945	147,792	147,792	商社・流通業
AVIVA PLC	3,634.64	3,815.43	1,644	256,928	256,928	保険
CRODA INTERNATIONAL	125.68	136.93	1,002	156,689	156,689	化学
DIAGEO PLC	2,096.47	2,277.84	8,273	1,292,591	1,292,591	飲料
SCHRODERS PLC	113.54	113.54	366	57,316	57,316	資本市場
DCC PLC	78.98	106.84	679	106,132	106,132	コングロマリット
NATIONAL GRID PLC	3,068.81	3,522.37	3,786	591,610	591,610	総合公益事業
KINGFISHER PLC	1,971.59	2,114.6	672	105,095	105,095	専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	2,737.49	3,096.99	1,858	290,324	290,324	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,065.85	2,127.07	7,251	1,132,924	1,132,924	タバコ
HALMA PLC	319.01	342.01	796	124,505	124,505	電子装置・機器・部品
NEXT PLC	114.67	131.97	944	147,590	147,590	複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	877.08	896.52	1,596	249,468	249,468	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	191.07	191.07	337	52,705	52,705	化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,075.54	1,255.2	4,540	709,436	709,436	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,564.43	1,721.99	3,067	479,301	479,301	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	18,255.85	19,905.53	11,111	1,736,024	1,736,024	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,146.92	5,733.2	1,559	243,645	243,645	保険
UNILEVER PLC	2,351.36	2,528.12	9,632	1,504,925	1,504,925	パーソナル用品
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	2,302.12	—	—	—	—	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	677.14	677.14	707	110,504	110,504	水道
RSA INSURANCE GROUP LTD	954.87	—	—	—	—	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	311.66	322.09	604	94,507	94,507	食品
PEARSON PLC	650.09	637.46	398	62,267	62,267	メディア
PERSIMMON PLC	281.26	336.88	823	128,690	128,690	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,268.96	2,544.6	2,994	467,937	467,937	保険
RIO TINTO PLC	1,010.08	1,091.55	6,245	975,851	975,851	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	24,232.37	27,067.74	3,694	577,267	577,267	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	645.58	692.96	4,091	639,322	639,322	家庭用品
RELX PLC	1,741.63	1,892.62	4,237	662,078	662,078	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,697.66	1,934.06	963	150,605	150,605	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	6,709.69	7,958.64	936	146,354	146,354	航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	4,230.54	5,723.46	1,388	216,941	216,941	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	497.89	483.93	727	113,602	113,602	資本市場
SSE PLC	886.46	999.67	1,524	238,187	238,187	電力
BP PLC	18,382.94	19,568.09	7,838	1,224,761	1,224,761	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC (THE)	1,084.48	924.78	631	98,598	98,598	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	403.17	354	545	85,203	85,203	コングロマリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	65.74	76.48	916	143,151	143,151	機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,400.93	2,427.25	1,335	208,654	208,654	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	64,953.56	69,189.54	3,577	558,885	558,885	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	3,467.94	3,467.94	527	82,466	82,466	家庭用耐久財
TESCO PLC	8,605.34	8,098.05	2,392	373,751	373,751	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	886.51	1,019.75	1,348	210,628	210,628	資本市場

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
		外貨建金額				
(イギリス)						
SMITH & NEPHEW PLC	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	769.28	880.29	1,061	165,869		医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,499.85	4,896.01	7,692	1,201,893		資本市場
WPP PLC	275.89	317.95	2,185	341,476		メディア
ASTRAZENECA PLC	1,115.98	1,134.03	1,353	211,465		医薬品
WHITBREAD PLC	1,175.51	1,508.4	12,641	1,975,170		ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC	185.94	187.44	599	93,743		専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	138.42	161.39	833	130,213		織維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	389.5	387.64	760	118,888		ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC	166.52	162.86	822	128,549		食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	1,902.05	1,828.62	507	79,225		保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	158.93	200.87	608	95,093		家庭用耐久財
SHELL PLC-A SHS	115.81	105.59	431	67,358		石油・ガス・消耗燃料
SHELL PLC-B SHS	3,777.76	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,238.58	—	—	—		医薬品
AVEVA GROUP PLC	182	180.34	350	54,831		ソフトウェア
ABRDN PLC	104.08	104.08	278	43,548		資本市場
EXPERIAN PLC	2,063.13	2,063.13	489	76,492		専門サービス
MONDI PLC	803.76	893.61	2,560	400,004		紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	471.7	458.75	855	133,638		資本市場
FRESNILLO PLC NPR	280.11	353.12	460	71,998		金属・鉱業
OACADO GROUP PLC	173.85	—	—	—		食品・生活必需品小売り
INFORMA PLC	427.89	449.09	584	91,250		メディア
GLENCORE PLC	1,493.58	1,515.66	922	144,073		金属・鉱業
ENTAIN PLC	8,804.08	9,681.28	4,086	638,469		金属・鉱業
EVRAZ PLC	496.18	581.26	979	152,979		ホテル・レストラン・レジャー
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	487.65	—	—	—		金属・鉱業
COCA-COLA HBC AG	1,126.94	—	—	—		保険
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	152.08	202.33	486	76,026		飲料
FERGUSON PLC	517.21	565.61	371	58,077		保険
M&G PLC	205.31	216.07	2,367	369,827		商社・流通業
JD SPORTS FASHION PLC	2,049.4	2,591.17	549	85,907		各種金融サービス
SHELL PLC	320.86	2,354.9	396	61,996		専門小売り
AUTO TRADER GROUP PLC	—	7,503.11	15,047	2,351,019		石油・ガス・消耗燃料
MELROSE INDUSTRIES PLC	980.62	1,046.24	667	104,323		インターネット・メディアおよびサービス
	4,246.75	4,701.29	714	111,648		コングロマリット
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	266,360.93	284,167.37	184,216	28,781,938	
		85銘柄	79銘柄	—	<4.5%>	
(イスラエル)						
BANK HAPOALIM BM	百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円		銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,023.59	1,077.44	3,565	126,397		銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	1,307.03	1,436.45	4,918	174,370		航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	17.6	21.98	1,238	43,910		銀行
ICL GROUP LTD	1,021.34	1,061.43	2,259	80,115		化学
NICE LTD	494.11	680.48	2,206	78,236		ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	55.35	61.29	5,225	185,261		銀行
AZRIELI GROUP	104.44	167.84	2,047	72,594		不動産管理・開発
	44.14	44.14	1,226	43,488		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,067.6	4,551.05	22,688	804,375	
		8銘柄	8銘柄	—	<0.1%>	
(スイス)						
CREDIT SUISSE GROUP AG	百株	百株	千スイス・フラン	千円		資本市場
LOGITECH INTL-REG	2,257.7	2,530.13	2,103	262,754		コンピュータ・周辺機器
	144.29	180.08	1,314	164,244		

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円		
NESTLE SA-REGISTERED	2,570.32	2,745.36	32,203	4,023,451		食品	
CIE FINANC RICHEMONT	474.14	508.16	6,654	831,395		織維・アパレル・贅沢品	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	628.85	680.16	23,275	2,907,987		医薬品	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	34.67	41.22	917	114,639		機械	
SIKA INHABER	123.63	138.38	4,097	511,933		化学	
SGS SA-REG	5.4	6.13	1,579	197,291		専門サービス	
NOVARTIS AG-REG SHS	1,981.27	2,138.86	16,937	2,116,187		医薬品	
BALOISE HOLDING AG -R	42.59	42.59	683	85,405		保険	
BARRY CALLEBAUT AG	2.65	3.29	687	85,909		食品	
CLARIANT AG-REG	199.79	199.79	335	41,935		化学	
SWISSCOM AG-REG	24.89	24.19	1,325	165,621		各種電気通信サービス	
ABB LTD	1,657.76	1,605.91	5,042	630,017		電気設備	
ADECCO GROUP AG-REG	129.44	140.95	657	82,169		専門サービス	
GEBERIT AG	31.81	35.39	2,109	263,528		建設関連製品	
LONZA GROUP AG-REG	68.69	71.69	4,322	540,104		ライフサイエンス・ツール／サービス	
LINDT & SPRUENGLI PART	0.95	1.1	1,108	138,533		食品	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.09	0.1	1,031	128,813		食品	
GIVAUDAN-REG	8.12	9.01	3,230	403,566		化学	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	135.85	147.34	6,527	815,503		保険	
ROCHE HOLDING AG-BEARER	—	36.04	1,338	167,235		医薬品	
HOLCIM LTD	478.95	511.47	2,593	323,988		建設資材	
TEMENOS GROUP	57.23	67.53	730	91,290		ソフトウェア	
BACHEM HOLDING AG	—	5	252	31,547		ライフサイエンス・ツール／サービス	
SONOVA HOLDING AG	46.98	52.1	1,661	207,583		ヘルスケア機器・用品	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	45.18	49.34	1,248	156,024		海運業	
STRAUmann HOLDING AG	9.19	11.25	1,553	194,109		ヘルスケア機器・用品	
THE SWATCH GROUP AG-B	24.41	29.91	859	107,325		織維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	45.92	254	31,755		織維・アパレル・贅沢品	
SCHINDLER NAMEN	16.63	14.94	330	41,326		機械	
SWISS LIFE HOLDING AG	27.61	30.53	1,806	225,737		保険	
BANQUE CANTONALE VAUD	25	—	—	—		銀行	
VIFOR PHARMA AG	46.45	52.56	856	107,039		医薬品	
EMS-CHEMIE HOLDING	8.27	6.16	562	70,305		化学	
SWISS PRIME SITE AG	83.37	80.4	717	89,653		不動産管理・開発	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	16.58	21.76	2,706	338,205		資本市場	
JULIUS BAER GROUP LTD	201.18	210.08	1,222	152,707		資本市場	
SWISS RE LTD	248.71	292.13	2,864	357,906		保険	
ALCON INC	429.61	485.73	3,446	430,635		ヘルスケア機器・用品	
UBS GROUP AG	3,314.28	3,427.79	6,535	816,493		資本市場	
VAT GROUP AG	—	24.12	819	102,400		機械	
小計	株 銘 柄 数 ・ 金 額 数 < 比 率 >	15,648.45	16,704.59	148,505	18,554,267		
		39銘柄	41銘柄	—	<2.9%>		
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
CARLSBERG AS-B	99.74	104.57	10,765	188,826		飲料	
A P MOLLER A/S	5.68	5.27	11,936	209,367		海運業	
AP MOLLER MAERSK A	2.55	3.41	7,311	128,235		海運業	
DANSKE BANK A/S	593.05	687.25	9,002	157,912		銀行	
GENMAB A/S	61.9	62.51	13,745	241,103		バイオテクノロジー	
NOVOZYMES-B SHS	177.4	191.32	7,444	130,572		化学	
ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	8.13	8.13	1,990	34,908		建設関連製品	
NOVO NORDISK A/S-B	1,540.44	1,640.82	105,521	1,850,840		医薬品	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(デンマーク)							
GN STORE NORD A/S	百株	百株	千円				
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	128.95	104.48	67,072	ヘルスケア機器・用品			
COLOPLAST-B	181.27	979.91	279,814	電気設備			
DSV A/S	107.34	119.22	191,630	ヘルスケア機器・用品			
DEMAN A/S	190.49	198.61	439,284	航空貨物・物流サービス			
H LUNDBECK A/S	107.39	107.39	50,349	ヘルスケア機器・用品			
TRYG A/S	48.4	—	—	医薬品			
PANDORA A/S	111.07	357.84	95,403	保険			
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	82.51	92.65	116,648	織維・アパレル・贅沢品			
AMBU A/S B	93.36	89.84	75,228	化学			
ORSTED A/S	141.56	141.56	29,919	ヘルスケア機器・用品			
	164.71	192.05	220,775	電力			
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,845.94	5,086.83	257,006	4,507,892		
		19銘柄	18銘柄	—	<0.7%>		
(ノルウェー)							
MOWI ASA	百株	百株	千円				
DNB ASA	435.37	432.02	132,094	食品			
NORSK HYDRO ASA	807.09	—	—	銀行			
TELENOR ASA	1,290.36	1,290.36	129,802	金属・鉱業			
SCHIBSTED ASA	630.38	674.35	120,364	各種電気通信サービス			
ORKLA ASA	75.37	75.37	22,702	メディア			
EQUINOR ASA	652.83	694.4	76,207	食品			
YARA INTERNATIONAL ASA	831.49	943.06	335,611	石油・ガス・消耗燃料			
AKER BP ASA	151.93	151.93	87,496	化学			
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	—	152.17	53,688	石油・ガス・消耗燃料			
ADEVINTA ASA	166.83	294.84	81,411	保険			
DNB BANK ASA	222.65	222.65	24,023	インターネット・メディアおよびサービス			
SCHIBSTED ASA	74.45	895.96	247,043	銀行			
		74.45	1,514	19,686	メディア		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,338.75	5,901.56	102,317	1,330,132		
		11銘柄	12銘柄	—	<0.2%>		
(スウェーデン)							
ATLAS COPCO AB-A SHS	百株	百株	千円				
ATLAS COPCO AB-B SHS	564.89	636.97	389,856	機械			
ERICSSON LM-B SHS	360.51	401.9	214,937	機械			
GETINGE AB-B SHS	2,649.68	2,794.5	395,763	通信機器			
INVESTOR AB-A SHS	—	244.21	106,604	ヘルスケア機器・用品			
LUNDBERGS B	73.82	73.82	141,833	各種金融サービス			
SKF AB-B SHS	348.49	322.28	42,702	各種金融サービス			
SANDVIK AB	1,034	1,143.71	74,484	機械			
SKANDINAViska ENSKILDA BAN-A	1,449.9	1,664.38	327,635	機械			
SKANSKA AB-B SHS	316.53	319.68	246,890	銀行			
SWEDBANK AB	798.25	893.78	93,779	建設・土木			
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	529.45	543.82	185,262	銀行			
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,392.3	1,340.2	108,328	紙製品・林産品			
VOLVO AB-A SHS	—	236.91	159,668	銀行			
VOLVO AB-B SHS	1,305.9	1,342.82	62,009	機械			
SWEDISH MATCH AB	138.45	1,583.29	348,336	機械			
TELE2 AB-B SHS	470.55	460.83	74,055	タバコ			
INDUSTRIVARDEN A	119.55	142.73	50,490	無線通信サービス			
INDUSTRIVARDEN C	114.03	119.4	41,473	各種金融サービス			
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	252.19	55,927	各種金融サービス			
SECURITAS AB-B SHS	240.98	483.54	5,751	家庭用耐久財			
					商業サービス・用品		

銘柄	期首(前期末)	当期期末			業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(スウェーデン)					
INVESTOR AB-B SHS	百株	百株	千円		各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	395.67	1,694.19	33,029	406,268	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	688.14	662.7	11,793	145,058	建設関連製品
TELIA CO AB	870.21	1,010.25	26,418	324,941	各種電気通信サービス
LUNDIN ENERGY AB	2,104.77	2,699.54	10,043	123,536	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB	147.39	207.62	7,019	86,341	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	283.76	240.47	9,638	118,547	機械
KINNEVIK AB-B	283.92	279.3	7,932	97,565	各種金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER	217.22	214.49	5,430	66,799	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB	89.67	114.01	6,687	82,260	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	90.09	—	—	—	機械
NIBE INDUSTRIER AB	336.92	451.58	5,477	67,375	建設関連製品
HEXAGON AB-B SHS	288.34	1,340.88	11,416	140,419	電子装置・機器・部品
SAGAX AB	265.34	1,852.43	22,738	279,684	不動産管理・開発
EPIROC AB-A	—	183.48	4,678	57,548	機械
EPIROC AB-B	607.5	593.63	11,273	138,658	機械
ESSITY AB-B	308.99	389.43	6,308	77,597	家庭用品
EQT AB	521.43	576.54	15,249	187,568	資本市場
EMBRACER GROUP AB	209.34	300.03	10,171	125,103	娯楽
LIFCO AB	—	491.42	4,155	51,118	コングロマリット
EVOLUTION AB	—	257.38	5,237	64,423	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP	136.41	161.47	17,115	210,524	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	2,957.52	3,102.72	34,018	418,424	コングロマリット
SINCH AB	149.45	149.45	3,987	49,044	ソフトウェア
—	—	562.99	5,393	66,339	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,051.27	33,094.29	545,655	6,711,557
		38銘柄	44銘柄		<1.0%>
(ユーロ…アイルランド)					
CRH PLC	百株	百株	千円		建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	716.53	755.8	3,302	431,120	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	141.28	175.84	2,343	305,910	食品
KINGSPAN GROUP PLC	147.3	149.68	1,607	209,883	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	134.52	143.07	1,244	162,509	容器・包装
—	208.7	242.28	1,139	148,765	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,348.33	1,466.67	9,636	1,258,190
		5銘柄	5銘柄	—	<0.2%>
(ユーロ…オランダ)					
AIRBUS SE	百株	百株	千円		航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV	531.76	575.35	6,691	873,618	化学
ING GROEP NV-CVA	152.1	168.59	2,683	350,306	銀行
ASM INTERNATIONAL NV	3,448.92	3,804.32	4,902	640,037	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	—	42.71	1,167	152,398	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	126.01	112.39	707	92,326	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	992.8	1,063.9	3,060	399,623	飲料
AKZO NOBEL	226.83	245.94	2,291	299,136	化学
ASML HOLDING NV	179.59	187.17	1,717	224,184	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	380.98	403.14	22,563	2,945,922	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,503.49	1,893.23	909	118,770	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	829.19	886.59	2,596	338,983	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	257.15	266.29	2,328	304,001	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	541.76	650.99	2,545	332,323	ライフサイエンス・ツール/サービス
VOPAK (KON.)	207.63	204.27	876	114,412	石油・ガス・消耗燃料
KONINKLIJKE KPN NV	53.64	—	—	—	各種電気通信サービス
		3,478.24	3,414.47	1,051	137,304

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…オランダ)							
HEINEKEN HOLDING NV-A	百株	百株	千ユーロ	千円			
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	100.04	106.67	804	105,077	飲料		
FERRARI NV	553.04	553.04	574	75,020	飲料		
CNH INDUSTRIAL NV	115.42	120.5	2,335	304,895	自動車		
PROSUS NV	893.78	1,061.55	1,480	193,272	機械		
JDE PEET'S BV	442.19	906.79	6,150	803,042	インターネット販売・通信販売		
EURONEXT NV	73.08	73.08	191	25,065	食品		
IMCD NV	—	96.19	795	103,796	資本市場		
NN GROUP NV	—	53.59	757	98,933	商社・流通業		
ARGENX SE	252.74	281.24	1,418	185,209	保険		
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	38.79	42.55	1,073	140,160	バイオテクノロジー		
STELLANTIS NV	—	679.41	1,426	186,277	娯楽		
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	1,769.58	1,962.48	3,206	418,665	自動車		
ABN AMRO BANK NV	108.36	160.29	615	80,350	インターネット販売・通信販売		
EXOR NV	342.51	343.82	443	57,871	銀行		
ADYEN NV	99.66	99.66	719	93,891	各種金融サービス		
	15.89	19.2	3,605	470,717	情報技術サービス		
小計	株数： 銘柄数<比率>	17,715.17 28銘柄	20,479.41 31銘柄	81,691 —	10,665,597 <1.7%>		
(ユーロ…ベルギー)							
UMICORE	百株	百株	千ユーロ	千円			
KBC GROUPE	176.54	177.49	573	74,918	化学		
SOFINA	210.38	265.87	2,042	266,726	銀行		
SOLVAY SA	13.82	13.82	469	61,347	各種金融サービス		
AGEAS	71.83	69.31	736	96,192	化学		
UCB SA	143.65	170.55	754	98,509	保険		
COLRUYT NV	105.71	127.78	1,085	141,705	医薬品		
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	46.73	46.73	168	21,988	食品・生活必需品小売		
PROXIMUS	99.04	107.14	995	129,922	各種金融サービス		
GALAPAGOS NV	137.39	137.39	247	32,296	各種電気通信サービス		
ELIA GROUP	34.26	—	—	—	バイオテクノロジー		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	28.62	28.62	325	42,560	電力		
	663.27	740.93	4,035	526,920	飲料		
小計	株数： 銘柄数<比率>	1,731.24 12銘柄	1,885.63 11銘柄	11,436 —	1,493,086 <0.2%>		
(ユーロ…ルクセンブルグ)							
ARCELOR MITTAL (NL)	百株	百株	千ユーロ	千円			
EUROFINS SCIENTIFIC	615.94	639.79	1,685	220,020	金属・鉱業		
TENARIS SA	113.3	139.43	1,185	154,733	ライフサイエンス・ツール／サービス		
SES FDR	369.59	529.85	609	79,588	エネルギー・設備・サービス		
AROUND TOWN SA	288.47	—	—	—	メディア		
INPOST SA	830.54	1,060.18	560	73,222	不動産管理・開発		
	—	203.95	128	16,746	航空貨物・物流サービス		
小計	株数： 銘柄数<比率>	2,217.84 5銘柄	2,573.2 5銘柄	4,169 —	544,311 <0.1%>		
(ユーロ…フランス)							
AIR LIQUIDE	百株	百株	千ユーロ	千円			
AXA SA	412	465.78	6,619	864,263	化学		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,694.93	1,895.06	5,225	682,257	保険		
DASSAULT AVIATION SA	507.07	674.38	2,124	277,436	総合公益事業		
DANONE	2.95	29.5	340	44,408	航空宇宙・防衛		
SAFRAN SA	543.15	632.31	3,462	452,067	食品		
ACCOR SA	280.36	333.08	3,737	488,010	航空宇宙・防衛		
BOUYGUES	173.8	173.8	575	75,108	ホテル・レストラン・レジャー		
	214.17	202.22	649	84,776	建設・土木		

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円		
BNP PARIBAS	1,017.91	1,099.14	6,787	886,135		銀行	
THALES SA	105.13	104.48	867	113,301		航空宇宙・防衛	
CAPGEMINI SA	149.12	155.19	2,996	391,251		情報技術サービス	
NATIXIS	701.66	—	—	—		資本市場	
EIFFAGE	84.65	84.77	813	106,248		建設・土木	
PUBLICIS GROUPE	185.95	253.45	1,604	209,462		メディア	
FAURECIA	61.17	107.74	445	58,165		自動車部品	
L'OREAL	224.47	245.54	8,670	1,131,957		パーソナル用品	
VMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	248.73	270.69	18,136	2,367,866		繊維・アパレル・贅沢品	
BOLLORE	713.47	708.07	345	45,094		娯楽	
MICHELIN(CGDE)-B	148.02	162.26	2,348	306,648		自動車部品	
PERNOD-RICARD	190.38	204.47	3,890	507,883		飲料	
RENAULT SA	190.19	190.19	653	85,382		自動車	
REMY COINTREAU	18.6	18.47	324	42,369		飲料	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	445.6	491.74	2,981	389,254		建設関連製品	
SEB SA	22.18	24.39	328	42,925		家庭用耐久財	
SOCIETE GENERALE-A	695.95	788.64	2,665	347,969		銀行	
VINCI S.A.	472.57	523.44	5,236	683,676		建設・土木	
SODEXO	91.78	93.25	788	102,925		ホテル・レストラン・レジャー	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	483.76	528.92	7,517	981,420		電気設備	
VIVENDI SE	709.95	687.46	805	105,147		メディア	
TOTALENERGIES SE	2,258.11	2,445.35	12,503	1,632,401		石油・ガス・消耗燃料	
VALEO	196.53	253.93	646	84,440		自動車部品	
ORANGE	1,840.93	1,917.27	2,086	272,396		各種電気通信サービス	
HERMES INTL	28.8	30.76	3,649	476,501		繊維・アパレル・贅沢品	
DASSAULT SYSTEMES SA	121.83	645.96	2,601	339,665		ソフトウェア	
KERING	68.27	72.93	4,493	586,729		繊維・アパレル・贅沢品	
CNP ASSURANCES	139.87	139.87	305	39,864		保険	
CARREFOUR SA	499.26	611.89	1,052	137,447		食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	89.72	—	—	—		情報技術サービス	
SANOFI	1,014.54	1,108.56	10,220	1,334,443		医薬品	
UBISOFT ENTERTAINMENT	76.86	71.51	360	47,092		娯楽	
TELEPERFORMANCE	53.12	59.18	1,896	247,558		専門サービス	
EURAZEOT	52.29	30.08	212	27,687		各種金融サービス	
ESSILORLUXOTTICA	249.84	278.64	4,582	598,292		繊維・アパレル・贅沢品	
CREDIT AGRICOLE SA	986.85	1,149.26	1,558	203,464		銀行	
ORPEA	49.32	49.32	182	23,850		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
WENDEL	22.2	22.2	206	26,926		各種金融サービス	
ILIAD SA	10.46	—	—	—		各種電気通信サービス	
BIOMERIEUX	32.48	46.12	466	60,846		ヘルスケア機器・用品	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	23.87	24.56	865	112,998		ライフサイエンス・ツール/サービス	
ENGIE	1,660.61	1,774.63	2,537	331,278		総合公益事業	
ALSTOM	217.79	285.33	733	95,739		機械	
ELECTRICITE DE FRANCE	547.78	415.49	338	44,134		電力	
IPSEN SA	36.46	36.46	340	44,450		医薬品	
ARKEMA SA	63.93	60.09	750	97,988		化学	
LEGRAND SA	238.06	259.78	2,216	289,378		電気設備	
ADP	23.13	23.13	299	39,061		運送インフラ	
SCOR SE	156.67	—	—	—		保険	
BUREAU VERITAS SA	298.1	298.1	730	95,392		専門サービス	
GETLINK	376.46	415.25	574	75,006		運送インフラ	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)							
SUEZ SA	百株	百株	千ユーロ	千円	—	総合公益事業	
EDENRED	266.2	—	—	—	—	情報技術サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	214.88	248.65	953	124,530	—	ホテル・レストラン・レジャー	
WORLDLINE SA	80.92	80.92	292	38,213	—	情報技術サービス	
AMUNDI SA	223.86	235.7	1,071	139,955	—	資本市場	
小計	23,068.91	24,298.59	150,074	19,593,711	<3.0%>		
	株数	株数	金額	—	—		
銘柄	比	比	率	59銘柄	59銘柄		
(ユーロ…ドイツ)							
ADIDAS AG	百株	百株	千ユーロ	千円	—	繊維・アパレル・贅沢品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	172.02	184.33	4,260	556,288	—	自動車	
COMMERZBANK AG	312.17	329.21	3,048	397,967	—	銀行	
FRESENIUS SE & CO KGAA	831.18	1,062.15	910	118,885	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
UNITED INTERNET	390.3	388.3	1,420	185,447	—	各種電気通信サービス	
FUCHS PETROLUB SE PREF	98.82	98.82	340	44,460	—	化学	
HANNOVER RUECK SE	55.46	55.46	203	26,631	—	保険	
GEA GROUP AG	48.68	53.21	913	119,281	—	機械	
CONTINENTAL AG	118.38	164.92	670	87,484	—	自動車部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	103.36	97.95	859	112,243	—	航空貨物・物流サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	869.75	959.37	4,912	641,432	—	自動車	
MERCK KGAA	126.49	159.12	1,360	177,582	—	医薬品	
RWE AG	118.74	123.64	2,176	284,187	—	総合公益事業	
SAP SE	592.73	644.26	2,352	307,186	—	ソフトウェア	
E.ON SE	934.54	1,015.97	10,706	1,397,813	—	総合公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	2,098.42	2,086.41	2,491	325,247	—	家庭用品	
SIEMENS AG-REG	86.02	103.66	730	95,345	—	コングロマリット	
PUJMA AG	686.52	746.31	10,411	1,359,263	—	繊維・アパレル・贅沢品	
BAYER AG	92.39	104.48	918	119,876	—	医薬品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	887.08	948.61	5,005	653,559	—	家庭用品	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	162.41	175	1,286	167,978	—	自動車	
BASF SE	780.56	827.56	6,149	802,891	—	化学	
BEIERSDORF AG	832.15	895.92	5,953	777,274	—	パーソナル用品	
HOCHTIEF AG	83.71	103.42	904	118,120	—	建設・土木	
HEIDELBERGCEMENT AG	17.07	—	—	—	—	建設資材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	145.71	140.32	900	117,542	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
ALLIANZ SE	201.91	188.36	1,089	142,192	—	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	375.04	401.57	8,959	1,169,690	—	旅客航空輸送業	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	279.9	702.48	512	66,943	—	保険	
VOLKSWAGEN AG	123.01	135.09	3,547	463,156	—	自動車	
VOLKSWAGEN AG PFD	27.58	31.53	757	98,962	—	自動車	
NEMETSCHEK SE	163.61	179.03	3,270	427,045	—	自動車	
DEUTSCHE BANK AG-REG	50.95	48.41	370	48,414	—	ソフトウェア	
BMW VORZUG	1,659.49	2,132.85	2,963	386,954	—	資本市場	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	41.16	69.57	539	70,439	—	自動車	
SARTORIUS AG	2,993.58	3,241.17	5,619	733,687	—	各種電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	30.44	26.86	1,104	144,166	—	ヘルスケア機器・用品	
RATIONAL AG	1,188.79	1,266.18	4,111	536,769	—	半導体・半導体製造装置	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4.79	4.79	326	42,613	—	機械	
BECHTLE AG	37.71	35.01	461	60,267	—	ヘルスケア機器・用品	
DEUTSCHE BOERSE AG	25.11	75.33	354	46,303	—	情報技術サービス	
LANXESS AG	167.52	196.7	3,101	404,991	—	資本市場	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	68.56	71.94	371	48,559	—	化学	
	48.73	48.07	931	121,660	—	航空宇宙・防衛	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)							
DEUTSCHE WOHNEN	百株	百株	千ユーロ	千円	—	不動産管理・開発	
SYMRISE AG	290.97	—	—	—	—	化学	
BRENTAG SE	113.08	121.06	1,225	160,031	—	商社・流通業	
EVONIK INDUSTRIES AG	140.44	163.1	1,249	163,072	—	化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	171.16	233.4	675	88,188	—	各種電気通信サービス	
LEG IMMOBILIEN SE	983.85	983.85	260	34,026	—	不動産管理・開発	
KION GROUP AG	59.34	61.13	688	89,907	—	機械	
VONOVIA SE	59.03	75.08	586	76,557	—	不動産管理・開発	
KNORR-BREMSE AG	454.51	700.86	3,315	432,906	—	機械	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	68.6	68.6	604	78,906	—	ヘルスケア機器・用品	
TEAMVIEWER AG	238.05	284.75	1,576	205,811	—	ソフトウェア	
SIEMENS ENERGY AG	136.68	—	—	—	—	電気設備	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	358.31	357.61	667	87,122	—	機械	
ZALANDO SE	—	378.31	1,186	154,918	—	インターネット販売・通信販売	
SCOUT24 SE	147.56	208.57	1,287	168,069	—	インターネット・メディアおよびサービス	
COVESTRO AG	96.7	96.7	505	66,054	—	化学	
HELLOFRESH SE	163.37	191.58	1,010	131,866	—	食品・生活必需品小売り	
UNIPER SE	128.38	169.9	829	108,337	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
DELIVERY HERO SE	182.03	104.27	406	53,092	—	インターネット販売・通信販売	
109.74	166.45	720	94,033	—	—	—	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,034.34	24,688.56	124,078	16,199,712	—	
		61銘柄	59銘柄	—	<2.5%>	—	
(ユーロ…ポルトガル)							
JERONIMO MARTINS	百株	百株	千ユーロ	千円	—	食品・生活必需品小売り	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	195.17	331.35	644	84,142	—	電力	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	2,386.62	2,686.36	1,074	140,292	—	石油・ガス・消耗燃料	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,982.67	3,400.53	2,101	274,346	—	
		3銘柄	3銘柄	—	<0.0%>	—	
(ユーロ…スペイン)							
IBERDROLA SA	百株	百株	千ユーロ	千円	—	電力	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	5,508.72	5,945.92	5,436	709,848	—	電気設備	
REPESOL SA	212.06	212.06	347	45,322	—	石油・ガス・消耗燃料	
TELEFONICA S.A.	1,359.9	1,502.89	1,753	228,946	—	各種電気通信サービス	
ENDESA S.A.	4,558.87	5,375.23	2,353	307,313	—	電力	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	277.36	286.39	524	68,537	—	建設・土木	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	213.95	228.77	502	65,590	—	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	5,782.51	6,440.62	3,691	481,912	—	ガス	
BANCO SANTANDER SA	236.12	162.89	400	52,252	—	銀行	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	15,869.57	16,741.54	5,601	731,360	—	電力	
INDITEX	345.96	462.37	786	102,744	—	専門小売り	
ENAGAS	1,004.23	1,042.55	2,640	344,780	—	ガス	
GRIFOLS SA	234.77	234.77	436	57,011	—	バイオテクノロジー	
FERROVIAL SA	235.18	306.87	443	57,853	—	建設・土木	
CAIXABANK	405.93	464.37	1,105	144,294	—	銀行	
EDP RENOVAVEIS SA	3,073.31	4,097.23	1,348	176,046	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AMADEUS IT GROUP SA	—	279.72	475	62,084	—	情報技術サービス	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	411.18	467.67	2,821	368,429	—	建設・土木	
AENA SME SA	213.57	—	—	—	—	運送インフラ	
CELLNEX TELECOM SAU	62.56	70.76	1,061	138,576	—	各種電気通信サービス	
272.34	487.6	1,901	248,278	—	—	—	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	40,278.09	44,810.22	33,633	4,391,186	—	
		19銘柄	19銘柄	—	<0.7%>	—	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)							
ASSICURAZIONI GENERALI	百株	百株	千ユーロ	千円			
INTESA SANPAOLO	975.69	1,117.77	2,051	267,865	保険		
UNICREDIT SPA	15,123.69	15,981.58	4,422	577,349	銀行		
ENI SPA	1,939.1	2,056.36	3,089	403,415	銀行		
MEDIOBANCA SPA	2,193.31	2,418.13	3,221	420,653	石油・ガス・消耗燃料		
ENEI SPA	574.42	574.42	583	76,233	銀行		
SNAM SPA	7,299.44	7,880.51	4,980	650,251	電力		
TELECOM ITALIA SPA	1,712.94	1,989.63	944	123,310	ガス		
TELECOM ITALIA-RNC	7,626.75	8,325.8	343	44,893	各種電気通信サービス		
ATLANTIA SPA	4,975.96	—	—	—	各種電気通信サービス		
TERNA SPA	452.99	457.18	739	96,547	運送インフラ		
RECORDATI SPA	1,136.54	1,671.4	1,106	144,460	電力		
AMPLIFON SPA	103.03	103.03	461	60,236	医薬品		
PRYSMIAN SPA	113.72	113.72	395	51,579	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		
DIASORIN SPA	223.28	218.22	600	78,463	電気設備		
MONCLER SPA	22.23	22.23	266	34,755	ヘルスケア機器・用品		
NEXI SPA	175.67	228.55	1,244	162,446	繊維・アパレル・贅沢品		
FINECOBANK SPA	430.97	435.86	551	71,957	情報技術サービス		
POSTE ITALIANE SPA	538.18	652.74	1,011	132,008	銀行		
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	400.15	557.49	601	78,572	保険		
	233.44	232.81	206	26,979	各種電気通信サービス		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	46,251.5	45,037.43	26,822	3,501,981		
		20銘柄	19銘柄	—	<0.5%>		
(ユーロ…フィンランド)							
KESKO OYJ-B	百株	百株	千ユーロ	千円			
WARTSILA OYJ	240.85	238.04	630	82,358	食品・生活必需品小売り		
UPM-KYMMENE OYJ	349.35	486.12	496	64,832	機械		
STORA ENSO OYJ-R SHS	448.29	559.82	1,837	239,881	紙製品・林産品		
SAMPO OYJ-A SHS	532.5	555.48	1,009	131,811	紙製品・林産品		
FORTUM OYJ	448.22	499.85	2,214	289,103	保険		
NOKIA OYJ	394.09	408.2	962	125,615	電力		
ELISA OYJ	5,185.32	5,106.9	2,489	325,043	通信機器		
NESTE OYJ	136.42	136.42	691	90,266	各種電気通信サービス		
KONE OYJ	367.96	432.9	1,627	212,456	石油・ガス・消耗燃料		
ORION OYJ	298.9	319.56	1,750	228,551	機械		
	80.51	81.06	281	36,797	医薬品		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,482.41	8,824.35	13,991	1,826,718		
		11銘柄	11銘柄	—	<0.3%>		
(ユーロ…オーストリア)							
OMV AG	百株	百株	千ユーロ	千円			
VERBUND AG	128.17	170.07	951	124,255	石油・ガス・消耗燃料		
VOEST-ALPINE AG	69.24	69.16	650	84,877	電力		
ERSTE GROUP BANK AG	98.75	98.75	301	39,426	金属・鉱業		
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	242.04	315.46	1,319	172,324	銀行		
	179.11	195.72	509	66,489	銀行		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	717.31	849.16	3,732	487,372		
		5銘柄	5銘柄	—	<0.1%>		
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	974,571.62	1,063,294.07	—	598,417,771		
		1,224銘柄	1,228銘柄	—	<93.1%>		

(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) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(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) 外国新株予約権証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	証券数	証券数	評価額		邦貨換算金額
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス) CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23	証券 87,844	証券 —	千スイス・フラン —	千円 —	—
合計	証券数・金額 銘柄	87,844 1銘柄	—	—	<-%>

(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各国別評価額の比率です。

(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。

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期末			比率
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
<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	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,006	13,788	2,531	292,214	0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	12,947	14,801	1,730	199,789	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	22,693	—	—	—	—	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127,559	150,15	1,079	124,604	0.0	
PROLOGIS INC	66.35	72.03	10,468	1,208,313	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,329	13,356	3,180	367,120	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	9,643	10,44	1,691	195,243	0.0	
EQUINIX INC	7,992	8,702	5,824	672,315	0.1	
DUKE REALTY TRUST	31,929	35,306	1,925	222,292	0.0	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	38,831	42,028	7,043	812,909	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,504	6,132	1,939	223,898	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	35,108	34,397	2,955	341,111	0.1	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,543	49,946	1,603	185,049	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	9,838	10,551	3,263	376,725	0.1	
WELLTOWER INC	38,411	40,744	3,246	374,661	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	24,591	28,44	1,241	143,283	0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,087	16,573	1,268	146,429	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	63,952	75,616	1,355	156,485	0.0	
MID AMERICA	10,854	11,699	2,428	280,294	0.0	
REALTY INCOME CORP	29,466	53,267	3,563	411,244	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	14,499	14,665	955	110,292	0.0	
UDR INC	27,057	28,289	1,544	178,308	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	28,083	31,871	4,458	514,629	0.1	
PUBLIC STORAGE	13,834	15,276	5,432	627,048	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	9.67	11,066	2,093	241,678	0.0	
VENTAS INC	35,021	40,408	2,022	233,474	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	12,714	15,123	616	71,111	0.0	
WEYERHAEUSER CO	64,096	72,184	2,953	340,840	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12,385	13,998	2,718	313,775	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	23,492	27,36	3,724	429,915	0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	53,911	54,08	1,123	129,706	0.0	
AGNC INVESTMENT CORP	46,028	44,32	607	70,132	0.0	
VEREIT INC	20,534	—	—	—	—	
AMERICAN TOWER CORP	39,736	44,301	10,379	1,197,976	0.2	
WP CAREY INC	15,529	19,446	1,474	170,174	0.0	

銘柄		期首(前期末)		当期			期末	
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率		
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%		
INVITATION HOMES INC		50,475	55,207	2,285	263,800	0.0		
VICI PROPERTIES INC		47,083	57,882	1,629	188,129	0.0		
小計	口数 : 金額 銘柄 数<比率>	1,135,78 37銘柄<1.8%>	1,233,442 35銘柄<1.8%>	102,365	11,814,981	—	—	1.8
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%		
CANADIAN APT PPTYS REIT		7,954	8,22	456	41,361	0.0		
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		13,467	13,467	319	28,966	0.0		
小計	口数 : 金額 銘柄 数<比率>	21,421 2銘柄<0.0%>	21,687 2銘柄<0.0%>	775 —	70,328 —	—	—	0.0
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%		
MIRVAC GROUP		329,418	414,125	1,031	84,875	0.0		
GPT GROUP		158,232	207,292	1,048	86,334	0.0		
STOCKLAND		194,018	243,481	954	78,560	0.0		
DEXUS		108,972	101,202	1,028	84,632	0.0		
GOODMAN GROUP		148,357	158,185	3,609	297,121	0.0		
VICINITY CENTRES		371,711	371,711	631	52,012	0.0		
SCENTRE GROUP		420,268	479,376	1,414	116,399	0.0		
小計	口数 : 金額 銘柄 数<比率>	1,730,976 7銘柄<0.1%>	1,975,372 7銘柄<0.1%>	9,718 —	799,936 —	—	—	0.1
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円	%		
LINK REIT		200.2	199.7	13,280	196,411	0.0		
小計	口数 : 金額 銘柄 数<比率>	200.2 1銘柄<0.0%>	199.7 1銘柄<0.0%>	13,280 —	196,411 —	—	—	0.0
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		483,636	545,177	1,117	95,768	0.0		
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT		292,606	248,606	703	60,287	0.0		
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		192.1	—	—	—	—		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		270.1	484.5	838	71,824	0.0		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		192.3	192.3	348	29,825	0.0		
小計	口数 : 金額 銘柄 数<比率>	1,430,742 5銘柄<0.1%>	1,470,583 4銘柄<0.0%>	3,007 —	257,705 —	—	—	0.0
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%		
BRITISH LAND CO PLC		69,819	75,77	407	63,737	0.0		
LAND SECURITIES GROUP PLC		55,843	74,028	583	91,233	0.0		
SEGRO PLC		100,956	120,36	1,486	232,242	0.0		
小計	口数 : 金額 銘柄 数<比率>	226,618 3銘柄<0.1%>	270,158 3銘柄<0.1%>	2,478 —	387,213 —	—	—	0.1
(フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%		
GECINA SA		3.67	4,763	530	69,212	0.0		
KLEPIERRE		17,099	17,099	404	52,819	0.0		
COVIVIO		4,663	4,663	337	44,077	0.0		
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		12.92	12.92	884	115,480	0.0		
小計	口数 : 金額 銘柄 数<比率>	38,352 4銘柄<0.0%>	39,445 4銘柄<0.0%>	2,156 —	281,590 —	—	—	0.0
合計	口数 : 金額 銘柄 数<比率>	4,784,089 59銘柄<2.1%>	5,210,387 56銘柄<2.1%>	—	13,808,167 —	—	—	2.1

(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) 比率は、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。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期		末	
	買 建 額	売 建 額		
外 国	S & P 500 E M I N I F U T	百万円 8,545		百万円 -
	S & P / T S E 60 I X F U T	421		-
	S P I 200 F U T U R E S	264		-
	FTSE 100 INDEX FUTURE	536		-
	D J E U R O S T O X X 5 0	1,772		-

(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

2022年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 598,417,771	% 92.9
投資信託受益証券、投資証券	13,808,167	2.1
コール・ローン等、その他	31,698,088	4.9
投資信託財産総額	643,924,027	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、642,251,567千円、99.7%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、2022年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.42円、1カナダ・ドル=90.68円、1オーストラリア・ドル=82.31円、1香港・ドル=14.79円、1シンガポール・ドル=85.69円、1ニュージーランド・ドル=76.43円、1イギリス・ポンド=156.24円、1イスラエル・シェケル=35.452円、1イスラエル・ポンド=124.94円、1デンマーク・クローネ=17.54円、1ノルウェー・クローネ=13.00円、1スウェーデン・クローネ=12.30円、1ユーロ=130.56円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月15日)現在

項	目	当期末
(A) 資本	一ル・口一ノ等式(評価額)	663,074,590,376円
株投	資信託受益証券(評価額)	8,092,389,228
投	資	598,417,771,479
未	投	1,057,641,470
未	資	12,750,525,590
差	取	37,918,383,393
負	入	461,392,808
未	委	4,376,486,408
未	配	20,432,094,210
差	証	20,346,719,210
負	拠	85,375,000
(B) 負	債	642,642,496,166
未	金	113,101,593,550
未	金	529,540,902,616
純	金	113,101,593,550円
元	金	56,820円
次	本	
(D) 受	益	
期	緑	
次	越	
受	損	
1	益	
万	口	
口	当	
当	た	
た	り	
基	基	
準	準	
価	価	
額	額	
(C)	(A - B)	
(D)	総益	
期	益	
次	総	
受	口	
1	益	
万	口	
口	当	
当	た	
た	り	
基	基	
準	準	
価	価	
額	額	
(D)	(C / D)	

(注1) 期首元本額 101,430,005,374円  
追加設定元本額 93,876,718,442円  
一部解約元本額 82,205,130,266円

(注2) 期末における元本の内訳

DI AM外国株式パッジ・ファンド	3,311,871,905円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,512,255円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	13,337,563円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	57,023,138円
グローバル8資産ラップ型ファンド(安定型)	20,046,091円
グローバル8資産ラップ型ファンド(中立型)	11,721,611円
グローバル8資産ラップ型ファンド(積極型)	11,183,927円
たわらノーロード 先進国株式	29,209,837,872円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	379,011,003円
たわらノーロード 先進国株式<替ヘッジあり>	2,783,685,914円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	582,139,859円
たわらノーロード バランス(堅実型)	67,491,775円
たわらノーロード バランス(標準型)	540,044,742円
たわらノーロード バランス(積極型)	666,401,105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)	881,601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)	148,165,312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)	439,640,001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)	332,155,340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)	491,044,760円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,241,327円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	18,750,438円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,393,492円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,200,746円
たわらノーロード 全世界株式	28,421,540円
DI AM外国株式インデックスファンド<DC年金>	51,140,481,555円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,232,942,901円
Oneグローバルバランス	2,978,639円
DI AMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型	152,382,039円
DI AMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	773,961,717円
DI AMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型	1,005,264,576円
DI AM DC バランス30インデックスファンド	95,122,258円
DI AM DC バランス50インデックスファンド	265,971,133円
DI AM DC バランス70インデックスファンド	248,725,315円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	20,541,627円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	68,650,722円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	133,496,490円
DI AM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	172,284,428円
DI AM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	172,035,194円
DI AM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	304,995,876円
投資のソムリエ	4,886,217,076円
グルーゴンコトロー	36,245,544円
投資のソムリエ<DC年金>	294,714,139円
DI AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	187,167,284円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	142,899,507円
DI AMコア資産設計ファンド(堅実型)	315,762円
DI AMコア資産設計ファンド(積極型)	1,000,259円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	162,957,398円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,118,793,304円

ワールドアセットバランス(基本コース)	203,026,933円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	434,831,464円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	26,209,400円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,968,412円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,345,477円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	39,369,147円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	95,606,011円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	361,901,590円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	159,502,748円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	25,023,763円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,301,608円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	9,568,065円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	29,534,589円
インカム重視マルチセッツ運用ファンド12(適格機関投資家限定)	622,063円
インカム重視マルチセッツ運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	126,295円
マルチセッツ・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	83,555円
マルチセッツ・インカム戦略ファンド20-09(適格機関投資家限定)	1,732,862円
マルチセッツ・インカム戦略ファンド20-09(適格機関投資家限定)	13,744円
マルチセッツ・インカム戦略マルチセッツ運用ファンド2021-04(適格機関投資家限定)	111,606円
マルチセッツ・インカム戦略マルチセッツ運用ファンドI 1 2021-04(適格機関投資家限定)	557,287円
マルチセッツ・インカム戦略ファンド(内外株式債券型)2-10-06(適格機関投資家限定)	57,490,733円
マルチセッツ・インカム戦略マルチセッツ運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	75,883円
MSCIコアハイ・インカムファンド(成長型)2020-09(適格機関投資家限定)	958,242,351円
DI AM外国株式イニテックスファンドVA(適格機関投資家専用)	63,352,968円
DI AM外国株式パッジ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,191,786,446円
DI AM先進国株式パッジ・ファンド(適格機関投資家限定)	2,189,774,417円
外国株式パッジ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,052,411,163円
投資のソムリエ・ミクニ(適格機関投資家限定)	73,837,834円
DI AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	8,226,089円
インカム重視マルチセッツ運用ファンド(適格機関投資家限定)	206,917円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOF用)(適格機関投資家専用)	2,898,910円
DI AMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	31,546,987円
DI AMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	56,354,600円
DI AM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,722,727円
DI AM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	22,177,017円
DI AM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,568,925円
DI AM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	489,870円
DI AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,953,136円
DI AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	28,909,778円
DI AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	204,390,999円
DI AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	306,392,875円
DI AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	998,858,127円
DI AMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	86,555,947円
DI AMグローバル・アセット・バランスVA 2(適格機関投資家限定)	51,952,941円
DI 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)	332,991,420円
DI AM世界アセットバランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	13,689,728円
DI AM世界セッターバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	3,498,399円
DI AM世界セッターバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	128,366,149円
DI AM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,208,160円
DI AM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	40,455,375円
DI 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)	63,324,997円
DI 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)	130,176,054円
期末元本合計	113,101,593,550円

## ■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月15日

項目					当期
(A) 配受の支	当取	等取	収利	益金	9,113,239,420円
受	取	配	当	息	9,080,104,798
そ	の	他	利	金	12,472
支	払		収	益	33,540,265
			利	金	△418,115
(B) 有価	債	証券	売	買	損益
売			買	買	益
売			賣	賣	損
(C) 先取	物	取引	等取	引	損益
取			引	引	益
取			引	引	損
(D) そ	の	他		費	損益
(E) 当	期	損益	金(A + B + C + D)		△203,677,815
期	損益				100,018,439,768
(F) 前	期	繰越		損益	376,135,937,658
(G) 解約	約	差	損	益	△371,018,562,768
(H) 追加	信託	差	損	益	424,405,087,958
(I) 合次	期	繰越	損	益	529,540,902,616
			計(E + F + G + H)		529,540,902,616
				金(I)	

(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》

■信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年12月21日)

# J－REITインデックスファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2022年6月6日）  
 (計算期間 2021年6月8日～2022年6月6日)

J－REITインデックスファンド・マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2006年8月4日から無期限です。
運用方針	東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）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	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券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	東証REIT指数		投資証券組入比率	不動産投信指數先物比率	純資産額
		期騰落率	中率			
12期（2018年6月6日）	円 18,181	% 3.1	ポイント 3,386.35	% 3.1	% 97.8	% 1.7 百万円 35,462
13期（2019年6月6日）	20,819	14.5	3,880.89	14.6	97.4	2.0 33,154
14期（2020年6月8日）	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2 41,885
15期（2021年6月7日）	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2 88,531
16期（2022年6月6日）	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	97.6	2.3 199,921

(注1) 不動産投信指數先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証REIT指数（配当込み）の指数值および同指數にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指數の算出、指數値の公表、利用など同指數に関するすべての権利・ノウハウおよび同指數にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指數の指數値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません（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）。

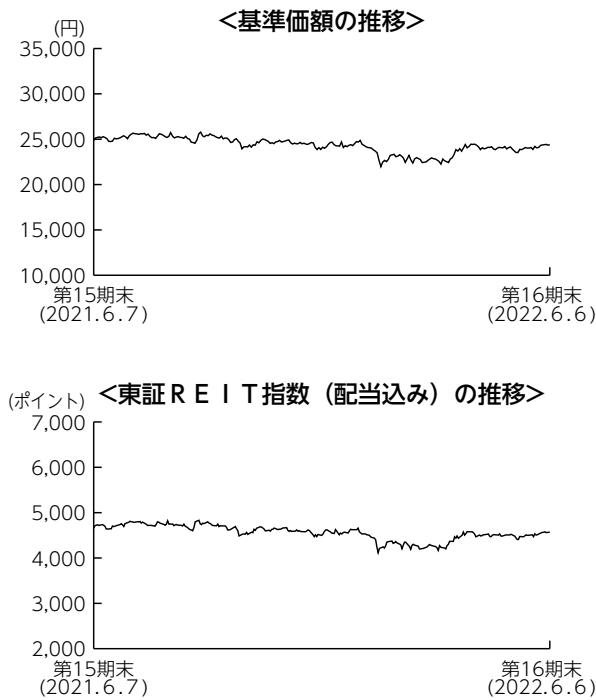
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数
		騰 落 率	(配 当 込み) (ベンチマーク)		
(期 首) 2021 年 6 月 7 日	円 24,869	% —	ポイント 4,660.79	% —	% 97.6
6 月 末	25,249	1.5	4,732.24	1.5	2.2
7 月 末	25,437	2.3	4,767.40	2.3	98.8
8 月 末	25,373	2.0	4,755.00	2.0	1.7
9 月 末	24,579	△1.2	4,605.71	△1.2	2.4
10 月 末	24,872	0.0	4,660.54	△0.0	2.2
11 月 末	23,858	△4.1	4,470.13	△4.1	2.4
12 月 末	24,686	△0.7	4,624.94	△0.8	2.2
2022 年 1 月 末	23,340	△6.1	4,372.24	△6.2	2.5
2 月 末	22,657	△8.9	4,243.65	△8.9	2.6
3 月 末	24,221	△2.6	4,536.64	△2.7	2.4
4 月 末	23,935	△3.8	4,483.12	△3.8	2.4
5 月 末	24,363	△2.0	4,563.32	△2.1	2.6
(期 末) 2022 年 6 月 6 日	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	2.3

(注1) 謄落率は期首比です。

(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（2021年6月8日から2022年6月6日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は24,389円となり、前期末比で1.9%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

インフレ懸念を背景とした米国の金融引き締め加速への警戒感や世界的な長期金利の上昇などから東証REIT指数（配当込み）が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。

### 投資環境

リート市場は下落しました。期の前半は長期金利の低位安定と相対的に高い配当利回りに注目した資金流入などを背景に堅調に推移していましたが、その後は公募増資による需給悪化懸念などにより上値の重い展開となりました。後半に入ると、米国の金融引き締め加速などへの警戒感から調整する局面もありましたが、期末にかけては日銀の金融緩和姿勢維持、新型コロナウイルスのまん延防止等重点措置解除、外国人観光客の入国規制緩和報道などからやや値を戻しました。

### ポートフォリオについて

リートの組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持しました。

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.0%下落しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

### 今後の運用方針

引き続き、リートの組入比率を高め、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。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持するよう努めます。

## ■ 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) (投資証券)	1円 (0) (1)	0.003% (0.001) (0.002)	(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	0.003	
期中の平均基準価額は24,325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 (2021年6月8日から2022年6月6日まで)

### (1) 投資証券

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
<b>国内</b>	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	6,445 (-)	908,630 (-)	4,145 (-)	564,705 (-)
サンケイリアルエステート投資法人	10,171 (-)	1,246,519 (-)	6,459 (-)	742,665 (-)
S O S I L A 物流リート投資法人	15,036 (-)	2,470,185 (-)	8,857 (-)	1,421,183 (-)
東海道リート投資法人	2,916 (-)	328,060 (-)	1,573 (-)	171,150 (-)
日本アコモデーションファンド投資法人	10,755 (-)	6,938,240 (-)	7,296 (-)	4,612,569 (-)
森ビルズリート投資法人	36,655 (-)	5,780,543 (-)	24,881 (-)	3,701,548 (-)
産業ファンド投資法人	44,19 (-)	9,054,056 (-)	29,941 (-)	5,900,481 (-)
アドバンス・レジデンス投資法人	31,297 (-)	11,328,675 (-)	20,918 (-)	7,288,268 (-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	22,034 (-)	4,924,796 (-)	14,619 (-)	3,083,776 (-)
アクティビア・プロパティーズ投資法人	16,738 (-)	7,748,557 (-)	11,166 (-)	4,729,881 (-)
G L P 投資法人	101,462 (-)	18,894,832 (-)	68,202 (-)	12,402,848 (-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	14,234 (-)	4,834,233 (-)	9,463 (-)	3,081,956 (-)
日本プロロジスリート投資法人	50,834 (-)	18,357,708 (-)	34,051 (-)	12,361,202 (-)
星野リゾート・リート投資法人	5,226 (-)	3,589,786 (-)	3,433 (-)	2,267,405 (-)
On e リート投資法人	5,253 (-)	1,639,088 (-)	3,384 (-)	997,445 (-)
イオンリート投資法人	37,466 (-)	5,903,228 (-)	24,481 (-)	3,659,415 (-)
ヒューリックリート投資法人	29,329 (-)	5,210,000 (-)	19,213 (-)	3,218,632 (-)
日本リート投資法人	9,815 (-)	4,160,973 (-)	6,85 (-)	2,765,100 (-)
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	91,241 (-)	2,070,962 (-)	139,141 (-)	3,156,012 (-)

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
	千口	千円	千口	千円
積水ハウス・リート投資法人	94.815	8,336,334	63.737	5,281,290
	(-)	(-)	(-)	(-)
トーセイ・リート投資法人	6.667	915,689	4.67	615,424
	(-)	(-)	(-)	(-)
ケネディックス商業リート投資法人	12.429	3,614,914	8.423	2,341,576
	(-)	(-)	(-)	(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人	7.36	1,134,365	4.671	706,878
	(-)	(-)	(-)	(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人	7.147	903,361	4.624	565,039
	(-)	(-)	(-)	(-)
野村不動産マスターファンド投資法人	100.834	17,143,184	68.482	11,021,949
	(-)	(-)	(-)	(-)
いちごホテルリート投資法人	5.272	485,596	3.684	312,470
	(-)	(-)	(-)	(-)
ラサールロジポート投資法人	38.003	7,098,551	25.646	4,706,781
	(-)	(-)	(-)	(-)
スター・アジア不動産投資法人	33.349	2,078,792	22.966	1,373,192
	(-)	(-)	(-)	(-)
マリモ地方創生リート投資法人	3.553	475,972	2.205	287,513
	(-)	(-)	(-)	(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	12.071	7,118,255	7.792	4,507,353
	(-)	(-)	(-)	(-)
大江戸温泉リート投資法人	5.031	393,948	3.417	244,968
	(-)	(-)	(-)	(-)
投資法人みらい	37.702	1,987,584	24.594	1,256,245
	(-)	(-)	(-)	(-)
森トラスト・ホテルリート投資法人	7.386	996,245	4.902	612,429
	(-)	(-)	(-)	(-)
三菱地所物流リート投資法人	8.741	4,213,761	5.541	2,611,455
	(-)	(-)	(-)	(-)
C R E ロジスティクスファンド投資法人	12.336	2,525,598	7.954	1,634,581
	(-)	(-)	(-)	(-)
ザイマックス・リート投資法人	4.999	611,499	3.323	390,695
	(-)	(-)	(-)	(-)
タカラレーベン不動産投資法人	12.651	1,521,341	7.998	921,597
	(-)	(-)	(-)	(-)
アドバンス・ロジスティクス投資法人	12.135	1,954,846	8.219	1,319,609
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本ビルファンド投資法人	36.124	25,428,950	24.156	16,411,837
	(-)	(-)	(-)	(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人	31.182	21,023,426	21.178	13,581,977
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本都市ファンド投資法人	156.564	17,207,488	105.6	10,606,437
	(-)	(-)	(-)	(-)
オリックス不動産投資法人	62.129	12,088,815	42.196	7,622,256
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本プライムリアルティ投資法人	21.282	8,882,224	13.988	5,482,023
	(-)	(-)	(-)	(-)
N T T 都市開発リート投資法人	29.99	4,740,285	19.983	3,006,886
	(-)	(-)	(-)	(-)
東急リアル・エステート投資法人	20.91	4,116,189	14.203	2,638,050
	(-)	(-)	(-)	(-)
グローバル・ワン不動産投資法人	21.595	2,610,692	14.811	1,709,256
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユナイテッド・アーバン投資法人	70.453	10,570,416	47.083	6,646,022
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	□ 数	金額	□ 数	金額
	千口	千円	千口	千円
森トラスト総合リート投資法人	22,288	3,354,263	15,138	2,160,020
	(-)	(-)	(-)	(-)
インヴィンシブル投資法人	137,746	5,793,937	92,055	3,654,156
	(-)	(-)	(-)	(-)
フロンティア不動産投資法人	11,014	5,602,506	7,365	3,594,447
	(-)	(-)	(-)	(-)
平和不動産リート投資法人	20,777	3,355,067	13,69	2,067,239
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	20,853	6,919,284	13,95	4,495,685
	(-)	(-)	(-)	(-)
福岡リート投資法人	16,127	2,846,543	10,953	1,800,359
	(-)	(-)	(-)	(-)
ケネディクス・オフィス投資法人	9,646	7,224,561	6,551	4,619,046
	(-)	(-)	(-)	(-)
いちごオフィスリート投資法人	25,548	2,372,398	17,35	1,487,895
	(-)	(-)	(-)	(-)
大和証券オフィス投資法人	6,585	4,953,141	4,482	3,236,468
	(-)	(-)	(-)	(-)
阪急阪神リート投資法人	14,088	2,264,248	9,57	1,472,807
	(-)	(-)	(-)	(-)
スターツプロシード投資法人	4,858	1,178,307	3,3	769,149
	(-)	(-)	(-)	(-)
大和ハウスリート投資法人	47,036	15,472,383	31,452	10,149,811
	(-)	(-)	(-)	(-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	97,424	6,309,714	67,966	4,153,483
	(-)	(-)	(-)	(-)
大和証券リビング投資法人	42,193	4,957,843	28,333	3,203,570
	(-)	(-)	(-)	(-)
ジャパンエクセレント投資法人	28.87	4,164,397	19,772	2,621,059
	(-)	(-)	(-)	(-)

(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	新規売付額	決済額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 18,774	百万円 15,886	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 (2021年6月8日から2022年6月6日まで)

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当期					
区分	分	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
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資証券		362,336	422	0.1	234,027	21,734	9.3

### (2) 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	付	当期	
		買	額
投資証券		百万円	15,547

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、みずほ証券です。

## ■組入資産の明細

### (1) 国内投資証券

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			
		□ 数	□ 数	評 働 額	比 率
<b>不動産ファンド</b>	千□	千□	千円		%
エスコンジャパンリート投資法人	1,232	3,532	474,347	0.2	
サンケイリアルエストート投資法人	1,844	5,556	548,932	0.3	
S O S I L A 物流リート投資法人	1,982	8,161	1,260,058	0.6	
東海道リート投資法人	—	1,343	159,145	0.1	
日本アコモデーションファンド投資法人	2,598	6,057	4,058,190	2.0	
森ヒルズリート投資法人	8,854	20,628	3,139,581	1.6	
産業ファンド投資法人	10,655	24,904	4,674,480	2.3	
アドバンス・レジデンス投資法人	7,16	17,539	6,314,040	3.2	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	5,137	12,552	2,688,638	1.3	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	3,777	9,349	3,870,486	1.9	
G L P 投資法人	23,554	56,814	9,584,521	4.8	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,389	8,16	2,762,160	1.4	
日本プロロジスリート投資法人	11,917	28.7	9,987,600	5.0	
星野リゾート・リート投資法人	1,147	2.94	2,043,300	1.0	
Oneリート投資法人	1,175	3,044	851,711	0.4	
イオンリート投資法人	7,645	20.63	3,177,020	1.6	
ヒューリックリート投資法人	6,249	16,365	2,654,403	1.3	
日本リート投資法人	2,448	5,413	2,054,233	1.0	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	47.9	—	—	—	
積水ハウス・リート投資法人	22.17	53,248	4,259,840	2.1	
トーセイ・リート投資法人	1,668	3,665	489,644	0.2	
ケネディクス商業リート投資法人	2,998	7,004	1,948,512	1.0	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,608	4,297	697,832	0.3	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,451	3,974	551,193	0.3	
野村不動産マスタートファンド投資法人	24,375	56,727	9,552,826	4.8	
いちごホテルリート投資法人	1,318	2,906	285,078	0.1	
ラサールロジポート投資法人	9,118	21,475	3,841,877	1.9	
スター・ア・ジア不動産投資法人	7,745	18,128	1,114,872	0.6	
マリモ地方創生リート投資法人	0,706	2,054	281,192	0.1	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,631	6.91	3,821,230	1.9	
大江戸温泉リート投資法人	1,217	2,831	201,567	0.1	
投資法人みらい	8,141	21,249	1,075,199	0.5	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,632	4,116	548,662	0.3	
三菱地所物流リート投資法人	1,896	5,096	2,377,284	1.2	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	2,412	6,794	1,387,334	0.7	
ザイマックス・リート投資法人	1,155	2,831	363,783	0.2	
タカラレーベン不動産投資法人	2,265	6,918	821,166	0.4	

銘柄	期首(前期末) □ 数	当期末				
		□ 数	評価額	比率		
<b>不動産ファンド</b>	千□	千□	千円	%		
アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,924	6.84	1,093,716	0.5		
日本ビルファンド投資法人	8,483	20.451	14,602,014	7.3		
ジャパンリアルエスティート投資法人	7,538	17.542	11,279,506	5.6		
日本都市ファンド投資法人	37,545	88.509	9,417,357	4.7		
オリックス不動産投資法人	15,019	34.952	6,431,168	3.2		
日本プライムリアルティ投資法人	4,693	11.987	4,962,618	2.5		
N T T都市開発リート投資法人	6,808	16.815	2,525,613	1.3		
東急リアル・エステート投資法人	5,054	11.761	2,269,873	1.1		
グローバル・ワン不動産投資法人	5,234	12.018	1,307,558	0.7		
ユナイテッド・アーバン投資法人	16.12	39.49	5,773,438	2.9		
森トラスト総合リート投資法人	5,387	12.537	1,790,283	0.9		
インヴィンシブル投資法人	31,518	77.209	3,254,359	1.6		
フロンティア不動産投資法人	2,501	6.15	3,265,650	1.6		
平和不動産リート投資法人	4,871	11.958	1,751,847	0.9		
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,925	11.828	3,873,670	1.9		
福岡リート投資法人	3,898	9.072	1,533,168	0.8		
ケネディクス・オフィス投資法人	2,332	5.427	3,598,101	1.8		
いちごオフィスリート投資法人	6,176	14.374	1,239,038	0.6		
大和証券オフィス投資法人	1,606	3.709	2,518,411	1.3		
阪急阪神リート投資法人	3,405	7.923	1,201,126	0.6		
スターツプロシード投資法人	1,174	2.732	672,891	0.3		
大和ハウスリート投資法人	10,755	26.339	8,362,632	4.2		
ジャパン・ホテル・リート投資法人	24,283	53.741	3,584,524	1.8		
大和証券リビング投資法人	9,843	23.703	2,754,288	1.4		
ジャパンエクセレント投資法人	6,994	16.092	2,087,132	1.0		
合計	□ 数 銘柄数	・ 金額 <比率>	472,255 61銘柄<97.6%>	1,025,069 61銘柄<97.6%>	195,071,937 —	— 97.6

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注2) 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。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注3) いちごホテルリート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、積水ハウス・リート投資法人、平和不動産リート投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、投資法人みらい、ザイマックス・リート投資法人、サンケイリアルエスティート投資法人、東海道リート投資法人、アドバンス・ロジスティクス投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、イオンリート投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、C R E ロジスティクスファンド投資法人、大和証券リビング投資法人、O n e リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、スターツプロシード投資法人、森トラスト総合リート投資法人、福岡リート投資法人、日本都市ファンド投資法人、ジャパンリアルエスティート投資法人、トーセイ・リート投資法人につきましては、委託会社の利害関係人（みずほ銀行、みずほ信託銀行、みずほ証券、みずほリートマネジメント）が運用会社または一般事務受託会社となっています。（当該投資法人の直近の資産運用報告書より記載）

(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 東 証 R E I T	百万円 4,692		百万円 -

■投資信託財産の構成

2022年6月6日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	%
投 資 証 券	千円 195,071,937		94.5
コール・ローン等、その他	11,337,248		5.5
投 資 信 託 財 産 総 額	206,409,185		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

(2022年6月6日)現在

項	目	当期末
(A) 資	産	206,409,185,963円
コ 一 ル ビ 資 未 収 未 収 差 入 委	口 証 入 配 金 金 証 金 金	9,924,691,323 195,071,937,150 373,786,980 1,098,130,310 △59,359,800
(B) 負	債	6,487,439,313
未 払 未 払	払 解 約 金	6,096,928,313 390,511,000
(C) 純 資 産 元 次 期 繰 越 損 益 金	総 額(A-B)	199,921,746,650 81,973,373,034 117,948,373,616
(D) 受 益 権 総 口	1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	81,973,373,034円 24,389円

(注1) 期首元本額 35,599,014,873円  
追加設定元本額 150,824,103,694円  
部解約元本額 104,449,745,533円

(注2) 期末における元本の内訳  
MITO ラップ型ファンド (安定型) 484,095円  
MITO ラップ型ファンド (中立型) 1,717,515円  
MITO ラップ型ファンド (積極型) 9,111,206円  
グローバル8資産ラップファンド (安定型) 2,267,895円  
グローバル8資産ラップファンド (中立型) 1,248,266円  
グローバル8資産ラップファンド (積極型) 1,183,169円  
たわらノーロード 国内リート 4,872,150,904円  
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け> 780,898,538円  
たわらノーロード バランス (8資産均等型) 1,571,632,416円  
たわらノーロード バランス (堅実型) 29,133,736円  
たわらノーロード バランス (標準型) 543,338,028円  
たわらノーロード バランス (積極型) 592,133,017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) 36,161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) 75,324,606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) 378,001,932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) 218,376,989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) 284,143,618円  
たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 2,463,171円  
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 33,763,995円  
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 4,546,963円  
たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 13,122,590円  
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 12,475,526円  
マネックス資産設計ファンド (育成型) 430,321,307円  
マネックス資産設計ファンド (エボリューション型) 3,270,803円  
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 127,599,856円  
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 168,835,185円  
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 338,747,680円  
投資のソムリエ 9,844,600,548円  
投資のソムリエ <DC年金> 615,851,556円  
D IAM 8資産バランスファンドN <DC年金> 138,640,897円  
投資のソムリエ <DC年金> リスク抑制型 407,049,793円  
リスク抑制世界8資産バランスファンド 2,093,350,810円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 23,670,570円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 11,955,495円  
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 2,715,586円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 59,914,647円  
リスクコントロール世界資産分散ファンド 258,104,151円  
9資産分散投資・スタンダード <DC年金> 105,387,836円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 27,927,213円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 11,933,960円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 7,880,111円  
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) 1,382,274円

Jリートインデックスファンド (DC) 50,855,522円  
D IAM J-R E I T インデックス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定) 79,667,856円  
D IAM J-R E I T インデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定) 720,422,023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) 720,808円  
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4 226,208,631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) 708,067円  
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-09 (適格機関投資家限定) 43,732,109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) 551,421円  
固定比率マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定) 190,209,302円  
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定) 59,683,551円  
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03 220,977,582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) 527,083円  
インカム重視マルチアセット運用ファンド I 1 2021-04 (適格機関投資家限定) 2,869,206円  
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05 148,330,752円  
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07 244,308,833円  
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08 170,659,574円  
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略 ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) 60,842,765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) 588,327円  
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09 170,407,397円  
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12 245,929,724円  
D IAM J-R E I T インデックスファンド (適格機関投資家向け) 4,526,901,363円  
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 254,449,768円  
日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定) 614,705,854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) 1,014,158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) 9,480,923円  
日米資産配分戦略ファンド (TIPS活用型) 141,000,699円  
しあわせの一歩・私募 (適格機関投資家限定) 30,493,320円  
D IAM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) 1,968,658,850円  
MHAM J-R E I T インデックスファンド<DC年金> 7,710,368,183円  
MHAM J-R E I T インデックスファンド (毎月決算型) 37,275,651,521円  
MHAM J-R E I T インデックスファンド (年1回決算型) 2,584,025,619円  
MHAM J-R E I T インデックスファンド (ファンドラップ) 111,687,629円  
期末元本合計 81,973,373,034円

## ■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2022年6月6日

項	目	当期
(A) 配 当 等 収 益		6,593,740,373円
受 取 配 当 金		6,590,445,292
受 取 利 息		12,539
そ の 他 収 益 金		4,406,968
支 払 利 息		△1,124,426
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		△19,639,284,044
売 売 買 益		2,322,804,698
売 売 買 損		△21,962,088,742
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益		△181,506,240
取 引 益		395,559,860
取 引 損		△577,066,100
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)		△13,227,049,911
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		52,932,492,732
(F) 解 約 差 損 益 金		△144,599,972,511
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金		222,842,903,306
(H) 合 次 期 繰 越 損 益 金(H)	計(D + E + F + G)	117,948,373,616
		117,948,373,616

(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15期 (決算日 2022年6月22日)

(対象期間 2021年6月23日～2022年6月22日)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第15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 R E I T インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）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 R E I T インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）		投資信託受益証券、投資証券組入比率	純資産額
		期騰落率 (ベンチマーク)	期騰落率 (ベンチマーク)		
11期(2018年6月22日)	円 11,979	% 1.8	ポイント 120,101.82	% 2.4	% 99.3 百万円 53,148
12期(2019年6月24日)	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2 47,410
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7 34,753
14期(2021年6月22日)	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4 78,959
15期(2022年6月22日)	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3 56,003

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

(注2) S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックス L L C またはその関連会社（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ L L C（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズ L L C（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、S P D J I、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 R E I T インデックスのいかなる過誤、遗漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

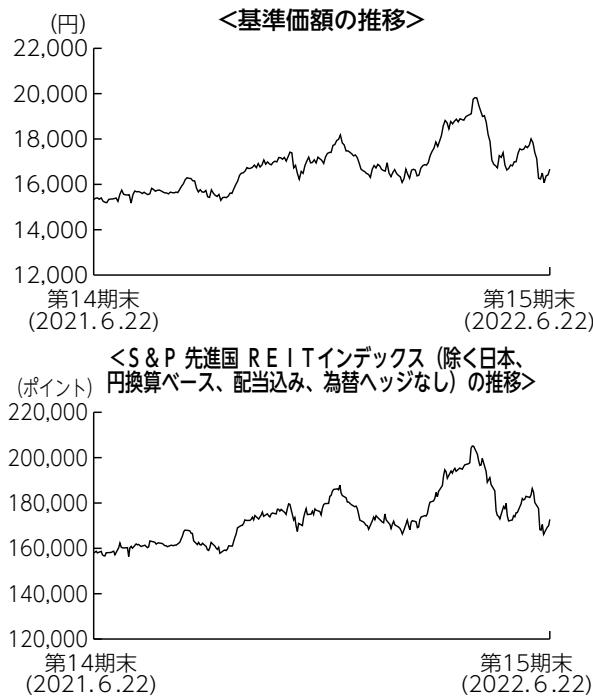
(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	S & P 先進国 R E I T インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし)			投 資 信 託 受 益 証 券、 投 資 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率 (ベンチマーク)	期 謄 落 率	中 率	
(期 首) 2021年 6月 22日	円 15,336	% —	ポイント 157,949.66	% —	% 99.4
6 月 末	15,211	△0.8	156,754.65	△0.8	99.4
7 月 末	15,595	1.7	160,838.73	1.8	99.7
8 月 末	15,916	3.8	164,194.41	4.0	99.6
9 月 末	15,552	1.4	160,446.64	1.6	90.7
10 月 末	16,916	10.3	174,463.23	10.5	99.8
11 月 末	16,840	9.8	173,578.70	9.9	89.5
12 月 末	17,934	16.9	185,199.89	17.3	100.1
2022年 1 月 末	16,668	8.7	172,188.18	9.0	99.6
2 月 末	16,669	8.7	172,409.41	9.2	99.2
3 月 末	18,724	22.1	193,705.17	22.6	98.9
4 月 末	19,029	24.1	196,763.47	24.6	85.6
5 月 末	17,570	14.6	181,951.19	15.2	99.6
(期 末) 2022年 6月 22日	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3

(注) 謄落率は期首比です。

## ■当期の運用経過 (2021年6月23日から2022年6月22日まで)



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は16,673円となり、前期末比で8.7%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

外国リート市場は利上げへの警戒感や長期金利の上昇を受けて米国やオーストラリア、欧州主要リート市場が下落し、マイナスの寄与となったものの、為替市場では日銀が緩和姿勢を継続したことを背景に多くの通貨に対して円安となったことがプラスの寄与となり、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

外国リート市場は下落しました。米国リート市場では新型コロナウイルスに対する警戒感の後退などから期前半は堅調な値動きとなりましたが、利上げ見通しが強まる中で米長期金利が上昇したことにより、ウクライナ紛争の長期化によるインフレ高止まりが懸念され下落しました。欧州リート市場ではウクライナ紛争を巡る不透明感や、インフレの高進、金利の引き上げなどが意識され下落しました。オーストラリアリート市場では市場予想以上の金利引き上げが嫌気され下落しました。

為替市場では、多くの投資通貨に対し円安となりました。ウクライナ情勢の緊迫化からユーロに対し円高に振れる場面もありましたが、景気回復やインフレの高進から欧米などで政策金利の引き上げによる内外金利差の拡大が見込まれたことが主な要因です。また、エネルギー価格の高騰などから日本の経常収支悪化が意識されたことなども円安要因となりました。

### 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9.4%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.7%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

### 今後の運用方針

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (投資信託受益証券) (投資証券)	7円 (1) (6)	0.040% (0.005) (0.034)	(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)	19 (1) (18)	0.114 (0.008) (0.106)	(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)	15 (9) (6)	0.091 (0.054) (0.038)	(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	41	0.246	
期中の平均基準価額は16,756円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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 (2021年6月23日から2022年6月22日まで) 投資信託受益証券、投資証券

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	158.855	30,863	177.915	33,766
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER'S INC.	2.05	527	2.378	596
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	156.582	18,204	179.035	20,293
	(-)	(-)	(-)	(-)
CEDAR REALTY TRUST INC	13.188	322	9.407	233
	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	262.595	7,890	300.123	8,767
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INV & MGMT CO-A	154.331	1,101	172.485	1,167
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGREE REALTY CORP	80.982	5,528	87.507	5,934
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRT APARTMENTS CORP	10.767	233	10.379	214
	(-)	(-)	(-)	(-)
SL GREEN	72.343	5,274	85.8	6,083
	(0.084)	(60)	(-)	(-)
EPR PROPERTIES	83.255	4,147	95.169	4,603
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	818.549	118,157	937.537	133,627
	(-)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	154.585	35,866	177.182	40,584
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXP INDUSTRIAL TRUST	313.011	4,441	355.629	4,842
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
CAMDEN PROPERTY TRUST	114.101	18,022	127.237	19,844
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
VERIS RESIDENTIAL INC	79.161	1,367	91.716	1,534
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	99.737	75,362	113.69	85,340
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	196.799	8,811	225.376	9,945
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CTO REALTY GROUTH INC	2.639	166	3.746	219
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	162.511	6,215	187.519	7,011
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	28.301	540	33.029	616
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	201.279	3,153	227.446	3,482
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	420.457	23,243	477.107	26,084
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	43.138	485	28.031	269
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	72.127	23,422	82.575	26,698
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	379.1	31,969	434.939	36,088
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	77.397	9,357	88.546	10,482
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	146.041	8,455	166.773	9,520
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	594.934	19,848	682.228	22,393
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	131.487	3,499	153.44	4,001
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	161.493	4,832	181.401	5,393
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	116	5,054	132.347	5,650
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	174.023	1,582	194.951	1,725
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	485.024	41,993	541.577	45,826
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	45.566	8,556	51.724	9,673
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	682.246	15,752	773.865	17,641
(78.06)	(△121)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	116.51	7,920	134.131	8,852
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	37.57	1,341	43.553	1,480
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	200.598	601	232.534	669
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)

	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
アメリカ		千口	千	アメリカ・ドル		千口	千	アメリカ・ドル
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A		62.974		1,258		111.145		2,252
		(-)		(-)		(-)		(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST		194.158		2,576		224.432		2,883
		(-)		(-)		(-)		(-)
IRON MOUNTAIN INC		321.912		15,741		368.218		17,411
		(-)		(-)		(-)		(-)
THE MACERICH COMPANY		253.283		4,034		266.867		4,192
		(-)		(-)		(-)		(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		189.867		15,052		216.131		16,956
		(-)		(-)		(-)		(-)
ACADIA REALTY TRUST		88.709		1,870		104.132		2,130
		(-)		(-)		(-)		(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC		790.713		14,017		901.597		15,719
		(-)		(-)		(-)		(-)
MID AMERICA		128.065		25,645		146.132		28,775
		(-)		(-)		(-)		(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST		28.468		270		35.964		328
		(-)		(-)		(-)		(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC		50.263		2,891		57.379		3,174
		(-)		(-)		(-)		(-)
CENTERSPACE		14.129		1,378		15.148		1,452
		(-)		(-)		(-)		(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC		13.695		431		15.942		487
		(-)		(-)		(-)		(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST		—		—		—		—
		(△27.137)		(-)		(-)		(-)
GETTY REALTY CORP		40.703		1,204		44.454		1,277
		(-)		(-)		(-)		(-)
PS BUSINESS PARKS		21.502		3,641		24.658		4,208
		(-)		(-)		(-)		(-)
RPT REALTY		82.25		1,054		94.901		1,193
		(-)		(-)		(-)		(-)
REALTY INCOME CORP		584.127		39,839		653.082		44,164
		(78.539)		(-)		(-)		(-)
REGENCY CENTERS CORP		171.045		11,811		198.104		13,458
		(-)		(-)		(-)		(-)
UDR INC		328.034		17,860		375.091		20,166
		(-)		(-)		(-)		(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES		121.783		3,354		139.582		3,723
		(-)		(-)		(-)		(-)
SAUL CENTERS INC		10.583		523		12.187		598
		(-)		(-)		(-)		(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC		362.903		48,983		415.796		55,867
		(-)		(-)		(-)		(-)
LIFE STORAGE INC		91.613		11,861		101.298		12,883
		(-)		(-)		(-)		(-)
PUBLIC STORAGE		169.181		57,924		193.522		65,138
		(-)		(-)		(-)		(-)
SUN COMMUNITIES INC		130.759		24,233		145.676		26,873
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
TANGER FACTORY OUTLET	106.177	1,863	121.975	2,161
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	47.409	1,092	52.036	1,175
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	28.55	623	34.347	729
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	10.073	573	12.287	676
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	439.274	24,263	497.685	26,335
	(5.792)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	173.513	7,268	198.638	8,069
	(-)	(-)	(-)	(-)
WASHINGTON REIT	91.284	2,266	106.807	2,616
	(-)	(-)	(-)	(-)
GEO GROUP INC	56.667	435	113.771	836
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEINGARTEN REALTY INVST	2.249	72	2,895	92
	(△55.441)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	155.979	8,545	177.913	9,751
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	203.121	4,330	237.77	4,935
	(61.224)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	148.735	28,506	169.96	32,134
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	84.762	476	98.234	538
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	248.858	2,905	281.805	3,222
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	246.264	12,480	271.595	13,495
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	313.291	46,748	357.633	53,438
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	225.157	2,161	263.596	2,475
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	660.812	13,574	753.532	15,152
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	196.573	6,295	220.349	6,883
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	131.563	2,409	152.251	2,715
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	136.96	2,353	156.261	2,657
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	107.883	1,018	124.997	1,161
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	82.201	5,770	91.032	6,357
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	54.651	1,990	62.171	2,225
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	184.183	2,567	209.54	2,858
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
AMERICOLD REALTY TRUST	297.472	9,005	334.363	10,023
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORESITE REALTY CORP	25.471	3,900	45.824	7,385
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	76.731	3,719	73.294	3,508
	(△111.404)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	148.192	3,331	169.08	3,739
	(-)	(-)	(-)	(-)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	49.842	1,223	55.834	1,335
	(-)	(-)	(-)	(-)
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	42.333	843	66.485	1,382
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	41.619	544	46.767	608
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	242.499	3,438	270.593	3,663
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	30.051	340	31.519	344
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	168.856	4,237	192.685	4,688
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	193.093	7,849	213.439	8,528
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	65.179	847	71.259	900
	(△98.273)	(-)	(-)	(-)
CYRUSONE INC	105.596	8,887	162.579	14,064
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	210.112	16,632	234.439	18,278
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	69.323	1,570	80.565	1,759
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	27.504	826	29.64	894
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	245.899	7,727	278.614	8,619
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	60.92	5,233	69.644	5,879
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	61.2	878	68.946	951
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	140.335	6,460	153.757	6,966
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	240.602	4,332	271.156	4,816
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	174.777	11,927	186.063	12,703
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	320.322	12,673	356.064	13,967
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	192.864	4,636	171.557	4,038
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	28.261	5,885	31.086	6,187
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
JBG SMITH PROPERTIES	125.167	3,561	143.727	3,970
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	123.05	996	136.478	1,087
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL VALUE INC	-	-	8.794	59
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	662.529	26,758	741.06	29,572
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
QTS REALTY TRUST INC	6.185	480	38.531	3,002
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
COREPOINT LODGING INC	17.747	276	36.853	576
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	703	523	829.9	613
(-)	(-)	(△6)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	143.677	1,350	164.141	1,499
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	31.417	816	30.922	824
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	11.544	756	13.211	867
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	136.877	3,623	149.645	3,909
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	64.209	1,437	72.39	1,566
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	41.819	753	97.996	1,779
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	258.816	12,034	289.654	13,167
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	335.239	8,066	383.42	9,069
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	41.527	231	21.354	121
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	-	-	17.653	326
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	518.8	408	570.4	437
(-)	(-)	(△4)	(-)	(-)
POSTAL REALTY TRUST INC	10.309	187	4.889	81
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	7.927	148	5.242	98
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	41.679	1,235	20.925	593
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	-	-	8.408	70
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	28.71	624	31.016	653
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	9.908	138	11.177	159
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CITY OFFICE REIT INC	28.766	495	34.307	570
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ORION OFFICE REIT INC	39.605	640	48.132	741
	(25.252)	(-)	(-)	(-)
NETSTREIT CORP	44.288	998	40.525	872
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	101.179	2,066	118.155	2,325
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUS REALTY TRUST INC	6.505	459	4.193	299
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHILLIPS EDISON & CO INC	75.398	2,506	40.473	1,326
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INCOME REIT CORP	175.962	8,883	201.213	10,018
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROADSTONE NET LEASE INC	184.386	4,342	200.821	4,641
	(-)	(-)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	17.195	501	9.655	261
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	104.2	92	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	-	-	-	-
	(△37.108)	(-)	(-)	(-)
STORE CAPITAL CORP	273.837	8,650	309.496	9,663
	(-)	(-)	(-)	(-)
PARAMOUNT GROUP INC	170.958	1,603	196.416	1,765
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	58.406	904	66.316	1,002
	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN EDGE PROPERTIES	119.903	2,211	139.674	2,506
	(-)	(-)	(-)	(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	86.651	1,831	95.154	1,961
	(-)	(-)	(-)	(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	120.487	2,167	137.758	2,426
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	21.491	1,635	24.993	1,892
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	95.075	5,565	102.268	5,919
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	24.167	1,037	27.658	1,164
	(-)	(-)	(-)	(-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	228.907	3,733	260.4	4,186
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL NET LEASE INC	99.803	1,541	109.932	1,623
	(-)	(-)	(-)	(-)
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,550.6	1,029	1,682.7	1,105
	(-)	(△4)	(-)	(-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	262.611	4,907	300.433	5,501
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	825.144	23,992	781.141	22,152
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	27.482	391	43.132	502
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買		売	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	86,209	2,367	99,799	2,704
INC	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITALBRIDGE GROUP INC	507,857	3,628	746,406	5,083
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	82,001	2,538	93,831	2,852
	(-)	(-)	(-)	(-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	98,869	5,540	112,949	6,224
	(-)	(-)	(-)	(-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	163.1	2,404	187,431	2,674
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	120,497	2,118	140,726	2,433
	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	180,005	4,146	206,404	4,636
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALLIED PROPERTIES REIT	72,475	3,100	82,519	3,455
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMINAR REAL ESTATE INVT TR	45,618	491	89,864	1,009
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	25,422	627	30,075	720
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	21,997	1,166	25,326	1,323
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	71,575	871	85,193	1,025
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	60,208	1,082	65,052	1,137
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	73,381	1,176	82,337	1,290
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	114,429	1,541	125,376	1,653
	(-)	(-)	(-)	(-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7,605	140	9,73	172
	(-)	(-)	(-)	(-)
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,894	95	5,251	48
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	123,339	1,975	129,832	2,030
	(-)	(-)	(-)	(-)
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	55,971	230	40,548	161
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	99,256	2,162	109,602	2,325
	(-)	(-)	(-)	(-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,522	3,550	42,255	3,931
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	36.59	263	41,806	293
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHOICE PROPERTIES REIT	188,86	2,812	214,484	3,137
	(-)	(-)	(-)	(-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,446	429	24,011	490
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	54,846	954	61,879	1,060
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLAZA RETAIL REIT	19,973	97	24,208	111
	(-)	(-)	(-)	(-)
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31,114	144	20,998	87
	(-)	(-)	(-)	(-)
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,678	101	22,823	602
	(-)	(-)	(-)	(-)
SLATE GROCERY REIT	24,906	375	27,594	406
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEXUS INDUSTRIAL REIT	25,992	323	18,534	221
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARIS REIT	27,937	409	30,815	432
	(16,822)	(-)	(-)	(-)
SLATE OFFICE REIT	13,763	69	9,662	47
	(-)	(-)	(-)	(-)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,151	257	18,758	251
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	56,911	1,224	63,719	1,353
	(-)	(-)	(-)	(-)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	487.34	2,006	567,653	2,296
	(-)	(-)	(-)	(-)
MIRVAC GROUP	4,433,852	11,968	5,063,359	13,566
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,623,195	1,367	2,021,448	1,693
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	588,821	2,446	667,187	2,724
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	2,122,435	10,629	2,441,97	12,145
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	667,191	1,992	706,835	2,074
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABACUS PROPERTY GROUP	389,68	1,307	459,942	1,545
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	374,896	1,412	431,125	1,596
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	2,676,734	11,481	3,068,152	12,943
	(-)	(-)	(-)	(-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	396,075	2,214	421,207	2,294
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	1,187,661	12,724	1,360,328	14,489
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	1,877,623	42,634	2,143,587	48,201
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	4,277,345	7,548	4,910,399	8,384
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL GROUP	516,531	8,756	591,78	9,827
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買		売	
	口 数	金 額	口 数	金 額
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	316.124	1,315	355.879	1,454
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	1,270.733	3,623	1,443.294	4,068
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	502.755	1,892	553.307	2,038
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ARENA REIT	331.702	1,507	387.191	1,736
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	685.451	3,464	760.017	3,767
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS INDUSTRIA REIT	182.33	613	191.542	615
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE REIT	1,263.971	3,102	1,450.937	3,490
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	157.555	578	165.859	602
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GDI PROPERTY GROUP	528.845	601	597.735	656
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME CONSORTIUM LTD	86.906	617	101.174	713
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
RURAL FUNDS GROUP	482.295	1,393	516.198	1,466
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
IRONGATE GROUP	634.385	1,088	709.339	1,201
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	5,803.8	17,298	6,635.014	19,248
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	220.813	203	80.47	73
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME CONSORTIUM LTD	116.968	765	141.533	877
(6.46)	(42)	(-)	(-)	(-)
HOMECO DAILY NEEDS REIT	759.24	1,082	906.771	1,216
(374.004)	(530)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCO REIT	159.265	293	87.778	138
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA OFFICE REIT	437.602	1,003	488.986	1,095
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
AVENTUS GROUP	226.775	774	233.236	774
(△170.002)	(△572)	(-)	(-)	(-)
WAYPOINT REIT LTD	806.09	2,178	954.977	2,531
(△21.228)	(△58)	(-)	(-)	(-)
香港	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
LINK REIT	2,297.2	157,065	2,626.3	177,032
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PROSPERITY REIT	982	2,883	1,226	3,547
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,369	8,026	2,448	8,162
(-)	(0.21457)	(-)	(-)	(-)
CHAMPION REIT	1,925	7,538	2,230	8,597
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
香港	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,122	4,751	1,231	5,219
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,628	12,412	1,872	14,300
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	-	-	305.25	3
(305.25)	(△0.21457)	(-)	(-)	(-)
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	5,835.4	12,379	6,430.8	13,626
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ASCENDAS REAL ESTATE INV'T	3,817.6	11,202	4,324.4	12,585
(-)	(-)	(△31)	(-)	(-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	2,479.8	3,906	2,818.3	4,420
(-)	(-)	(△1)	(-)	(-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	3,586	6,671	3,970.8	7,346
(-)	(-)	(△26)	(-)	(-)
STARHILL GLOBAL REIT	1,526.6	939	1,771	1,081
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ASCOTT RESIDENCE TRUST	2,078.5	2,174	2,382	2,473
(-)	(-)	(△4)	(-)	(-)
KEPPEL REIT	2,247.6	2,576	2,600.2	2,947
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	1,279	2,967	1,575.3	3,629
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ESR LOGOS REIT	3,408.8	1,506	4,069.2	1,766
(1,069.91)	(458)	(-)	(-)	(-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	849.4	1,023	937.5	1,103
(-)	(-)	(△3)	(-)	(-)
CAPITALAND CHINA TRUST	1,144.8	1,373	1,256.8	1,488
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	715.6	216	996.7	293
(-)	(-)	(△9)	(-)	(-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	451.7	647	504.8	715
(-)	(-)	(△3)	(-)	(-)
PARKWAY LIFE REIT	387.3	1,859	448.9	2,164
(-)	(-)	(△2)	(-)	(-)
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	-	-	2,759.1	130
(-)	(-)	(△2)	(-)	(-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	2,173.1	5,826	2,488.6	6,606
(-)	(-)	(△0.68061)	(-)	(-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	2,461.2	4,840	2,816.3	5,479
(-)	(-)	(△5)	(-)	(-)
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	1,195	1,047	1,179.4	1,040
(△603.48)	(△517)	(-)	(-)	(-)
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	-	-	313.2	131
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	2,360.4	2,600	3,255	3,558
(-)	(-)	(△33)	(-)	(-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	1,074.8	665	1,262.5	767
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
SPH REIT	968.7	937	1,127.6	1,080
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	209.3	147	224.3	157
(-)	(-)	(△0.00001)	(-)	(-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	510	439	523.6	449
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
OUE COMMERCIAL REIT	2,366.1	996	2,698.5	1,135
(-)	(-)	(△2)	(-)	(-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	1,194.9	978	1,044.1	852
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS HOSPITALITY TRUST	-	-	377.1	171
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	103.9	74	-	-
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
IREIT GLOBAL	369.8	235	415.7	261
(-)	(-)	(△2)	(-)	(-)
KEPPEL DC REIT	1,490.3	3,454	1,678.3	3,828
(-)	(-)	(△7)	(-)	(-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	3,272.5	4,773	3,692.7	5,352
(-)	(-)	(△15)	(-)	(-)
ニュージーランド	千口	千ニュージーランド・ドル	千口	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	1,380.504	2,161	1,498.848	2,319
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	407.484	1,269	445.327	1,348
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	1,177.028	2,864	1,379.893	3,328
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,667.156	1,864	1,942.429	2,154
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	975.321	1,430	1,073.46	1,561
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	1,072.95	5,611	1,222.357	6,288
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	125.389	4,157	143.656	4,719
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	192.7	2,890	217.342	3,169
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	4,584.197	1,514	5,513.049	1,763
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	862.339	6,480	987.714	7,287
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	138.79	1,096	160.203	1,247
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	444.964	4,967	507.935	5,528
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	1,505.98	2,276	1,715.62	2,532
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY PLC	321.302	1,959	377.658	2,287
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
SEGRO PLC	1,340.273	17,188	1,534.87	19,450
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	287.251	2,072	328.823	2,355
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	3,335.879	2,348	3,675.459	2,521
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LTD	257.64	212	321.322	256
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	421.073	227	515.379	276
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	617.37	608	695.399	685
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	877.238	709	969.076	786
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	233.808	2,887	266.972	3,216
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,067.091	2,817	1,190.237	3,070
	(-)	(-)	(-)	(-)
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	785.572	845	916.961	978
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	959.617	1,598	1,098.079	1,806
	(-)	(-)	(-)	(-)
GCP STUDENT LIVING PLC	204.051	435	414.247	877
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEWRIVER REIT PLC	121.045	109	147.303	129
	(-)	(-)	(-)	(-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	564.808	522	675.904	619
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRS REIT PLC/THE	723.891	778	542.722	569
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	384.572	372	456.276	429
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	996.24	1,244	986.42	1,207
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,062.787	4,738	2,297.396	5,221
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUSTODIAN REIT PLC	394.227	406	468.275	478
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME REIT PLC	468.725	566	383.46	457
	(-)	(-)	(-)	(-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	682.508	613	766.56	673
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEW UK REIT PLC	80.881	95	106.184	118
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXI REIT PLC	820.716	1,204	835.877	1,208
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGIONAL REIT LTD	414.619	370	470.723	416
	(-)	(-)	(-)	(-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	313.459	370	330.806	388
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
イスラエル	千口	千イスラエル・シュケル	千口	千イスラエル・シュケル
REIT 1 LTD	157,562	3,177	181,198	3,740
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	(-)	(-)	(-)	(-)
87,076	876	23,453	219	(-)
(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
韓国	千口	千韓国・ウォン	千口	千韓国・ウォン
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	43,051	283,114	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	90,636	429,991	101,644	481,155
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	49,557	393,982	49,672	389,405
	(-)	(3)	(-)	(-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	18,615	109,358	17,541	101,772
	(-)	(-)	(-)	(-)
LOTTE REIT CO LTD	141,664	805,920	156,57	877,855
	(-)	(-)	(-)	(-)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	17.79	115,758	24,498	153,062
	(-)	(△8)	(-)	(-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD-RTS	-	-	23.41	-
	(23.41)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	4,123	21,978	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
JR REIT XXVII	143.27	781,151	154,298	831,650
	(-)	(-)	(-)	(-)
SK REITS CO LTD	32,243	213,040	14,552	98,881
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	-	-	7,141	-
	(7.141)	(△3)	(-)	(-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	143,555	943,970	189,413	1,225,635
	(-)	(-)	(-)	(-)
D&D PLATFORM REIT CO LTD	38,018	204,291	23,689	126,041
	(-)	(-)	(-)	(-)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	11,162	59,530	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT-RTS	-	-	3,188	-
	(3.188)	(8)	(-)	(-)
ユーロ(シンガポール)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	313.4	747	343.8	820
	(-)	(△3)	(-)	(-)
ユーロ(アイルランド)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
HIBERNIA REIT PLC	670,655	908	977,503	1,366
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	425,258	652	513,785	772
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ(オランダ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4,781 (△18,604)	105 (-)	4,387 (-)	96 (-)
VASTNED RETAIL	19,064 (-)	466 (-)	22,698 (-)	543 (-)
WERELDHAVE NV	40,773 (-)	586 (-)	46,515 (-)	641 (-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
NSI NV	19,909	706	22,325	781
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	(-)	(-)	(-)	(-)
	33,552	707	40,321	820
	(18,761)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
BEFIMMO	25,803	1,020	30,753	1,198
COFINIMMO SA	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL ESTATES	32,746	4,266	37,41	4,889
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	9,371	662	11,04	768
MONTEA SCA	24,855	649	28,305	741
AEDIFICA	(-)	(-)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV	160,242	5,965	180,812	6,657
XIOR STUDENT HOUSING NV	9,915	1,166	11,58	1,340
	(-)	(-)	(-)	(-)
	41,877	4,645	46,408	5,123
	(-)	(-)	(-)	(-)
	30,116	760	33,301	842
	(-)	(-)	(-)	(-)
	20,671	1,030	21,96	1,075
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
GECINA SA	60,455	7,020	69,268	7,984
ICADE	(-)	(-)	(-)	(-)
ALTAREA	33,864	2,105	38,571	2,397
KLEPIERRE	(-)	(-)	(-)	(-)
COVIVIO	3,947	632	4,342	671
MERCIALYS	216,142	4,605	249,876	5,274
CARMILA SA	(-)	(△70)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	52,496	3,782	60,831	4,338
ALTAREA SCA-RTS	40,088	352	41,163	360
	(-)	(-)	(-)	(-)
	39,205	546	47,86	660
	(-)	(△9)	(-)	(-)
	134,349	8,772	163,439	10,582
	(-)	(-)	(-)	(-)
	(1,672)	(-)	1,672	4
		(-)	(-)	(-)
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	61,156	580	69,728	653
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	(-)	(-)	(-)	(-)
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	108,844	1,916	189,799	3,435
	(-)	(-)	(-)	(-)
	293,908	2,399	330,438	2,652
	(-)	(△25)	(-)	(-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
ユーロ（スペイン） LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	千口 36.39 (-) 368.517 (-)	千ユーロ 182 (△4) 3,654 (△16)	千口 45.091 (-) 424.548 (-)	千ユーロ 223 (-) 4,130 (-)
ユーロ（イタリア） IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE COIMA RES SPA	千口 44.176 (-) 18.292 (-)	千ユーロ 178 (-) 139 (-)	千口 55.103 (-) 10.696 (-)	千ユーロ 218 (-) 84 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## ■利害関係人との取引状況等（2021年6月23日から2022年6月22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

### 外国投資信託受益証券、投資証券

銘 柄	期 首(前期末) □	当 期				末 比 率 %
		数 千口	数 千口	外 貨 建 金 額 千アメリカ・ドル	邦 貨 換 算 金 額 千円	
不動産ファンド (アメリカ)						
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	354.4	227.5	154	21,115	0.0	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	72.7	72.7	0	0	0.0	
PRIME US REIT	211.4	159.8	107	14,613	0.0	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE	—	104.2	93	12,728	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME	658.4	526.3	302	41,304	0.1	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64.515	45.455	5,982	816,590	1.5	
ALEXANDER'S INC.	0.989	0.661	143	19,630	0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	66.493	44.04	3,963	540,991	1.0	
CEDAR REALTY TRUST INC	—	3.781	101	13,830	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	109.6	72,072	1,982	270,618	0.5	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	68.881	50,727	297	40,642	0.1	
AGREE REALTY CORP	29.676	23,151	1,606	219,295	0.4	
BRT APARTMENTS CORP	3.832	4.22	93	12,746	0.0	
SL GREEN	33.08	19,707	951	129,837	0.2	
EPR PROPERTIES	34.918	23,004	1,042	142,327	0.3	
PROLOGIS INC	346.969	227,981	25,615	3,496,320	6.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	65.657	43,06	8,241	1,124,907	2.0	
LXP INDUSTRIAL TRUST	129.482	86,864	904	123,421	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	45.941	32,805	4,276	583,738	1.0	
VERIS RESIDENTIAL INC	39.452	26,897	371	50,698	0.1	
EQUINIX INC	42.011	28,058	17,962	2,451,656	4.4	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	82.875	54,298	2,245	306,450	0.5	
CTO REALTY GROUTH INC	2.965	1,858	111	15,155	0.0	
COUSINS PROPERTIES INC	70.851	45,843	1,340	182,957	0.3	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	14.44	9,712	155	21,209	0.0	
SITE CENTERS CORP	81.132	54,965	711	97,078	0.2	
DUKE REALTY TRUST	175.583	118,933	6,254	853,702	1.5	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	15,107	86	11,814	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	30,569	20,121	5,140	701,601	1.3	
EQUITY RESIDENTIAL	161.226	105,387	7,509	1,025,023	1.8	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	33.02	21,871	2,072	282,874	0.5	
FIRST INDUSTRIAL RT	60.986	40,254	1,869	255,153	0.5	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	253.462	166,168	4,134	564,285	1.0	
EQUITY COMMONWEALTH	56.714	34,761	964	131,660	0.2	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	65.332	45,424	1,201	163,925	0.3	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	48.629	32,282	1,089	148,664	0.3	
SERVICE PROPERTIES TRUST	76.025	55,097	278	38,052	0.1	
WELLTOWER INC	196.362	139,809	11,000	1,501,413	2.7	
EAST GROUP	18.728	12,57	1,902	259,719	0.5	
KIMCO REALTY	204.567	191,008	3,632	495,864	0.9	
KILROY REALTY CORP	50.045	32,424	1,659	226,543	0.4	
LTC PROPERTIES INC	17.932	11,949	451	61,632	0.1	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	112.836	80.9	152	20,759	0.0	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	48.171	—	—	—	—	
BRANDYWINE REALTY TRUST	83.055	52,781	503	68,654	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	135.791	89,485	4,222	576,369	1.0	
THE MACERICH COMPANY	78.672	65,088	581	79,421	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	79.741	53,477	3,719	507,723	0.9	
ACADIA REALTY TRUST	42.275	26,852	422	57,687	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	332.075	221,191	3,643	497,235	0.9	
MID AMERICA	53.615	35,548	5,818	794,166	1.4	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期					末 率
		口 数	口 数	外 貨	建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル		千円		%
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,618	9,122	85	11,728		0.0	
NATIONAL HEALTH INVS INC	21,18	14,064	826	112,872		0.2	
CENTERSPACE	6,06	5,041	391	53,495		0.1	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,856	5,609	142	19,414		0.0	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,075	1,938	7	1,031		0.0	
GETTY REALTY CORP	16,951	13,2	340	46,537		0.1	
PS BUSINESS PARKS	9,349	6,193	1,151	157,222		0.3	
RPT REALTY	37,794	25,143	239	32,704		0.1	
REALTY INCOME CORP	175,691	185,275	12,129	1,655,617		3.0	
REGENCY CENTERS CORP	74,742	47,683	2,783	379,886		0.7	
UDR INC	139,707	92,65	4,085	557,679		1.0	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	52,297	34,498	914	124,778		0.2	
SAUL CENTERS INC	6,198	4,594	199	27,294		0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	154,013	101,12	9,767	1,333,122		2.4	
LIFE STORAGE INC	35,667	25,982	2,759	376,615		0.7	
PUBLIC STORAGE	71,371	47,03	14,207	1,939,153		3.5	
SUN COMMUNITIES INC	52,37	37,453	5,792	790,564		1.4	
TANGER FACTORY OUTLET	47,408	31,61	444	60,704		0.1	
UMH PROPERTIES INC	18,196	13,569	227	31,058		0.1	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16,822	11,025	201	27,447		0.0	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,995	3,781	191	26,128		0.0	
VENTAS INC	175,714	123,095	5,976	815,700		1.5	
VORNADO REALTY TRUST	74,163	49,038	1,386	189,216		0.3	
WASHINGTON REIT	41,358	25,835	553	75,566		0.1	
GEO GROUP INC	57,104	—	—	—		—	
WEINGARTEN REALTY INVST	56,087	—	—	—		—	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	65	43,066	2,760	376,843		0.7	
KITE REALTY GROUP TRUST	40,874	67,449	1,180	161,106		0.3	
EXTRA SPACE STORAGE INC	62,579	41,354	6,691	913,378		1.6	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,648	33,176	138	18,927		0.0	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,104	67,157	671	91,662		0.2	
CUBESMART	94,451	69,12	2,799	382,084		0.7	
DIGITAL REALTY TRUST INC	132,013	87,671	11,234	1,533,350		2.7	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	102,73	64,291	538	73,447		0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	277,416	184,696	2,707	369,566		0.7	
DOUGLAS EMMETT INC	77,84	54,064	1,200	163,818		0.3	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	57,754	37,066	577	78,821		0.1	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	57,283	37,982	494	67,445		0.1	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	48,846	31,732	225	30,837		0.1	
TERRENO REALTY CORP	32,097	23,266	1,300	177,546		0.3	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	23,736	16,216	473	64,651		0.1	
RLJ LODGING TRUST	76,242	50,885	560	76,537		0.1	
AMERICOLD REALTY TRUST	119,402	82,511	2,331	318,262		0.6	
CORESITE REALTY CORP	20,353	—	—	—		—	
VEREIT INC	107,967	—	—	—		—	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	61,175	40,287	705	96,283		0.2	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	22,164	16,172	310	42,424		0.1	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES	24,152	—	—	—		—	
CHATHAM LODGING TRUST	22,362	17,214	176	24,106		0.0	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	98,359	70,265	971	132,636		0.2	
WHITESTONE REIT	17,85	16,382	175	23,992		0.0	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	70,573	46,744	739	100,996		0.2	
STAG INDUSTRIAL INC	74,75	54,404	1,662	226,926		0.4	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	104,353	—	—	—		—	
CYRUSONE INC	56,983	—	—	—		—	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期					末 率
		口 数	口 数	外 貨	建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル		千円	%	
WP CAREY INC	83.879	59.552	4,998	682,285	1.2		
ALEXANDER & BALDWIN INC	33.22	21.978	394	53,875	0.1		
GLADSTONE LAND CORP	11.352	9.216	211	28,830	0.1		
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	103.264	70.549	1,954	266,729	0.5		
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	25.702	16.978	1,293	176,603	0.3		
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	27.874	20.128	257	35,192	0.1		
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	54.785	41.363	1,544	210,864	0.4		
PHYSICIANS REALTY TRUST	98.37	67.816	1,139	155,504	0.3		
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	62.108	50.822	2,901	396,015	0.7		
AMERICAN HOMES 4 RENT	127.151	91.409	3,038	414,716	0.7		
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	46.758	68.065	1,398	190,820	0.3		
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	11.187	8.362	907	123,914	0.2		
JBG SMITH PROPERTIES	51.608	33.048	795	108,618	0.2		
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	50.312	36.884	257	35,139	0.1		
RETAIL VALUE INC	8.794	—	—	—	—		
INVITATION HOMES INC	266.492	187.961	6,396	873,032	1.6		
QTS REALTY TRUST INC	32.346	—	—	—	—		
COREPOINT LODGING INC	19.106	—	—	—	—		
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	67.709	47.245	325	44,494	0.1		
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13.046	13.541	242	33,082	0.1		
SAFEHOLD INC	6.652	4.985	169	23,174	0.0		
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	53.159	40.391	845	115,386	0.2		
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	29.984	21.803	290	39,668	0.1		
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	56.177	—	—	—	—		
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	103.548	72.71	3,293	449,466	0.8		
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	140.188	92.007	1,810	247,142	0.4		
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	—	20.173	95	13,023	0.0		
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	17.653	—	—	—	—		
POSTAL REALTY TRUST INC	—	5.42	77	10,615	0.0		
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	—	2.685	47	6,438	0.0		
INVENTRUST PROPERTIES CORP	—	20.754	551	75,265	0.1		
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST	12.476	4.068	30	4,119	0.0		
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	10.643	8.337	216	29,574	0.1		
FARMLAND PARTNERS INC	11.176	9.907	144	19,715	0.0		
CITY OFFICE REIT INC	20.935	15.394	182	24,856	0.0		
ORION OFFICE REIT INC	—	16.725	196	26,822	0.0		
NETSTREIT CORP	10.996	14.759	276	37,750	0.1		
CARETRUST REIT INC	46.858	29.882	522	71,293	0.1		
INDUS REALTY TRUST INC	—	2.312	138	18,886	0.0		
PHILLIPS EDISON & CO INC	—	34.925	1,147	156,593	0.3		
APARTMENT INCOME REIT CORP	73.756	48.505	1,959	267,466	0.5		
BROADSTONE NET LEASE INC	68.576	52.141	1,066	145,608	0.3		
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	—	7.54	195	26,716	0.0		
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	37.108	—	—	—	—		
STORE CAPITAL CORP	113.425	77.766	2,005	273,742	0.5		
PARAMOUNT GROUP INC	80.717	55.259	406	55,435	0.1		
GLOBAL MEDICAL REIT INC	25.732	17.822	196	26,806	0.0		
URBAN EDGE PROPERTIES	53.765	33.994	508	69,412	0.1		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	37.693	29.19	540	73,826	0.1		
XENIA HOTELS & RESORTS INC	52.488	35.217	503	68,784	0.1		
NEXPPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10.397	6.895	401	54,828	0.1		
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	32.425	25.232	1,174	160,314	0.3		
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10.481	6.99	234	32,056	0.1		
APPLE HOSPITALITY REIT INC	96.779	65.286	968	132,237	0.2		
GLOBAL NET LEASE INC	41.546	31.417	422	57,675	0.1		

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%		
CLIPPER REALTY INC	5,086	5,086	38	5,261	0.0		
PARK HOTELS & RESORTS INC	110,619	72,797	1,036	141,489	0.3		
VICI PROPERTIES INC	252,573	296,576	8,855	1,208,722	2.2		
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	15.65	—	—	—	—		
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	37.21	23.62	609	83,240	0.1		
DIGITALBRIDGE GROUP INC	238.549	—	—	—	—		
小計	11,651,995	7,979,351	311,730	42,548,156	—		
	銘柄数	金額	—	—	—		
	数<比率>	156銘柄<74.6%>	151銘柄<76.0%>	—	—	76.0	
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%		
SMARTCENTRES REIT	33,365	21,535	588	62,039	0.1		
CANADIAN APT PPTYS REIT	40,179	26,099	1,153	121,625	0.2		
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	67,209	42,878	533	56,225	0.1		
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	52,733	32,504	483	50,982	0.1		
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	72,829	46.43	947	99,841	0.2		
ALLIED PROPERTIES REIT	29,143	19,099	657	69,315	0.1		
COMINAR REAL ESTATE INVT TR	44,246	—	—	—	—		
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	12,866	8,213	161	17,011	0.0		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,875	7,546	321	33,861	0.1		
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	31,111	17,493	213	22,477	0.0		
CROMBIE REAL ESTATE INV	21,592	16,748	267	28,158	0.1		
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	31,544	22,588	275	29,048	0.1		
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	43,997	33.05	403	42,572	0.1		
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	8,583	6,458	106	11,211	0.0		
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT	—	4,643	35	3,700	0.0		
DREAM INDUSTRIAL REIT	42,899	36,406	445	46,971	0.1		
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	15,423	56	5,917	0.0		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	37,879	27,533	459	48,409	0.1		
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	14,568	9,835	780	82,304	0.1		
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	22,019	16,803	106	11,194	0.0		
CHOICE PROPERTIES REIT	74,537	48,913	672	70,893	0.1		
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	8,825	5.26	76	8,028	0.0		
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24.18	17,147	274	28,919	0.1		
PLAZA RETAIL REIT	20,611	16,376	70	7,388	0.0		
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE	—	10,116	39	4,126	0.0		
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES	19,145	—	—	—	—		
SLATE GROCERY REIT	10,657	7,969	112	11,902	0.0		
NEXUS INDUSTRIAL REIT	—	7,458	76	8,018	0.0		
PRIMARIS REIT	—	13,944	176	18,637	0.0		
SLATE OFFICE REIT	11,634	15,735	73	7,795	0.0		
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT	7,088	7,481	97	10,314	0.0		
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	24,752	17,944	306	32,344	0.1		
小計	819,066	579,627	9,972	1,051,238	—		
	銘柄数	金額	—	—	—	1.9	
	数<比率>	27銘柄<2.0%>	30銘柄<1.9%>	—	—		
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%		
BWP TRUST	224,791	144,478	562	53,228	0.1		
MIRVAC GROUP	1,846,984	1,217,477	2,483	235,226	0.4		
CROMWELL PROPERTY GROUP	865,185	466,932	333	31,619	0.1		
CHARTER HALL RETAIL REIT	236,221	157,855	612	58,007	0.1		
GPT GROUP	911,007	591,472	2,484	235,276	0.4		
CENTURIA CAPITAL GROUP	229,128	189,484	365	34,635	0.1		
ABACUS PROPERTY GROUP	196,651	126,389	338	32,080	0.1		
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	154,369	98.14	316	30,022	0.1		
STOCKLAND	1,128.82	737,402	2,691	254,913	0.5		
INGENIA COMMUNITIES GROUP	134,675	109,543	422	40,046	0.1		
DEXUS	505,128	332,461	3,042	288,109	0.5		

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率		
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%		
GOODMAN GROUP	789.54	523.576	9,178	869,275	1.6		
VICINITY CENTRES	1,826.547	1,193.493	2,243	212,507	0.4		
CHARTER HALL GROUP	220.887	145.638	1,625	153,934	0.3		
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	136.67	96.915	332	31,483	0.1		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	513.792	341.231	934	88,551	0.2		
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	212.974	162.422	469	44,456	0.1		
ARENA REIT	159.242	103.753	422	39,993	0.1		
CHARTER HALL LONG WALE REIT	260.875	186.309	806	76,404	0.1		
DEXUS INDUSTRIA REIT	73.145	63.933	172	16,348	0.0		
NATIONAL STORAGE REIT	516.215	329.249	740	70,162	0.1		
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73.965	65.661	206	19,589	0.0		
GDI PROPERTY GROUP	247.876	178.986	170	16,104	0.0		
HOME CONSORTIUM LTD	85.98	—	—	—	—		
RURAL FUNDS GROUP	160.193	126.29	334	31,696	0.1		
IRONGATE GROUP	256.148	181.194	341	32,348	0.1		
SCENTRE GROUP	2,437.607	1,606.393	4,208	398,610	0.7		
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	—	140.343	115	10,899	0.0		
HOME CONSORTIUM LTD	—	53.607	241	22,847	0.0		
HOME CO DAILY NEEDS REIT	213.11	439.583	580	54,955	0.1		
HEALTHCO REIT	—	71.487	105	10,020	0.0		
CENTURIA OFFICE REIT	179.274	127.89	225	21,317	0.0		
AVENTUS GROUP	176.463	—	—	—	—		
WAYPOINT REIT LTD	382.777	212.662	480	45,519	0.1		
小計	□銘柄数	・金額比率	15,356,239	10,522,248	37,590	3,560,193	—
	銘柄数<比率>		31銘柄<6.9%>	32銘柄<6.4%>	—	—	6.4
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円	%		
LINK REIT	977.72	648.62	41,835	727,527	1.3		
PROSPERITY REIT	597	353	843	14,671	0.0		
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	761	682	2,066	35,935	0.1		
CHAMPION REIT	937.07	632.07	2,218	38,580	0.1		
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	451	342	1,231	21,410	0.0		
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	680	436	2,816	48,979	0.1		
小計	□銘柄数	・金額比率	4,403.79	3,093.69	51,012	887,106	—
	銘柄数<比率>		6銘柄<1.7%>	6銘柄<1.6%>	—	—	1.6
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	2,169.309	1,573.909	3,368	331,393	0.6		
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,544.76	1,037.96	2,854	280,843	0.5		
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,006.99	668.49	1,076	105,894	0.2		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,370.62	985.82	1,616	159,071	0.3		
STARHILL GLOBAL REIT	656.8	412.4	239	23,534	0.0		
ASCOTT RESIDENCE TRUST	891.616	588.116	670	65,965	0.1		
KEPPEL REIT	951.5	598.9	676	66,586	0.1		
FRASERS CENTREPOINT TRUST	622.9	326.6	728	71,659	0.1		
ESR LOGOS REIT	1,148.73	1,558.24	638	62,859	0.1		
CDL HOSPITALITY TRUSTS	365.2	277.1	357	35,170	0.1		
CAPITALAND CHINA TRUST	450.18	338.18	388	38,264	0.1		
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	608.8	327.7	91	9,027	0.0		
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	216.895	163.795	221	21,756	0.0		
PARKWAY LIFE REIT	179	117.4	564	55,560	0.1		
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	2,759.1	—	—	—	—		
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	913.12	597.62	1,500	147,587	0.3		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,028.2	673.1	1,204	118,545	0.2		
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	587.88	—	—	—	—		
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	313.2	—	—	—	—		
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,019	124.4	149	14,687	0.0		

銘柄	期首(前期末)		当期末			
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(シンガポール)	千口	千口	千円	千円	%	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	491.5	303.8	191	18,831	0.0	
SPH REIT	471.9	313	294	28,948	0.1	
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT	127.4	112.4	62	6,193	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	208.1	194.5	146	14,448	0.0	
OUE COMMERCIAL REIT	1,120.355	787.955	303	29,847	0.1	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	422.2	573	449	44,256	0.1	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	377.1	—	—	—	—	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	—	103.9	72	7,104	0.0	
IREIT GLOBAL	214.5	168.6	104	10,284	0.0	
KEPPEL DC REIT	591.5	403.5	778	76,621	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	1,314.964	894.764	1,207	118,848	0.2	
小計	□数 銘柄 数<比率>	24,143.319 30銘柄<3.3%>	14,225.149 27銘柄<3.5%>	19,959 —	1,963,791 —	
(ニュージーランド)	千口	千口	千円	千円	%	
PRECINCT PROPERTIES	510.038	391.694	524	45,117	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	180.112	142.269	382	32,897	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	520.345	317.48	628	54,035	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	742.461	467.188	455	39,155	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	388.009	289.87	343	29,526	0.1	
小計	□数 銘柄 数<比率>	2,340.965 5銘柄<0.4%>	1,608.501 5銘柄<0.4%>	2,335 —	200,732 —	
(イギリス)	千口	千口	千円	千円	%	
BRITISH LAND CO PLC	437.522	288.115	1,452	242,674	0.4	
DERWENT LONDON PLC	52.817	34.55	945	157,976	0.3	
BIG YELLOW GROUP PLC	77.686	53.044	668	111,784	0.2	
HAMMERSOHN PLC	1,976.821	1,047.969	222	37,128	0.1	
LAND SECURITIES GROUP PLC	355.626	230.251	1,655	276,744	0.5	
WORKSPACE GROUP PLC	63.229	41.816	261	43,711	0.1	
INTU PROPERTIES PLC	231.04	231.04	0	0	0.0	
UNITE GROUP PLC	186.15	123.179	1,326	221,707	0.4	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	617.519	407.879	567	94,817	0.2	
SHAFTESBURY PLC	144.406	88.05	492	82,329	0.1	
SEGRO PLC	564.915	370.318	3,647	609,592	1.1	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	119.078	77.506	477	79,789	0.1	
ASSURA PLC	1,242.776	903.196	602	100,678	0.2	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	179.591	115.909	90	15,147	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	255.156	160.85	86	14,462	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	257.572	179.543	168	28,174	0.1	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	347.914	256.076	201	33,637	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS LTD	97.821	64.657	679	113,565	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	423.479	300.333	697	116,545	0.2	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT	370.408	239.019	274	45,856	0.1	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL	397.993	259.531	390	65,232	0.1	
GCP STUDENT LIVING PLC	210.196	—	—	—	—	
NEWRIVER REIT PLC	139.604	113.346	103	17,313	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	294.033	182.937	146	24,488	0.0	
PRS REIT PLC/THE	—	181.169	195	32,699	0.1	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	177.39	105.686	92	15,401	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	371.767	381.587	492	82,264	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	810.128	575.519	1,083	181,012	0.3	
CUSTODIAN REIT PLC	202.92	128.872	133	22,355	0.0	
HOME REIT PLC	100.813	186.078	210	35,202	0.1	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	281.997	197.945	168	28,118	0.1	
AEW UK REIT PLC	83.963	58.66	69	11,607	0.0	
LXI REIT PLC	292.448	277.287	380	63,671	0.1	

銘柄		期首(前期末)	当期			期末
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
REGIONAL REIT LTD		206.337	150.233	115	19,332	0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		153.417	136.07	166	27,879	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	11,724.532 34銘柄<5.6%>	8,148.22 34銘柄<5.5%>	18,267	3,052,903	— 5.5
(イスラエル)		千口	千口	千イスラエル・シュケル	千円	%
REIT 1 LTD		85.363	61.727	1,132	44,721	0.1
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD		—	63.623	613	24,241	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	85.363 1銘柄<0.1%>	125.35 2銘柄<0.1%>	1,745	68,963	— 0.1
(韓国)		千口	千口	千韓国・ウォン	千円	%
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE		39.843	28.835	129,757	13,689	0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		19.635	19.52	151,670	16,001	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		9.958	11.032	60,124	6,343	0.0
LOTTE REIT CO LTD		54.509	39.603	224,152	23,648	0.0
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		17.86	11.152	66,688	7,035	0.0
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD		—	4.123	21,315	2,248	0.0
JR REIT XXVII		56.222	45.194	239,076	25,222	0.0
SK REITS CO LTD		—	17.691	109,861	11,590	0.0
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD		46.423	43.616	244,249	25,768	0.0
D&D PLATFORM REIT CO LTD		—	14.329	71,286	7,520	0.0
NH ALL-ONE REIT CO LTD		—	11.162	57,261	6,041	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	244.45 7銘柄<0.2%>	246,257 11銘柄<0.3%>	1,375,444 —	145,109 —	— 0.3
(ユーロ…シンガポール)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
CROMWELL REIT EUR		131.74	101.34	198	28,494	0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	131.74 1銘柄<0.1%>	101.34 1銘柄<0.1%>	198 —	28,494 —	— 0.1
(ユーロ…アイルランド)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
HIBERNIA REIT PLC		306.848	—	—	—	—
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI		214.307	125.78	158	22,808	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	521.155 2銘柄<0.1%>	125.78 1銘柄<0.0%>	158 —	22,808 —	— 0.0
(ユーロ…オランダ)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		18.21	—	—	—	—
VASTNED RETAIL		8.822	5.188	115	16,634	0.0
WERELDHAVE NV		18.894	13.152	192	27,565	0.0
NSI NV		8.112	5.696	195	27,987	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		—	11.992	263	37,779	0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	54.038 4銘柄<0.2%>	36,028 4銘柄<0.2%>	766 —	109,967 —	— 0.2
(ユーロ…ベルギー)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
BEFIMMO		12.281	7.331	346	49,640	0.1
COFINIMMO SA		13.734	9.07	1,028	147,554	0.3
RETAIL ESTATES		5.045	3.376	218	31,287	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		10.415	6.965	179	25,679	0.0
WAREHOUSES DE PAUW		64.409	43.839	1,386	198,862	0.4
MONTEA SCA		4.725	3.06	283	40,606	0.1
AEDIFICA		15.707	11.176	1,058	151,913	0.3
CARE PROPERTY INVEST NV		12.034	8.849	213	30,657	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		8.239	6.95	287	41,178	0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	146.589 9銘柄<1.3%>	100,616 9銘柄<1.3%>	5,000	717,379	— 1.3
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA		25.599	16.786	1,636	234,791	0.4
ICADE		14.526	9.819	478	68,656	0.1

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率		
(ユーロ…フランス)							
ALTAREA	千口	千口	千ユーロ	千円	%		
KLEPIERRE	1,643	1,248	160	23,095	0.0		
COVIVIO	93.81	60,076	1,241	178,144	0.3		
MERCIALYS	22,853	14,518	829	119,029	0.2		
CARMILA SA	19,022	17,947	151	21,678	0.0		
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	21,853	13,198	196	28,135	0.1		
	64,946	35,856	1,946	279,210	0.5		
小計	□数 銘柄 数<比率>	264,252 8銘柄<2.4%>	169,448 8銘柄<1.7%>	6,641 —	952,743 —	—	1.7
(ユーロ…ドイツ)							
HAMBORNER REIT AG	千口	千口	千ユーロ	千円	%		
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	32,106	23,534	200	28,697	0.1		
	84,625	3,67	44	6,391	0.0		
小計	□数 銘柄 数<比率>	116,731 2銘柄<0.3%>	27,204 2銘柄<0.1%>	244 —	35,089 —	—	0.1
(ユーロ…スペイン)							
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	千口	千口	千ユーロ	千円	%		
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	119,135	82,605	530	76,139	0.1		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	27,656	18,955	93	13,474	0.0		
	158,63	102,599	998	143,214	0.3		
小計	□数 銘柄 数<比率>	305,421 3銘柄<0.4%>	204,159 3銘柄<0.4%>	1,622 —	232,828 —	—	0.4
(ユーロ…イタリア)							
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	千口	千口	千ユーロ	千円	%		
COIMA RES SPA	25,287	14,36	51	7,323	0.0		
	—	7,596	75	10,777	0.0		
小計	□数 銘柄 数<比率>	25,287 1銘柄<0.0%>	21,956 2銘柄<0.0%>	126 —	18,100 —	—	0.0
合計	□数 銘柄 数<比率>	72,334,932 327銘柄<99.4%>	47,314,924 328銘柄<99.3%>	— —	55,595,607 —	—	99.3

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

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

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

## ■投資信託財産の構成

2022年6月22日現在

項目	当期末		
	評価額	比率	
投資信託受益証券、投資証券	千円	%	
	55,595,607	98.5	
コール・ローン等、その他	842,071	1.5	
投資信託財産総額	56,437,679	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、55,938,040千円、99.1%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、2022年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.49円、1カナダ・ドル=105.41円、1オーストラリア・ドル=94.71円、1香港・ドル=17.39円、1シンガポール・ドル=98.39円、1ニュージーランド・ドル=85.96円、1イギリス・ポンド=167.12円、1イスラエル・シェケル=39.504円、100韓国・ウォン=10.55円、1ユーロ=143.46円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月22日)現在

項	目	当期末
(A) 資	産	56,437,679,196円
コ 一 ル ル · 口 一 ナ 等		288,322,757
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)		5,691,222,488
投 資 証 券(評価額)		49,904,384,713
未 収 入 金		369,386,292
未 収 配 当 金		184,362,946
(B) 負 債		434,601,501
未 払 金		431,473,501
未 払 解 約 金		3,128,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)		56,003,077,695
元 本		33,589,773,063
次 期 繰 越 損 益 金		22,413,304,632
(D) 受 益 権 総 口 数		33,589,773,063口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)		16,673円

(注1) 期首元本額 51,487,595,373円  
 追加設定元本額 123,561,181,960円  
 一部解約元本額 141,459,004,270円

(注2) 期末における元本の内訳

先進REITインデックスF<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	89,931,914円
先進REITインデックスF<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	50,563,654円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	6,720,407円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	23,507,005円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	124,969,213円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	31,704,221円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	17,648,722円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,738,279円
たわらノーロード 先進国リート	12,630,933,969円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,109,201,766円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	313,831,478円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,325,859,048円
たわらノーロード バランス (堅実型)	21,585,836円
たわらノーロード バランス (標準型)	393,429,232円
たわらノーロード バランス (積極型)	783,248,768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)	2,849,915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)	5,559,853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)	92,299,102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)	219,476,091円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	5,370,883円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,144,625円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,960,422円
One D C先進国リートインデックスファンド	1,184,878,273円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	14,409,019円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	497,283,471円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	42,883,778円
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	179,983,530円
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	232,723,605円
D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	466,414,247円
投資のソムリエ	6,257,726,433円
投資のソムリエ<DC年金>	394,192,597円
D IAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	192,368,902円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	358,133,162円

リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,813,208,729円
ワールドアセットバランス (基本コース)	355,965,633円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	243,707,293円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	36,458,019円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	18,413,243円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)	2,367,743円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	82,448,556円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	319,237,578円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	147,067,136円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,933,275円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	19,741,762円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	12,168,821円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	2,125,847円
D IAMパッジ資産分散ファンド	276,893,448円
D IAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	252,886,121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)	983,915円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4	53,121,417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)	656,048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)	459,027円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03	56,379,915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)	583,400円
インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定)	826,526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)	692,408円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	153,285,243円
AM Oneマルチアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定)	8,623,168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)	1,380,735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)	7,212,770円
しあわせの一歩・私募 (適格機関投資家限定)	31,286,199円
D IAM世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	80,722,535円
D IAM世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家限定)	194,641,132円
D IAM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)	823,557,498円
D IAM海外リートインデックスファンド (適格機関投資家限定)	436,383,528円
期末元本合計	33,589,773,063円

## ■損益の状況

当期 自2021年6月23日 至2022年6月22日

項	目	当期			
(A) 配 受 受 そ 支	当 取 取 の 払	等 配 利 他 利	収 当 益 益 益	益 金 息 金 息	2,249,560,788円 2,170,878,662 1,204,472 77,775,326 △297,672
(B) 有 売 売	価 証 券	売 買	買 賣	買 損	1,466,080,453 20,774,196,674 △19,308,116,221
(C) そ (D) 当 (E) 前 (F) 解 (G) 追 (H) 合	の 期 期 約 加 期	他 損 繰 差 信 繰	費 益 越 損 託 越	用 金(A + B + C) 益 金	△65,480,614 3,650,160,627 27,471,618,273 △94,232,927,308 85,524,453,040 計(D + E + F + G)
					22,413,304,632
					22,413,304,632

(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。

# エマージング債券パッジブ・マザーファンド

## 運用報告書

第14期 (決算日 2022年4月18日)  
(計算期間 2021年4月20日～2022年4月18日)

エマージング債券パッジブ・マザーファンドの第14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	2008年3月6日から無期限です。
運用方針	主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 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。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)(ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰落率	中騰落率			
10期 (2018年4月18日)	円 17,815	% △0.6	ポイント 87,698.99	% △1.0	% 96.4	百万円 111,615
11期 (2019年4月18日)	19,206	7.8	93,647.60	6.8	97.5	— 108,066
12期 (2020年4月20日)	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5	— 78,076
13期 (2021年4月19日)	21,087	8.5	98,265.18	10.5	98.4	— 152,776
14期 (2022年4月18日)	19,947	△5.4	93,033.64	△5.3	97.6	— 137,292

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJP.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します(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)。

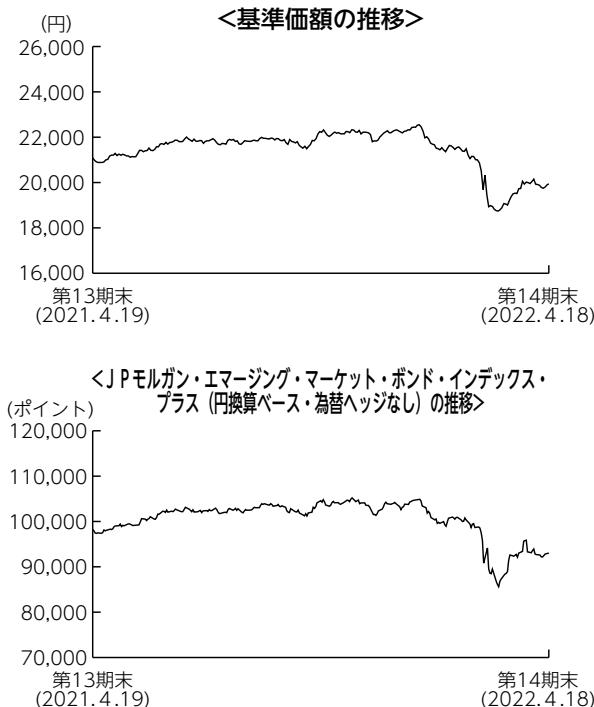
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)(ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 4 月 19 日	円 21,087	% —	ポイント 98,265.18	% —	% 98.4
4 月 末	21,020	△0.3	98,056.84	△0.2	98.2
5 月 末	21,419	1.6	100,513.37	2.3	98.2
6 月 末	21,816	3.5	102,177.41	4.0	98.0
7 月 末	21,668	2.8	101,776.22	3.6	98.3
8 月 末	21,941	4.0	103,575.81	5.4	97.8
9 月 末	21,803	3.4	102,494.39	4.3	91.4
10 月 末	22,177	5.2	104,130.69	6.0	98.3
11 月 末	21,843	3.6	101,547.56	3.3	91.6
12 月 末	22,441	6.4	104,567.15	6.4	97.6
2022 年 1 月 末	21,616	2.5	100,953.92	2.7	98.2
2 月 末	20,330	△3.6	94,159.30	△4.2	97.2
3 月 末	20,021	△5.1	95,873.44	△2.4	96.4
(期 末) 2022 年 4 月 18 日	19,947	△5.4	93,033.64	△5.3	97.6

(注1) 謄落率は期首比です。

(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（2021年4月20日から2022年4月18日まで）



為替市場では、米ドルは対円で大幅に上昇しました。2021年9月から10月にかけては、米国の金融政策正常化観測や景気改善期待などから上昇しました。2022年3月以降は、欧米各国が利上げなどタカ派的な政策に向かう一方、日銀が金融緩和を維持していることから、政策の違いが意識され、大幅な円安米ドル高が進みました。

### 基準価額の推移

当期末の基準価額は19,947円となり、前期末比で5.4%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

米長期金利の上昇（価格は下落）を主因に、基準価額は下落しました。

### 投資環境

新興国債券市場は大幅に下落しました。期初から2021年8月にかけては、欧米での景気回復期待や欧州復興基金の創設でEU（欧州連合）首脳が合意したことなどから堅調に推移したものの、その後は新型コロナウイルス感染の再拡大やタカ派的な米金融当局の姿勢、労働市場の引き締まりなどから下落しました。2022年2月後半にはロシアがウクライナに軍事侵攻したことで急落し、続く経済・金融面での対ロシア制裁が世界経済にも不確実性をもたらすとの思惑などから期末にかけても荒い展開となりました。

## ポートフォリオについて

ベンチマークであるJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。当期はロシアを全売却しました。

### 【運用状況】

#### ○国別構成比

期首(前期末)

国	ファンド	ベンチマーク	差
中南米	アルゼンチン	—	6.0% △6.0%
	ブラジル	10.4%	8.5% 1.9%
	メキシコ	15.7%	13.1% 2.6%
	パナマ	5.9%	4.1% 1.8%
	ペルー	5.6%	3.9% 1.7%
	ベネズエラ	—	0.0% △0.0%
	コロンビア	9.4%	7.6% 1.8%
計		47.0%	43.2% 3.8%
欧州	ハンガリー	4.1%	2.3% 1.8%
	ロシア	12.9%	10.4% 2.6%
	トルコ	—	14.1% △14.1%
	ウクライナ	—	4.2% △4.2%
	クロアチア	2.1%	1.0% 1.0%
	ルーマニア	3.6%	2.0% 1.5%
	計	22.7%	34.1% △11.4%
アジア・オセアニア	インドネシア	13.5%	11.2% 2.3%
	フィリピン	9.0%	7.1% 1.8%
	計	22.4%	18.3% 4.1%
アフリカ	南アフリカ	6.3%	4.4% 1.9%
	計	6.3%	4.4% 1.9%
現金など		1.6%	—
合計		100.0%	100.0% —

期末

国	ファンド	ベンチマーク	差
中南米	アルゼンチン	—	4.4% △4.4%
	ブラジル	9.5%	7.7% 1.8%
	チリ	2.2%	1.5% 0.7%
	メキシコ	11.7%	9.3% 2.4%
	パナマ	7.5%	6.4% 1.1%
	ペルー	7.1%	5.9% 1.3%
	ベネズエラ	—	0.0% △0.0%
	エクアドル	—	0.9% △0.9%
	コロンビア	7.9%	6.2% 1.7%
	ドミニカ共和国	1.3%	1.1% 0.2%
欧州	ウルグアイ	0.8%	0.5% 0.3%
	計	48.2%	43.9% 4.2%
	ハンガリー	4.5%	3.3% 1.2%
アジア・オセアニア	トルコ	—	9.8% △9.8%
	ウクライナ	—	2.5% △2.5%
	クロアチア	2.1%	1.4% 0.7%
	ルーマニア	3.4%	2.6% 0.8%
	計	10.0%	19.7% △9.7%
アフリカ	中国	0.2%	1.0% △0.8%
	インドネシア	11.4%	8.9% 2.5%
	フィリピン	8.7%	7.4% 1.3%
	スリランカ	—	0.1% △0.1%
	計	20.3%	17.4% 2.9%
中近東	カタール	3.9%	3.0% 0.8%
	アラブ首長国連邦	3.7%	3.0% 0.7%
	サウジアラビア	4.6%	4.8% △0.1%
	オマーン	—	1.3% △1.3%
	計	12.2%	12.0% 0.2%
アフリカ	南アフリカ	7.0%	5.9% 1.1%
	エジプト	—	0.8% △0.8%
	ナイジェリア	—	0.3% △0.3%
	計	7.0%	7.0% 0.0%
現金など		2.4%	—
合計		100.0%	100.0% —

(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) ベンチマークは、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスです。

## 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5.3%下落しました。

当ファンドはベンチマークを0.1%下回りました。当期は概ねベンチマークに連動しました。

## 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めざして運用を行います。

## ■ 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) (そ の 他)	3円 (3) (0)	0.013% (0.013) (0.000)	(a) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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	3	0.013	
期中の平均基準価額は21,435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 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 2,747,556	千アメリカ・ドル 2,826,988 (12,350)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2021年4月20日から2022年4月18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級以下組入比率	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 1,105,238	千アメリカ・ドル 1,057,538	千円 133,968,997	% 97.6	% 17.8	% 77.6	% 12.1	% 7.9	
合計	—	—	133,968,997	97.6	17.8	77.6	12.1	7.9	

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

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

#### (B) 個別銘柄開示

##### 外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当 期				末		
	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		
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	6.0500	9,900	10,594	1,342,096	2040/01/11	
BRAZIL 5.625 01/07/41	国債証券	5.6250	10,100	9,413	1,192,502	2041/01/07	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	国債証券	4.6000	11,000	9,812	1,242,984	2046/01/23	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	国債証券	3.1000	3,000	2,242	284,098	2061/01/22	
PANAMA 4.5 01/19/63	国債証券	4.5000	2,000	1,804	228,609	2063/01/19	
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	3,800	4,292	543,780	2026/01/29	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国債証券	7.7500	3,100	3,956	501,162	2031/01/14	
ROMANIA 6.125 01/22/44	国債証券	6.1250	8,400	9,288	1,176,657	2044/01/22	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	国債証券	3.7500	2,000	1,820	230,593	2055/01/21	
INDONESIA 5.25 01/17/42	国債証券	5.2500	10,300	10,882	1,378,614	2042/01/17	
INDONESIA 6.75 01/15/44	国債証券	6.7500	6,500	8,200	1,038,837	2044/01/15	
BRAZIL 5.0 01/27/45	国債証券	5.0000	10,800	9,156	1,159,926	2045/01/27	
INDONESIA 5.125 01/15/45	国債証券	5.1250	8,400	8,782	1,112,590	2045/01/15	
INDONESIA 4.35 01/11/48	国債証券	4.3500	5,000	4,873	617,405	2048/01/11	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	国債証券	5.8750	6,000	4,830	611,864	2060/01/30	
BRAZIL 8.25 01/20/34	国債証券	8.2500	7,200	8,654	1,096,339	2034/01/20	
PANAMA 6.7 01/26/36	国債証券	6.7000	11,900	14,093	1,785,322	2036/01/26	
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	4,500	5,926	750,709	2038/01/17	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	国債証券	3.9500	7,800	7,412	939,008	2040/01/20	
INDONESIA 5.95 01/08/46	国債証券	5.9500	4,200	4,880	618,322	2046/01/08	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	3.6000	4,200	4,267	540,547	2025/01/30	
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	5,800	5,930	751,235	2025/01/15	
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	6,000	6,232	789,528	2027/01/08	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	国債証券	3.7500	8,000	8,083	1,023,998	2029/01/14	
ROMANIA 4.875 01/22/24	国債証券	4.8750	5,600	5,773	731,408	2024/01/22	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国債証券	4.5000	9,000	8,843	1,120,333	2026/01/28	
CROATIA 6.0 01/26/24	国債証券	6.0000	11,400	11,985	1,518,359	2024/01/26	

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	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	国債証券	4.1250	7,000	7,222	914,896	2026/01/21
INDONESIA 5.875 01/15/24	国債証券	5.8750	6,200	6,520	826,055	2024/01/15
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	7,800	8,169	1,034,857	2026/01/08
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	国債証券	4.2000	6,800	6,969	882,864	2024/01/21
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	12,800	12,785	1,619,614	2028/01/13
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	国債証券	3.7500	5,200	5,164	654,273	2028/01/11
INDONESIA 3.5 01/11/28	国債証券	3.5000	5,200	5,231	662,749	2028/01/11
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	国債証券	5.2500	2,000	2,245	284,449	2050/01/16
PERU 3.0 01/15/34	国債証券	3.0000	5,000	4,380	554,858	2034/01/15
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	国債証券	3.5000	3,000	2,544	322,395	2050/01/25
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	国債証券	3.5000	2,000	1,887	239,045	2034/01/31
PANAMA 3.16 01/23/30	国債証券	3.1600	10,000	9,486	1,201,686	2030/01/23
BRAZIL 4.75 01/14/50	国債証券	4.7500	12,000	9,639	1,221,068	2050/01/14
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	国債証券	2.5500	2,000	1,800	228,024	2032/01/27
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国債証券	4.5000	6,000	5,281	669,098	2050/01/31
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	2,000	1,804	228,591	2031/01/31
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	国債証券	4.3750	4,000	4,210	533,322	2031/01/23
PERU 2.783 01/23/31	国債証券	2.7830	20,000	18,025	2,283,407	2031/01/23
COLOMBIA 3.0 01/30/30	国債証券	3.0000	8,000	6,658	843,531	2030/01/30
PERU 2.392 01/23/26	国債証券	2.3920	6,000	5,712	723,649	2026/01/23
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	国債証券	2.7500	2,000	1,920	243,225	2027/01/31
COLOMBIA 3.875 02/15/61	国債証券	3.8750	4,000	2,669	338,113	2061/02/15
BRAZIL 8.75 02/04/25	国債証券	8.7500	4,800	5,550	703,074	2025/02/04
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国債証券	3.7000	8,000	7,344	930,337	2042/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	国債証券	4.6000	8,400	7,420	940,009	2048/02/10
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	国債証券	3.4500	3,000	2,513	318,420	2061/02/02
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国債証券	9.5000	5,800	8,005	1,014,097	2030/02/02
COLOMBIA 4.125 02/22/42	国債証券	4.1250	9,000	6,600	836,152	2042/02/22
COLOMBIA 5.625 02/26/44	国債証券	5.6250	11,000	9,358	1,185,558	2044/02/26
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	国債証券	3.5000	2,000	1,760	223,020	2034/02/12
INDONESIA 5.35 02/11/49	国債証券	5.3500	3,000	3,309	419,203	2049/02/11
ROMANIA 4.0 02/14/51	国債証券	4.0000	9,000	7,485	948,324	2051/02/14
BRAZIL 5.625 02/21/47	国債証券	5.6250	7,600	6,864	869,572	2047/02/21
INDONESIA 4.75 02/11/29	国債証券	4.7500	5,000	5,366	679,802	2029/02/11
HUNGARY 5.375 02/21/23	国債証券	5.3750	5,358	5,482	694,492	2023/02/21
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	国債証券	3.0000	10,000	9,816	1,243,564	2028/02/01
ROMANIA 3.0 02/14/31	国債証券	3.0000	9,000	8,080	1,023,690	2031/02/14
REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28	国債証券	3.2400	3,000	2,932	371,430	2028/02/06
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	国債証券	2.2500	4,000	3,566	451,741	2033/02/02
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	国債証券	6.0000	5,000	4,693	594,604	2033/02/22
INDONESIA 2.85 02/14/30	国債証券	2.8500	4,000	3,800	481,386	2030/02/14
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	5.5000	5,000	4,797	607,747	2029/02/22
PANAMA 3.875 03/17/28	国債証券	3.8750	7,100	7,085	897,638	2028/03/17
COLOMBIA 4.5 03/15/29	国債証券	4.5000	9,000	8,456	1,071,211	2029/03/15

銘柄	種類	利 率	額面金額	当期		末償還年月日
				評価額	外貨建金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル		千円
HUNGARY 7.625 03/29/41	国債証券	7.6250	7,000	9,485	1,201,651	2041/03/29
HUNGARY 5.375 03/25/24	国債証券	5.3750	14,380	14,997	1,899,853	2024/03/25
PANAMA 3.75 03/16/25	国債証券	3.7500	7,200	7,291	923,679	2025/03/16
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	国債証券	4.1500	7,400	7,611	964,247	2027/03/28
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	4.8170	6,000	6,732	852,857	2049/03/14
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.875 03/04/23	国債証券	2.8750	2,000	2,008	254,424	2023/03/04
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	国債証券	4.3400	3,000	2,893	366,501	2042/03/07
PERU 3.3 03/11/41	国債証券	3.3000	10,000	8,387	1,062,541	2041/03/11
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.625 03/04/28	国債証券	3.6250	6,000	6,057	767,376	2028/03/04
PERU 3.55 03/10/51	国債証券	3.5500	10,000	8,397	1,063,807	2051/03/10
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	国債証券	4.0000	5,000	5,225	661,998	2029/03/14
INDONESIA 3.05 03/12/51	国債証券	3.0500	6,000	5,132	650,197	2051/03/12
INDONESIA 1.85 03/12/31	国債証券	1.8500	7,000	6,100	772,799	2031/03/12
ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	国債証券	1.7000	4,000	3,565	451,664	2031/03/02
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	国債証券	3.3750	4,000	4,035	511,179	2024/03/14
PANAMA 4.5 04/16/50	国債証券	4.5000	12,300	11,420	1,446,770	2050/04/16
PANAMA 4.5 04/01/56	国債証券	4.5000	13,000	12,008	1,521,268	2056/04/01
INDONESIA 4.45 04/15/70	国債証券	4.4500	3,000	2,910	368,641	2070/04/15
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	国債証券	3.7500	7,000	5,068	642,014	2071/04/19
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	国債証券	4.5000	4,000	4,112	521,028	2060/04/22
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	国債証券	5.0000	7,000	6,583	834,006	2051/04/27
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	国債証券	4.5000	8,000	8,159	1,033,693	2029/04/22
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	国債証券	4.7500	9,000	9,138	1,157,712	2032/04/27
CROATIA 5.5 04/04/23	国債証券	5.5000	10,400	10,713	1,357,127	2023/04/04
INDONESIA 4.1 04/24/28	国債証券	4.1000	4,000	4,154	526,251	2028/04/24
COLOMBIA 3.25 04/22/32	国債証券	3.2500	12,000	9,648	1,222,269	2032/04/22
BRAZIL 6.0 04/07/26	国債証券	6.0000	9,800	10,521	1,332,829	2026/04/07
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	9,400	9,537	1,208,268	2026/04/14
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	国債証券	5.1030	6,000	6,952	880,780	2048/04/23
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49	国債証券	5.0000	3,000	3,233	409,563	2049/04/17
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55	国債証券	4.9750	4,000	4,366	553,176	2055/04/20
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	4.3750	6,000	6,357	805,357	2029/04/16
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	国債証券	4.5000	4,000	4,271	541,059	2030/04/17
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	国債証券	3.2500	10,000	9,290	1,176,958	2030/04/16
COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	3.1250	12,000	9,741	1,234,005	2031/04/15
STATE OF QATAR 4.5 04/23/28	国債証券	4.5000	5,000	5,362	679,258	2028/04/23
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25	国債証券	4.0000	5,000	5,142	651,388	2025/04/17
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	国債証券	4.4000	5,000	5,327	674,887	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	国債証券	3.8750	5,000	4,922	623,577	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	国債証券	3.1250	5,000	4,997	633,087	2030/04/16
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	国債証券	3.7500	4,000	4,133	523,644	2030/04/16
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	国債証券	3.9000	3,000	3,054	386,884	2025/04/27
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	国債証券	3.4000	4,000	3,985	504,819	2025/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	国債証券	2.5000	3,000	2,959	374,947	2025/04/16

銘柄	種類	利 率	額面金額	期		償還年月日
				評価額	外貨建金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千円		
COLOMBIA 4.125 05/15/51	国債証券	4.1250	5,000	3,532	447,503	2051/05/15
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	国債証券	3.7710	10,000	7,493	949,308	2061/05/24
COLOMBIA 5.2 05/15/49	国債証券	5.2000	8,000	6,423	813,690	2049/05/15
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	国債証券	3.1000	3,000	2,473	313,342	2041/05/07
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	国債証券	2.6590	14,000	12,206	1,546,278	2031/05/24
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	国債証券	2.9500	4,000	3,190	404,174	2045/05/05
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	8,000	7,697	975,131	2029/05/30
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	国債証券	2.4570	12,000	10,949	1,387,128	2030/05/05
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	9,400	9,664	1,224,300	2030/06/22
COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	5.0000	17,000	13,403	1,697,909	2045/06/15
ROMANIA 5.125 06/15/48	国債証券	5.1250	6,600	6,516	825,457	2048/06/15
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	国債証券	6.3000	4,000	3,673	465,414	2048/06/22
PERU 2.844 06/20/30	国債証券	2.8440	6,000	5,497	696,468	2030/06/20
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	国債証券	1.6480	9,000	7,700	975,552	2031/06/10
BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	3.8750	13,000	11,734	1,486,585	2030/06/12
ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	国債証券	1.6250	2,000	1,837	232,787	2028/06/02
BRAZIL 2.875 06/06/25	国債証券	2.8750	6,000	5,831	738,774	2025/06/06
PANAMA 3.87 07/23/60	国債証券	3.8700	2,000	1,619	205,160	2060/07/23
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	国債証券	2.5500	4,000	3,483	441,226	2033/07/27
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	国債証券	3.2000	7,000	5,835	739,248	2046/07/06
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	国債証券	4.2800	2,000	1,740	220,423	2041/08/14
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	国債証券	2.7000	2,000	1,458	184,711	2070/09/02
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	国債証券	5.8750	10,200	10,795	1,367,538	2025/09/16
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	国債証券	5.6500	9,200	7,811	989,553	2047/09/27
HUNGARY 3.125 09/21/51	国債証券	3.1250	2,000	1,543	195,492	2051/09/21
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	4,000	3,968	502,686	2029/09/18
PANAMA 2.252 09/29/32	国債証券	2.2520	15,000	12,676	1,605,840	2032/09/29
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	国債証券	3.1250	2,000	1,725	218,583	2049/09/30
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	5.7500	14,000	11,993	1,519,374	2049/09/30
BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	3.7500	6,000	5,304	671,910	2031/09/12
HUNGARY 2.125 09/22/31	国債証券	2.1250	3,000	2,551	323,163	2031/09/22
ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	国債証券	1.8750	4,000	3,597	455,713	2031/09/15
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	国債証券	2.5000	3,000	2,883	365,334	2029/09/30
ABU DHABI GOVT INT'L 0.75 09/02/23	国債証券	0.7500	3,000	2,929	371,109	2023/09/02
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	国債証券	4.8500	12,000	11,580	1,466,954	2029/09/30
ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,000	1,963	248,772	2024/09/30
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	国債証券	5.7500	5,800	5,449	690,280	2110/10/12
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	国債証券	3.2500	2,000	1,736	219,992	2061/10/19
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債証券	6.3750	9,000	10,900	1,380,930	2034/10/23
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	国債証券	4.3000	11,200	10,661	1,350,650	2028/10/12
INDONESIA 4.2 10/15/50	国債証券	4.2000	5,000	4,803	608,485	2050/10/15
ABU DHABI GOVT INT'L 4.125 10/11/47	国債証券	4.1250	2,000	2,045	259,085	2047/10/11
INDONESIA 3.7 10/30/49	国債証券	3.7000	3,000	2,706	342,901	2049/10/30
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.625 10/04/47	国債証券	4.6250	3,000	3,046	385,959	2047/10/04

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	千円		
INDONESIA 3.85 10/15/30	国 債 証 券	3.8500	6,000	6,099	772,654	2030/10/15
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	国 債 証 券	1.2000	2,000	1,729	219,096	2030/10/21
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	国 債 証 券	3.2500	2,000	1,967	249,262	2030/10/22
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	国 債 証 券	2.9000	4,000	3,980	504,186	2025/10/22
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 10/11/27	国 債 証 券	3.1250	3,000	3,022	382,859	2027/10/11
PERU 5.625 11/18/50	国 債 証 券	5.6250	11,000	12,872	1,630,733	2050/11/18
HUNGARY 5.75 11/22/23	国 債 証 券	5.7500	14,000	14,604	1,850,153	2023/11/22
PERU 2.78 12/01/60	国 債 証 券	2.7800	11,000	7,699	975,338	2060/12/01
PERU 1.862 12/01/32	国 債 証 券	1.8620	8,000	6,432	814,805	2032/12/01
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	国 債 証 券	2.6500	5,000	3,846	487,249	2045/12/10
合 計		—	—	1,105,238	1,057,538	133,968,997
						—

## ■投資信託財産の構成

2022年4月18日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	%
公 社 債	千円	133,968,997	96.3
コ ー ル ・ 口 ー ン 等 、 そ の 他		5,083,944	3.7
投 資 信 託 財 产 總 額		139,052,942	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、137,112,810千円、98.6%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、2022年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=126.68円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月18日)現在

項目	当期末
(A) 資産	139,052,942,122円
コール・ローン等	3,558,351,761
公社債(評価額)	133,968,997,674
未収利息	534,037,882
前払費用	991,554,805
(B) 負債	1,760,168,800
未払本金	1,758,951,800
未払解約金	1,217,000
(C) 純資産総額(A-B)	137,292,773,322
元本	68,830,241,594
次期繰越損益	68,462,531,728
(D) 受益権総口数	68,830,241,594口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,947円

(注1) 期首元本額 72,451,871,684円  
 追加設定元本額 145,248,490,978円  
 一部解約元本額 148,870,121,068円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM新興国債券インテックスファンド<為替ヘッジなし>	193,172,059円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,842,717,308円
たわらノーロード バランス (堅実型)	137,186,833円
たわらノーロード バランス (標準型)	384,233,606円
たわらノーロード バランス (積極型)	163,093,610円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,133,115円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,132,310円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	29,703,612円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,217,012円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,217,582円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	59,256,549円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	236,077,296円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	325,129,552円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	670,583,251円
投資のソムリエ	21,826,975,940円
クルーズコントロール	269,846,036円
投資のソムリエ<DC年金>	1,327,285,815円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	243,760,761円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,135,044,315円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,330,686,040円
ワールドアセットバランス (基本コース)	536,425,776円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	600,825,759円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	33,112,488円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	16,727,971円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	7,764,190円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	124,678,896円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	798,577,422円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	222,519,382円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	36,355,348円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	14,482,845円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	11,120,595円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	1,277,092円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	21,510,968,507円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	555,387,723円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,435,421,495円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2 (適格機関投資家限定)	589,689,490円
リスクコントロール世界8資産(バランスファンド)(FOF用) (適格機関投資家専用)	19,931,763円
しあわせの歩み・私募 (適格機関投資家限定)	92,241,468円
エマージング債券バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	9,327,182円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	174,538,113円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	86,381,611円
DIAM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)	5,769,033,876円
期末元本合計	68,830,241,594円

## ■損益の状況

当期 自2021年4月20日 至2022年4月18日

項目	当期
(A) 配当等収益	6,283,492,883円
受取利息	6,283,975,110
支払利息	△482,227
(B) 有価証券売買損益	△12,859,825,221
売買益	17,626,879,424
売買損	△30,486,704,645
(C) その他費用	△17,925,399
(D) 当期損益金(A+B+C)	△6,594,257,737
(E) 前期繰越損益金	80,324,854,399
(F) 解約差損益金	△168,137,236,956
(G) 追加信託差損益金	162,869,172,022
(H) 合計(D+E+F+G)	68,462,531,728
次期繰越損益金(H)	68,462,531,728

(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。

# エマージング株式パッジブ・マザーファンド

## 運用報告書

第14期 (決算日 2022年4月18日)  
(計算期間 2021年4月20日～2022年4月18日)

エマージング株式パッジブ・マザーファンドの第14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	2008年2月20日から無期限です。
運用方針	主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	海外の証券取引所に上場している株式*を主要投資対象とします。 ※DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 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	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託受益証券、投資証券組入比率	純資産額
		期中騰落率	期中騰落率				
10期(2018年4月18日)	円 12,241	% 20.9	ポイント 273,007.15	% 21.9	% 92.1	% 7.1	百万円 66,443
11期(2019年4月18日)	12,260	0.2	276,323.22	1.2	94.4	4.4	61,535
12期(2020年4月20日)	9,723	△20.7	225,442.54	△18.4	64.7	34.8	41,166
13期(2021年4月19日)	14,848	52.7	347,921.32	54.3	93.2	6.1	58,156
14期(2022年4月18日)	14,507	△2.3	343,415.90	△1.3	84.0	15.2	62,888

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) ベンチマークはMSCIエマージング・マーケット・インデックス(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4) MSCIエマージング・マーケット・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています(以下同じ)。

(注5) △(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

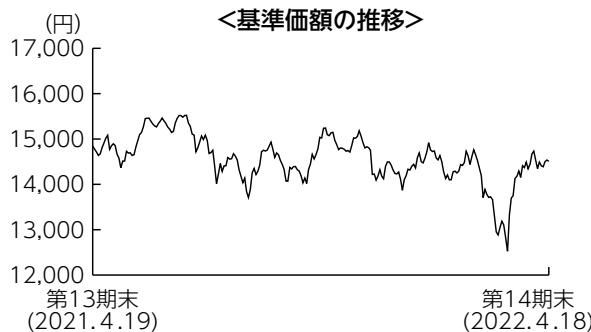
年 月 日	基 準 価 額	M S C I エマージング・マーケット・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投 資 信 託 受 益 証 券、 投 資 証 券 組 入 比 率
		騰落率					
(期 首) 2021年 4月 19日	円 14,848	% —	ポイント 347,921.32	% —	% 93.2	% 6.1	% 0.7
4 月 末	15,081	1.6	353,070.95	1.5	92.6	6.7	0.7
5 月 末	15,145	2.0	355,462.51	2.2	89.3	10.6	0.7
6 月 末	15,480	4.3	363,603.66	4.5	88.1	11.2	0.7
7 月 末	14,459	△2.6	340,066.34	△2.3	85.8	13.5	0.7
8 月 末	14,424	△2.9	339,465.31	△2.4	87.7	11.5	0.7
9 月 末	14,324	△3.5	337,651.14	△3.0	90.6	7.7	0.7
10 月 末	14,874	0.2	349,962.23	0.6	90.0	9.3	0.6
11 月 末	14,227	△4.2	334,849.20	△3.8	90.5	7.2	0.6
12 月 末	14,363	△3.3	339,256.12	△2.5	88.0	12.5	0.6
2022年 1 月 末	14,102	△5.0	333,169.94	△4.2	94.5	4.9	0.6
2 月 末	13,886	△6.5	328,370.31	△5.6	89.5	9.6	0.6
3 月 末	14,489	△2.4	342,137.40	△1.7	89.6	9.6	0.7
(期 末) 2022年 4月 18日	14,507	△2.3	343,415.90	△1.3	84.0	15.2	0.6

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)



### 基準価額の推移

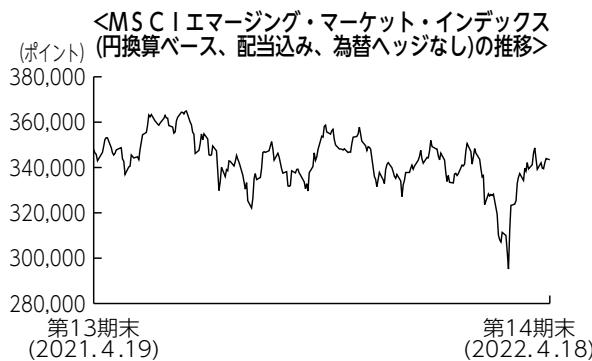
当期末の基準価額は14,507円となり、前期末比で2.3%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

為替市場では多くの組入通貨に対して円安となったものの、中国や韓国、台湾などの株式市場が下落したことから、当ファンドの基準価額は下落しました。

### 投資環境

新興国株式市場は下落しました。2021年は先進国株式市場の上昇に連れ高となる場面もありましたが、中国の大手不動産企業の破綻懸念や特定の業種に対する規制強化、米国の金融政策の転換見通しなどが株価押し下げ要因となり、比較的狭い範囲での値動きとなりました。2022年はロシアによるウクライナ侵攻を受け、米欧などが制裁を強化したことでロシア株式を中心に下落しました。3月中旬以降は急速に持ち直しましたが、前期末の水準を下回って期末を迎えました。



為替市場では、米ドルは米国の経済活動正常化やインフレ率の上昇により、金融緩和策の転換や継続的な利上げが意識されることなどから対円で上昇しました。他の多くの通貨も対円で上昇しましたが、トルコではエルドアン大統領の度重なる介入により中央銀行の独立性が危惧されたことなどからトルコリラは対円で大きく下落しました。

## ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス（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したポートフォリオを構築しました。

保有するロシア関連銘柄につきましてはベンチマークからは削除されているものの、取引所等の制約により売却できない状態が続いています。

### 【運用状況】

#### ○組入上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	組入比率
1	銀行	12.2%
2	小売	10.7
3	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.9
4	メディア・娯楽	8.8
5	半導体・半導体製造装置	8.8
6	素材	7.9
7	エネルギー	4.4
8	食品・飲料・タバコ	3.1
9	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.1
10	自動車・自動車部品	3.1

期末

No.	業種	組入比率
1	銀行	14.2%
2	素材	8.1
3	半導体・半導体製造装置	8.1
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.9
5	メディア・娯楽	5.8
6	小売	5.3
7	エネルギー	4.2
8	食品・飲料・タバコ	3.2
9	電気通信サービス	3.0
10	資本財	2.8



（注1）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。

### 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1.3%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを1.0%下回りましたが、ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当課税の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

### 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。また、保有しているロシア関連銘柄につきましては、売却可能となり次第、速やかに売却する方針です。

## ■ 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) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券)	17円 (14) (0) (2) (0) (0)	0.116% (0.098) (0.000) (0.016) (0.001) (0.000)	(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、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 (株式) (新株予約権証券) (投資信託受益証券) (投資証券)	27 (27) (0) (0) (0)	0.189 (0.189) (0.000) (0.000) (0.000)	(b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、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)	71 (18) (53)	0.485 (0.124) (0.361)	(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	115	0.789	
期中の平均基準価額は14,559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 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)

### (1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	アメリカ	百株 20,146.02 (△824.92)	千アメリカ・ドル 58,144 (-)	百株 16,543.25	千アメリカ・ドル 77,287
	香港	百株 616,544.18 (105.96)	千香港・ドル 1,376,880 (△262)	百株 618,091.69	千香港・ドル 983,742
	台湾	百株 254,227.68 (2,768.45)	千台湾・ドル 2,547,939 (△3,777)	百株 264,897.71	千台湾・ドル 2,464,130
	イギリス	百株 371.85 (-)	千イギリス・ポンド 531 (-)	百株 528.52	千イギリス・ポンド 273
	トルコ	百株 5,577.81 (-)	千トルコ・リラ 12,088 (-)	百株 8,363.98	千トルコ・リラ 15,167
	メキシコ	百株 42,372.7 (-)	千メキシコ・ペソ 181,080 (△283)	百株 43,439.65	千メキシコ・ペソ 189,768
	フィリピン	百株 36,563.6 (-)	千フィリピン・ペソ 200,591 (-)	百株 37,358.7	千フィリピン・ペソ 197,158
	チ	百株 135,635.14 (1.33)	千チリ・ペソ 1,787,010 (-)	百株 132,638.16	千チリ・ペソ 2,027,983

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	コロニアビア	百株 2,474.83 (-)	千コロンビア・ペソ 4,262,317 (-)	百株 2,351.82	千コロンビア・ペソ 5,156,904
	クウェート	百株 9,476.64 (768.56)	千クウェート・ディナール 882 (-)	百株 11,022.63	千クウェート・ディナール 945
	カタール	百株 13,991.54 (-)	千カタール・リアル 13,116 (-)	百株 14,153.17	千カタール・リアル 14,742
	サウジアラビア	百株 12,280.49 (108.98)	千サウジアラビア・リアル 69,371 (-)	百株 12,682.28	千サウジアラビア・リアル 72,767
	インド	百株 64,736.61 (1,481.04)	千インド・ルピー 5,595,119 (-)	百株 64,216.43	千インド・ルピー 5,385,934
	パキスタン	百株 70 (-)	千パキスタン・ルピー 6,367 (-)	百株 605.68	千パキスタン・ルピー 11,225
	インドネシア	百株 234,540 (35,713.31)	千インドネシア・ルピア 112,524,368 (-)	百株 240,572.31	千インドネシア・ルピア 108,450,071
	アラブ首長国連邦	百株 20,159.66 (39.92)	千アラブ首長国連邦・ディルハム 25,454 (-)	百株 18,602.71	千アラブ首長国連邦・ディルハム 22,145
	ブラジル	百株 53,158 (6,541.86)	千ブラジル・レアル 148,194 (△274)	百株 55,963.57	千ブラジル・レアル 149,909
	チエコ	百株 301.59 (-)	千チェコ・コルナ 24,670 (-)	百株 337.74	千チェコ・コルナ 27,798
	韓国	百株 11,449.68 (193.35)	千韓国・ウォン 95,478,180 (-)	百株 11,582.72	千韓国・ウォン 88,653,527
	中国	百株 125,580.09 (1,388.19)	千オフショア・人民元 206,239 (-)	百株 121,571.97	千オフショア・人民元 182,375
	マレーシア	百株 57,040 (788)	千マレーシア・リンギット 27,434 (-)	百株 58,387.71	千マレーシア・リンギット 27,121
	南アフリカ	百株 21,398.27 (-)	千南アフリカ・ランド 308,836 (△807)	百株 20,769.72	千南アフリカ・ランド 343,620
	タ	百株 114,059 (-)	千タイ・バーツ 334,982 (△82)	百株 120,757	千タイ・バーツ 369,144
	ポーランド	百株 3,983.18 (-)	千ポーランド・ズロチ 17,822 (-)	百株 3,295.52	千ポーランド・ズロチ 16,589
	ハンガリー	百株 499.33 (-)	千ハンガリー・フォリント 423,627 (-)	百株 537.49	千ハンガリー・フォリント 400,239
	ユーロ	百株 5,064.15 (-)	千ユーロ 1,160 (-)	百株 2,058.9	千ユーロ 777

(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) 新株予約権証券

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外 国	タ イ	証券 135,777	千タイ・バーツ 82	証券 145,242 (-)	千タイ・バーツ 155 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 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>メキシコ</b>		千口	千メキシコ・ペソ	千口	千メキシコ・ペソ
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV		157.9 (-)	26,174 (-)	165.6 (-)	26,352 (-)
GRUPO TELEVISA SAB		142.6 (-)	6,842 (-)	163.7 (-)	7,271 (-)
CEMEX SAB DE CV		1,334.6 (-)	18,177 (-)	1,428.3 (-)	17,273 (-)
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV		18.1 (-)	1,255 (-)	21.1 (-)	1,558 (-)
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		61.5 (-)	1,312 (△63)	67.4 (-)	1,513 (-)
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		58.1 (-)	6,152 (-)	71.3 (-)	7,478 (-)
<b>ブラジル</b>		千口	千ブラジル・レアル	千口	千ブラジル・レアル
SUL AMERICA SA		- (-)	- (-)	15,356 (-)	516 (-)
BANCO SANTANDER BRASIL SA		23.4 (-)	916 (-)	12.8 (-)	469 (-)
ENERGISA SA		11.7 (-)	547 (-)	21.1 (-)	962 (-)
KLABIN SA		19.1 (-)	468 (-)	17.3 (-)	471 (-)
BANCO INTER SA		10.2 (9)	758 (-)	2.2 (-)	399 (-)
GETNET ADQUIRENCIA E SERVICOS		- (5.275)	- (-)	5,275 (-)	29 (-)
BANCO BTG PACTUAL SA		65 (50.1)	2,107 (-)	60.4 (-)	1,491 (-)
<b>南アフリカ</b>		千口	千南アフリカ・ランド	千口	千南アフリカ・ランド
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		541,065 (-)	7,803 (-)	610,638 (-)	8,367 (-)

(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。

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外 国 株 式 先 物 取 引	百万円 107,439	百万円 101,899	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	145,146,459千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	62,687,269千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	2.31

(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 (2021年4月20日から2022年4月18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) 外国株式

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)							
TRIP.COM GROUP LTD ADR	294.2	289.44	669	84,845	千アメリカ・ドル	ホテル・レストラン・レジャー	
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	154.93	127.55	139	17,693	金属・鉱業		
SURGUTNEfteGAZ SP ADR PREF	242.1	242.1	12	1,564	石油・ガス・消耗燃料		
CREDICORP LTD	43.46	38.93	563	71,415	銀行		
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	316.8	423.11	232	29,479	無線通信サービス		
NETEASE INC-ADR	254.46	—	—	—	娯楽		
SOUTHERN COPPER CORP	45.18	51.98	378	47,930	金属・鉱業		
TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	37.89	—	—	—	各種電気通信サービス		
YPF SA ADR	42.48	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料		
LUKOIL SPON ADR	261.36	338.45	24	3,086	石油・ガス・消耗燃料		
GAZPROM PAO ADR	3,686.81	4,834.71	280	35,583	石油・ガス・消耗燃料		
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	893.51	1,284.21	289	36,685	銀行		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	963.88	963.88	89	11,306	不動産管理・開発		
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	—	125	47	5,993	ソフトウェア		
SURGUTNEfteGAZ ADR	550.84	710.84	33	4,232	石油・ガス・消耗燃料		
51JOB INC ADR	21.3	21.01	127	16,174	専門サービス		
X5 RETAIL GROUP NV GDR	70.85	160.03	8	1,076	食品・生活必需品小売		
NOVATEK PJSC GDR	58.75	74.13	4	610	石油・ガス・消耗燃料		
BAIDU INC -SPON ADR	165.07	161.28	2,089	264,703	インターネット・メディアおよびサービス		
NOVOLIPETSK STEEL GDR	73.5	132.6	4	530	金属・鉱業		
MMC NORILSK NICKEL ADR	410.9	539.53	101	12,917	金属・鉱業		
ROSNEFT OIL CO GDR	678.41	1,079.51	64	8,218	石油・ガス・消耗燃料		
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	947.65	127.33	141	17,872	各種消費者サービス		
SEVERSTAL GDR	167.71	186.08	1	141	金属・鉱業		
TATNEFT ADR	157.61	195.09	45	5,807	石油・ガス・消耗燃料		
VTB BANK OJSC GDR	1,120	1,520	1	192	銀行		
MAGNIT PJSC GDR	230.51	378.7	0.45444	57	食品・生活必需品小売		
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	274.29	246.13	190	24,101	インターネット販売・通信販売		
VNET GROUP INC ADR	41.06	—	—	—	情報技術サービス		
TAL EDUCATION GROUP-ADR	234.7	246.28	74	9,422	各種消費者サービス		
VK CO LTD GDR	68.53	98.58	8	1,068	インターネット・メディアおよびサービス		
YANDEX NV	190.65	256.01	484	61,424	インターネット・メディアおよびサービス		
NOAH HOLDINGS LTD ADR	17.16	6.8	14	1,866	資本市場		
SBERBANK ADR	1,688.88	2,242.78	112	14,205	銀行		
PHOSAGRO PJSC GDR	83.08	181.63	0.94447	119	化学		
HUAZHU GROUP LTD ADR	88.28	97.48	325	41,281	ホテル・レストラン・レジャー		
JOYY INC-ADR	36.17	28.36	112	14,219	インターネット・メディアおよびサービス		
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	35.01	30.17	133	16,885	半導体・半導体製造装置		
GDS HOLDINGS LTD ADR	58.26	46.54	168	21,324	情報技術サービス		
ZAI LAB LTD ADR	44.44	39.33	174	22,126	バイオテクノロジー		
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	79.99	99.61	31	4,029	銀行		
HUYA INC ADR	42.04	—	—	—	娯楽		
360 DIGITECH INC ADR	—	58.13	82	10,486	消費者金融		
BILIBILI INC ADR	98.16	91.62	228	28,946	娯楽		
NIO INC ADR	785.09	763.43	1,500	190,037	自動車		
TECENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	235.57	342.05	167	21,275	娯楽		
AUTOHOME INC ADR	37.89	38.67	110	13,936	インターネット・メディアおよびサービス		
DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR	73.6	—	—	—	娯楽		
GAOTU TECHEDU INC ADR	42.75	—	—	—	各種消費者サービス		
IMAB ADR	—	34.03	45	5,742	バイオテクノロジー		
WEIBO CORP ADR	30.03	43.86	100	12,668	インターネット・メディアおよびサービス		
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	29.11	29.11	12	1,611	情報技術サービス		
KANZHUN LTD ADR	—	56.5	134	16,998	インターネット・メディアおよびサービス		

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)							
RLX TECHNOLOGY INC ADR	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
DIDI GLOBAL INC ADR	80	490.92	101	12,811	タバコ		
KE HOLDINGS INC ADR	—	268.13	65	8,355	陸運・鉄道		
CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	68.69	205.47	288	36,544	不動産管理・開発		
DADA NEXUS LTD ADR	—	63.36	34	4,358	情報技術サービス		
JD.COM INC ADR	—	41.79	38	4,859	インターネット販売・通信販売		
LEGEND BIOTECH CORP ADR	528.21	—	—	—	インターネット販売・通信販売		
LI AUTO INC ADR	—	33.09	134	17,035	バイオテクノロジー		
XPENG INC ADR	121.2	320.49	823	104,381	自動車		
OZON HOLDINGS PLC ADR	93.72	224.58	604	76,615	自動車		
LUFAX HOLDING LTD ADR	—	45.37	52	6,667	インターネット販売・通信販売		
GLOBANT SA	112.72	328.01	179	22,687	消費者金融		
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	21.45	—	—	—	情報技術サービス		
HELLO GROUP INC ADR	1,154.1	—	—	—	インターネット販売・通信販売		
BAOZUN INC-SPN ADR	77.93	126.41	61	7,814	インターネット販売・通信販売		
PINDUODUO INC ADR	41.12	—	—	—	インターネット販売・通信販売		
YUM CHINA HOLDINGS INC	240.48	253.68	1,015	128,641	インターネット販売・通信販売		
IQIYI INC ADR	244.85	243.75	1,019	129,194	ホテル・レストラン・レジャー		
POLYUS PJSC GDR	154.4	154.4	63	8,058	娯楽		
HUTCHMED CHINA LTD ADR	39.46	67.87	26	3,353	金属・鉱業		
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	37.61	61.36	105	13,385	医薬品		
BEIGENE LTD ADR	256.08	245.84	646	81,937	航空貨物・物流サービス		
小計	株数	金額	19,505.23	22,283.08	15,303	バイオテクノロジー	
	銘柄数	比率	66銘柄	64銘柄	1,938,597 <3.1%>		
(香港)							
JIANGXI COPPER CO LTD	百株	百株	千香港・ドル	千円			
JIANGSU EXPRESS	670	670	946	15,278	金属・鉱業		
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	900	900	741	11,976	運送インフラ		
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,620	1,800	846	13,662	旅客航空輸送業		
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	64	64	672	10,860	飲料		
BEIJING ENTERPRISES	785	735	3,109	50,211	建設資材		
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	215	150	406	6,564	ガス		
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	1,800	3,420	1,200	19,386	独立系発電事業者・エネルギー販売業者		
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	2,580	1,980	950	15,348	インターネット販売・通信販売		
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	700	1,080	2,808	45,349	石油・ガス・消耗燃料		
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	460	515.9	877	14,164	不動産管理・開発		
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	405	330	1,207	19,505	パーソナル用品		
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	1,420	1,420	0	0	自動車		
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	5,656	5,036	4,285	69,213	医薬品		
CHINA RESOURCES LAND LTD	2,436.2	2,321.2	6,302	101,778	不動産管理・開発		
CITIC LTD	1,988.88	1,908.88	7,511	121,309	不動産管理・開発		
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	3,470	3,300	2,877	46,473	コングロマリット		
LENOVO GROUP LTD	960	680	318	5,139	運送インフラ		
PETRO CHINA CO LTD	4,540	4,120	3,193	51,566	コンピュータ・周辺機器		
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	11,200	11,920	4,863	78,543	石油・ガス・消耗燃料		
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,121.9	1,105.9	1,066	17,217	保険		
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	15,432	13,872	5,548	89,613	石油・ガス・消耗燃料		
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	490	370	449	7,254	情報技術サービス		
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	1,530	1,430	2,293	37,043	ソフトウェア		
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	501	451	4,929	79,610	ガス		
COSCO SHIPPING PORTS LTD	2,080	2,760	1,854	29,953	ガス		
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,520	740	436	7,051	運送インフラ		
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	3,160	1,252	1,116	18,036	不動産管理・開発		
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	1,140	740	1,040	16,803	運送インフラ		
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	1,460	2,440	1,168	18,875	金属・鉱業		
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	870	760	1,843	29,764	不動産管理・開発		
CHINA EVERBRIGHT LTD	910	965	837	13,527	運送インフラ		
	440	—	—	—	資本市場		

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(香港)						
CHINA GAS HOLDINGS LTD	百株 1,654	百株 1,570	千香港・ドル 1,513	24,442		ガス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	460	350	1,281	20,688		電子装置・機器・部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	3,680	3,350	3,953	63,840		自動車
SHENZHEN INVESTMENT LTD	2,160	—	—	—		不動産管理・開発
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	560	500	1,652	26,687		ガス
BYD CO LTD	480	485	11,630	187,829		自動車
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	1,180	1,180	1,000	16,160		エネルギー設備・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	5,400	10,300	700	11,311		娯楽
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	2,525.92	1,745.92	843	13,618		商業サービス・用品
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	—	2,080	1,401	22,641		情報技術サービス
MMG LTD	—	1,840	732	11,826		金属・鉱業
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	700	700	273	4,420		紙製品・林産品
CHINA YOUZAN LTD	8,800	—	—	—		ソフトウェア
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	4,337.88	3,917.88	3,267	52,770		保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	1,350	1,350	564	9,113		航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	912	1,312	1,968	31,783		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	1,795	1,645	1,898	30,658		自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	4,600	4,370	5,313	85,819		保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	3,390	3,170	4,399	71,059		金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	1,520	1,224	1,079	17,435		ヘルスケア機器・用品
WEICHAI POWER CO LTD	1,354.4	1,274.4	1,506	24,327		機械
TINGYI HOLDING CORP	1,060	1,040	1,535	24,790		食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	280	400	2,548	41,150		飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	1,780	1,540	1,583	25,567		水道
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	2,140	2,380	944	15,259		医薬品
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	913.33	813.33	3,765	60,816		飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	680	540	367	5,939		運送インフラ
HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	710	318	5,136		化学
SINO BIOPHARMACEUTICAL	6,512.5	5,562.5	2,347	37,910		医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,740	1,820	7,880	127,271		食品
TENCENT HOLDINGS LTD	3,503	3,375	126,360	2,040,714		インターネット・メディアおよびサービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	3,635	3,710	21,258	343,321		保険
LI NING CO LTD	1,325	1,350	8,633	139,426		繊維・アパレル・贅沢品
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	2,600	3,620	948	15,317		水道
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	6,892.4	6,892.4	323	5,231		専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	5,000	3,490	1,357	21,925		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	760	580	337	5,451		旅客航空輸送業
ZTE CORP	442.88	442.88	682	11,029		通信機器
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	1,965	2,015	5,299	85,586		石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	1,855	1,772.5	2,297	37,099		海運業
BANK OF COMMUNICATIONS	5,752.05	5,182.05	2,933	47,368		銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	1,102.5	1,242.5	1,233	19,925		建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	415	600	1,022	16,511		電子装置・機器・部品
CHINA CONSTRUCTION BANK	58,105.3	56,795.3	33,282	537,505		銀行
SHENZHUO INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	514	466	4,771	77,065		繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,400	2,060	1,200	19,395		自動車
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	980	980	413	6,678		不動産管理・開発
MINTH GROUP LTD	460	440	798	12,890		自動車部品
SSY GROUP LTD	1,320	—	—	—		医薬品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	840	1,380	1,006	16,247		紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	2,380	2,280	2,421	39,104		建設資材
BANK OF CHINA LTD	48,042	47,872	14,936	241,217		銀行
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	675	—	—	—		不動産管理・開発
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	600	600	970	15,678		不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	992	—	—	—		不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	2,399.7	2,299.7	13,740	221,912		銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H	36,942.35	33,392.35	15,861	256,161		銀行

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(香港)							
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	百株	百株	千香港・ドル	千円	—	金属・鉱業	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	495	—	—	—	—	電子装置・機器・部品	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	535	535	667	10,783	—	建設・土木	
CHINA COAL ENERGY CO	1,676	1,676	581	9,392	—	石油・ガス・消耗燃料	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	1,020	750	12,124	—	機械	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	330	250	474	7,655	—	電気設備	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	313	446	1,168	18,871	—	不動産管理・開発	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	4,941.42	4,741.42	2,915	47,092	—	金属・鉱業	
CHINA CITIC BANK-H	2,400	2,370	1,080	17,453	—	銀行	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	5,968	5,798	2,359	38,110	—	不動産管理・開発	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	650	1,380	487	7,867	—	電子装置・機器・部品	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	448	403	4,465	72,113	—	繊維・アパレル・贅沢品	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	670	610	5,679	91,717	—	家庭用品	
FOSUN INTERNATIONAL	200	200	364	5,878	—	コンプロマリット	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	1,430.28	1,080.28	896	14,480	—	不動産管理・開発	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	3,000	3,060	853	13,787	—	不動産管理・開発	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	850	—	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
KINGSOFT CORP LTD	1,620	2,640	934	15,093	—	娯楽	
SINOTRUK HONG KONG LTD	520	492	1,170	18,911	—	機械	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	350	340	318	5,139	—	建設・土木	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	3,180	2,350	1,203	19,431	—	食品	
DONGYUE GROUP	1,010	1,110	788	12,727	—	化学	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	—	780	693	11,198	—	通信機器	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	425	475	715	11,552	—	食品	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	2,840	2,520	1,695	27,389	—	保険	
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,604	1,570	3,011	48,631	—	不動産管理・開発	
CRRC CORP LTD - H	1,100	—	—	—	—	機械	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	—	2,390	700	11,309	—	医薬品	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	980	610	718	11,605	—	食品・生活必需品小売り	
SINOPHARM GROUP CO	835	2,265	586	9,474	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY CORP LTD	760	672	1,185	19,144	—	石油・ガス・消耗燃料	
CHINA RESOURCES CEMENT	—	1,690	799	12,909	—	建設資材	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	1,785.27	1,865.27	1,270	20,514	—	自動車	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,290	1,505	1,595	25,764	—	金属・鉱業	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	1,980	—	—	—	—	銀行	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	1,940	1,900	3,241	52,348	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	642	466	616	9,964	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,640	—	—	—	—	不動産管理・開発	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	612	1,250	661	10,679	—	機械	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	—	900	723	11,686	—	機械	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,020	1,075	4,590	74,132	—	不動産管理・開発	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	603	650	1,482	23,934	—	保険	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	3,996.56	3,556.56	1,070	17,288	—	銀行	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1,250	—	—	—	—	不動産管理・開発	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	310	688	843	13,622	—	電気設備	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	790	810	759	12,270	—	建設関連製品	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,500	2,500	735	11,870	—	銀行	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	15,470	15,850	4,739	76,537	—	銀行	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	300	410	2,218	35,822	—	専門小売り	
FAR EAST HORIZON LTD	1,030	1,030	734	11,860	—	各種金融サービス	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	460	446	718	11,596	—	ヘルスケア機器・用品	
CITIC SECURITIES CO LTD	1,305	1,405	2,593	41,887	—	資本市場	
SEAZEN GROUP LIMITED	1,180	980	443	7,169	—	不動産管理・開発	
HAITONG SECURITIES CO LTD	936	1,940	1,162	18,767	—	資本市場	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	4,610	6,750	1,748	28,234	—	保険	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	255	345	1,190	19,222	—	医薬品	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	2,260	1,960	901	14,560	—	不動産管理・開発	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(香港)						
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	1,065	2,165	千香港・ドル	1,028	16,608	資本市場
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	9,860	9,860	0	0	0	半導体・半導体製造装置
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	3,230	3,230	0	0	0	食品
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	720	1,360	1,135	18,339	不動産管理・開発	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	5,370	4,490	2,922	47,206	銀行	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	260	360	802	12,965	食品	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	780	780	1,786	28,847	ライフサイエンス・ツール／サービス	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	125	—	—	—	各種消費者サービス	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	900	1,170	4,527	73,125	不動産管理・開発	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	920	—	—	—	不動産管理・開発	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	283	330	726	11,724	インターネット販売・通信販売	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	520	520	337	5,450	各種消費者サービス	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	375	375	663	10,719	金属・鉱業	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	200	—	—	—	ヘルスケア機器・用品	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	237.5	442.5	588	9,504	不動産管理・開発	
CHINA TOWER CORP LTD	27,060	22,560	2,052	33,155	各種電気通信サービス	
XIAOMI CORP	8,778	8,246	10,291	166,199	コンピュータ・周辺機器	
WUXI APPTEC CO LTD	165.6	207.12	2,444	39,470	ライフサイエンス・ツール／サービス	
WEIMOB INC	1,070	1,660	828	13,377	ソフトウェア	
MEITUAN	2,200	2,391	37,108	599,299	インターネット販売・通信販売	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	444	712	1,028	16,604	ホテル・レストラン・レジャー	
HAIDIAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	440	870	1,405	22,705	ホテル・レストラン・レジャー	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,340	2,760	3,836	61,957	半導体・半導体製造装置	
INNOVENT BIOLOGICS INC	620	610	1,692	27,337	バイオテクノロジー	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	420	820	964	15,573	不動産管理・開発	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	6,650	6,650	897	14,498	資本市場	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	420	400	1,100	17,765	専門小売り	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	1,110	1,030	270	4,374	不動産管理・開発	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	995	1,055	2,363	38,165	建設・土木	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	58	—	—	—	不動産管理・開発	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	780	1,075	656	10,607	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	270	—	—	—	各種消費者サービス	
CANSINO BIOLOGICS INC	40	62	644	10,403	医薬品	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	620	1,160	742	11,989	専門小売り	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	660	860	1,133	18,305	医薬品	
CHINA FEIHE LTD	830	1,850	1,411	22,796	食品	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	—	8,894.68	84,944	1,371,848	インターネット販売・通信販売	
PHARMARON BEIJING CO LTD	77	74	733	11,849	ライフサイエンス・ツール／サービス	
JD.COM INC	—	1,169.35	26,474	427,556	インターネット販売・通信販売	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	350	980	1,809	29,216	タバコ	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	—	155	216	3,494	ヘルスケア機器・用品	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	440	500	835	13,485	ホテル・レストラン・レジャー	
KUAISHOU TECHNOLOGY	132	263	1,675	27,056	インターネット・メディアおよびサービス	
HAIER SMART HOME CO LTD	1,226	1,234	3,374	54,506	家庭用耐久財	
AKESO INC	—	200	308	4,980	バイオテクノロジー	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	—	770	376	6,080	不動産管理・開発	
NETEASE INC	—	1,202	18,090	292,155	娯楽	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	250	250	253	4,094	ソフトウェア	
NONGFU SPRING CO LTD	190	1,010	4,272	68,997	飲料	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	2,220	1,340	178	2,878	銀行	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	180	176.5	904	14,608	インターネット販売・通信販売	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	—	298	1,060	17,133	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	
CHINA RESOURCES MIX LIFESTYLE SERVICES LTD	—	324	1,274	20,590	不動産管理・開発	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	80	96	868	14,031	ライフサイエンス・ツール／サービス	
CHINA VANKE CO LTD-H	926.61	1,065.61	2,237	36,140	不動産管理・開発	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	280	370	1,132	18,285	半導体・半導体製造装置	
CGN POWER CO LTD	4,500	6,090	1,260	20,359	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)							
GF SECURITIES CO LTD	百株	百株	千香港・ドル	千円		資本市場	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	682	682	761	12,291		自動車部品	
HUATAI SECURITIES CO LTD	252	276	808	13,060		資本市場	
3SBIO INC	484	924	1,069	17,280		バイオテクノロジー	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	905	905	576	9,310		医薬品	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	940	—	—	—		資本市場	
CHINA LITERATURE LTD	4,610	—	—	—		メディア	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	162	284	917	14,814		半導体・半導体製造装置	
DALI FOODS GROUP CO LTD	—	340	1,004	16,225		食品	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	1,465	1,465	597	9,653		各種消費者サービス	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	640	—	—	—		不動産管理・開発	
BOC AVIATION LTD	650	650	648	10,466		商社・流通業	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	107	105	639	10,327		保険	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	262	340	892	14,413		自動車	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	540	900	1,101	17,790		資本市場	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	688	796	1,437	23,216		ライフサイエンス・ツール/サービス	
GANFENG LITHIUM CO LTD	2,015	2,070	13,165	212,617		金属・鉱業	
		132	1,362	22,000			
小計	株数	519,873.43	518,431.88	728,718	11,768,810		
	銘柄数	202銘柄	200銘柄	—	<18.7%>		
(台湾)							
ACCTON TECHNOLOGY CORP	百株	百株	千台湾・ドル	千円		通信機器	
ACER INC	320	270	6,048	26,299		コンピュータ・周辺機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	2,065.32	1,515.32	4,258	18,515		コンピュータ・周辺機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	445.54	415.54	14,814	64,417		半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	266.16	246.16	9,797	42,602		建設資材	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	1,319.28	1,159.28	5,437	23,642		電子装置・機器・部品	
TAIWAN BUSINESS BANK	190	—	—	—		銀行	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	4,572.67	—	—	—		半導体・半導体製造装置	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	540	480	5,184	22,542		コンピュータ・周辺機器	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	380	450	5,422	23,579		電子装置・機器・部品	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	770	700	14,350	62,399		コンピュータ・周辺機器	
QUANTA COMPUTER INC	479.75	—	—	—		コンピュータ・周辺機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	1,818.58	1,558.58	13,388	58,217		不動産管理・開発	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	807.77	—	—	—		コンピュータ・周辺機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	437.6	387.6	5,678	24,691		銀行	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	2,447.61	2,262.08	4,241	18,443		自動車部品	
CHINA STEEL CORP	841.69	1,371.69	4,698	20,428		金属・鉱業	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	7,590.58	6,900.58	27,291	118,675		保険	
ADVANTECH CO LTD	889.73	—	—	—		コンピュータ・周辺機器	
COMPAL ELECTRONICS INC	206.75	216.75	7,943	34,543		コンピュータ・周辺機器	
DELTA ELECTRONICS INC	2,133.04	2,283.04	5,810	25,265		電子装置・機器・部品	
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,206.63	1,136.63	28,358	123,315		半導体・半導体製造装置	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	790	900	5,751	25,007		各種電気通信サービス	
AU OPTRONICS CORP	2,234.27	2,304.27	29,840	129,757		電子装置・機器・部品	
TAIWAN MOBILE CO LTD	5,371.94	4,671.94	8,900	38,700		無線通信サービス	
EVERGREEN MARINE CORP	958	1,158	12,216	53,123		海運業	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,278.2	1,478.2	20,916	90,953		コンポーネント	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	1,688.24	1,658.24	5,041	21,920		繊維・アパレル・贅沢品	
ECLAT TEXTILE CO LTD	217.68	317.68	6,178	26,868		半導体・半導体製造装置	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	113.22	103.22	4,815	20,938		繊維・アパレル・贅沢品	
FORMOSA PLASTICS CORP	352.85	322.85	12,914	56,155		半導体・半導体製造装置	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	2,426.33	2,236.33	23,481	102,106		化学	
GIANT MANUFACTURING	2,265.94	2,065.94	16,382	71,239		化学	
MEDIATEK INC	161.51	211.51	5,488	23,866		レジャー用品	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	915.07	895.07	74,469	323,824		半導体・半導体製造装置	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	4,169.36	4,459.42	33,490	145,628		保険	
HOTAI MOTOR CO LTD	4,669.44	4,927.52	11,949	51,960		銀行	
	190	170	9,826	42,727		専門小売	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(台湾)							
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	百株 890	百株 890	千台湾・ドル 6,719	千円 29,219		無線通信サービス	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	6,001.46	5,381.46	14,314	62,245		各種金融サービス	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,889.41	4,699.41	30,076	130,783		保険	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	7,274.03	8,940.11	16,986	73,862		保険	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	7,084.48	7,067.98	23,536	102,345		銀行	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	7,622.25	7,372.25	75,934	330,192		電子装置・機器・部品	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	6,164.95	6,454.95	27,659	120,274		銀行	
LARGAN PRECISION CO LTD	62.2	62.2	10,107	43,951		電子装置・機器・部品	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	5,280.58	5,861.32	11,722	50,974		銀行	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	7,910.61	6,763.45	7,135	31,027		保険	
INVENTEC CO LTD	1,200.05	1,300.05	3,295	14,330		コンピュータ・周辺機器	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,288.45	1,178.45	7,966	34,640		コンピュータ・周辺機器	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	5,534.43	5,654.43	10,460	45,487		銀行	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	10,870.48	11,000.48	32,286	140,394		銀行	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,729.77	6,098.06	17,318	75,307		銀行	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	375.6	—	—	—		半導体・半導体製造装置	
NAN YA PLASTICS CORP	3,258.28	3,038.28	26,979	117,319		化学	
WISTRON CORP	1,579.16	—	—	—		コンピュータ・周辺機器	
POU CHEN CORP	1,789.9	1,209.9	3,744	16,283		繊維・アパレル・贅沢品	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	3,052.97	2,832.97	19,094	83,029		食品	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	373.92	323.92	8,681	37,748		食品・生活必需品小売	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	644.8	864.8	7,999	34,784		石油・ガス・消耗燃料	
PHISON ELECTRONICS CORP	106.58	—	—	—		半導体・半導体製造装置	
E INK HOLDINGS INC	—	490	8,354	36,328		電子装置・機器・部品	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	465.89	762.24	5,526	24,030		不動産管理・開発	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	435.88	735.88	4,459	19,391		電子装置・機器・部品	
SYNTEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	628.99	678.99	5,268	22,911		電子装置・機器・部品	
TAIWAN CEMENT CORP	3,131.71	3,011.71	14,185	61,682		建設資材	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	14,990.83	14,450.83	812,136	3,531,494		半導体・半導体製造装置	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,285.25	6,875.25	32,348	140,662		半導体・半導体製造装置	
WAN HAI LINES LTD	—	395	6,122	26,623		海運業	
WINBOND ELECTRONICS CORP	1,800	1,580	4,266	18,550		半導体・半導体製造装置	
YAGEO CORP	201.6	251.6	10,189	44,309		電子装置・機器・部品	
YANG MING MARINE TRANSPORT	—	1,010	12,524	54,459		海運業	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,510	1,610	4,572	19,882		運送インフラ	
INNOLUX CORPORATION	5,123.45	5,433.45	8,503	36,975		電子装置・機器・部品	
WPG HOLDINGS CO LTD	1,242.03	1,182.03	6,643	28,886		電子装置・機器・部品	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	140	160	7,056	30,682		電子装置・機器・部品	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	174.75	179.69	4,043	17,580		機械	
EMMEMORY TECHNOLOGY INC	—	40	5,520	24,003		半導体・半導体製造装置	
PEGATRON CORP	1,035.54	1,165.54	8,193	35,629		コンピュータ・周辺機器	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	70	83.71	7,291	31,704		機械	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	220	230	5,290	23,003		半導体・半導体製造装置	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	674.7	745.93	18,424	80,116		各種金融サービス	
ONENESS BIOTECH CO LTD	160	180	3,573	15,536		医薬品	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	—	50	6,950	30,221		半導体・半導体製造装置	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	20	20	2,960	12,871		半導体・半導体製造装置	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	293.85	353.85	3,715	16,156		電子装置・機器・部品	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	5,189.54	5,573.93	16,303	70,895		銀行	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	1,999.93	2,029.93	10,058	43,737		銀行	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	—	40	5,560	24,177		電気設備	
WIVYNN CORP	40	50	4,810	20,915		コンピュータ・周辺機器	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	2,049.03	1,879.03	18,395	79,991		半導体・半導体製造装置	
SILERGY CORP	50	50	13,325	57,942		半導体・半導体製造装置	
MOMO.COM INC	—	30	2,715	11,805		インターネット販売・通信販売	
GLOBALWAFERS CO LTD	120	120	7,224	31,412		半導体・半導体製造装置	

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
			株数	株数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)						
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD		百株	百株	千台湾・ドル	千円	
小計	株数・金額	120	110	3,355	14,588	家庭用耐久財
小計	銘柄数・比率	195,688.08	187,786.5	1,896,266	8,245,725	
(イギリス)						
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
小計	株数・金額	156.67	—	—	—	金属・鉱業
小計	銘柄数・比率	156.67	1銘柄	—	—	
(トルコ)						
AKBANK TAS		百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		2,388.37	2,388.37	2,245	19,452	銀行
EREGLİ DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS		448.98	448.98	1,236	10,713	航空宇宙・防衛
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		961.86	891.95	3,148	27,281	金属・鉱業
KOC HOLDING AS		46.68	46.68	1,428	12,376	自動車
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS		537.7	537.7	2,190	18,980	コングロマリット
TURK HAVA YOLLARI		900	510.26	888	7,701	コングロマリット
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		442.06	—	—	—	旅客航空輸送業
TURKIYE GARANTİ BANKASI AS		626.54	486.15	1,123	9,738	無線通信サービス
TURKIYE IS BANKASI		1,141.53	1,814.55	2,522	21,854	銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE		662.05	911.35	982	8,512	銀行
YAPI VE KREDİ BANKASI AS		62.01	59.02	1,532	13,280	石油・ガス・消耗燃料
HACI OMER SABANCI HOLDING AS		2,392.3	—	—	—	銀行
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		210.58	—	—	—	銀行
小計	株数・金額	277.55	217.03	1,837	15,918	食品・生活必需品小売り
小計	銘柄数・比率	11,098.21	8,312.04	19,136	165,812	
(メキシコ)						
ALFA SAB DE CV		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
GRUPO BIMBO SAB DE CV		—	2,223	3,281	20,821	コングロマリット
GRUMA SAB DE CV		850	869	5,021	31,862	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA		106.15	103.6	2,642	16,770	食品
GRUPO CARSO SAB DE CV		164.6	178.6	2,825	17,927	運送インフラ
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV		349	349	2,499	15,859	コングロマリット
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV		1,621	1,514	20,706	131,400	銀行
INDUSTRIAS PENOLEOS SAB DE CV		530.25	784.25	3,961	25,136	化学
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV		76.35	83.35	2,084	13,230	金属・鉱業
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV		863	753	2,138	13,570	家庭用品
GRUPO MEXICO SAB DE CV		120.4	112.9	4,685	29,733	運送インフラ
AMERICA MOVIL SAB DE CV		1,939.52	1,832.52	19,703	125,030	金属・鉱業
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA		21,166.78	18,088.78	39,994	253,791	無線通信サービス
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		966	1,227	4,979	31,596	銀行
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV		231	235	2,906	18,446	飲料
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV		3,200	3,093	24,082	152,817	食品・生活必需品小売り
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV		240.85	202.95	6,183	39,238	運送インフラ
TELESITES SAB DE CV		292	—	—	—	ガス
OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV		773	773	2,011	12,763	各種電気通信サービス
BECLE SAB DE CV		384	384	1,838	11,664	各種電気通信サービス
小計	株数・金額	33,873.9	32,806.95	151,545	961,661	飲料
小計	銘柄数・比率	18銘柄	18銘柄	—	<1.5%>	
(フィリピン)						
AYALA LAND INC		百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		4,255	4,567	15,527	37,693	不動産管理・開発
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND		943.3	1,133.3	6,533	15,860	コングロマリット
AYALA CORP		1,075.2	937.2	9,231	22,409	銀行
GLOBE TELECOM INC		185.83	153.73	11,806	28,660	コングロマリット
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC		14.2	25.7	6,291	15,272	無線通信サービス
JG SUMMIT HOLDINGS INC		461.2	550.3	12,128	29,442	運送インフラ
JOLLIBEE FOODS CORP		1,934.8	1,578.4	8,760	21,265	コングロマリット
METROPOLITAN BANK & TRUST		325.9	339.4	7,432	18,043	ホテル・レストラン・レジャー
		615.75	800.15	4,400	10,683	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(フィリピン)					
BDO UNIBANK INC	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	銀行
MEGAWORLD CORP	1,222,33	1,088,33	13,985	33,948	不動産管理・開発
PLDT INC	8,790	—	—	—	無線通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	52.6	52.6	9,636	23,392	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	6,363.75	5,967.75	21,961	53,311	食品
SM INVESTMENTS CORP	548.4	425.5	4,999	12,136	コングロマリット
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	164,63	130,43	11,380	27,624	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP	9,019	9,019	3,454	8,385	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MANILA ELECTRIC COMPANY	957	—	—	—	電力
PUREGOLD PRICE CLUB INC	177.1	177.1	6,414	15,571	食品・生活必需品小売り
GT CAPITAL HOLDINGS INC	676	—	—	—	コングロマリット
AC ENERGY CORP	66.01	66.01	3,379	8,204	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MONDE NISSIN CORP	—	6,894	5,859	14,224	食品
	—	3,147	4,191	10,175	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	37,848	37,052.9	167,375	406,304
		20銘柄	19銘柄	—	<0.6%>
(チリ)					
BANCO SANTANDER CHILE	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	36,313.83	36,020.92	158,095	24,577	銀行
BANCO DE CHILE	27.73	30.95	88,857	13,813	銀行
EMPRESAS CMPC SA	27,690.44	25,409.25	220,552	34,286	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	601.53	630.23	86,656	13,471	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	224.18	191.38	129,081	20,066	飲料
ENEL AMERICAS SA	105.81	105.81	61,845	9,614	電力
COLBUN SA	19,059.81	15,968.88	144,518	22,466	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
EMBOTELLADORA ANDINA SA	5,804.23	—	—	—	飲料
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	200.26	—	—	—	化学
FALABELLA SA	74.92	78.85	534,642	83,114	複合小売り
CENCOSUD SA	561.57	488.73	125,212	19,465	食品・生活必需品小売り
CENCOSUD SHOPPING SA	811.21	759.72	114,109	17,739	不動産管理・開発
ENEL CHILE SA	292.31	—	—	—	電力
	14,696.15	29,777.57	68,190	10,600	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	106,463.98	109,462.29	1,731,764	269,218
		14銘柄	11銘柄	—	<0.4%>
(コロンビア)					
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	電力
ECOPETROL SA	231.25	212.84	529,971	17,934	石油・ガス・消耗燃料
BANCOLOMBIA SA	2,812.3	3,126.78	1,046,220	35,405	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	129.5	120.06	524,662	17,755	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	309.57	270.16	1,099,010	37,191	各種金融サービス
	228.2	103.99	372,596	12,609	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,710.82	3,833.83	3,572,461	120,895
		5銘柄	5銘柄	—	<0.2%>
(クエート)					
KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	百株	百株	千クウェート・ディナール	千円	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	2,546.84	3,443.16	340	141,574	無線通信サービス
GULF BANK KSCP	1,262.48	1,229.02	82	34,234	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	1,426.6	—	—	—	銀行
AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	4,183.85	4,310.49	448	186,556	航空貨物・物流サービス
MABANEE CO KPSC	532.37	688.52	83	34,894	不動産管理・開発
BOUBYAN BANK KSCP	532.93	272.82	23	9,856	銀行
	839.09	602.72	54	22,752	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,324.16	10,546.73	1,033	429,869
		7銘柄	6銘柄	—	<0.7%>
(カタール)					
QATAR NATIONAL BANK	百株	百株	千カタール・リアル	千円	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	2,728.04	2,704.78	6,453	224,391	銀行
OOREDOO QSC	902.99	1,090.64	839	29,199	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	400.49	438.16	311	10,831	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	284.78	295.91	545	18,972	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	246.05	271.76	493	17,150	
	510.28	340.3	418	14,541	銀行

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(カタール)		百株	百株	千カタール・リアル	千円	
INDUSTRIES QATAR QSC		1,233.12	874.25	1,743	60,612	コングロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ		758.19	682.74	1,657	57,637	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO LTD		1,389.61	1,453.82	515	17,929	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN		2,423.81	2,715.27	1,509	52,491	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		1,384.49	1,384.49	482	16,781	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO		2,519.21	2,367.31	684	23,787	化学
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,781.06	14,619.43	15,655	544,329	
		12銘柄	12銘柄	二	<0.9%>	
(サウジアラビア)		百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO		154.78	142.5	929	31,440	化学
JARIR MARKETING CO		40.04	38.7	773	26,165	専門小売り
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE		41.55	41.55	298	10,109	保険
ETIHAD ETISALAT CO		185	206.59	900	30,480	無線通信サービス
SAUDI BRITISH BANK		445.2	480.31	2,146	72,653	銀行
AL RAJHI BANK		746.13	723.19	12,843	434,636	銀行
ARAB NATIONAL BANK		344.64	340.28	1,116	37,769	銀行
BANK ALBILAD		264.91	276.49	1,526	51,647	銀行
BANK AL-JAZIRA		354.4	217.93	675	22,861	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI		371.02	340.18	1,884	63,774	銀行
RIYAD BANK		739.24	793.52	3,170	107,276	銀行
SAUDI TELECOM CO		362.86	353.7	4,060	137,406	各種電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO		120.5	123	2,186	74,006	化学
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP		551.48	536.93	6,958	235,479	化学
SAUDI CEMENT CO		64.77	—	—	—	建設資材
SAUDI ELECTRICITY CO		459.63	472.84	1,279	43,282	電力
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP		186.28	222.02	803	27,197	化学
SAVOLA GROUP		145.38	128.55	480	16,247	食品
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO		225.28	166.21	393	13,330	化学
ALMARAI CO JSC		165.75	140.57	728	24,640	食品
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP		—	15.13	398	13,475	メディア
EMAAR ECONOMIC CITY		283.11	283.11	320	10,845	不動産管理・開発
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO		162.78	201.64	1,171	39,644	化学
ADVANCED PETROCHEMICAL CO		83.95	63.3	463	15,701	化学
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO		392.76	413.78	894	30,273	化学
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO		310.11	310.11	338	11,438	不動産管理・開発
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO		107.17	129.65	413	13,995	石油・ガス・消耗燃料
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA		218.18	187.22	263	8,907	無線通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO		29.68	30.41	526	17,802	保険
ALINMA BANK		615.01	579.56	2,405	81,391	銀行
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO		35.16	35.16	400	13,563	食品・生活必需品小売り
SAUDI ARABIAN MINING CO		270.62	253.35	3,511	118,826	金属・鉱業
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO		—	33.77	783	26,512	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SAUDI AIRLINES CATERING CO		30.88	—	—	—	商業サービス・用品
SAUDI ARABIAN OIL CO		1,312.38	1,290.7	5,517	186,720	石油・ガス・消耗燃料
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO		27.12	42.12	806	27,281	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
THE SAUDI NATIONAL BANK		1,358.29	1,299.16	9,756	330,166	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,206.04	10,913.23	71,127	2,406,954	
		35銘柄	35銘柄	—	<3.8%>	
(インド)		百株	百株	千インド・ルピー	千円	
RELIANCE INDUSTRIES LTD		1,742.43	1,675.92	427,636	714,152	石油・ガス・消耗燃料
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		373.5	473.6	17,949	29,975	石油・ガス・消耗燃料
ASIAN PAINTS LTD		242.86	223.52	68,858	114,994	化学
EICHER MOTORS LTD		87.39	76.15	18,972	31,683	自動車
GRASIM INDUSTRIES LTD		166.36	146.14	25,807	43,098	建設資材
MAHINDRA & MAHINDRA LTD		517.85	504.69	43,711	72,997	自動車
SHREE CEMENT LTD		5.81	7.56	19,174	32,021	建設資材
ICICI BANK LTD		3,142.49	3,017.09	229,977	384,062	銀行

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(インド)		百株	百株	千インド・ルピー	千円	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	372.98	322.22	9,426	15,742	石油・ガス・消耗燃料	
STATE BANK OF INDIA LTD	1,136.74	1,050.57	54,388	90,827	銀行	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	206.08	188.88	12,740	21,277	陸運・鉄道	
TATA STEEL LTD	473.87	418.51	55,222	92,221	金属・鉱業	
TATA MOTORS LTD	929.53	971.29	41,867	69,918	自動車	
JSW STEEL LTD	519.94	485.58	37,212	62,144	金属・鉱業	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	370.48	332.8	27,209	45,440	食品	
TATA POWER CO LTD	—	810.66	22,139	36,972	電力	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	70.36	57.68	19,320	32,265	食品	
NESTLE INDIA LTD	18.49	19.01	34,944	58,358	食品	
GAIL INDIA LTD	834.49	828.72	13,976	23,340	ガス	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	345.09	324.21	57,696	96,353	銀行	
VEDANTA LTD	1,176.59	646.34	27,521	45,960	金属・鉱業	
AXIS BANK LTD	1,410.99	1,329.94	105,470	176,136	銀行	
TITAN COMPANY LTD	228.71	204.85	50,420	84,202	繊維・アパレル・贅沢品	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,391.96	1,403.09	24,448	40,829	石油・ガス・消耗燃料	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	65.31	62.95	9,635	16,091	パーソナル用品	
BHARAT ELECTRONICS LTD	—	656.79	16,229	27,102	航空宇宙・防衛	
LUPIN LTD	127.8	170.03	13,143	21,949	医薬品	
MPHASIS LTD	—	45.93	14,012	23,400	情報技術サービス	
ACC LTD	35.92	57.06	12,602	21,046	建設資材	
BAJAJ FINANCE LTD	167.57	157.42	115,364	192,658	消費者金融	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	1,046.63	1,008.69	239,916	400,661	貯蓄・抵当・不動産金融	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	465.43	—	—	—	メディア	
INFOSYS LTD	2,079	1,978.88	346,017	577,848	情報技術サービス	
WIPRO LTD	631.91	801.12	44,798	74,813	情報技術サービス	
MRF LTD	0.96	0.84	5,665	9,461	自動車部品	
INDIAN OIL CORP LTD	1,430.83	1,024.14	13,098	21,874	石油・ガス・消耗燃料	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	504.39	484.22	104,211	174,033	パーソナル用品	
TRENT LTD	93.85	98.34	12,123	20,246	複合小売	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	47.7	56.86	26,976	45,051	ヘルスケア・プロバイダー・ヘルスケア・サービス	
HCL TECHNOLOGIES LTD	677.21	636.55	71,618	119,602	情報技術サービス	
DABUR INDIA LTD	343.49	337.81	18,778	31,360	パーソナル用品	
HERO MOTOCORP LTD	77.01	64.18	14,597	24,377	自動車	
SRF LTD	—	81.95	21,397	35,733	化学	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	70.63	63.57	13,320	22,244	自動車部品	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	75.27	64.32	27,652	46,179	医薬品	
IPCA LABORATORIES LTD	57.43	—	—	—	医薬品	
BHARTI AIRTEL LTD	1,524.71	1,450.7	107,446	179,434	無線通信サービス	
UNITED SPIRITS LTD	150.17	159.19	14,230	23,765	飲料	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	542.74	482.55	45,202	75,488	医薬品	
DIVI'S LABORATORIES LTD	72.41	73.97	33,280	55,579	ライフサイエンス・ツール/サービス	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	86.24	79.74	59,561	99,468	自動車	
AUROBINDO PHARMA LTD	178.68	147.88	10,111	16,885	医薬品	
HAVELLS INDIA LTD	116.19	130.47	16,617	27,751	電気設備	
INDRAPRASTHA GAS LTD	246.03	220.37	8,592	14,349	ガス	
BIOCON LTD	219.17	183.06	6,419	10,721	バイオテクノロジー	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	676.1	885.01	12,319	20,573	自動車部品	
SHIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	93.53	140.71	16,659	27,821	消費者金融	
PETRONET LNG LTD	569.37	527.03	10,764	17,976	石油・ガス・消耗燃料	
CIPILA LTD/INDIA	277.24	268.78	27,324	45,631	医薬品	
LARSEN & TOUBRO LTD	446.07	402.05	70,792	118,224	建設・土木	
ULTRATECH CEMENT LTD	73.11	57.7	38,832	64,850	建設資材	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	572.48	546.28	200,045	334,075	情報技術サービス	
ADANI ENTERPRISES LTD	—	159.22	35,019	58,482	商社・流通業	
NTPC LTD	2,766.29	2,758.8	42,471	70,927	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	53.27	78.99	18,036	30,121	各種金融サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
		外貨建金額				
(インド)						
YES BANK LTD	百株	千インド・ルピー	千円			
AMBUJA CEMENTS LTD	7,148.5	7,148.5	10,401	17,369		銀行
BHARAT FORGE LTD	345.17	414.63	15,308	25,564		建設資材
HINDALCO INDUSTRIES LTD	158.49	180.24	13,212	22,064		自動車部品
ITC LTD	967.13	924.72	50,559	84,433		金属・鉱業
PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,874.66	1,739.81	46,896	78,317		タバコ
UNITED PHOSPHORUS LTD	86.76	84.2	19,922	33,269		化学
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	297.92	279.32	22,866	38,187		化学
SIEMENS INDIA LTD	25.21	39.29	11,195	18,696		医薬品
INFO EDGE INDIA LTD	36.37	36.01	8,883	14,835		コングロマリット
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	42.16	52.47	24,943	41,655		インターネット・メディアおよびサービス
TECH MAHINDRA LTD	257.69	229.9	18,078	30,190		パーソナル用品
MINDTREE LTD	406.6	366.01	51,623	86,211		情報技術サービス
MARICO LTD	—	36.05	14,776	24,677		情報技術サービス
PAGE INDUSTRIES LTD	266.96	362.41	18,834	31,453		食品
DLF LTD	3.78	2.91	13,041	21,779		繊維・アパレル・贅沢品
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	337.09	354.05	13,853	23,136		不動産管理・開発
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	1,403.37	1,788.14	41,037	68,533		電力
REC LTD	317.46	322.22	27,082	45,227		運送インフラ
BAJAJ FINSERV LTD	450.37	—	—	—		各種金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	24.28	21.74	34,979	58,416		各種金融サービス
JUBLILANT FOODWORKS LTD	43.88	49.14	18,168	30,341		自動車
MUTHOOT FINANCE LTD	57.44	40.89	11,370	18,989		ホテル・レストラン・レジャー
COAL INDIA LTD	49.65	88.1	11,777	19,667		消費者金融
INDUS TOWERS LTD	994.58	845.19	15,771	26,337		石油・ガス・消耗燃料
PI INDUSTRIES LTD	373.74	549.46	11,906	19,884		各種電気通信サービス
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	41.33	43.11	12,684	21,183		化学
ADANI GREEN ENERGY LTD	27.48	35.87	21,661	36,174		情報技術サービス
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	253.35	224.36	64,263	107,319		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	445.36	507.11	28,644	47,835		保険
BANDHAN BANK LTD	389.9	377.5	12,312	20,561		資本市場
ADANI TOTAL GAS LTD	—	158.08	39,533	66,020		銀行
GODREJ PROPERTIES LTD	—	69.71	11,176	18,664		ガス
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	—	222.29	16,233	27,110		不動産管理・開発
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	—	166.24	13,856	23,141		消費者金融
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	—	129.53	10,107	16,879		商業サービス・用品
ZOMATO LTD	—	1,256.44	10,541	17,604		インターネット販売・通信販売
BERGER PAINTS INDIA LTD	125.56	109.81	7,951	13,279		化粧品
ADANI TRANSMISSIONS LTD	—	157.9	42,486	70,953		電力
AVENUE SUPERMARTS LTD	88.1	92.95	38,024	63,501		食品・生活必需品小売
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	115.17	113.49	15,419	25,750		保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	190.44	276.04	14,933	24,939		保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	48.93	77.33	14,686	24,526		旅客航空輸送業
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	240.46	251.49	28,843	48,168		保険
小計	株数	・金額	50,386.72	52,387.94	4,299,658	7,180,430
銘柄	銘柄	数	96銘柄	106銘柄	—	<11.4%>
(パキスタン)						
MCB BANK LTD	百株	千パキスタン・ルピー	千円			
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	124	—	—	—		銀行
HABIB BANK LTD	218.68	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
小計	株数	・金額	535.68	—	—	—
銘柄	銘柄	数	3銘柄	—銘柄	—	<-%>
(インドネシア)						
ANEKA TAMBANG TBK PT	百株	千インドネシア・ルピア	千円			
BARITO PACIFIC TBK PT	5,717	5,717	1,589,326	14,145		金属・鉱業
UNITED TRACTORS TBK PT	14,709	14,484	1,260,108	11,214		化学
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	848.01	905.01	2,696,929	24,002		石油・ガス・消耗燃料
			3,529	3,529		食品

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
		外貨建金額				
(インドネシア)						
UNILEVER INDONESIA TBK PT	百株 4,805	百株 4,854	千円 1,650,360	14,688	家庭用品	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	13,067	11,683	8,032,062	71,485	自動車	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	31,399	28,718	13,440,024	119,616	各種電気通信サービス	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	3,868	3,830	1,911,170	17,009	食品	
GUDANG GARAM TBK PT	324	324	991,440	8,823	タバコ	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	678	758	761,790	6,779	建設資材	
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	1,908	1,908	1,454,850	12,948	紙製品・林産品	
BANK MANDIRI	11,831	10,904	8,368,820	74,482	銀行	
BANK RAKYAT INDONESIA	34,221	39,992	18,156,368	161,591	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	8,222	—	—	—	ガス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	3,443	4,001	3,360,840	29,911	銀行	
KALBE FARMA TBK PT	10,057	10,083	1,598,155	14,223	医薬品	
SEMENT INDONESIA PERSERO TBK PT	1,498	1,257	757,342	6,740	建設資材	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	6,028	32,729	25,201,330	224,291	銀行	
ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	9,341	9,341	3,091,871	27,517	石油・ガス・消耗燃料	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	1,650	1,650	1,183,875	10,536	食品	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	—	5,333	1,647,897	14,666	各種電気通信サービス	
SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	17,183	17,183	1,735,483	15,445	各種電気通信サービス	
BANK JAGO TBK PT	—	2,702	3,512,600	31,262	銀行	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	4,256	6,378	3,348,450	29,801	金属・鉱業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	188,582.01 22銘柄	218,263.01 23銘柄	107,912,604 —	960,422 <1.5%>	
(アラブ首長国連邦)						
ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	百株 1,142.69	百株 732.54	千円 646	22,348	銀行	
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	942.96	1,553.05	973	33,643	銀行	
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	1,071.47	2,033.41	7,523	259,940	各種電気通信サービス	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	1,764.04	1,582.72	1,646	56,870	銀行	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	1,680.85	2,606.27	5,811	200,803	銀行	
EMAAAR PROPERTIES PJSC	1,873.97	2,686.91	1,639	56,627	不動産管理・開発	
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,243.84	2,215.52	1,134	39,191	不動産管理・開発	
EMIRATES NBD BANK PJSC	1,385.97	1,448.03	2,143	74,043	銀行	
EMAAAR MALLS PJSC	2,679.19	—	—	—	不動産管理・開発	
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	—	1,523.4	623	21,527	専門小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,784.98 9銘柄	16,381.85 9銘柄	22,141 —	764,997 <1.2%>	
(ブラジル)						
BRF SA	百株 296.92	百株 472.92	千円 720	19,404	食品	
VALE SA	2,252.21	2,405.89	22,155	596,898	金属・鉱業	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	790	—	—	—	電力	
RAIA DROGASIL SA	635	599	1,333	35,922	食品・生活必需品小売り	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	112.5	130.5	555	14,973	電力	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	197	197	854	23,033	電力	
BANCO DO BRASIL SA	564	519	1,826	49,217	銀行	
ITAUSA SA	2,433.6	2,729.88	2,757	74,280	銀行	
LOJAS AMERICANAS SA	531.74	—	—	—	インターネット販売・通信販売	
GERDAU SA	671.3	652.3	1,919	51,701	金属・鉱業	
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,230.1	2,100.1	7,297	196,610	石油・ガス・消耗燃料	
VIBRA ENERGIA SA	392	673	1,527	41,139	専門小売り	
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,958.12	2,885.12	9,021	243,054	石油・ガス・消耗燃料	
CCR SA	653.2	909.2	1,227	33,067	運送インフラ	
WEG SA	524.72	961.44	3,104	83,637	電気設備	
BANCO BRADESCO SA PREF	2,820.85	2,950.93	6,323	170,370	銀行	
BANCO BRADESCO SA	713.25	753.57	1,336	35,995	銀行	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	410.06	368.06	936	25,225	金属・鉱業	
BRADESPAR SA	102	—	—	—	金属・鉱業	
SUZANO SA	464.75	426.75	2,287	61,635	紙製品・林産品	
CPFL ENERGIA SA	222	—	—	—	電力	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(ブラジル)						
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	百株	2,994.47	2,871.47	千ブラジル・レアル	千円	銀行
AMERICANAS SA	154	361.71	7,560	1,018	203,688	インターネット販売・通信販売
BRASKEM SA	—	123	536	536	27,431	化学
ENGIE BRASIL SA	179.87	73.87	325	325	14,457	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALPARGATAS SA	85	194	440	440	8,770	織維・アパレル・贅沢品
LOCALIZA RENT A CAR	389.89	352.89	2,017	2,017	11,859	陸運・鉄道
LOJAS RENNER SA	450.37	563.2	54,362	1,505	40,572	複合小売り
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	379.04	559.04	22,621	839	35,892	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA	144	575	石油・ガス・消耗燃料	1,332	26,307	石油・ガス・消耗燃料
TOTVS SA	236	279	ソフトウェア	976	39,059	電力
EQUATORIAL ENERGIA SA	685	560	電力	1,449	50,071	食品
JBS SA	695	483	食品	1,858	24,497	電力
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	508.69	588.17	水道	909	25,599	医薬品
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	179.98	188.98	医薬品	950	20,351	資本市場
HYPERA SA	182	195	資本市場	755	138,445	複合小売り
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	1,271.16	3,546.48	複合小売り	5,138	27,234	MAGAZINE LUIZA SA
MAGAZINE LUIZA SA	1,810	1,682	石油・ガス・消耗燃料	1,010	25,893	HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA
HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	—	386	石油・ガス・消耗燃料	961	41,440	TELEFONICA BRASIL SA
TELEFONICA BRASIL SA	322.28	286.28	各種電気通信サービス	1,538	—	VIA S/A
VIA S/A	683	—	専門小売り	—	—	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	423	458	保険	1,198	32,278	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	342	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	—	—	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	591	2,456.61	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2,554	68,830	ATACADO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA
ATACADO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	299	299	食品・生活必需品小売り	690	18,615	AMBEV SA
AMBEV SA	2,925.95	2,773.95	飲料	4,077	109,857	NATURA & CO HOLDING SA
NATURA & CO HOLDING SA	571	498	パーソナル用品	1,245	33,541	TIM SA
TIM SA	622	466	無線通信サービス	636	17,149	REDE D'OR SAO LUIZ SA
REDE D'OR SAO LUIZ SA	—	222	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	942	25,400	RUMO SA
RUMO SA	797	855	陸運・鉄道	1,573	42,383	
小計	株数	37,896.02	41,632.31	109,231	2,942,785	
	銘柄	・金額	41,632.31	—	<4.7%>	
	数	比	44銘柄	—		
(チェコ)						
KOMERCI NI BANKA AS	百株	62.5	百株	千チェコ・コルナ	千円	銀行
CEZ	98.49	36.64	36.64	3,057	17,113	電力
MONETA MONEY BANK AS	269.89	88.2	88.2	8,837	49,463	銀行
小計	株数	430.88	269.89	2,469	13,821	
	銘柄	・金額	3銘柄	—	<0.1%>	
	数	比	3銘柄	—		
(韓国)						
SKC CO LTD	百株	—	百株	千韓国・ウォン	千円	化学
CHEIL WORLDWIDE INC	73	14.72	14.72	230,368	23,704	メディア
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	20.68	50.14	50.14	123,344	12,692	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	18.56	22.26	22.26	197,891	20,363	保険
DB INSURANCE CO LTD	38.43	16.95	16.95	361,035	37,150	保険
COWAY CO LTD	23.34	34.5	34.5	237,705	24,459	保険
KT&G CORP	64.55	36.97	36.97	244,002	25,107	家庭用耐久財
S-1 CORPORATION	7.94	66.64	66.64	531,787	54,720	タバコ
KOREA GAS CORP	13.03	1.07	1.07	7,329	754	商業サービス・用品
CJ CORP	10.01	10.01	10.01	87,287	8,981	ガス
KAKAO CORP	175.75	180.92	1,725,976	1,725,976	177,603	コングロマリット
CJ ENM CO LTD	2.99	7.61	7.61	99,158	10,203	インターネット・メディアおよびサービス
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	24.97	—	—	—	—	娯楽
KMW CO LTD	13.34	—	—	—	—	機械
SK TELECOM CO LTD	25.24	22.04	22.04	131,138	13,494	通信機器
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	215.11	200.59	200.59	167,492	17,234	無線通信サービス
NCSOFT CORPORATION	10.26	9.06	9.06	401,358	41,299	資本市場
LG UPLUS CORP	156.81	146.06	146.06	208,135	21,417	娯楽
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	152.61	200.52	200.52	420,089	43,227	各種電気通信サービス
						電気設備

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(韓国)							
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	百株	百株	千韓国・ウォン		千円	パーソナル用品	
LG CHEM LTD	5.62	5.29	463,933		47,738	化学	
LG CHEM LTD	28.06	26.33	1,329,665		136,822	化学	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	4.99	4.99	130,239		13,401	パーソナル用品	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	2.03	1.02	50,235		5,169	銀行	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	273.94	255.17	1,028,335		105,815	海運業	
S-OIL CORP	—	151.96	405,733		41,749	石油・ガス・消耗燃料	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	24.6	23.35	251,012		25,829	化学	
MERITZ SECURITIES CO LTD	65.26	83.1	282,955		29,116	資本市場	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	202.52	202.52	137,106		14,108	資本市場	
POSCO CHEMICAL CO LTD	52.63	46.18	187,490		19,292	建設資材	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	13.38	20.82	271,701		27,958	化学	
HOTEL SHILLA CO LTD	10.44	8.75	168,000		17,287	専門小売り	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	16.75	13.99	114,578		11,790	機械	
HYUNDAI MOBIS	22.28	19.26	188,170		19,362	自動車部品	
SK HYNIX INC	41.29	38.05	783,830		80,656	半導体・半導体製造装置	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	333.67	318.1	3,435,480		353,510	建設・土木	
HYUNDAI MOTOR CO	45.34	42.06	185,694		19,108	自動車	
HYUNDAI MOTOR CO	15.15	15.15	133,320		13,718	自動車	
HYUNDAI STEEL CO	92.1	80.41	1,423,257		146,453	金属・鉱業	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	45.33	60.59	250,236		25,749	銀行	
KIA CORPORATION	211.14	183.71	202,081		20,794	自動車	
KOREA ZINC CO LTD	163.27	153.03	1,173,740		120,777	自動車	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	4.65	4.7	294,220		30,275	金属・鉱業	
HANWHA CORP	164.88	142.75	310,481		31,948	電力	
KOREAN AIR CO LTD	24.18	—	—		—	コングロマリット	
CJ LOGISTICS	97.24	94.37	296,793		30,540	旅客航空輸送業	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	4.51	1.29	16,770		1,725	陸運・鉄道	
DOUZONE BIZON CO LTD	10.93	11.99	182,248		18,753	化学	
HLB INC	10.2	—	—		—	ソフトウェア	
LG ELECTRONICS INC	48.88	67.89	207,064		21,306	レジャー用品	
LOTTE CORP	66.67	60.7	767,855		79,012	家庭用耐久財	
LG CORP	15.91	—	—		—	コングロマリット	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	52.51	48.25	353,672		36,392	コングロマリット	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	91.63	91.63	101,709		10,465	資本市場	
NAVER CORP	47.63	46.31	196,122		20,181	建設・土木	
L&F CO LTD	75.17	71.42	2,203,307		226,720	インターネット・メディアおよびサービス	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	—	14.49	340,659		35,053	電子装置・機器・部品	
OTTOGI CORP	22.41	29.32	219,020		22,537	資本市場	
AMOREPACIFIC GROUP	0.66	—	—		—	食品	
KANGWON LAND INC	20.01	23.47	111,834		11,507	パーソナル用品	
POSCO HOLDINGS INC	87.13	43.02	118,950		12,239	ホテル・レストラン・レジャー	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	46.03	42.5	1,200,625		123,544	金属・鉱業	
SAMSUNG SDI CO LTD	88.11	82.93	202,349		20,821	建設・土木	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	33.81	31.92	1,956,696		201,344	電子装置・機器・部品	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	35.6	30.59	480,263		49,419	電子装置・機器・部品	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	—	4.1	78,310		8,058	バイオテクノロジー	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,913	2,802,68	18,665,848		1,920,715	コンピュータ・周辺機器	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	267.7	354.68	221,320		22,773	機械	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	494.02	485.33	2,907,126		299,143	コンピュータ・周辺機器	
SHINSEGAE CO LTD	5.13	—	—		—	複合小売り	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	15.63	—	—		—	医薬品	
YUHAN CORP	37.2	21.27	126,556		13,022	医薬品	
HANON SYSTEMS	101.46	80.78	91,281		9,392	自動車部品	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	31.66	—	—		—	保険	
GS HOLDINGS CORP	28.79	26.22	115,892		11,925	石油・ガス・消耗燃料	
LG DISPLAY CO LTD	140.45	125.69	241,953		24,896	電子装置・機器・部品	
CELLTRION INC	59.4	56.12	889,502		91,529	バイオテクノロジー	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(韓国)						
HANA FINANCIAL GROUP	百株	百株	千韓国・ウォン	千円		銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	190.41	172.18	807,524	83,094		航空貨物・物流サービス
CELLTRION PHARM INC	11.32	11.38	224,755	23,127		医薬品
LOTTE SHOPPING CO	9.88	10.17	89,089	9,167		複合小売り
MERIT FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	5.38	4.57	43,003	4,425		保険
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	—	24.99	116,078	11,944		保険
AMOREPACIFIC CORP	43.61	37.28	241,201	24,819		パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	17.7	17.9	289,085	29,746		消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	30.26	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	34.79	29.24	606,730	62,432		食品
STX PAN OCEAN CO LTD	4.66	3.85	148,610	15,291		海運業
LG INNOTEK CO LTD	195.95	201.72	133,336	13,720		電子装置・機器・部品
SK INC	7.64	7.85	312,822	32,189		コングロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	245.61	229.45	1,362,933	140,245		銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	36.64	34.39	151,831	15,623		航空宇宙・防衛
ILJIN MATERIALS CO LTD	—	19.49	183,790	18,912		電子装置・機器・部品
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	—	28	114,800	11,812		各種金融サービス
HANMI PHARM CO LTD	2.87	2.35	72,145	7,423		医薬品
FILA HOLDINGS CORP	25.17	—	—	—		繊維・アパレル・贅沢品
SEEGENE INC	9.79	19.58	81,452	8,381		バイオテクノロジー
E-MART CO LTD	10.07	14.26	196,788	20,249		食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	6.53	—	—	—		食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	38.56	52.61	180,978	18,622		自動車部品
HD HYUNDAI CO LTD	23.05	20.56	120,687	12,418		石油・ガス・消耗燃料
BGF RETAIL CO LTD	3.44	4.13	74,133	7,628		食品・生活必需品小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	17.03	17.6	152,944	15,737		食品
SK CHEMICALS CO LTD	4.09	6.13	77,544	7,979		化学
NETMARBLE CORP	14.5	14.78	152,234	15,664		娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	299.5	284.88	433,017	44,557		銀行
ECOPRO BM CO LTD	—	5.86	268,681	27,647		電気設備
SD BIOSENSOR INC	—	30.95	150,107	15,446		ヘルスケア機器・用品
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	11.69	20.02	177,177	18,231		医薬品
KRAFTON INC	—	12.16	321,632	33,095		娯楽
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	—	13.12	160,064	16,470		化学
SK SQUARE CO LTD	—	53.81	307,255	31,616		半導体・半導体製造装置
SK BIOSCIENCE CO LTD	—	16.72	224,048	23,054		バイオテクノロジー
KAKAO GAMES CORP	—	25.15	164,984	16,976		娯楽
HYBE CO LTD	—	11.58	340,452	35,032		娯楽
LG ENERGY SOLUTION	—	11.97	520,695	53,579		電気設備
KAKAOBANK CORP	—	67.67	312,635	32,170		銀行
F&F CO LTD / NEW	—	13.7	205,500	21,145		繊維・アパレル・贅沢品
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD-RTS	—	0.87	17,313	1,781		バイオサイエンス・ツール/サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	21.86	18.25	250,937	25,821		情報技術サービス
ALTEOGEN INC	23.29	20.26	108,796	11,195		バイオテクノロジー
SAMSUNG C&T CORP	54.59	46.39	505,651	52,031		コングロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	10.33	9.96	831,660	85,577		バイオサイエンス・ツール/サービス
PEARL ABYSS CORP	20.8	20.8	222,976	22,944		娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	29.22	28.05	122,017	12,555		機械
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	38.5	47.15	282,900	29,110		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
小計	株数	金額	9,377,78	9,438,09	63,133,776	6,496,465
銘柄	数	比率	106銘柄	112銘柄	—	<10.3%>
(中国)						
EVE ENERGY CO LTD	百株	百株	千オフショア・人民元	千円		電気設備
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	90.32	88.32	629	12,491		電子装置・機器・部品
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	54	59.4	69	1,376		電子装置・機器・部品
ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	—	34	348	6,913		電子装置・機器・部品
BEIJING THUNISOFT CORP LTD	58	—	—	—		ソフトウェア

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(中国)				千オフショア・人民元	千円	
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	百株	百株				飲料
	30	30		68	1,362	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	120	120		115	2,292	半導体・半導体製造装置
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	18	52		595	11,810	金属・鉱業
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	—	52		68	1,357	金属・鉱業
UNISPLENDOUR CORP LTD	75.4	75.4		131	2,617	電子装置・機器・部品
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	163	163		112	2,224	電子装置・機器・部品
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	191	191		229	4,542	紙製品・林産品
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	40	40		64	1,277	通信機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12	12		126	2,507	ライフサイエンス・ツール/サービス
JOYOUNG CO LTD	51	—		—	—	家庭用耐久財
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	164	39		88	1,757	電気設備
HUAGONG TECH CO LTD	75	75		132	2,618	電子装置・機器・部品
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	9	21		331	6,571	医薬品
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	103.3	103.3		162	3,223	機械
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	66	—		—	—	医薬品
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	53	53		155	3,078	娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	59	59		62	1,231	電子装置・機器・部品
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	191	191		327	6,501	電子装置・機器・部品
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	238	—		—	—	保険
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	66	—		—	—	家庭用耐久財
BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	66.5	—		—	—	建設資材
GEM CO LTD	291	291		218	4,340	金属・鉱業
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	44	26		230	4,574	ソフトウェア
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	69	69		381	7,563	バイオテクノロジー
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	186	186		103	2,055	娯楽
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	24	65		549	10,898	電気設備
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	61.2	85.68		145	2,877	電子装置・機器・部品
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	59.04	59.04		184	3,659	家庭用耐久財
ZHEJIANG NHU CO LTD	58	32.6		103	2,053	医薬品
SHUIJAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	19	26.6		95	1,898	医薬品
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	27	—		—	—	電子装置・機器・部品
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	66	66		126	2,511	食品
CHINA NATIONAL ACCORD MEDICINES CORP LTD	39	—		—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	34	34		80	1,590	機械
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	51	51		160	3,175	建設関連製品
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	15	15		14	296	情報技術サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	26	26		30	602	情報技術サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	46	46		273	5,429	食品
GOTION HIGH-TECH CO LTD	124	30		85	1,699	電気設備
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	110	110		107	2,131	航空宇宙・防衛
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	84	—		—	—	自動車部品
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	120	196		1,027	20,388	食品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	48	72		835	16,564	バイオテクノロジー
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	—	40		60	1,194	石油・ガス・消耗燃料
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	—	180		180	3,584	コングロマリット
ADDSINO CO LTD	102	102		107	2,136	通信機器
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	112	112		117	2,330	コンピュータ・周辺機器
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	—	101		101	2,021	電子装置・機器・部品
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	314	314		200	3,967	化学
NAVINFO CO LTD	56	56		72	1,445	ソフトウェア
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	143	143		74	1,477	不動産管理・開発
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	27.3	27.3		22	444	ヘルスケア・テクノロジー
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	26	26		41	832	医薬品
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	78	78		144	2,870	バイオテクノロジー
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	259	502.5		728	14,443	化学
CHINA RESOURCES SANJU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	60	60		225	4,463	医薬品
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	32	32		556	11,038	半導体・半導体製造装置

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(中国)						
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	百株	百株	千オフショア・人民元		千円	コンピュータ・周辺機器
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	35.7	35.7	97		1,926	医薬品
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	149	—	—		—	コンピュータ・周辺機器
O-FILM TECH CO LTD	127	127	122		2,423	電子装置・機器・部品
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	86	86	53		1,067	金属・鉱業
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	500	367	262		5,205	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	124.8	233.81	807		16,023	電子装置・機器・部品
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	139	108	291		5,782	飲料
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	48	5.6	20		416	ヘルスケア機器・用品
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	69	69	130		2,581	機械
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	382	382	207		4,114	医薬品
DONG-E-JIAO CO LTD	13	—	—		—	医薬品
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	49	49	159		3,169	医薬品
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	153	153	147		2,919	通信機器
HUADONG MEDICINE CO LTD	210	210	137		2,724	繊維・アパレル・贅沢品
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	75	75	257		5,105	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	50	50	200		3,980	エネルギー設備・サービス
37' INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	62	25		504	金属・鉱業
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	66	66	147		2,926	娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	—	119	254		5,051	航空宇宙・防衛
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	48	45	938		18,611	飲料
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	74	111	583		11,581	機械
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	149.5	149.5	129		2,562	食品
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	177	177	138		2,749	資本市場
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	178	153	618		12,264	半導体・半導体製造装置
BEIJING SHIJU INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	59.4	59.4	81		1,622	ホテル・レストラン・レジャー
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	38	53.2	97		1,924	ソフトウェア
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	160	160	71		1,418	不動産管理・開発
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	21	21	197		3,923	資本市場
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	364.8	364.8	229		4,544	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	143	143	110		2,195	娯楽
SHANXI SECURITIES CO LTD	291.54	271.54	793		15,738	電子装置・機器・部品
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	275	275	154		3,065	資本市場
NEW HOPE LIUHE CO LTD	445	838	493		9,790	メディア
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	199	199	311		6,169	食品
DHC SOFTWARE CO LTD	—	239	375		7,452	電子装置・機器・部品
IFLYTEK CO LTD	38	38	25		506	情報技術サービス
HESTEE CO LTD	113	135	561		11,134	ソフトウェア
GOERTEK INC	1,047	1,047	281		5,586	金属・鉱業
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	87	78	248		4,932	電子装置・機器・部品
BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD	213	213	163		3,236	資本市場
BANK OF NINGBO CO LTD	575	—	—		—	商業サービス・用品
LENS TECHNOLOGY CO LTD	191	192	735		14,590	銀行
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	146	124	132		2,634	電子装置・機器・部品
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	474	474	225		4,475	家庭用耐久財
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	283	283	175		3,480	資本市場
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	376	376	287		5,698	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN SECURITIES CO LTD	124	416.6	432		8,586	自動車
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	227	227	159		3,169	資本市場
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	82	47	145		2,887	食品
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUTRY GROUP	38	38	296		5,887	医薬品
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	107	—	—		—	航空宇宙・防衛
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	278.4	267.08	718		14,251	資本市場
WULIANGYE YIBIN CO LTD	48	44	607		12,044	飲料
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	146	128	2,174		43,137	飲料
SUNING.COM CO LTD	208	208	119		2,376	バイオテクノロジー
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	237	237	83		1,654	専門小売り
	1,256	855	351		6,970	電子装置・機器・部品

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(中国)				千オフショア・人民元	千円	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	百株	百株		499	253	8,536
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	—	—		—	110	2,183
MIDEA GROUP CO LTD	136	—		—	—	—
GUOSHEN SECURITIES CO LTD	170	—		—	—	資本市場
PING AN BANK CO LTD	614	601	986	302.8	155.8	19,575
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	302.8	712	334	302.8	312	6,625
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	1,287	319	679	1,287	551	6,200
CHINA VANKE CO LTD	374	243	13,478	374	59	13,478
ZTE CORP	216	285	10,936	216	190	10,936
ZOONIION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	285	211	3,776	285	251	3,776
WEICHAI POWER CO LTD	170	47	機械	170	59	機械
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	42	42	2,868	42	144	医薬品
GF SECURITIES CO LTD	391	219	資本市場	391	391	7,767
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	211	211	電気設備	211	251	4,997
BYD CO LTD	71	59	自動車	71	1,393	27,643
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	341	341	電子装置・機器・部品	341	158	3,138
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	39	48.3	化学	39	393	7,813
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	—	29	化学	—	209	4,160
LB GROUP CO LTD	110	110	化学	110	229	4,545
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	—	179	化学	—	246	4,885
NANJI E-COMMERCE CO LTD	129	—	メディア	129	—	—
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	—	129	化学	—	284	5,649
CHACHA FOOD CO LTD	29	29	食品	29	171	3,397
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	80	80	医薬品	80	199	3,952
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15	27	半導体・半導体製造装置	15	705	13,998
JIANGXI ZHENGANG TECHNOLOGY CO LTD	36	36	食品	36	25	505
HUAFON CHEMICAL CO LTD	—	342	化学	—	292	5,807
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	494	—	金属・鉱業	494	—	—
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	55.5	55.5	娯楽	55.5	70	1,400
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12	30	飲料	12	561	11,132
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	156	156	化学	156	132	2,627
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	66	66	半導体・半導体製造装置	66	338	6,713
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	6	6	家庭用耐久財	6	31	633
NINESTAR CORP	57	57	コンピュータ・周辺機器	57	236	4,683
YUNDA HOLDING CO LTD	70.2	70.2	航空貨物・物流サービス	70.2	121	2,413
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	338	338	半導体・半導体製造装置	338	109	2,165
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	120	120	娯楽	120	109	2,180
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	42	67.2	機械	42	320	6,351
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	16	16	医薬品	16	75	1,491
ASYMCHM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	5	15	医薬品	5	463	9,193
JIUGUI LIQUOR CO LTD	—	23	飲料	—	368	7,317
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	151	151	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	151	86	1,707
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	53	53	ソフトウェア	53	55	1,095
SF HOLDING CO LTD	150	142	航空貨物・物流サービス	150	711	14,114
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	—	18	建設関連製品	—	184	3,659
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	236	236	資本市場	236	134	2,658
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	—	25	半導体・半導体製造装置	—	207	4,124
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	65	—	化学	65	—	—
BANK OF SHANGHAI CO LTD	637.9	637.9	銀行	637.9	430	8,541
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	—	389	ソフトウェア	—	356	7,068
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	—	23	家庭用耐久財	—	244	4,852
CSC FINANCIAL CO LTD	136	136	資本市場	136	330	6,560
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	50	—	航空宇宙・防衛	50	—	—
SHANGHAI PUTALAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	21	29.4	化学	21	367	7,288
NANJING KINGFRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	—	126	医薬品	—	362	7,193
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	164	133	化学	164	292	5,806
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	31	31	飲料	31	256	5,093

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(中国)				千オフショア・人民元	千円	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	百株 225	百株 225	238	4,735	資本市場	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	13	15.6	43	855	食品・生活必需品小売り	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	—	115	143	2,856	金属・鉱業	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	52	52	179	3,559	食品	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	—	102	406	8,064	化学	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	31.5	31.5	230	4,563	通信機器	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	33	32	609	12,092	化学	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	27	27	180	3,588	電子装置・機器・部品	
JUEWEI FOOD CO LTD	31	31	141	2,797	食品	
OPPEIN HOME GROUP INC	21	21	277	5,495	家庭用耐久財	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	236	—	—	—	銀行	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	43.2	43.2	350	6,944	金属・鉱業	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	95	95	149	2,967	食品	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	30	30	87	1,737	通信機器	
C&S PAPER CO LTD	78	78	90	1,788	家庭用品	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	8.4	8.4	77	1,541	電子装置・機器・部品	
HUZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	—	7	75	1,489	自動車部品	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	27	27	98	1,948	医薬品	
GUANGZHOU WONDO BIOTECH CO LTD	16	—	—	—	ヘルスケア機器・用品	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	13.3	13.3	58	1,154	ヘルスケア機器・用品	
BGI GENOMICS CO LTD	13	13	98	1,960	バイオテクノロジー	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	30	30	146	2,896	化学	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	20	20	161	3,211	バイオテクノロジー	
CAITONG SECURITIES CO LTD	127	127	101	2,020	資本市場	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	—	38	351	6,967	化学	
BANK OF CHENGDU CO LTD	270	270	446	8,863	銀行	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	19	19	139	2,762	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
NANJING SECURITIES CO LTD	98	98	84	1,683	資本市場	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	144	59	59	1,175	電子装置・機器・部品	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	36	38	1,295	25,688	ヘルスケア機器・用品	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	53	—	—	—	各種消費者サービス	
HUAXI SECURITIES CO LTD	155	155	131	2,610	資本市場	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	12	12	118	2,356	ソフトウェア	
OVCTEK CHINA INC	29	40.6	148	2,947	ヘルスケア機器・用品	
SG MICRO CORP	6	9	255	5,070	半導体・半導体製造装置	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	77	80	3,606	71,546	電気設備	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	24.4	34.16	452	8,971	半導体・半導体製造装置	
WUXI APPTEC CO LTD	55.6	76.72	837	16,604	ライフサイエンス・ツール/サービス	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	—	3	12	257	半導体・半導体製造装置	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	35	23	160	3,179	電子装置・機器・部品	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	10	16	315	6,258	電子装置・機器・部品	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	—	363	584	11,585	化学	
PHARMARON BEIJING CO LTD	—	33	396	7,865	ライフサイエンス・ツール/サービス	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	—	38	405	8,038	半導体・半導体製造装置	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	—	64	387	7,693	半導体・半導体製造装置	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	—	7	69	1,384	電気設備	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	37	38	660	13,108	半導体・半導体製造装置	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	—	17	225	4,471	機械	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	—	171	386	7,672	電気設備	
TIANFENG SECURITIES CO LTD	967	9	3	61	資本市場	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	817	817	312	6,206	金属・鉱業	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	—	107	311	6,186	電子装置・機器・部品	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	—	287	295	5,852	資本市場	
PROYA COSMETICS CO LTD	9	9	165	3,286	パーソナル用品	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	609	1,737	856	16,986	陸運・鉄道	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	10	324	6,441	半導体・半導体製造装置	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	—	9.6	276	5,484	電気設備	

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(中国)				千オフショア・人民元	千円	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	百株 1,077	百株 1,077		612	12,155	銀行
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	—	23		195	3,886	バイオテクノロジー
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	61	61		299	5,935	食品
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	—	16		73	1,465	医薬品
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	8	12		52	1,042	ヘルスケア機器・用品
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	—	39		398	7,910	金属・鉱業
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	—	62		473	9,395	半導体・半導体製造装置
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	—	506		419	8,320	資本市場
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	—	19		511	10,141	バイオテクノロジー
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	6	6		74	1,480	食品
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	—	109		454	9,022	資本市場
IMEK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	—	10		494	9,799	バイオテクノロジー
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	—	43		376	7,462	コンピュータ・周辺機器
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	—	24.47		443	8,803	ソフトウェア
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	—	164		369	7,319	半導体・半導体製造装置
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	—	455		235	4,662	家庭用耐久財
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	—	660		161	3,194	建設・土木
PETROCHINA CO LTD	1,109	1,109		614	12,187	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	2,118	2,118		1,008	19,998	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	2,744	2,744		842	16,710	銀行
BANK OF CHINA LTD	840	840		275	5,465	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	421	1,585		689	13,676	石油・ガス・消耗燃料
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	100	100		269	5,341	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	155	175		543	10,771	石油・ガス・消耗燃料
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	736	701		3,282	65,117	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	377	370		1,787	35,449	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD	688	686		1,527	30,290	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	978	1,020		831	16,489	銀行
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	1,382	1,382		529	10,499	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD	239	257		433	8,589	自動車
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	46	44		7,946	157,624	飲料
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	1,265	1,265		651	12,922	銀行
CITIC SECURITIES CO LTD	466	565		1,179	23,401	資本市場
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	325	162		371	7,365	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	383	383		237	4,702	運送インフラ
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	758	738		1,726	34,255	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DAQIN RAILWAY CO LTD	977	189		127	2,534	陸運・鉄道
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	1,097	784		262	5,209	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	—	1,223		738	14,652	建設・土木
HAITONG SECURITIES CO LTD	661	—		—	—	資本市場
HUAXIA BANK CO LTD	1,129	829		470	9,323	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	163	190		733	14,551	食品
BANK OF BEIJING CO LTD	879	879		408	8,107	銀行
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	—	407		143	2,849	無線通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	705	548		402	7,989	金属・鉱業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	140	97		387	7,684	建設資材
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	335	335		496	9,841	資本市場
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	78	78		49	988	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR CO LTD	165	141		362	7,182	自動車
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	451	451		871	17,283	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD	—	770		405	8,034	機械
JIANGSU HENGRI MEDICINE CO LTD	196.6	172.52		588	11,666	医薬品
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	—	189		656	13,016	金属・鉱業
HUATAI SECURITIES CO LTD	461	52		77	1,537	資本市場
CHINA RAILWAY GROUP LTD	—	1,111		748	14,853	建設・土木
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	120	—		—	—	保険
HAIER SMART HOME CO LTD	317	278		685	13,593	家庭用耐久財

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(中国)						
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	百株	百株	千オフショア・人民元		千円	機械
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	270	193	355		7,055	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	—	1,273	332		6,590	銀行
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	766	103	64		1,272	医薬品
GUANGHUI ENERGY CO LTD	79	79	373		7,410	石油・ガス・消耗燃料
GEMDALE CORP	—	72	62		1,239	不動産管理・開発
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	106	106	161		3,193	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	221	—	—		—	化学
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	103	124	1,049		20,821	電気設備
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	—	970	383		7,600	金属・鉱業
FOUNDER SECURITIES CO LTD	935	927	1,124		22,304	資本市場
SDC POWER HOLDINGS CO LTD	580	—	—		—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NARI TECHNOLOGY CO LTD	316	316	299		5,935	電気設備
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	243	136.2	388		7,707	エネルギー設備・サービス
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	298	298	129		2,565	専門小売
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	67	62	1,129		22,412	金属・鉱業
TSINGTAO BREWERY CO LTD	—	2,359	528		10,481	飲料
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	250	250	104		2,067	各種金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	951	261	149		2,961	金属・鉱業
AIR CHINA LTD	284	284	293		5,819	旅客航空輸送業
TBEA CO LTD	267	267	525		10,428	電気設備
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	314	—	—		—	建設・土木
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	—	457	170		3,390	建設・土木
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	843	843	652		12,942	建設・土木
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	—	69	120		2,393	機械
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	33	33	173		3,450	運送インフラ
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	69	69	204		4,058	医薬品
JIANGXI COPPER CO LTD	—	172	348		6,908	金属・鉱業
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	343	343	149		2,959	資本市場
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	83	83	166		3,309	自動車部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD	148	148	136		2,697	資本市場
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	48	48	51		1,028	化学
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	237	237	258		5,119	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	—	6	11		230	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AECC AVIATION POWER CO LTD	—	144	547		10,854	航空宇宙・防衛
BANK OF NANJING CO LTD	291	291	346		6,869	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	76	76	103		2,060	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	22	599.7	906		17,974	海運業
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	602	641	353		7,018	金属・鉱業
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	327	—	—		—	金属・鉱業
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	282	282	214		4,262	資本市場
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	95.2	229.2	497		9,865	金属・鉱業
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	76	76	254		5,048	電気設備
BBMG CORP	542	542	161		3,203	建設資材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	294	294	130		2,583	食品・生活必需品小売
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	186	—	—		—	石油・ガス・消耗燃料
YUTONG BUS CO LTD	125	—	—		—	機械
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	386	386	186		3,698	旅客航空輸送業
LIAONING CHENG DA CO LTD	16	—	—		—	販売
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	150.19	150.19	188		3,744	電気設備
SHANXI LUAN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	77	77	137		2,734	石油・ガス・消耗燃料
HUNDSEN TECHNOLOGIES INC	56.4	78.96	302		5,998	ソフトウェア
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	162.5	162.5	337		6,701	ソフトウェア
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	—	33	57		1,133	金属・鉱業
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	327	327	223		4,443	旅客航空輸送業
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	590	590	194		3,862	建設・土木
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	126	109	382		7,584	自動車部品

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
				外 貨 建 金 額		
(中国)				千オフショア・人民元	千円	
XIAMEN C & D INC	百株	189	189	267	5,301	商社・流通業
YOUNGOR GROUP CO LTD		256	256	175	3,473	不動産管理・開発
AVIC HELICOPTER CO LTD		46	46	209	4,156	航空宇宙・防衛
SOOCHOW SECURITIES CO LTD		168	168	124	2,479	資本市場
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD		147	—	—	—	医薬品
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD		394	394	194	3,853	化学
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD		196	196	157	3,125	電気設備
ZHANGZHOU PIENTZHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD		18	17	533	10,578	医薬品
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD		90	—	—	—	医薬品
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD		266	—	—	—	金属・鉱業
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD		27	48.8	1,296	25,719	飲料
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD		12	12	16	336	通信機器
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD		263	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD		250	250	252	5,003	専門小売り
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD		259	—	—	—	航空宇宙・防衛
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD		31	—	—	—	ソフトウェア
ZHEJIANG JUJUHA CO LTD		226	226	274	5,446	化学
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD		262	262	98	1,959	金属・鉱業
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD		54	54	114	2,269	バイオテクノロジー
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD		129	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD		126	126	182	3,621	電気設備
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD		300	300	223	4,433	石油・ガス・消耗燃料
JONEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD		42	42	119	2,365	食品
INNER MONGOLIA FIRST MACHINERY GROUP CO LTD		199	—	—	—	機械
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LTD		64	—	—	—	バイオテクノロジー
SICHUAN ROAD & BRIDGE CO LTD		—	56	56	1,114	建設・土木
ZHEJIANG HUAIHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	58.3	58.3	99	99	1,980	医薬品
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD		119	—	—	—	運送インフラ
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD		118	118	131	2,609	医薬品
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD		45	45	73	1,454	電子装置・機器・部品
TONGWEI CO LTD		103	210	829	16,449	食品
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD		11	78.3	370	7,344	ソフトウェア
JCET GROUP CO LTD		—	109	258	5,135	半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD		—	68	276	5,476	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO LTD		25	25	310	6,164	飲料
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD		53	53	286	5,687	ホテル・レストラン・レジャー
HUAXIN CEMENT CO LTD		56	56	116	2,301	建設資材
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD		93	120.9	404	8,017	化学
XIAMEN FARATRONIC CO LTD		—	1	15	310	電子装置・機器・部品
CHINA JUSHI CO LTD		234	267.46	428	8,504	建設資材
NINGBO SHANSHAN CO LTD		—	29	70	1,389	化学
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD		22.24	73.24	356	7,073	機械
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD		—	196	226	4,502	建設関連製品
HENGTON OPTIC-ELECTRIC CO LTD		40	308	344	6,836	通信機器
TONGKUN GROUP CO LTD		157	157	259	5,157	化学
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD		17	17	202	4,007	化学
ANGEL YEAST CO LTD		49	49	197	3,923	食品
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD		—	12	58	1,156	半導体・半導体製造装置
TRINA SOLAR CO LTD		—	59	284	5,640	半導体・半導体製造装置
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD		—	1,215	684	13,568	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LONGJI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD		128	172.2	1,143	22,680	半導体・半導体製造装置
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD		18	18	228	4,536	自動車部品
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD		68	—	—	—	医薬品
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	323.51	246.51	432	8,581	石油・ガス・消耗燃料	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	102.8	129.24	1,167	23,164	食品	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	50	50	219	4,350	飲料	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	12	12	15	298	自動車部品	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
				外貨建金額		
(中国)						
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	百株	百株	千オフショア・人民元	千円		
	58	58	255	5,062		電気設備
DONGXING SECURITIES CO LTD	132	132	125	2,482		資本市場
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	—	20	100	1,989		自動車部品
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	506	6	9	188		資本市場
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	597	597	454	9,023		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	34	34	190	3,777		飲料
SKSHU PAINT CO LTD	—	38	316	6,283		化学
HUANSECURITIES CO LTD	165	—	—	—		資本市場
BANK OF JIANGSU CO LTD	1,173	334	252	5,002		銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD	236	236	361	7,162		銀行
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	90	114	230	4,572		自動車部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	11	14.3	66	1,310		ヘルスケア機器・用品
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	20	20	42	847		医薬品
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	—	96	160	3,176		航空貨物・物流サービス
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	12	12	80	1,591		半導体・半導体製造装置
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	15	15	94	1,865		家庭用耐久財
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	392	392	401	7,970		資本市場
SDIC CAPITAL CO LTD	433	0.16	0.1128	2		資本市場
TOPCHOICE MEDICAL CORP	8	8	119	2,376		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	48	47	460	9,129		半導体・半導体製造装置
TOLY BREAD CO LTD	36	50.4	111	2,202		食品
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	22	28.6	103	2,058		食品・生活必需品小売
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	29.4	29.4	118	2,344		機械
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	—	87	215	4,266		商業サービス・用品
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	194	194	211	4,186		資本市場
SPRING AIRLINES CO LTD	42	—	—	—		旅客航空輸送業
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	160	160	204	4,059		資本市場
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	63	60	290	5,759		商業サービス・用品
GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	292	306.6	165	3,290		不動産管理・開発
FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	107	107	327	6,496		不動産管理・開発
小計	株数・金額	76,994.14	82,390.45	135,213	2,682,111	
	銘柄数	358銘柄	388銘柄	—	<4.3%>	
(マレーシア)						
AMMB HOLDINGS BHD	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円		
GENTING PLANTATIONS BHD	814	803	293	8,786		銀行
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	141	—	—	—		食品
DIGI.COM BHD	3,589	3,731	1,899	56,774		銀行
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	2,353	1,940	592	17,725		無線通信サービス
RHB BANK BHD	897.2	479.2	328	9,827		運送インフラ
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	834.8	1,408.8	835	24,975		銀行
TOP GLOVE CORP BHD	317	317	237	7,088		コングロマリット
GAMUDA BHD	2,627	3,823	684	20,458		ヘルスケア機器・用品
GENTING BHD	1,002	—	—	—		建設・土木
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	1,072	1,049	482	14,425		ホテル・レストラン・レジャー
HONG LEONG BANK BHD	252.56	202.56	391	11,711		銀行
IOI CORP BHD	349.08	339.08	701	20,963		銀行
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	1,908.13	1,908.13	822	24,586		食品
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	226	221	601	17,970		食品
MALAYAN BANKING BHD	116	116	272	8,142		飲料
MISC BHD	2,543.75	2,859.75	2,513	75,149		銀行
NESTLE MALAYSIA BHD	1,008.8	1,008.8	770	23,041		海運業
PPB GROUP BHD	41	41	547	16,375		食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	462.6	462.6	792	23,704		食品
PETRONAS GAS BHD	223	223	474	14,186		石油・ガス・消耗燃料
GENTING MALAYSIA BHD	396	554	932	27,890		ガス
TELEKOM MALAYSIA BHD	2,198	2,198	652	19,516		ホテル・レストラン・レジャー
TENAGA NASIONAL BHD	595	595	299	8,965		各種電気通信サービス
		1,396.5	1,463.5	1,309	39,158	電力

銘柄	期首(前期末)	当期期末				業種等
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額	
		外貨建金額				
(マレーシア)						
QL RESOURCES BHD	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円		食品
DIALOG GROUP BHD	509.5	254.5	126	3,781		エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	2,339.44	1,837.44	477	14,282		銀行
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	8,914.5	8,512.5	3,975	118,845		ヘルスケア機器・用品
SUPERMAX CORP BHD	828	—	—	—		ヘルスケア機器・用品
SIME DARBY BERHAD	745.71	—	—	—		コングロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,395	2,348	565	16,916		ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD	1,072	1,058	488	14,612		無線通信サービス
MAXIS BHD	1,701	1,345	485	14,515		無線通信サービス
INARI AMERTRON BHD	1,308	1,052	407	12,171		電子装置・機器・部品
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,362	1,350	1,393	41,650		化学
IHH HEALTHCARE BHD	1,687	1,266	810	24,222		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	357	176	70	2,104		運送インフラ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	788	1,825	1,189	35,572		金属・鉱業
SIME DARBY PLANTATION BHD	934	1,064	539	16,127		食品
小計	株数	金額				
	49,304.57	48,744.86	27,348	817,609		
	銘柄数	比率				
	38銘柄	35銘柄	—	<1.3%>		
(南アフリカ)						
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円		
BIDVEST GROUP LTD	71.63	71.63	1,917	16,527		金属・鉱業
CLICKS GROUP LTD	162	160.66	3,425	29,524		コングロマリット
DISCOVERY LTD	155.31	134.09	4,011	34,582		食品・生活必需品小売
GOLD FIELDS LTD	211.37	249.05	4,227	36,439		保険
REMGRO LTD	557.34	515.31	11,483	98,989		金属・鉱業
NORTHAM PLATINUM LTD	260	283.02	4,094	35,291		各種金融サービス
HARMONY GOLD MINING CO LTD	236.02	—	—	—		金属・鉱業
EXXARO RESOURCES LTD	285.37	363.08	2,504	21,589		石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	141.15	154.24	3,612	31,136		銀行
MTN GROUP LTD	38.02	47.36	10,182	87,772		無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	1,063.52	992.79	17,383	149,847		金属・鉱業
FIRSTRAND LTD	265.08	241.13	8,283	71,399		各種金融サービス
NASPERS LTD	3,039.68	2,949.79	20,613	177,685		インターネット販売・通信販売
NEDBANK GROUP LTD	265.6	126.73	19,303	166,394		銀行
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	234.74	268.1	5,903	50,884		金属・鉱業
SASOL LTD	29.67	31.16	6,169	53,182		化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD	312.58	330.95	12,202	105,182		食品・生活必需品小売
MR PRICE GROUP LTD	325.94	294.74	6,870	59,227		専門小売
STANDARD BANK GROUP LTD	182.1	142.2	3,119	26,893		銀行
SPAR GROUP LTD/THE	842.71	794.67	13,238	114,115		食品・生活必需品小売
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	94.14	95.11	1,563	13,479		複合小売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	542.19	560.8	3,293	28,390		医薬品
ABSA GROUP LTD	241.12	217.55	3,917	33,768		銀行
TIGER BRANDS LTD	391.86	420.97	7,475	64,439		食品
SANLAM LTD	118.03	129.81	1,906	16,430		保険
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	1,195.61	1,091.85	7,491	64,573		金属・鉱業
KUMBA IRON ORE LTD	489.66	475.83	10,307	88,854		金属・鉱業
RMI HOLDINGS	31.73	44.97	2,923	25,199		金属・鉱業
VODACOM GROUP PTY LTD	358.36	393.52	1,879	16,197		保険
NEPI ROCKCASTLE PLC	432.18	367.03	5,429	46,802		無線通信サービス
OLD MUTUAL LTD	221.85	333.57	3,194	27,537		不動産管理・開発
REINET INVESTMENTS SCA	2,929.73	2,992.44	3,659	31,547		保険
PEPKOR HOLDINGS LTD	77.43	64.7	2,140	18,451		資本市場
MULTICHOICE GROUP LTD	272.58	1,003.74	2,231	19,233		専門小売
SIBANYE STILLWATER LTD	1,755.33	1,547.9	3,471	29,923		メディア
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	—	287.27	9,394	80,978		金属・鉱業
			5,588	48,175		金属・鉱業

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
			株数	株数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)						
BID CORP LTD		百株 180.86	百株 192.56	千円 6,065	千円 52,280	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	18,012.49 36銘柄	18,641.04 37銘柄	240,479	2,072,930 <3.3%>	
(タイ)						
BANGKOK BANK PCL		百株 277	百株 —	千円 —	千円 —	銀行
BERLI JUCKER PCL NVDR		1,011	1,037	3,681	13,841	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK PCL NVDR		1,036	1,538	2,045	7,691	銀行
RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR		342	27	119	449	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR		432	470	4,864	18,290	銀行
TRUE CORP PCL NVDR		5,093.55	6,857.55	3,373	12,685	各種電気通信サービス
KASIKORN BANK PCL NVDR		267	—	—	—	銀行
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR		124	184	3,109	11,692	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHIN CORP PCL		1,366	570	4,189	15,752	無線通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL		2,497	2,008	4,718	17,742	食品
ADVANCED INFO SERVICE PCL		664	696	15,520	58,358	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR		4,308.2	3,124.2	5,092	19,147	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR		208	210	7,392	27,793	電子装置・機器・部品
PTT PCL		7,056	5,815	21,515	80,898	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR		1,471	1,665	2,780	10,454	食品
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR		656	677	3,994	15,018	消費者金融
LAND AND HOUSES PCL NVDR		6,511	4,641	4,362	16,403	不動産管理・開発
SIAM CEMENT PCL NVDR		489.5	451.5	16,389	61,624	建設資材
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR		2,345	2,511	17,074	64,201	運送インフラ
KASIKORN BANK PCL - FOREIGN		686	—	—	—	銀行
CENTRAL PATTANA PCL NVDR		1,328	1,455	8,984	33,782	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR		5,106	5,386	13,868	52,147	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BUMRUNG RAD HOSPITAL PCL-NVDR		415	225	3,645	13,705	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		1,695.1	1,642.1	5,665	21,301	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL NVDR		858	831	4,300	16,169	石油・ガス・消耗燃料
CP ALL PCL NVDR		3,704	3,422	23,098	86,850	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL		3,561	4,271	3,886	14,613	陸運・鉄道
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR		706.45	770.45	11,055	41,570	石油・ガス・消耗燃料
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL		292	—	—	—	無線通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL NVDR		1,234.22	1,313.22	5,942	22,343	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		1,452.08	1,175.08	5,787	21,760	化学
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR		760	807	7,263	27,308	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR		6,136	3,021	2,537	9,541	運送インフラ
B GRIMM POWER PCL NVDR		566	566	1,853	6,969	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR		2,077	1,969	9,697	36,461	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
OSOTSPA PCL NVDR		237	386	1,331	5,007	飲料
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR		1,053	1,053	2,095	7,878	資本市場
ASSET WORLD CORP PCL NVDR		3,536	3,536	1,732	6,514	ホテル・レストラン・レジャー
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR		919.33	1,120.33	4,509	16,955	複合小売り
SCG PACKAGING PCL NVDR		—	904	5,107	19,204	容器・包装
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR		568	236	1,250	4,703	消費者金融
SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR		906	419	1,047	3,938	ヘルスケア機器・用品
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR		1,966	1,966	4,915	18,480	専門小売り
CARABAO GROUP PCL NVDR		—	262	2,633	9,900	飲料
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR		611	611	3,055	11,486	消費者金融
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR		491	491	3,412	12,830	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	77,018.43 44銘柄	70,320.43 42銘柄	258,902 —	973,472 <1.5%>	
(ポーランド)						
MBANK		百株 —	百株 6.34	千ポーランド・ズロチ 218	千円 6,457	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA		97.85	79.89	1,365	40,283	金属・鉱業
BANK PEKAO SA		97.3	98.56	1,079	31,842	銀行
ORANGE POLSKA SA		307.83	589.32	456	13,461	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				業種等
		株 数	株 数	評 価 額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		百株	千ポーランド・ズロチ	千円		
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	164.47	166.5	1,349	39,831		石油・ガス・消耗燃料
LPP SA	0.67	0.61	676	19,959		繊維・アパレル・贅沢品
SANTANDER BANK POLSKA SA	16	19.52	561	16,552		銀行
CD PROJEKT RED SA	42.92	46.78	781	23,050		娯楽
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOŚCI BANK POLSKI SA	578.12	489.95	1,862	54,961		銀行
POLSKIE GORNICSTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	885.35	1,293.98	864	25,518		石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA	122.39	200	546	16,121		メディア
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	521.92	521.92	486	14,352		電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	363.09	332.7	1,110	32,776		保険
DINO POLSKA SA	34.34	26.31	888	26,222		食品・生活必需品小売り
ALLEGRO.EU SA	228.95	276.48	771	22,759		インターネット販売・通信販売
小計	株数 銘柄数 数<比率>	3,461.2 14銘柄	4,148.86 15銘柄	13,019 —	384,153 <0.6%>	
(ハンガリー)		百株	千ハンガリー・フォリント	千円		
RICHTER GEDEON NYRT	83.93	82.72	58,731	21,356		医薬品
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	307.03	283.77	85,131	30,956		石油・ガス・消耗燃料
OTP BANK NYRT	137.82	124.13	132,819	48,297		銀行
小計	株数 銘柄数 数<比率>	528.78 3銘柄	490.62 3銘柄	276,681 —	100,609 <0.2%>	
(ユーロ…ギリシャ)		百株	千ユーロ	千円		
ALPHA BANK A.E.	—	1,036.65	112	15,327		銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	131.62	113.34	204	27,966		各種電気通信サービス
FF GROUP	31.3	31.3	0	0		繊維・アパレル・贅沢品
EUROBANK ERGASIAS SERVICES	—	1,819.4	185	25,408		銀行
OPAP SA	112.46	155.54	223	30,529		ホテル・レストラン・レジャー
JUMBO SA	81.43	45.83	68	9,352		専門小売り
PUBLIC POWER CORP	—	160	132	18,186		電力
小計	株数 銘柄数 数<比率>	356.81 4銘柄	3,362.06 7銘柄	926 —	126,771 <0.2%>	
合計	株数 銘柄数 数<比率>	1,493,200.07 1,264銘柄	1,522,645.11 1,291銘柄	— —	52,841,334 <84.0%>	

(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各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(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。

(注4) 銘柄コード等の変更があった銘柄や普通株と優先株は、別銘柄として掲載しております。

## (2) 外国新株予約権証券

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		証券数	証券数	評価額	邦貨換算金額	
(タイ)		証券	証券	千タイ・バーツ	千円	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465	—	—	—	—	
合計	証券数 銘柄数 数<比率>	9,465 1銘柄	— —銘柄	—	—	<-%>

(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各国別評価額の比率です。

(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。

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)	千口	千口	千メキシコ・ペソ	千円	
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D	121.8	114.1	17,846	113,247	
GRUPO TELEVISA SAB	141.9	120.8	5,281	33,514	
CEMEX SAB DE CV	948.675	854.975	8,096	51,378	
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	28	25	1,492	9,470	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	173.9	168	3,860	24,498	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	41.5	28.3	3,124	19,829	
小計	口数 銘柄	金額 数<比率>	1,455.775 6銘柄<0.5%>	1,311.175 6銘柄<0.4%>	39,702 —
(ブラジル)	千口	千口	千ブラジル・レアル	千円	
SUL AMERICA SA	15.356	—	—	—	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	21.7	32.3	1,127	30,369	
ENERGISA SA	17.5	8.1	383	10,343	
KLABIN SA	48.7	50.5	1,150	31,006	
BANCO INTER SA	6.7	23.7	391	10,554	
BANCO BTG PACTUAL SA	12.8	67.5	1,694	45,644	
小計	口数 銘柄	金額 数<比率>	122.756 6銘柄<0.2%>	182.1 5銘柄<0.2%>	4,748 —
(南アフリカ)	千口	千口	千南アフリカ・ランド	千円	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	259.878	190.305	2,679	23,097	
小計	口数 銘柄	金額 数<比率>	259.878 1銘柄<0.0%>	190.305 1銘柄<0.0%>	2,679 —
合計	口数 銘柄	金額 数<比率>	1,838.409 13銘柄<0.7%>	1,683.58 12銘柄<0.6%>	402,955 —

(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) 比率は、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。

(4) 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
外国 MINI MSCI EMG MKT	百万円 9,569		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

2022年4月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 52,841,334	% 83.8
投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券	402,955	0.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,834,830	15.6
投 資 信 託 財 产 總 額	63,079,120	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、62,754,884千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=126.68円、1香港・ドル=16.15円、1台湾・ドル=4.348円、1イギリス・ポンド=165.23円、1トルコ・リラ=8.664円、1メキシコ・ペソ=6,345円、1フィリピン・ペソ=2,427円、100チリ・ペソ=15.545円、100コロンビア・ペソ=3,384円、1クウェート・ディナール=415.75円、1カタール・リアル=34.77円、1サウジアラビア・リアル=33.84円、1インド・ルピー=1.67円、100インドネシア・ルピア=0.89円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=34.55円、1ブラジル・レアル=26.94円、1チェコ・コルナ=5.596円、100韓国・ウォン=10.29円、1オフショア・人民元=19.836円、1マレーシア・リンギット=29.895円、1南アフリカ・ランド=8.62円、1タイ・バーツ=3.76円、1ポーランド・ズロチ=29.505円、100ハンガリー・フォリント=36.363円、1ユーロ=136.78円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月18日)現在

項	目	当期末
(A) 資	産	63,109,573,624円
コ 一 ル ル · 口 一 ナ 等	式(評価額)	7,055,858,395
株		52,841,334,882
投 資 信 託 受 益 証	券(評価額)	355,359,551
投 資 証	券(評価額)	47,595,705
未 収 入 金		37,933,568
未 収 配 当 金		167,890,388
差 入 委 託 証 抱 金		2,603,601,135
(B) 負 債		221,356,632
未 払 金		217,825,632
未 解 約 金		3,531,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)		62,888,216,992
元 本		43,349,645,868
次 期 繰 越 損 益 金		19,538,571,124
(D) 受 益 権 総 口 数		43,349,645,868口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)		14,507円

(注1) 期首元本額 39,168,921,759円  
 追加設定元本額 57,766,963,374円  
 一部解約元本額 53,586,239,265円

(注2) 期末における元本の内訳

D IAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>  
 8,165,233,734円  
 D IAM新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)  
 316,451,891円  
 MITO ラップ型ファンド (安定型) 5,065,871円  
 MITO ラップ型ファンド (中立型) 19,255,020円  
 MITO ラップ型ファンド (積極型) 104,695,576円  
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 26,026,610円  
 グローバル8資産ラップファンド (中立型) 14,309,083円  
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 14,356,432円  
 たわらノーロード 新興国株式 9,234,570,518円  
 たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け> 2,873,148,312円  
 たわらノーロード バランス (8資産均等型) 2,578,644,415円  
 たわらノーロード バランス (堅実型) 23,686,677円  
 たわらノーロード バランス (標準型) 88,594,794円  
 たわらノーロード バランス (積極型) 150,290,585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) 93,091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) 127,975,656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) 212,043,143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) 185,865,372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) 263,319,015円  
 たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 538,209円  
 たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 18,070,875円  
 たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 1,905,741円  
 たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 6,342,806円  
 たわらノーロード 全世界株式 150,472,510円

One DC 新興国株式インデックスファンド 390,365,407円  
 マネックス資産設計ファンド エボリューション 385,912,567円  
 D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 345,994,625円  
 D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 463,152,779円  
 D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 940,074,201円  
 投資のソムリエ 8,414,976,041円  
 クルーズコントロール 371,495,340円  
 投資のソムリエ<DC年金> 512,003,596円  
 D IAM 8資産バランスファンド<DC年金> 377,344,929円  
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 512,932,398円  
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 2,856,021,516円  
 ワールドアセットバランス (基本コース) 755,160,967円  
 ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 832,729,130円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 17,362,940円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 8,593,766円  
 リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 3,509,820円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 60,654,292円  
 リスクコントロール世界8資産分散ファンド 512,298,207円  
 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 334,081,535円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 14,127,616円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 7,563,166円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 5,875,009円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) 682,711円  
 エマージング株式パッシブファンドVA (適格機関投資家専用) 12,616,953円  
 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 213,862,757円  
 リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) 7,828,376円  
 しあわせの一歩・私募 (適格機関投資家限定) 40,668,920円  
 D IAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 248,047,269円  
 D IAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 122,753,099円  
 期末元本合計 43,349,645,868円

## ■損益の状況

当期 自2021年4月20日 至2022年4月18日

項	目	当 期
(A) 配 当 等 収 益		1,478,930,564円
受 取 配 当 金		1,474,434,394
受 取 利 息		930,536
そ の 他 収 益 金		3,662,561
支 払 利 息		△96,927
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		△4,450,256,246
売 買 益 益		16,463,925,031
売 買 損 損		△20,914,181,277
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益		△592,117,607
取 引 益 益		1,566,330,273
取 引 損 損		△2,158,447,880
(D) そ の 他 費 用		△354,426,674
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)		△3,917,869,963
(F) 前 期 繰 越 損 益 金		18,987,564,725
(G) 解 約 差 損 益 金		△21,955,890,564
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金		26,424,766,926
(I) 合 計(E + F + G + H)		19,538,571,124
次 期 繰 越 損 益 金(I)		19,538,571,124

(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。