

運用報告書 (全体版)

第6期<決算日2022年10月12日>

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	2017年7月28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	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	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) 銘柄を主要投資対象とします。
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の株式を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	イマージング株式パッシブ・マザーファンド	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。
	イマージング債券パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	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。
運用方法	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券 [※] を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場 (これに準ずるものを含みます。) されている不動産投資信託証券とします。
	各マザーファンド受益証券へ均等に投資することを通じて、各資産クラスの代表的な指数に連動する投資成果をめざして運用を行います。各マザーファンド受益証券の配分比率は、均等とすることを目標とします。時価変動等により、配分比率が均等比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。マザーファンド受益証券以外の投資信託証券 (上場投資信託証券を除きます。) への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。決算日 (原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。) に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益 (マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額 (以下「みなし配当等収益」といいます。) を含みます。) および売買益 (評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額) 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。	
組入制限		
分配方針		

たわらノーロード バランス (8資産均等型)

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、「たわらノーロード バランス (8資産均等型)」は、2022年10月12日に第6期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

たわらノーロード バランス (8資産均等型)

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			株式組 入率	株式先 物率	債券組 入率	新株予約 権証券 比率	債券先 物率	投資信託 受託証券 比率	純資産 総額
	円	円	%							
2期 (2018年10月12日)	10,184	0	△1.0	34.5	1.6	34.6	—	—	22.2	百万円 1,235
3期 (2019年10月15日)	11,136	0	9.3	35.4	2.3	35.4	—	—	24.8	4,942
4期 (2020年10月12日)	11,224	0	0.8	34.9	2.3	35.9	—	—	24.7	11,727
5期 (2021年10月12日)	13,254	0	18.1	35.1	2.3	35.6	—	—	24.5	23,472
6期 (2022年10月12日)	12,874	0	△2.9	34.9	2.0	36.4	—	—	24.6	34,559

(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、不動産投信指数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数が存在しないため、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 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 率
	円	騰 落 率						
(期 首) 2021 年 10 月 12 日	13,254	% -	% 35.1	% 2.3	% 35.6	% -	% -	% 24.5
10 月 末	13,579	2.5	34.8	2.1	36.0	-	-	25.0
11 月 末	13,323	0.5	32.9	1.7	35.8	-	-	22.5
12 月 末	13,676	3.2	34.8	2.6	35.6	-	-	25.1
2022 年 1 月 末	13,133	△0.9	34.9	1.7	36.2	-	-	24.7
2 月 末	12,904	△2.6	35.0	1.9	36.5	-	-	25.3
3 月 末	13,546	2.2	35.2	2.2	35.1	-	-	25.4
4 月 末	13,354	0.8	33.6	2.9	35.0	-	-	23.0
5 月 末	13,267	0.1	35.4	2.5	34.2	-	-	25.0
6 月 末	13,188	△0.5	35.4	1.9	37.4	-	-	25.5
7 月 末	13,477	1.7	35.2	2.1	36.1	-	-	25.3
8 月 末	13,538	2.1	35.0	2.2	36.3	-	-	24.8
9 月 末	12,882	△2.8	34.8	1.9	36.1	-	-	24.5
(期 末) 2022 年 10 月 12 日	12,874	△2.9	34.9	2.0	36.4	-	-	24.6

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「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。

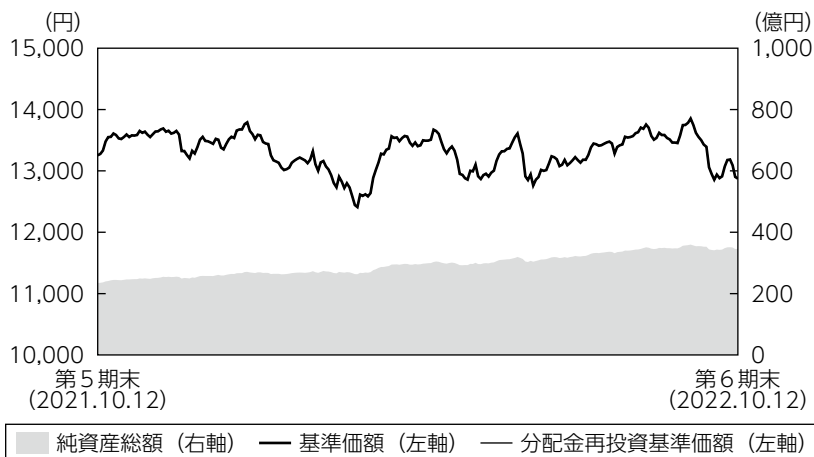
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注5) 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10月13日から2022年10月12日まで）

基準価額等の推移



第6期首：13,254円
 第6期末：12,874円
 (既払分配金0円)
 騰落率：△2.9%
 (分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

高インフレへの懸念や、インフレ抑制を目的とした主要国の金融引き締め加速観測等から国内外の長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと、また主要国の金利上昇や金融引き締めに対する懸念から国内外の株式市場やリート市場が下落したことがマイナスに寄与しました。一方、国内外の金融政策の方向性の違いが意識されたことや内外金利差の拡大等を背景に主要通貨に対して円安が進んだことがプラスに寄与しました。

◆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
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	△3.2%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△3.6%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.3%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.5%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	△10.0%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	△8.6%
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	△2.2%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△1.1%

投資環境

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、日本を除く主要国の金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアの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、円安米ドル高の進行、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、一進一退の展開となりました。

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2021年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、もみ合いとなりました。2022年に入ると米中央銀行が利上げに着手するとの観測から利回りは上昇し、期末にかけても欧米の好調な経済指標がインフレ加速を意識させ、利回りは一段と上昇しました。

先進国株式市場は下落しました。期初、好調な企業業績を背景に上昇した後、F R B（米連邦準備理事会）の資産買い入れ縮小加速への警戒感から不安定な展開となりました。2022年に入ると米国の金融緩和策の急速な転換が懸念され下落しました。3月上旬にかけては、ロシアのウクライナ侵攻が嫌気され下落しました。その後は和平交渉の進展期待から反発しましたが、F R Bがインフレ抑制を目的に断続的な利上げを行ったことが嫌気され調整して期末を迎えました。

外国債券市場では、米国債およびドイツ国債の利回りはともに上昇しました。米国債は、堅調な米雇用統計や、F R Bが金融引き締めを積極的に続けるとの見方、米インフレ率の上振れなどを背景に利回りは上昇しました。ドイツ国債についてもロシアのウクライナ侵攻を受けたエネルギー価格の高騰や米国長期金利の上昇、E C B（欧州中央銀行）が大幅利上げを行ったことなどを受けて利回りは上昇しました。

新興国株式市場は下落しました。期初は、台湾企業の好決算などを受け堅調に推移しました。その後、米金融緩和縮小などから調整し、2022年2月下旬のロシアによるウクライナ侵攻を受け、米欧などが制裁を強化したことで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ましたが、その後は中国での新型コロナウイルスの感染拡大や米ドル高にともなう新興国からの資金流出懸念などにより不安定な展開となる中、期末を迎えました。

新興国債券市場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により、下落基調で推移しました。米中央銀行による金融引き締めや、それに伴う景気減速懸念も下落材料となりました。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。しかし景気減速懸念などから、期を通じては拡大しました。

国内リート市場は下落しました。期初は新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念などから上値の重い展開となりましたが、2022年1月には米国金利の上昇懸念からリスク回避的な動きが強まり大幅に下落しました。その後も政府によるまん延防止等重点措置の解除や新型コロナウイルスの水際対策の緩和、日銀の金融緩和姿勢維持などがプラス要因となる一方、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。

外国リート市場は下落しました。米国リート市場はインフレ圧力の高まりを背景としたF R Bの金融引き締め観測から下落しました。欧州リート市場はE C Bが大幅利上げを行ったことやロシア産ガス供給削減に伴う景気後退懸念などから下落しました。オーストラリアリート市場はR B A（オーストラリア準備銀行）が大幅利上げを行ったことや、世界的な金利上昇が同国の長期金利にも波及したことなどを背景に下落しました。

為替市場では主要通貨に対して円安の動きとなりました。ドル／円相場は、米国が金融政策の正常化を進める一方で日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示したことで日米の金融政策の方向性の違いが意識されたことや米国の金利が大きく上昇し内外金利差が拡大したこと等を材料に、円安米ドル高の動きとなりました。その他の主要通貨においても、金融政策の方向性の違いが意識されたことや内外金利差の拡大等を背景に円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

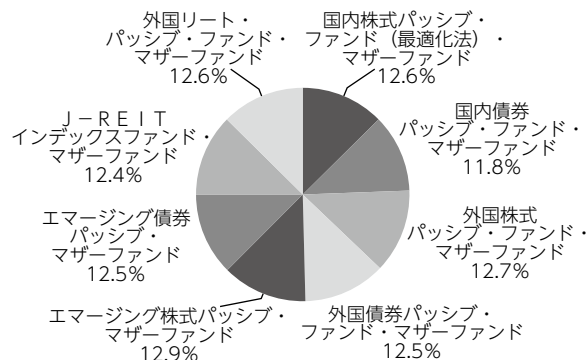
●当ファンド

マザーファンドを通じて国内外の株式、債券およびリートの8資産に投資を行いました。また、組入れる8資産の保有比率が均等となるように資産配分を行いました。

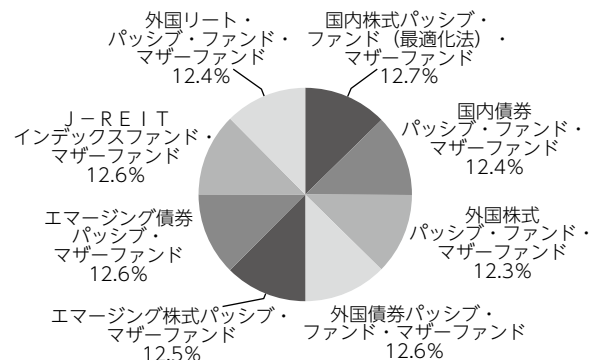
【運用状況】

○マザーファンド組入比率

期首（前期末）



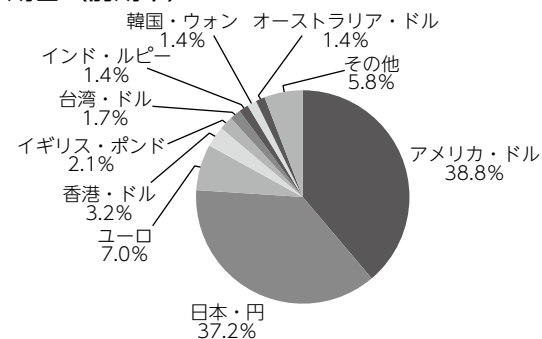
期末



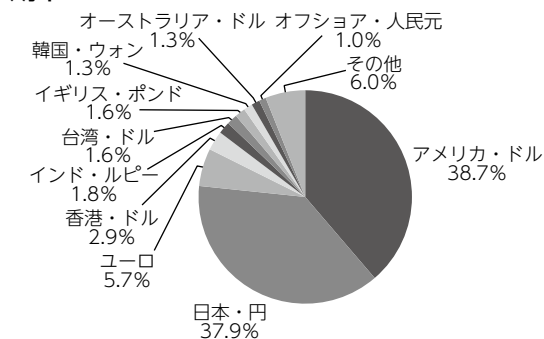
（注）組入比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

○通貨別構成比

期首（前期末）



期末



（注1）組入比率は当ファンドが実質的に投資している有価証券の評価額に対する割合です。

（注2）組入比率が1.0%未満の通貨については、合計してその他として表示しております。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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。

●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NOMUR A-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。

●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。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●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。

●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。

●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実質組入比率を高め、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。

分配金

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

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年10月13日 ～2022年10月12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	2,932円

（注1）「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、各資産の保有比率が均等になるように各マザーファンドへの投資を実施します。マザーファンドの組入比率につきましては、高位での組入れを維持します。

●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。

●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。

●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。

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。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。

●**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。

●**J－REITインデックスファンド・マザーファンド**

引き続き、リートの実質組入比率を高め、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	第6期		項目の概要
	(2021年10月13日 ～2022年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	20円	0.154%	(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13,311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)	(7)	(0.055)	
(販売会社)	(10)	(0.077)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	3	0.020	(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)	(2)	(0.012)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(1)	(0.004)	
(c) 有価証券取引税	5	0.036	(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)	(3)	(0.023)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(2)	(0.012)	
(d) その他費用	10	0.073	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(4)	(0.034)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(5)	(0.037)	
合計	38	0.284	

(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まず。

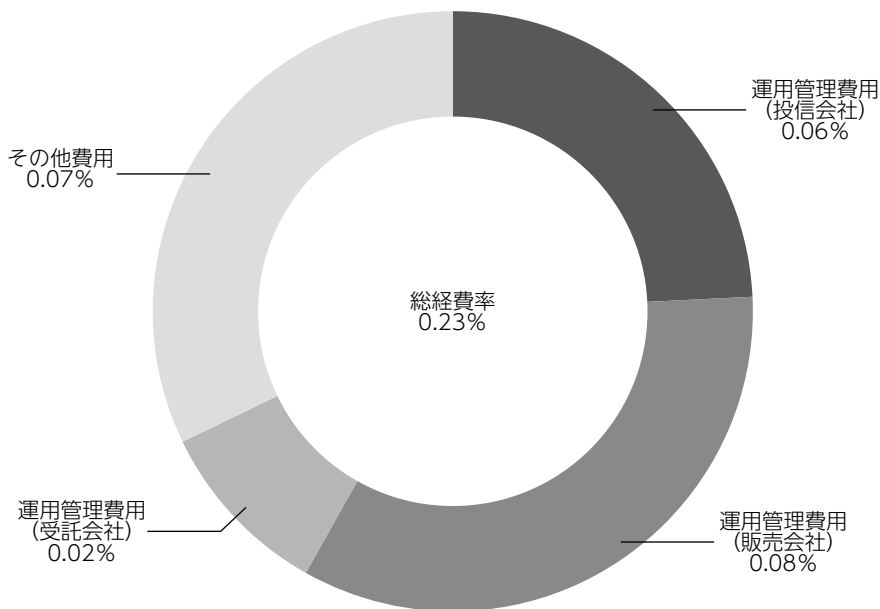
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.23%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年10月13日から2022年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	476,561	1,530,736	-	-
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,270,508	1,633,840	-	-
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	201,927	1,161,891	-	-
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	682,353	1,418,157	-	-
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	1,197,817	1,660,263	210	310
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	823,298	1,692,184	-	-
J-R E I T インデックス ファンド・マザーファンド	624,279	1,496,960	-	-
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	872,603	1,459,420	-	-

■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	1,067,234,936千円	659,420,093千円	141,219,730千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	396,936,901千円	676,923,834千円	65,943,383千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.68	0.97	2.14

(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10月13日から2022年10月12日まで）

【たわらノーロード バランス（8資産均等型）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 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.030	百万円 0.030	% 100.0	百万円 0.030	百万円 0.030	% 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)	5,978千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B)/(A)	0.0%

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

【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 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 520,125	百万円 306,276	% 58.9	百万円 547,108	百万円 282,996	% 51.7
金 銭 信 託	1	1	100.0	1	1	100.0

平均保有割合 0.9%

(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。

(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 3,858	百万円 4,265	百万円 2,760

(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 895

【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

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 1,281,650	百万円 113,428	% 8.9	百万円 1,005,786	百万円 119,738	% 11.9
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	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

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
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 0.5%

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

【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

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

平均保有割合 2.2%

(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。

【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

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	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 5.0%

(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。

【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

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
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 3.0%

(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-R E I T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

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 222,209	百万円 2,020	% 0.9	百万円 221,265	百万円 29,251	% 13.2
金 銭 信 託	0.406	0.406	100.0	0.406	0.406	100.0

平均保有割合 1.9%

(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。

(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
投 資 証 券		百万円 6,467

【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

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
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 5.1%

(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。

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	
	□ 数	□ 数	評価額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	884,832	1,361,394	4,320,520
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,091,119	3,361,628	4,229,265
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	525,147	727,075	4,192,099
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,398,637	2,080,990	4,304,113
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2,025,874	3,223,481	4,252,094
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,320,051	2,143,349	4,283,699
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	1,176,460	1,800,740	4,283,241
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,835,800	2,708,404	4,235,674

■投資信託財産の構成

2022年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	4,320,520	12.5
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,229,265	12.2
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,192,099	12.1
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,304,113	12.4
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4,252,094	12.3
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	4,283,699	12.4
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4,283,241	12.4
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,235,674	12.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	523,645	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	34,624,352	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、2022年10月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは717,597,772千円、99.6％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは176,741,904千円、98.1％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは86,973,491千円、98.5％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは88,623,580千円、96.0％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは50,553,108千円、99.4％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=146.20円、1カナダ・ドル=106.01円、1オーストラリア・ドル=91.57円、1香港・ドル=18.62円、1シンガポール・ドル=101.61円、1ニュージーランド・ドル=81.62円、1台湾・ドル=4.583円、1イギリス・ポンド=160.43円、1イスラエル・シェケル=40.79円、1スイス・フラン=146.60円、1トルコ・リラ=7.864円、1デンマーク・クローネ=19.07円、1ノルウェー・クローネ=13.57円、1スウェーデン・クローナ=12.87円、1メキシコ・ペソ=7.288円、1フィリピン・ペソ=2.482円、100チリ・ペソ=15.743円、100コロンビア・ペソ=3.171円、1クウェート・ディナール=470.70円、1カタール・リアル=39.78円、1サウジアラビア・リアル=38.97円、1インド・ルピー=1.79円、100インドネシア・ルピア=0.96円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=39.87円、1ブラジル・レアル=27.553円、1チェコ・コルナ=5.777円、100韓国・ウォン=10.21円、1オフショア・人民元=20.367円、1マレーシア・リンギット=31.268円、1南アフリカ・ランド=8.05円、1タイ・バーツ=3.82円、1ポーランド・ズロチ=29.231円、100ハンガリー・フォリント=33.03円、1ユーロ=141.84円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	34,624,352,173円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	523,645,094
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)	4,320,520,547
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	4,229,265,134
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	4,192,099,095
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	4,304,113,244
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	4,252,094,317
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	4,283,699,166
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)	4,283,241,236
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	4,235,674,340
(B) 負 債	64,629,492
未 払 解 約 金	39,050,936
未 払 信 託 報 酬	25,063,654
そ の 他 未 払 費 用	514,902
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	34,559,722,681
元 本	26,844,673,267
次 期 繰 越 損 益 金	7,715,049,414
(D) 受 益 権 総 口 数	26,844,673,267口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	12,874円

(注) 期首における元本額は17,710,639,357円、当期中における追加設定元本額は10,792,295,406円、同解約元本額は1,658,261,496円です。

■損益の状況

当期 自2021年10月13日 至2022年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△94,987円
受 取 利 息	5,455
支 払 利 息	△100,442
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,020,572,710
売 買 益	124,589,200
売 買 損	△1,145,161,910
(C) 信 託 報 酬 等	△46,308,543
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,066,976,240
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,703,027,364
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,078,998,290
(配 当 等 相 当 額)	(4,410,489,689)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,668,508,601)
(G) 合 計(D+E+F)	7,715,049,414
次 期 繰 越 損 益 金(G)	7,715,049,414
追 加 信 託 差 損 益 金	6,078,998,290
(配 当 等 相 当 額)	(4,424,872,335)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,654,125,955)
分 配 準 備 積 立 金	3,446,497,792
繰 越 損 益 金	△1,810,446,668

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	743,470,428円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	4,424,872,335
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,703,027,364
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	7,871,370,127
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	2,932.19
(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運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《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「外国株式パッシブ・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。

(2021年12月21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、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)

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 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落 中率			
16期 (2018年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2019年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
18期 (2020年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
19期 (2021年2月8日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
20期 (2022年2月7日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
	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（㈩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、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩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、㈩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）。

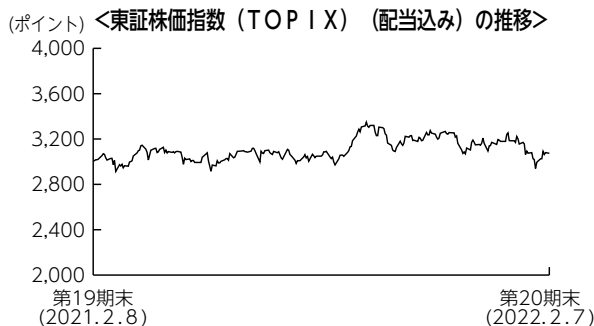
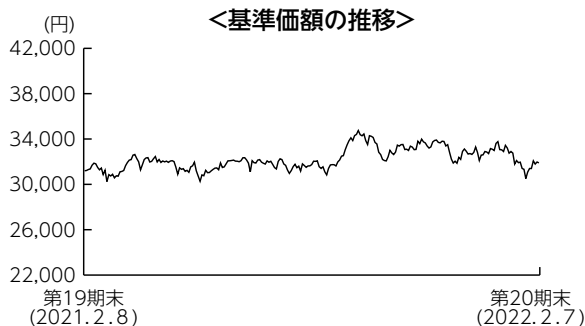
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2021年 2月 8日	円 31,202	% -	ポイント 3,006.47	% -	% 97.7	% 2.3
2 月 末	30,248	△3.1	2,914.58	△3.1	99.0	1.1
3 月 末	31,972	2.5	3,080.87	2.5	96.2	4.0
4 月 末	31,068	△0.4	2,993.46	△0.4	96.5	3.5
5 月 末	31,493	0.9	3,034.76	0.9	96.6	3.4
6 月 末	31,864	2.1	3,070.81	2.1	96.0	4.0
7 月 末	31,172	△0.1	3,003.91	△0.1	97.2	2.8
8 月 末	32,156	3.1	3,099.08	3.1	97.1	2.9
9 月 末	33,562	7.6	3,234.08	7.6	96.3	3.8
10 月 末	33,082	6.0	3,188.28	6.0	96.8	3.4
11 月 末	31,886	2.2	3,073.26	2.2	84.8	1.0
12 月 末	32,994	5.7	3,179.28	5.7	97.1	3.4
2022年 1 月 末	31,401	0.6	3,025.69	0.6	95.8	4.2
(期 末) 2022年 2月 7日	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（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（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。

【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	千円	千株	千円
		192,672.8 (6,584.913)	479,219,336 (-)	161,731.513	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

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 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		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
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。

(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	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) 資産	399,670,143,174円
- 株	11,420,891,042
- 株未入式(評価額)	387,140,847,090
- 未収配当金	11,243,540
- 未収委託配当証	655,237,202
- 未払解約金	441,924,300
(B) 負債	2,333,527,720
- 未払解約金	909,720
(C) 純資産総額(A-B)	2,332,618,000
- 元次	397,336,615,454
- 繰越損益	124,570,625,521
(D) 受益権総額	272,765,989,933
- 1万口当たり基準価額(C/D)	124,570,625,521円
	31,896円

(注1) 期首元本額 102,105,610,506円
 追加設定元本額 163,179,331,486円
 一部解約元本額 140,714,316,471円

(注2) 期末における元本の内訳
 MHAMスリーウェイクオープン 561,857,238円
 MHAM TOP I Xオープン 2,725,686,605円
 MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ) 7,087,968,915円
 One DC 国内株式インデックスファンド 20,422,344,253円
 D I AM国内株式バッシブ・ファンド 4,704,569,337円
 M I T O ラップ型ファンド(安定型) 3,424,028円
 M I T O ラップ型ファンド(中立的) 23,972,661円
 M I T O ラップ型ファンド(積極型) 78,308,323円
 グローバル8資産ラップファンド(安定型) 28,249,023円
 グローバル8資産ラップファンド(中立的) 21,103,225円
 グローバル8資産ラップファンド(積極型) 15,896,115円
 たわらノーロード TOP I X 1,306,069,812円
 たわらノーロード バランス(8資産均等型) 1,033,861,326円
 たわらノーロード バランス(堅実型) 40,906,841円
 たわらノーロード バランス(標準型) 262,619,504円
 たわらノーロード バランス(積極型) 394,664,404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) 3,669,806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) 174,139,046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) 434,342,242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) 283,511,087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) 405,598,982円
 たわらノーロード 最適化バランス(保守型) 705,164円
 たわらノーロード 最適化バランス(安定型) 2,916,286円
 たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型) 36,588,931円
 たわらノーロード 最適化バランス(成長型) 6,020,593円
 たわらノーロード 最適化バランス(積極型) 19,092,798円
 D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金> 34,009,153,068円
 Oneグローバルバランス 5,199,858円
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 1,065,319,872円
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 3,512,005,009円
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 3,794,173,475円
 D I AM DC バランス30インデックスファンド 3,343,138,358円
 D I AM DC バランス50インデックスファンド 1,113,385,483円
 D I AM DC バランス70インデックスファンド 1,115,312,187円
 マネックス資産設計ファンド(隔月分配型) 30,317,366円
 マネックス資産設計ファンド(育成型) 1,055,563,450円
 マネックス資産設計ファンド エゴリユーション 18,529,124円
 D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国10) 304,544,955円
 D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国20) 306,459,778円
 D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国30) 545,764,310円
 投資のソムリエ 13,743,021,171円
 フルーズコントロール 128,837,057円
 投資のソムリエ<DC年金> 831,424,634円
 D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金> 337,759,108円
 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> 549,884,906円
 D I AMコア資産設計ファンド(堅実型) 1,701,235円
 D I AMコア資産設計ファンド(積極型) 5,513,567円
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 559,030,369円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 3,846,898,552円
 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045) 41,503,360円
 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055) 20,515,309円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC) 4,618,660円
 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035) 146,712,017円
 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> 348,653,940円
 リスクコントロール世界分散投資 2,393,008,159円
 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 279,145,423円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040) 42,977,458円
 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050) 17,916,384円
 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060) 15,092,602円
 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> 105,875,155円
 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2065) 985,477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) 22,944,960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) 23,431,080円
 マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定) 21,508,092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) 14,273,870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) 22,637,856円
 インカム重視マルチアセット運用ファンドI2021-04(適格機関投資家限定) 193,585,816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 41,677,610円
 マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型) 21-06 84,110,969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 68,984,011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 47,924,787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) 22,733,018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 49,987,822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 70,694,127円
 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定) 329,597,803円
 D I AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定) 34,825,039円
 日米興業戦略ファンド(インカム重視)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定) 116,640,502円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド(FOF5用)(適格機関投資家限定) 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 I AMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定) 57,045,218円
 D I AMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) 101,888,672円
 D I AM国際分散/ラップファンド30VA(適格機関投資家限定) 4,956,036円
 D I AM国際分散/ラップファンド50VA(適格機関投資家限定) 26,722,846円
 D I AM国内重視/ラップファンド30VA(適格機関投資家限定) 5,712,676円
 D I AM国内重視/ラップファンド50VA(適格機関投資家限定) 1,338,373円
 D I AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) 7,152,634円
 D I AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) 34,835,196円
 D I AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定) 557,427,217円
 D I AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定) 634,827,723円
 D I AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定) 1,809,585,772円
 D I AMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定) 31,302,862円
 D I AMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定) 31,388,733円
 D I AM アサahiグローバル/ラップファンド30VA(適格機関投資家限定) 301,727,248円
 D I AM世界アセット/ラップファンドVA(適格機関投資家限定) 74,733,048円
 D I AM世界/ラップファンド55VA(適格機関投資家限定) 1,406,645円
 D I AM世界アセット/ラップファンド2VA(適格機関投資家限定) 349,638,985円
 D I AM世界アセット/ラップファンド40VA(適格機関投資家限定) 20,826,409円
 D I AM世界アセット/ラップファンド25VA(適格機関投資家限定) 73,311,471円
 D I AM世界アセット/ラップファンド3VA(適格機関投資家限定) 173,199,524円
 D I AM世界アセット/ラップファンド4VA(適格機関投資家限定) 237,769,545円
 D I AM世界バランス25VA(適格機関投資家限定) 38,321,734円
 D I AM国内バランス30VA(適格機関投資家限定) 18,177,991円
 D I AM世界アセット/ラップファンド7VA(121)(適格機関投資家限定) 291,737,796円
 D I AM世界アセット/ラップファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定) 936,557,239円
 D I AM世界アセット/ラップファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定) 1,240,495,959円
 D I AM世界アセット/ラップファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定) 49,936,951円
 動的パッケージファンド<DC年金> 19,960,341円
 コア資産形成ファンド 13,478,680円
 MHAM TOP I XファンドVA(適格機関投資家専用) 692,612,483円
 MHAM TOP I XファンドVA(適格機関投資家専用) 65,067,902円
 MHAM動的パッケージファンド(適格機関投資家限定) 2,686,127,829円
 MHAM日本株式バッシブファンド(適格機関投資家限定) 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。

(注3)

■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)	配当等収益	7,296,744,510円	
	受取配当金	7,292,821,896	
	受取利息	44,549	
	その他の収益	6,677,036	
	支払利息	△2,798,971	
(B)	有価証券売買損益	△7,496,155,473	
	売却益	39,449,298,775	
	売却損	△46,945,454,248	
(C)	先物取引等取引損益	654,522,360	
	取引益	1,686,367,190	
	取引損	△1,031,844,830	
(D)	当期損益金(A+B+C)	455,111,397	
(E)	前期繰越損益金	216,481,029,551	
(F)	解約差損益金	△309,165,756,529	
(G)	追加信託差損益金	364,995,605,514	
(H)	合計(D+E+F+G)	272,765,989,933	
	次期繰越損益金(H)	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。

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 (ベンチマーク)		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 総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率				
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	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)。

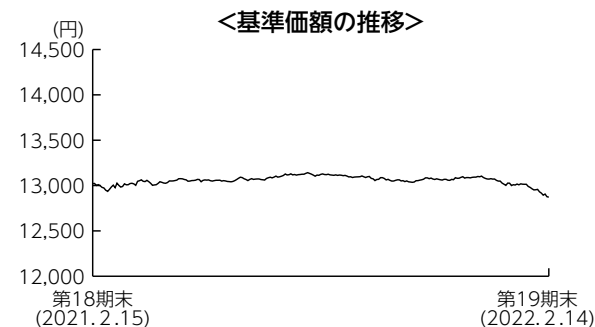
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月16日から2022年2月14日まで）

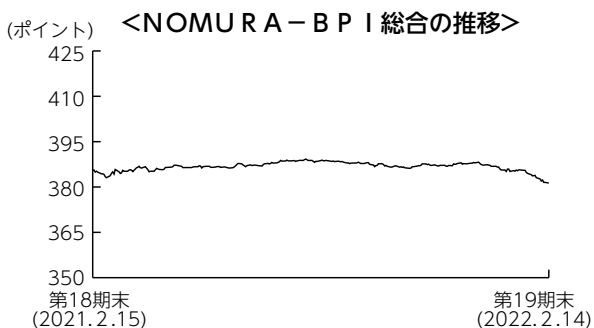


基準価額の推移

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

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。

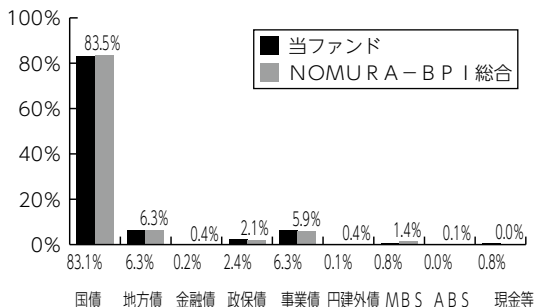
ポートフォリオについて

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。

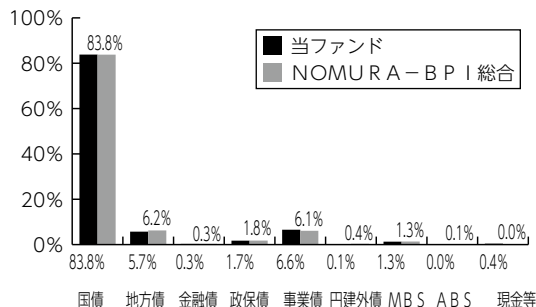
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

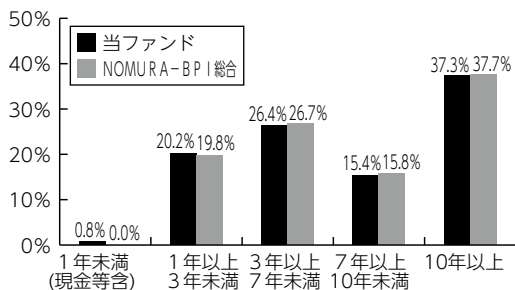


期末

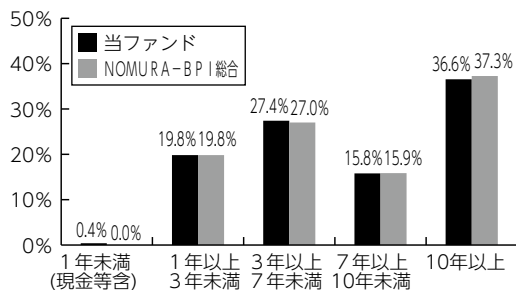


○残存年限別構成比

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		千円	千円
	国債証券	717,343,530	471,488,133 (-)
	地方債証券	18,975,569	4,218,721 (-)
	特殊債証券	14,592,716	2,073,694 (297,842)
	社債証券	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 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
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
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 B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	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 証 券	25,151,985	26,325,307	4.8	0.0	3.3	0.8	0.6
金 融 債 証 券	1,800,000	1,796,652	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 証 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 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	
4 2 3 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,000,000	3,002,670	2023/04/01
4 2 4 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,100,000	3,102,976	2023/05/01
4 2 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,060	2023/06/01
1 3 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,850,000	4,861,058	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	8,350,000	8,447,027	2023/06/20
4 2 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,100,000	2,102,163	2023/07/01
4 2 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,400,000	2,402,448	2023/08/01
4 2 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,500,000	2,502,500	2023/09/01
1 3 7 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,610,000	3,619,205	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	3,460,000	3,507,194	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,950,000	1,970,377	2023/09/20
6 4 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	30,000	30,936	2023/09/20
4 2 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,100	2023/10/01
4 3 0 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,040	2023/11/01
4 3 1 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	4,000,000	4,003,920	2023/12/01
1 3 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	5,000,000	5,013,800	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	3,880,000	3,926,172	2023/12/20
6 5 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	60,000	62,153	2023/12/20
4 3 2 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,400,000	3,403,162	2024/01/01
1 3 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,750,000	3,760,950	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	3,630,000	3,678,206	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	50,000	52,023	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,490,000	3,500,609	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	4,240,000	4,302,582	2024/06/20
7 0 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	
7 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	40,000	42,086	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,610,000	3,621,227	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	4,700,000	4,763,403	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	460,000	485,313	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,530,000	3,541,543	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	2,100,000	2,130,765	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,010,000	3,036,969	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	380,000	401,724	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	40,000	42,400	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,200,000	3,210,880	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	6,030,000	6,106,400	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	180,000	191,710	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	74,121	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	42,478	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	5,400,000	5,418,954	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	6,510,000	6,598,080	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	265,830	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	53,333	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	96,300	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,350,000	4,365,616	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	4,410,000	4,473,371	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	400,000	428,676	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	150,540	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,900,000	3,914,235	2025/12/20
3 4 1 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
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	303,732 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
2133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	共同発行市場公募公債 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	大阪府公募公債	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	2.0500	100,000	112,685 2028/12/20
6回	大阪府公募公債 20年	2.2100	200,000	227,612 2028/12/20
17回	横浜市公募公債 20年	2.0700	100,000	112,820 2028/12/20
6回	北九州市公募公債 20年	2.0300	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	岡山県公募公債 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 横浜市公募債	0.0500	400,000	395,316	2029/10/16
令和元年度16回 兵庫県公募債	0.0500	200,000	197,652	2029/10/23
21回 東京都公募債 20年	2.1900	100,000	115,284	2029/12/20
17回 さいたま市公募債	0.1100	200,000	198,376	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募債	0.1350	200,000	198,670	2030/01/30
21年度2回 福岡県公募債 (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 東京都公募債	0.1300	400,000	396,980	2030/03/19
511回 名古屋市長公募債 10年	0.0750	200,000	197,608	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公募債	0.1350	400,000	397,116	2030/04/12
令和2年2回 大阪府公募債	0.1310	300,000	297,588	2030/05/22
9回 埼玉県公募債 20年	2.1500	100,000	115,631	2030/05/24
8回 静岡県公募債 15年	0.8280	200,000	209,836	2030/06/07
令和2年度10回 静岡県公募債	0.1350	100,000	99,073	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公募債	0.1350	100,000	99,522	2030/10/23
36回2号 宮城県公募債 10年	0.1350	250,000	247,500	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
22年度14回 愛知県公募債	2.0870	300,000	347,595	2030/12/13
9回 京都市公募債 20年	2.1430	200,000	232,738	2030/12/17
813回 東京都公募債	0.1790	300,000	297,897	2030/12/20
16回 神奈川県公募債 20年	2.0900	300,000	348,129	2031/01/24
464回 大阪府公募債 10年	0.0720	200,000	196,622	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公募債	0.1450	100,000	98,897	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公募債	0.2140	200,000	199,184	2031/03/12
令和2年7回 広島県公募債	0.2140	200,000	199,182	2031/03/19
251回 神奈川県公募債 10年	0.1990	200,000	198,826	2031/03/20
令和2年度14回 静岡県公募債	0.1400	200,000	197,780	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公募債 10年	0.1900	200,000	198,682	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公募債	0.1750	100,000	99,165	2031/04/25
467回 大阪府公募債 10年	0.1640	200,000	197,956	2031/04/28
469回 大阪府公募債 10年	0.1280	200,000	197,136	2031/06/27
令和3年5回 千葉県公募債	0.1050	200,000	196,712	2031/09/25
472回 大阪府公募債 10年	0.1000	200,000	196,436	2031/09/29
19回 神奈川県公募債 20年	1.8180	100,000	114,954	2032/01/30
24年度2回 福岡県公募債 (20年)	1.6350	300,000	340,239	2032/08/16
10回 大阪府公募債 20年	1.7200	200,000	228,482	2032/09/24
24年度12回 神戸市公募債	1.7110	200,000	228,902	2032/12/17
14回 千葉県公募債 20年	1.1370	100,000	108,398	2033/04/15
13回 埼玉県公募債 20年	1.5990	100,000	113,533	2033/05/20
1回 東京都公募債 30年	2.2100	200,000	240,730	2033/06/20
14回 埼玉県公募債 20年	1.5460	300,000	340,266	2034/05/08
29回 横浜市公募債 20年	1.5280	100,000	113,263	2034/05/26
16回 名古屋市公募債 20年	1.5200	100,000	113,143	2034/06/09
5回 群馬県公募債 20年	1.5290	100,000	113,268	2034/06/16
17回 北九州市公募債 20年	1.5290	100,000	113,146	2034/06/20
15回 埼玉県公募債 20年	1.1660	100,000	108,996	2035/02/16
2回 横浜市公募債 30年	2.4900	100,000	125,684	2035/03/20
18回 千葉県公募債 20年	1.1380	100,000	108,681	2035/04/13
17回 名古屋市公募債 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 大阪府公募債 20年	1.2030	100,000	109,382	2035/09/28
14回 大阪府公募債 20年	0.5400	100,000	100,067	2036/09/29
21回 千葉県公募債 20年	0.4240	100,000	98,557	2036/10/15
3回 神奈川県公募債 30年	2.6200	100,000	129,747	2037/03/19
29年度2回 広島市公募債	0.6160	200,000	201,596	2037/08/18
29年度5回 札幌市公募債 20年	0.5970	300,000	301,374	2037/09/18
30年度2回 仙台市公募債 20年	0.7290	100,000	101,875	2038/10/18
30年度7回 福岡市公募債	0.7010	200,000	202,748	2038/10/19
2019年度5回 福岡市公募債 20年	0.2860	100,000	94,215	2039/07/29
2回 兵庫県公募債 30年	2.3600	100,000	128,860	2040/03/19
22年度8回 福岡市公募債	2.2800	100,000	127,719	2040/09/20
令和2年2回 広島県公募債	0.4640	100,000	96,353	2040/09/21
23年度7回 札幌市公募債 30年	2.0970	100,000	125,408	2041/09/20
5回 川崎市公募債 30年	2.0970	100,000	125,839	2042/03/20
24年度12回 愛知県公募債 30年	2.1200	100,000	126,252	2042/09/19
14回 東京都公募債 30年	2.0500	100,000	125,309	2043/06/19
27年度8回 愛知県公募債 30年	1.5790	150,000	174,357	2045/06/20
27年度2回 広島県公募債 30年	0.7110	100,000	97,493	2046/03/22
6回 埼玉県公募債 30年	0.9570	200,000	204,822	2046/12/20
令和元年度1回 島根県公募債	0.2900	200,000	189,308	2049/09/17
5回 京都市公募債 30年定時償還	0.2900	200,000	189,826	2049/09/17
令和3年度6回 神戸市公募債 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・債務返済機構債	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・債務返済機構債	0.8820	500,000	506,195	2023/06/30
50回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	506,570	2023/07/14
195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	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・債務返済機構債	0.6990	105,000	106,289	2023/10/31
56回 政保地方公共団体金融機構債券	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	0.6940	100,000	101,052	2024/02/28
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6600	100,000	101,364	2024/02/29
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6600	100,000	101,533	2024/05/31
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6440	200,000	203,092	2024/06/28
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	304,170	2024/09/13
139回 日本高速道路保有・債務返済機構債	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・債務返済機構債	0.4500	500,000	506,870	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機構債券	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・債務返済機構債	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 中日日本高速道路債	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
(特殊債券)		%	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構債券 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構債券	1.5070	300,000	320,157 2026/11/06
9 1 回	政保地方公共団体金融機構債券	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構債券	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構債券	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構債券	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構債券	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構債券 20年	2.0700	200,000	225,488 2028/12/20
9 3 4 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構債券 20年	2.2660	300,000	344,622 2029/06/28
2 回	地方公共団体金融機構債券 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構債券 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	2.0660	350,000	406,605 2031/06/13
7 9 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構債券	1.8400	200,000	229,494 2031/12/26
2 3 回	地方公共団体金融機構債券 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	国際協力機構債券	1.7240	100,000	113,908 2032/09/17
2 4 回	地方公共団体金融機構債券 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構債券 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
(特殊債券)		%	千円	千円
4 4 回	地方公共団体金融機構債券 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	高速道路機構債	0.2880	200,000	192,904 2036/06/20
5 9 回	地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	101,313 2037/04/28
6 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	29,607	29,689 2037/05/10
8 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	20,706	20,925 2037/05/10
9 回	貸付債権担保5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 回	高速道路機構債	2.6700	200,000	261,262 2037/09/18
2 回	貸付債権担保5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	高速道路機構債	0.6770	100,000	100,551 2038/09/17
2 8 8 回	政保地方公共団体金融機構債券	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	高速道路機構債	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	高速道路機構債	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	都市再生機構債券	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	高速道路機構債	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
(特殊債券)	%	千円	千円	
118回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
120回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
小計	-	25,151,985	26,325,307	-
(金融債券)	%	千円	千円	
342回 利付信金中金債(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 利付信金中金債(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 利付信金中金債(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
小計	-	1,800,000	1,796,652	-
(普通社債券)	%	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 ファーストリテイリング社債	0.1100	100,000	100,014	2023/06/06
23回 東京瓦斯社債	1.0100	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 フランクス証券株式会社発行(BFCM)円債社債(2018)	0.4430	100,000	100,225	2023/10/12
48回 クレディ・アグリコル社債	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	2.0150	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
(普通社債券)	%	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円貸社債(ソーシャルボンド)	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・エー円貸社債	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	2.0500	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	2.0400	200,000	212,108	2025/06/20
12回 新生銀行社債	0.3600	400,000	400,780	2025/07/09
27回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	213,564	2025/09/19
42回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	399,540	2025/12/19
14回 セン&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 三菱ケ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・エー円貸社債(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	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	0.0400	500,000	498,510	2026/09/17
62回 西日本高速道路債	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	0.2700	300,000	302,304	2026/12/14

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
3 4 回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	201,988	2027/02/16
1 2 回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	109,385	2027/03/15
8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	110,997	2027/04/20
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	302,142	2027/04/23
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	301,983	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,320	2027/05/07
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	299,919	2027/07/16
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	111,110	2027/09/17
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	102,875	2027/09/24
25回 フランス信託証券(銀行 (RF C/M) 円社債 (2017))	0.5100	300,000	300,165	2027/10/12
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,776	2027/10/22
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	198,714	2027/10/25
5 4 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
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	301,581	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	396,368	2028/06/02
7回 ファーストリテイリング社債	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
2 1 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
1 4 回 プリダストーン社債	0.3750	300,000	299,688	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	106,046	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	398,716	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	397,692	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	197,242	2029/07/25
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	197,254	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	114,048	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	199,608	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	99,336	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	99,442	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	198,552	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	400,636	2030/05/24
4 2 5 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
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	399,996	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	113,148	2030/09/27
1 7 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
(普通社債券)	%	千円	千円	
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	297,459	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	230,196	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	198,218	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	201,078	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	98,948	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	296,484	2031/04/25
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	296,946	2031/09/19
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	493,755	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	197,668	2031/10/20
3 9 6 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 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	202,224	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	197,974	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	101,283	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	99,688	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	100,776	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	198,848	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	100,101	2038/05/25
8回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	200,640	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	97,663	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	98,977	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	95,902	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	193,860	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	92,270	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	94,387	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	193,374	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	192,742	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	96,298	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	109,475	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	103,649	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	93,961	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	189,550	2051/07/14
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	93,754	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	91,698	2060/09/17
1 6 0 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	率
	額		
公 社 債	千円		%
コーポレートローン等、その他	551,087,616		91.6
投資信託財産総額	50,748,215		8.4
	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 産	601,835,832,511円
コ ー ー ル ・ ン 等	49,696,366,967
公 社 債(評価額)	551,087,616,706
未 収 利 息	809,631,617
前 払 費	242,217,221
(B) 負 債	48,532,656,000
未 払 解 約 債 金	48,532,656,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	553,303,176,511
元 本	429,840,166,151
次 期 繰 越 損 益	123,463,010,360
(D) 受 益 権 総 口 数	429,840,166,151口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,872円

(注1) 期首元本額	209,919,027,595円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	37,377,953円
追加設定元本額	611,239,283,321円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	15,418,280円
一部解約元本額	391,318,144,765円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	12,877,158円
(注2) 期末における元本の内訳		4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	327,852,051円
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,682,506,030円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	851,076円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	83,095,931円	DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	153,860,446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)	1,570,192,380円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	119,506,919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)	1,607,821,940円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	687,384,295円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	1,368,128,834円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	133,587,952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)	982,094,880円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,730,893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)	1,551,466,786円
たわらノーロード 国内債券	15,834,399,947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)	2,239,773,338円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,521,507,162円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型) 21-06	1,216,964,056円
たわらノーロード バランス (堅実型)	886,604,365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)	1,398,783,514円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,507,222,733円	DIAM国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	8,901,727,961円
たわらノーロード バランス (積極型)	189,908,936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
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	投資のソムリエ・私費 (適格機関投資家限定)	2,068,944,514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	Oneコアポートフォリオ・プラス戦略 (債券動的アロケーション)	379,250,637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)	1,225,069,364円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	276,996,912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)	327,185,576円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	3,244,504,751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)	22,506,242円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家限定)	3,251,938,545円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	17,145,320円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定)	3,223,328,742円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	13,611,444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)	2,685,868,185円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	90,707,115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)	51,300,165円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	5,060,786円	DIAM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
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	414,272円	DIAM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
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,277,651,015円	DIAM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
Oneグローバルバランス	8,911,633円	DIAM国際分散(バランス)ファンドK50VA (適格機関投資家限定)	97,096,530円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,982,923,753円	DIAM国内重視(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定)	34,365,367円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	12,483,500,015円	DIAM国内重視(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,318,042円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,178,995,984円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	25,972,068円
DIAM DCバランス30インデックスファンド	2,189,166,701円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	126,573,725円
DIAM DCバランス50インデックスファンド	2,329,357,704円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	3,587,635,563円
DIAM DCバランス70インデックスファンド	390,282,840円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,301,884,615円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	87,660,620円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,374,149,034円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	3,040,981,442円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	113,717,335円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	11,707,847円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	190,263,848円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,303,883,102円	DIAM アスク グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,187,734,764円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,576,117,456円	DIAM世界アセット(バランス)ファンドVA (適格機関投資家向け)	180,904,488円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	340,130,669円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	10,231,460円
投資のソムリエ	86,470,476,048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)	2,254,611,473円
クルーズコントロール	331,216,116円	DIAM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
投資のソムリエ<DC年金>	5,215,918,149円	DIAM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
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,612,393,810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)	558,346,963円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	738,611,977円	DIAM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
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,459,012円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	298,351,041円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,619,684円	DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	101,646,068円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,424,858,123円	Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	1,043,766,370円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	44,101,884,740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
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	35,684,515円	動的パッケージファンド<DC年金>	333,573,020円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	17,735,957円	コア資産形成ファンド	227,460,602円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	53,072,038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
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	176,635,602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
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,233,253,084円	MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	14,232,766,343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	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
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,330,495,531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	
	その他の収益	4,106,122	
	支払利息	△958,146	
(B)	有価証券売買損益	△10,450,257,321	
	売却益	660,402,300	
	売却損	△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)	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。

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
	円	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）	騰落率			
16期(2018年2月15日)	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

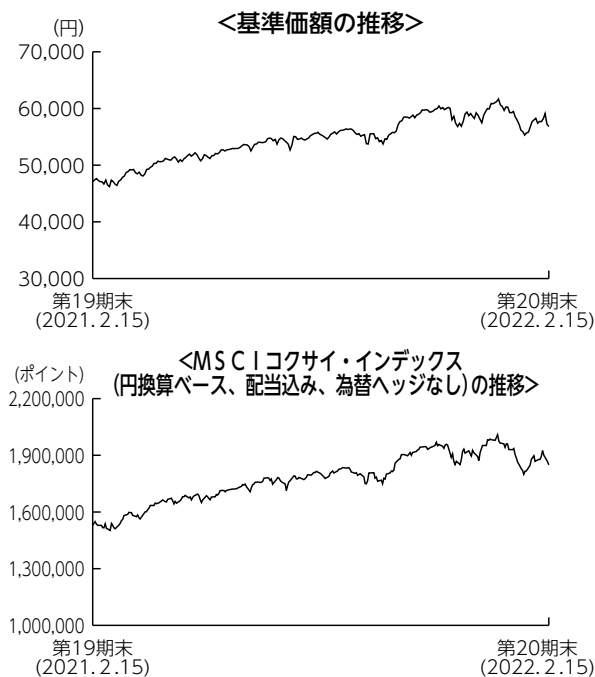
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2 月 15 日	47,083	% -	1,529,401.79	% -	% 95.5	% 2.5
2 月 末	46,501	△1.2	1,513,956.06	△1.0	95.5	2.4
3 月 末	49,621	5.4	1,611,609.95	5.4	94.8	3.1
4 月 末	51,949	10.3	1,687,947.89	10.4	94.9	3.0
5 月 末	52,709	11.9	1,713,776.65	12.1	95.8	2.2
6 月 末	54,024	14.7	1,757,211.68	14.9	94.2	3.6
7 月 末	54,788	16.4	1,782,621.67	16.6	95.5	2.3
8 月 末	56,137	19.2	1,826,693.61	19.4	95.9	1.8
9 月 末	54,830	16.5	1,784,539.69	16.7	90.4	1.7
10 月 末	58,844	25.0	1,915,338.44	25.2	95.7	2.2
11 月 末	58,620	24.5	1,907,177.99	24.7	94.2	3.1
12 月 末	61,010	29.6	1,986,097.70	29.9	95.7	2.9
2022年 1 月 末	56,736	20.5	1,847,457.63	20.8	95.5	2.3
(期 末) 2022年 2 月 15 日	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1	1.8

(注1) 騰落率は期首比です。

(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）



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加え、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

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。

【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

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



(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。

■ 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	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
国	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	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	
	スイス	百株 12,180.84 (-)	千スイス・フラン 103,265 (△222)	百株 11,124.7	千スイス・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	
国	ユ	アイスランド	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
		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
	ロ	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 額		売 付 額	
		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 額		売 付 額	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ		千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
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□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	4.337	241	4.071	223
	(-)	(-)	(-)	(-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
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	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	212.6 (-)	14,716 (-)	213.1 (-)	14,405 (-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	295.4 (57,741)	611 (89)	291.6 (-)	604 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	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	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	76.052 (-)	389 (-)	70.101 (-)	371 (-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	18.185 (-)	127 (-)	- (-)	- (-)
SEGRO PLC	53.28 (-)	602 (-)	33.876 (-)	385 (-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	1.093 (-)	145 (-)	- (-)	- (-)
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
INTL 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		コンプロマリット
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 INTL 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		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		ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,018.55	2,157.51	14,414	1,663,701		医薬品
ONEOK INC	392.84	420.2	2,643	305,158		石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	80.93	74.44	1,011	116,694		保険
UNITED RENTALS INC	61.81	69.35	2,172	250,737		商社・流通業
SEMPRA ENERGY	261.13	310.48	4,195	484,246		総合公益事業
FEDEX CORP	224.18	247.48	5,653	652,576		航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	87.62	103.4	2,208	254,871		情報技術サービス
AMPHENOL CORP	262.07	581.23	4,377	505,221		電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	260.85	297.33	1,973	227,767		飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	971.36	971.36	599	69,174		メディア
CSX CORP	686.59	2,203.61	7,474	862,723		陸運・鉄道
COTERRA ENERGY INC	314.16	785.16	1,823	210,517		石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	166.23	203.34	895	103,336		食品
SEAGATE TECHNOLOGY	196.41	-	-	-		コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	146.75	164.21	3,840	443,218		飲料
CARDINAL HEALTH INC	247.18	290.05	1,516	175,054		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	471.45	763.02	1,629	188,112		ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	486.12	532.89	10,651	1,229,446		機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	98.65	102.58	1,330	153,538		ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	99.33	115.3	1,175	135,687		ソフトウェア
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		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		
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
FREEMPORT-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		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		コンピュータ・周辺機器
WW 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
TRANE 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
INTL 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		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・生活必需品小売り
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		専門小売り
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		専門小売り
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
MARKET 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		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		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
SYNOPSIS INC	133.81	147.52	4,351	502,221		ソフトウェア

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		
(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	-	-	-		ヘルスケア機器・用品
VF CORP	287.12	356.87	2,137	246,686		繊維・アパレル・贅沢品
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		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
ZILLOW 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
ALTICE 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		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		
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		インタラクティブ・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		インタラクティブ・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
CHEVY 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		インタラクティブ・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		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		
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		インタラクティブ・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		インタラクティブ・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		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	
COCA-COLA EURO-PACIFIC PARTNERS PLC	182.96	215.37	1,227	141,640	飲料
TELADOC HEALTH INC	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	138,981	容器・包装
KRAFT HEINZ CO	568.79	640.01	2,213	255,516	食品
NOVOCURE LTD	74.08	97.72	770	88,967	ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP	259.81	329.64	2,144	247,496	機械
WASTE CONNECTIONS INC	247.78	261.86	3,126	360,903	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	269	293.14	79,456	9,170,832	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,162.57	1,231.01	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	1,431,174	情報技術サービス
SEA LTD ADR	-	132.32	1,709	197,273	娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC	352.77	343.46	1,165	134,545	各種金融サービス
SUNRUN INC	100	162.13	366	42,291	電気設備
ZILLOW GROUP INC-C	133.76	156.65	909	104,993	不動産管理・開発
ALPHABET INC-CL C	267.96	280.94	76,022	8,774,501	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZSCALER INC	61.93	77.59	2,129	245,764	ソフトウェア
CABLE ONE INC	3.92	5.42	813	93,881	メディア
LINDE PLC	470.49	503.98	14,792	1,707,329	化学
ATHENE HOLDING LTD	118.47	-	-	-	保険
ROKU INC	95.87	119.01	1,892	218,432	娯楽
AVALARA INC	71.02	78.24	776	89,636	ソフトウェア
CHARTER COMMUNICATIONS INC	129.32	124.76	7,584	875,421	メディア
VISTRA CORP	380.32	397.58	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 銘柄数<比率>	278,491.28 592銘柄	309,096.71 608銘柄	3,769,273 -	435,049,586 <67.7%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	205.78	455.67	3,042	275,894	金属・鉱業
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	784.79	-	-	-	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP	1,559.61	1,736.87	4,663	422,885	金属・鉱業
ATCO LTD	71.93	-	-	-	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	複合小売り
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		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		繊維・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
RITCHIE 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) CS	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		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	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	218.4	—	—	—	金属・鉱業
IVANHOE MINES LTD	—	619.3	699	63,402	金属・鉱業
INTER PIPELINE LTD	418.63	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD	506.3	555.64	5,191	470,751	化学
TFI INTERNATIONAL INC	—	89.99	1,223	110,963	陸運・鉄道
SSR MINING INC	180	—	—	—	金属・鉱業
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	113.46	415	37,676	ソフトウェア
WSP GLOBAL INC	101.94	129.91	2,103	190,733	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	122.78	116.6	947	85,939	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	164.85	164.85	630	57,193	商業サービス・用品
NUVEI CORP	—	49.6	391	35,496	情報技術サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	108.45	108.45	477	43,290	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CANADA	107.22	179.4	434	39,433	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	251.76	264.43	1,922	174,299	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC	97.39	109.46	11,810	1,070,947	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	35.03	32.93	636	57,700	不動産管理・開発
CANOPY GROWTH CORP	186.34	186.34	199	18,113	医薬品
HYDRO ONE LTD	273.4	357.38	1,151	104,448	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	35,759.37 87銘柄	38,115.54 86銘柄	251,560 —	22,811,543 <3.5%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	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
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	2,577.13	2,757.53	7,776	640,061	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION	3,180.22	3,565.97	8,515	700,913	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,535.17	1,622.22	3,690	303,769	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	3,644.09	3,896.81	1,582	130,223	各種電気通信サービス
AMP LTD	3,024.14	—	—	—	各種金融サービス
ASX LTD	191.62	189.26	1,569	129,172	資本市場
BHP GROUP LTD	2,637.49	3,064.96	14,812	1,219,254	金属・鉱業
AMPOL LTD	209.46	209.46	677	55,773	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	380.4	516.04	1,189	97,947	情報技術サービス
CSL LIMITED	407.66	464.24	11,307	930,681	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	57.45	58.28	789	64,970	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,508.16	2,937.86	3,769	310,248	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD	526.93	—	—	—	飲料
COCHLEAR LTD	55.33	58.75	1,116	91,912	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,328.6	1,463.6	908	74,811	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,589.4	1,728.88	17,295	1,423,610	銀行
RIO TINTO LIMITED	338.59	359.15	4,366	359,410	金属・鉱業
APA GROUP	1,182.05	1,182.05	1,182	97,294	ガス
ARISTOCRAT LEISU	517.17	620.13	2,494	205,345	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,251.8	2,694.3	1,271	104,674	保険
TPG TELECOM LTD	287.19	—	—	—	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	398.39	462.46	2,159	177,725	建設資材
ORICA LTD	413.11	413.11	608	50,052	化学
CIMIC GROUP LTD	87.09	—	—	—	建設・土木
LEND LEASE CORP LTD	621.16	621.16	623	51,332	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	496.93	469.46	882	72,606	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	1,160.56	1,422.58	1,240	102,104	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD	298.21	337.36	6,552	539,312	資本市場
SUNCORP GROUP LTD	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	インタラクティブ・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 銘 柄 数 < 比 率 >	65,373.59 58銘柄	66,920.43 55銘柄	146,885 —	12,090,177 <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		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,085	1,385	13,510	199,822	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	495	495	2,393	35,397	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,285	1,320	17,608	260,434	機械
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,660	1,660	3,585	53,031	建設関連製品
SJM HOLDINGS LTD	1,560	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,244	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	—	2,172	3,492	51,655	専門小売り
AIA GROUP LTD	10,872.27	11,750.27	102,462	1,515,418	保険
HKT TRUST / HKT LTD	2,890	4,450	4,841	71,607	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	1,988	2,520	5,544	81,995	ホテル・レストラン・レジャー
SITC INTERNATIONAL CO LTD	—	1,330	4,176	61,765	海運業
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,188	32,363	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,497.5	1,517.5	5,455	80,685	不動産管理・開発
ESR CAYMAN LTD	1,474	2,038	5,319	78,670	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,812	26,805	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	1,506	1,506	3,471	51,340	飲料
WH GROUP LTD	8,970	8,970	5,139	76,017	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,553.32	2,563.32	15,315	226,521	コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	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 33銘柄	82,613.53 30銘柄	350,582 —	5,185,109 <0.8%>
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE TECH ENG	1,250	1,095	418	35,843	航空宇宙・防衛
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,557	1,766	6,569	562,942	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	364	364	259	22,270	不動産管理・開発
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	674	656	56,253	資本市場
CAPITALAND LTD	3,088.15	—	—	—	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	4,268	7,242	557	47,783	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,349	1,349	814	69,819	コングロマリット
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,716.53	3,209.53	4,281	366,882	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,768.22	8,084.22	2,061	176,647	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,608.5	1,580.5	823	70,560	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,024	1,113	3,639	311,869	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	405	295	25,334	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	210	421	762	65,368	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,814	1,814	823	70,570	食品
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	—	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 14銘柄	32,069.4 14銘柄	23,033 —	1,973,722 <0.3%>
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,102.26	1,102.26	796	60,909	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE 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
A2 MILK CO LTD	550.91	—	—	—	食品
FISHER & PAYKEL	490.44	573.88	1,607	122,856	ヘルスケア機器・用品
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,596.23	2,629.43	1,156	88,425	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	617.34	617.34	357	27,319	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	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 7銘柄	6,659.02 6銘柄	4,988 —	381,252 <0.1%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	317.98	352.61	489	76,550	金属・鉱業

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

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SMITH & NEPHEW PLC	769.28	880.29	1,061	165,869	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,499.85	4,896.01	7,692	1,201,893	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	275.89	317.95	2,185	341,476	資本市場
WPP PLC	1,115.98	1,134.03	1,353	211,465	メディア
ASTRAZENECA PLC	1,175.51	1,508.4	12,641	1,975,170	医薬品
WHITBREAD PLC	185.94	187.44	599	93,743	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC	138.42	161.39	833	130,213	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	389.5	387.64	760	118,888	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	166.52	162.86	822	128,549	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC	1,902.05	1,828.62	507	79,225	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	158.93	200.87	608	95,093	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	115.81	105.59	431	67,358	家庭用耐久財
SHELL PLC-A SHS	3,777.76	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SHELL PLC-B SHS	3,238.58	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	182	180.34	350	54,831	医薬品
AVEVA GROUP PLC	104.08	104.08	278	43,548	ソフトウェア
ABRDN PLC	2,063.13	2,063.13	489	76,492	資本市場
EXPERIAN PLC	803.76	893.61	2,560	400,004	専門サービス
MONDI PLC	471.7	458.75	855	133,638	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	280.11	353.12	460	71,998	資本市場
FRESNILLO PLC NPR	173.85	—	—	—	金属・鉱業
OCADO GROUP PLC	427.89	449.09	584	91,250	食品・生活必需品小売り
INFORMA PLC	1,493.58	1,515.66	922	144,073	メディア
GLENCORE PLC	8,804.08	9,681.28	4,086	638,469	金属・鉱業
ENTAIN PLC	496.18	581.26	979	152,979	ホテル・レストラン・レジャー
EVRAZ PLC	487.65	—	—	—	金属・鉱業
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,126.94	—	—	—	保険
COCA-COLA HBC AG	152.08	202.33	486	76,026	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	517.21	565.61	371	58,077	保険
FERGUSON PLC	205.31	216.07	2,367	369,827	商社・流通業
M&G PLC	2,049.4	2,591.17	549	85,907	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	320.86	2,354.9	396	61,996	専門小売り
SHELL PLC	—	7,503.11	15,047	2,351,019	石油・ガス・消耗燃料
AUTO TRADER GROUP PLC	980.62	1,046.24	667	104,323	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,246.75	4,701.29	714	111,648	コングロメラット
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	266,360.93 85銘柄	284,167.37 79銘柄	184,216 —	28,781,938 <4.5%>
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	1,023.59	1,077.44	3,565	126,397	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,307.03	1,436.45	4,918	174,370	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	17.6	21.98	1,238	43,910	航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,021.34	1,061.43	2,259	80,115	銀行
ICL GROUP LTD	494.11	680.48	2,206	78,236	化学
NICE LTD	55.35	61.29	5,225	185,261	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	104.44	167.84	2,047	72,594	銀行
AZRIELI GROUP	44.14	44.14	1,226	43,488	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,067.6 8銘柄	4,551.05 8銘柄	22,688 —	804,375 <0.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,257.7	2,530.13	2,103	262,754	資本市場
LOGITECH INTL-REG	144.29	180.08	1,314	164,244	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	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 FINANCIERICHMONT	474.14	508.16	6,654	831,395	繊維・アパレル・贅沢品	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	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	繊維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	45.92	254	31,755	繊維・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 数 銘 柄 数 < 金 額 数 < 比 率 >	15,648.45 39銘柄	16,704.59 41銘柄	148,505 -	18,554,267 <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)	百株	百株	千円	千円	
GN STORE NORD A/S	128.95	104.48	3,823	67,072	ヘルスケア機器・用品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	181.27	979.91	15,952	279,814	電気設備
COLOPLAST-B	107.34	119.22	10,925	191,630	ヘルスケア機器・用品
DSV A/S	190.49	198.61	25,044	439,284	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S	107.39	107.39	2,870	50,349	ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S	48.4	—	—	—	医薬品
TRYG A/S	111.07	357.84	5,439	95,403	保険
PANDORA A/S	82.51	92.65	6,650	116,648	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	93.36	89.84	4,288	75,228	化学
AMBU A/S B	141.56	141.56	1,705	29,919	ヘルスケア機器・用品
ORSTED A/S	164.71	192.05	12,586	220,775	電力
小 計	株 数 銘 柄	株 数 銘 柄	外 貨 建 金 額 257,006	邦 貨 換 算 金 額 4,507,892	
	・ 金 額 数 < 比 率 >	・ 金 額 数 < 比 率 >	—	< 0.7% >	
(ノルウェー)	百株	百株	千円	千円	
MOWI ASA	435.37	432.02	10,161	132,094	食品
DNB ASA	807.09	—	—	—	銀行
NORSK HYDRO ASA	1,290.36	1,290.36	9,984	129,802	金属・鉱業
TELENOR ASA	630.38	674.35	9,258	120,364	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	75.37	75.37	1,746	22,702	メディア
ORKLA ASA	652.83	694.4	5,862	76,207	食品
EQUINOR ASA	831.49	943.06	25,816	335,611	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	151.93	151.93	6,730	87,496	化学
AKER BP ASA	—	152.17	4,129	53,688	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	166.83	294.84	6,262	81,411	保険
ADEVINTA ASA	222.65	222.65	1,847	24,023	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DNB BANK ASA	—	895.96	19,003	247,043	銀行
SCHIBSTED ASA	74.45	74.45	1,514	19,686	メディア
小 計	株 数 銘 柄	株 数 銘 柄	外 貨 建 金 額 102,317	邦 貨 換 算 金 額 1,330,132	
	・ 金 額 数 < 比 率 >	・ 金 額 数 < 比 率 >	—	< 0.2% >	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	564.89	636.97	31,695	389,856	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	360.51	401.9	17,474	214,937	機械
ERICSSON LM-B SHS	2,649.68	2,794.5	32,175	395,763	通信機器
GETINGE AB-B SHS	—	244.21	8,667	106,604	ヘルスケア機器・用品
INVESTOR AB-A SHS	—	557.33	11,531	141,833	各種金融サービス
LUNDBERGS B	73.82	73.82	3,471	42,702	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	348.49	322.28	6,055	74,484	機械
SANDVIK AB	1,034	1,143.71	26,637	327,635	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,449.9	1,664.38	20,072	246,890	銀行
SKANSKA AB-B SHS	316.53	319.68	7,624	93,779	建設・土木
SWEDBANK AB	798.25	893.78	15,061	185,262	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	529.45	543.82	8,807	108,328	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,392.3	1,340.2	12,981	159,668	銀行
VOLVO AB-A SHS	—	236.91	5,041	62,009	機械
VOLVO AB-B SHS	1,305.9	1,342.82	28,320	348,336	機械
SWEDISH MATCH AB	138.45	1,583.29	11,026	135,620	タバコ
TELE2 AB-B SHS	470.55	460.83	6,020	74,055	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	119.55	142.73	4,104	50,490	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	114.03	119.4	3,371	41,473	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	252.19	4,546	55,927	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS	240.98	483.54	5,751	70,746	商業サービス・用品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
INVESTOR AB-B SHS	395.67	1,694.19	33,029	406,268	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	688.14	662.7	11,793	145,058	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	870.21	1,010.25	26,418	324,941	建設関連製品
TELIA CO AB	2,104.77	2,699.54	10,043	123,536	各種電気通信サービス
LUNDIN ENERGY AB	147.39	207.62	7,019	86,341	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB	283.76	240.47	9,638	118,547	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	283.92	279.3	7,932	97,565	機械
KINNEVIK AB-B	217.22	214.49	5,430	66,799	各種金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER	89.67	114.01	6,687	82,260	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB	90.09	-	-	-	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	336.92	451.58	5,477	67,375	機械
NIBE INDUSTRIER AB	288.34	1,340.88	11,416	140,419	建設関連製品
HEXAGON AB-B SHS	265.34	1,852.43	22,738	279,684	電子装置・機器・部品
SAGAX AB	-	183.48	4,678	57,548	不動産管理・開発
EPIROC AB-A	607.5	593.63	11,273	138,658	機械
EPIROC AB-B	308.99	389.43	6,308	77,597	機械
ESSITY AB-B	521.43	576.54	15,249	187,568	家庭用品
EQT AB	209.34	300.03	10,171	125,103	資本市場
EMBRACER GROUP AB	-	491.42	4,155	51,118	娯楽
LIFCO AB	-	257.38	5,237	64,423	コングロマリット
EVOLUTION AB	136.41	161.47	17,115	210,524	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP	2,957.52	3,102.72	34,018	418,424	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	149.45	149.45	3,987	49,044	コングロマリット
SINCH AB	-	562.99	5,393	66,339	ソフトウェア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,051.27 38銘柄	33,094.29 44銘柄	545,655 -	6,711,557 <1.0%>
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	716.53	755.8	3,302	431,120	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	141.28	175.84	2,343	305,910	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	147.3	149.68	1,607	209,883	食品
KINGSPAN GROUP PLC	134.52	143.07	1,244	162,509	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	208.7	242.28	1,139	148,765	容器・包装
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,348.33 5銘柄	1,466.67 5銘柄	9,636 -	1,258,190 <0.2%>
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	531.76	575.35	6,691	873,618	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV	152.1	168.59	2,683	350,306	化学
ING GROEP NV-CVA	3,448.92	3,804.32	4,902	640,037	銀行
ASM INTERNATIONAL NV	-	42.71	1,167	152,398	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	126.01	112.39	707	92,326	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	992.8	1,063.9	3,060	399,623	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	226.83	245.94	2,291	299,136	飲料
AKZO NOBEL	179.59	187.17	1,717	224,184	化学
ASML HOLDING NV	380.98	403.14	22,563	2,945,922	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	1,503.49	1,893.23	909	118,770	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	829.19	886.59	2,596	338,983	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	257.15	266.29	2,328	304,001	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	541.76	650.99	2,545	332,323	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	207.63	204.27	876	114,412	ライフサイエンス・ツール/サービス
VOPAK (KON.)	53.64	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
KONINKLIJKE KPN NV	3,478.24	3,414.47	1,051	137,304	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		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
HEINEKEN HOLDING NV-A	100.04	106.67	804	105,077	飲料
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	553.04	553.04	574	75,020	飲料
FERRARI NV	115.42	120.5	2,335	304,895	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	893.78	1,061.55	1,480	193,272	機械
PROSUS NV	442.19	906.79	6,150	803,042	インターネット販売・通信販売
JDE PEET'S BV	73.08	73.08	191	25,065	食品
EURONEXT NV	-	96.19	795	103,796	資本市場
IMCD NV	-	53.59	757	98,933	商社・流通業
NN GROUP NV	252.74	281.24	1,418	185,209	保険
ARGENX SE	38.79	42.55	1,073	140,160	バイオテクノロジー
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	-	679.41	1,426	186,277	娯楽
STELLANTIS NV	1,769.58	1,962.48	3,206	418,665	自動車
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	108.36	160.29	615	80,350	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV	342.51	343.82	443	57,871	銀行
EXOR NV	99.66	99.66	719	93,891	各種金融サービス
ADYEN NV	15.89	19.2	3,605	470,717	情報技術サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 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)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	176.54	177.49	573	74,918	化学
KBC GROUPE	210.38	265.87	2,042	266,726	銀行
SOFINA	13.82	13.82	469	61,347	各種金融サービス
SOLVAY SA	71.83	69.31	736	96,192	化学
AGEAS	143.65	170.55	754	98,509	保険
UCB SA	105.71	127.78	1,085	141,705	医薬品
COLRUYT NV	46.73	46.73	168	21,988	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	99.04	107.14	995	129,922	各種金融サービス
PROXIMUS	137.39	137.39	247	32,296	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV	34.26	-	-	-	バイオテクノロジー
ELIA GROUP	28.62	28.62	325	42,560	電力
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	663.27	740.93	4,035	526,920	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 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)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELOR MITTAL (NL)	615.94	639.79	1,685	220,020	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	113.3	139.43	1,185	154,733	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	369.59	529.85	609	79,588	エネルギー設備・サービス
SES FDR	288.47	-	-	-	メディア
AROUNDTOWN SA	830.54	1,060.18	560	73,222	不動産管理・開発
INPOST SA	-	203.95	128	16,746	航空貨物・物流サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 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)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	412	465.78	6,619	864,263	化学
AXA SA	1,694.93	1,895.06	5,225	682,257	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	507.07	674.38	2,124	277,436	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	2.95	29.5	340	44,408	航空宇宙・防衛
DANONE	543.15	632.31	3,462	452,067	食品
SAFRAN SA	280.36	333.08	3,737	488,010	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	173.8	173.8	575	75,108	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	214.17	202.22	649	84,776	建設・土木

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(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
LVMH 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
EURAZEO	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)		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	
SUEZ SA	266.2	-	-	-	総合公益事業
EDENRED	214.88	248.65	953	124,530	情報技術サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	80.92	80.92	292	38,213	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDLINE SA	223.86	235.7	1,071	139,955	情報技術サービス
AMUNDI SA	59.24	59.24	402	52,555	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,068.91 64銘柄	24,298.59 59銘柄	150,074 -	19,593,711 <3.0%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	172.02	184.33	4,260	556,288	繊維・アパレル・贅沢品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	312.17	329.21	3,048	397,967	自動車
COMMERZBANK AG	831.18	1,062.15	910	118,885	銀行
FRESENIUS SE & CO KGAA	390.3	388.3	1,420	185,447	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET	98.82	98.82	340	44,460	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	55.46	55.46	203	26,631	化学
HANNOVER RUECK SE	48.68	53.21	913	119,281	保険
GEA GROUP AG	118.38	164.92	670	87,484	機械
CONTINENTAL AG	103.36	97.95	859	112,243	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	869.75	959.37	4,912	641,432	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	126.49	159.12	1,360	177,582	自動車
MERCK KGAA	118.74	123.64	2,176	284,187	医薬品
RWE AG	592.73	644.26	2,352	307,186	総合公益事業
SAP SE	934.54	1,015.97	10,706	1,397,813	ソフトウェア
E.ON SE	2,098.42	2,086.41	2,491	325,247	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	86.02	103.66	730	95,345	家庭用品
SIEMENS AG-REG	686.52	746.31	10,411	1,359,263	コンゴロマリット
PUMA AG	92.39	104.48	918	119,876	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG	887.08	948.61	5,005	653,559	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	162.41	175	1,286	167,978	家庭用品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	780.56	827.56	6,149	802,891	自動車
BASF SE	832.15	895.92	5,953	777,274	化学
BEIERSDORF AG	83.71	103.42	904	118,120	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	17.07	-	-	-	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	145.71	140.32	900	117,542	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	201.91	188.36	1,089	142,192	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE	375.04	401.57	8,959	1,169,690	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	279.9	702.48	512	66,943	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	123.01	135.09	3,547	463,156	保険
VOLKSWAGEN AG	27.58	31.53	757	98,962	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD	163.61	179.03	3,270	427,045	自動車
NEMETSCHKE SE	50.95	48.41	370	48,414	ソフトウェア
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,659.49	2,132.85	2,963	386,954	資本市場
BMW VORZUG	41.16	69.57	539	70,439	自動車
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,993.58	3,241.17	5,619	733,687	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG	30.44	26.86	1,104	144,166	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,188.79	1,266.18	4,111	536,769	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	4.79	4.79	326	42,613	機械
CARL ZEISS MEDITEC AG	37.71	35.01	461	60,267	ヘルスケア機器・用品
BECHTLE AG	25.11	75.33	354	46,303	情報技術サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	167.52	196.7	3,101	404,991	資本市場
LANXESS AG	68.56	71.94	371	48,559	化学
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	48.73	48.07	931	121,660	航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE WOHNEN	290.97	—	—	—	不動産管理・開発	
SYMRISE AG	113.08	121.06	1,225	160,031	化学	
BRENNTAG SE	140.44	163.1	1,249	163,072	商社・流通業	
EVONIK INDUSTRIES AG	171.16	233.4	675	88,188	化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	983.85	983.85	260	34,026	各種電気通信サービス	
LEG IMMOBILIEN SE	59.34	61.13	688	89,907	不動産管理・開発	
KION GROUP AG	59.03	75.08	586	76,557	機械	
VONOVIA SE	454.51	700.86	3,315	432,906	不動産管理・開発	
KNORR-BREMSE AG	68.6	68.6	604	78,906	機械	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	238.05	284.75	1,576	205,811	ヘルスケア機器・用品	
TEAMVIEWER AG	136.68	—	—	—	ソフトウェア	
SIEMENS ENERGY AG	358.31	357.61	667	87,122	電気設備	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	378.31	1,186	154,918	機械	
ZALANDO SE	147.56	208.57	1,287	168,069	インターネット販売・通信販売	
SCOUT24 SE	96.7	96.7	505	66,054	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
COVESTRO AG	163.37	191.58	1,010	131,866	化学	
HELLOFRESH SE	128.38	169.9	829	108,337	食品・生活必需品小売り	
UNIPER SE	182.03	104.27	406	53,092	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
DELIVERY HERO SE	109.74	166.45	720	94,033	インターネット販売・通信販売	
小計	株数 : 金額 銘柄数 <比率>	22,034.34 61銘柄	24,688.56 59銘柄	124,078 —	16,199,712 <2.5%>	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	195.17	331.35	644	84,142	食品・生活必需品小売り	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,386.62	2,686.36	1,074	140,292	電力	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	400.88	382.82	382	49,911	石油・ガス・消耗燃料	
小計	株数 : 金額 銘柄数 <比率>	2,982.67 3銘柄	3,400.53 3銘柄	2,101 —	274,346 <0.0%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	5,508.72	5,945.92	5,436	709,848	電力	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	212.06	212.06	347	45,322	電気設備	
REPSOL SA	1,359.9	1,502.89	1,753	228,946	石油・ガス・消耗燃料	
TELEFONICA S.A	4,558.87	5,375.23	2,353	307,313	各種電気通信サービス	
ENDESA S.A.	277.36	286.39	524	68,537	電力	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	213.95	228.77	502	65,590	建設・土木	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,782.51	6,440.62	3,691	481,912	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	236.12	162.89	400	52,252	ガス	
BANCO SANTANDER SA	15,869.57	16,741.54	5,601	731,360	銀行	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	345.96	462.37	786	102,744	電力	
INDITEX	1,004.23	1,042.55	2,640	344,780	専門小売り	
ENAGAS	234.77	234.77	436	57,011	ガス	
GRIFOLS SA	235.18	306.87	443	57,853	バイオテクノロジー	
FERROVIAL SA	405.93	464.37	1,105	144,294	建設・土木	
CAIXABANK	3,073.31	4,097.23	1,348	176,046	銀行	
EDP RENOVAVEIS SA	—	279.72	475	62,084	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AMADEUS IT GROUP SA	411.18	467.67	2,821	368,429	情報技術サービス	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	213.57	—	—	—	建設・土木	
AENA SME SA	62.56	70.76	1,061	138,576	運送インフラ	
CELLNEX TELECOM SAU	272.34	487.6	1,901	248,278	各種電気通信サービス	
小計	株数 : 金額 銘柄数 <比率>	40,278.09 19銘柄	44,810.22 19銘柄	33,633 —	4,391,186 <0.7%>	

銘柄	期首(前期末)		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)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	975.69	1,117.77	2,051	267,865	保険
INTESA SANPAOLO	15,123.69	15,981.58	4,422	577,349	銀行
UNICREDIT SPA	1,939.1	2,056.36	3,089	403,415	銀行
ENI SPA	2,193.31	2,418.13	3,221	420,653	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	574.42	574.42	583	76,233	銀行
ENEL SPA	7,299.44	7,880.51	4,980	650,251	電力
SNAM SPA	1,712.94	1,989.63	944	123,310	ガス
TELECOM ITALIA SPA	7,626.75	8,325.8	343	44,893	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	4,975.96	-	-	-	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	452.99	457.18	739	96,547	運送インフラ
TERNA SPA	1,136.54	1,671.4	1,106	144,460	電力
RECORDATI SPA	103.03	103.03	461	60,236	医薬品
AMPLIFON 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
PRYSMIAN SPA	223.28	218.22	600	78,463	電気設備
DIASORIN SPA	22.23	22.23	266	34,755	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA	175.67	228.55	1,244	162,446	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA	430.97	435.86	551	71,957	情報技術サービス
FINECOBANK SPA	538.18	652.74	1,011	132,008	銀行
POSTE ITALIANE SPA	400.15	557.49	601	78,572	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	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 20銘柄	45,037.43 19銘柄	26,822 -	3,501,981 <0.5%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B	240.85	238.04	630	82,358	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ	349.35	486.12	496	64,832	機械
UPM-KYMMENE OYJ	448.29	559.82	1,837	239,881	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	532.5	555.48	1,009	131,811	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	448.22	499.85	2,214	289,103	保険
FORTUM OYJ	394.09	408.2	962	125,615	電力
NOKIA OYJ	5,185.32	5,106.9	2,489	325,043	通信機器
ELISA OYJ	136.42	136.42	691	90,266	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	367.96	432.9	1,627	212,456	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	298.9	319.56	1,750	228,551	機械
ORION OYJ	80.51	81.06	281	36,797	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,482.41 11銘柄	8,824.35 11銘柄	13,991 -	1,826,718 <0.3%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	128.17	170.07	951	124,255	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	69.24	69.16	650	84,877	電力
VOEST-ALPINE AG	98.75	98.75	301	39,426	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	242.04	315.46	1,319	172,324	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	179.11	195.72	509	66,489	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	717.31 5銘柄	849.16 5銘柄	3,732 -	487,372 <0.1%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	974,571.62 1,224銘柄	1,063,294.07 1,228銘柄	- -	598,417,771 <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		期末	
		証券数		証券数	評価額		率
		証券数	金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		証券	証券	千スイス・フラン	千円		
CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23		87,844	-	-	-		
合計	証券数・金額	87,844	-	-	-		
	銘柄数<比率>	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中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		期末	
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
不動産ファンド		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
(アメリカ)							
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				末
		□ 数	□ 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	%
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	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	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	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	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	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	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	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	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 INVT	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	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	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	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	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	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率	
	38.352 4銘柄<0.0%>	39.445 4銘柄<0.0%>	2,156	281,590	—	0.0
合 計	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	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	額
外 国	S & P 5 0 0 E M I N I F U T		8,545		百万円 -
	S & P / T S E 6 0 I X F U T		421		百万円 -
	S P I 2 0 0 F U T U R E S		264		百万円 -
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E		536		百万円 -
	D J E U R O S T O X X 5 0		1,772		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2月15日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	率
株 式	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・シケル=35.452円、1スイス・フラン=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・クローナ=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 産	663,074,590,376円
株 式	8,092,389,228
債 券(評価額)	598,417,771,479
信 託 受 益 証 券(評価額)	1,057,641,470
資 信 託 受 益 証 券(評価額)	12,750,525,590
未 収 入 当 金	37,918,383,393
未 差 入 収 委 託 証 当 金	461,392,808
(B) 負 債	20,432,094,210
未 払 約 金	20,346,719,210
未 払 解 約 金	85,375,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	642,642,496,166
元 次 期 繰 越 損 益	113,101,593,550
(D) 受 益 権 総 額	529,540,902,616
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	113,101,593,550円
	56,820円

(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	
DIAM外国株式バッシブ・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資産ラップファンド (安定型)	20,046,091円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	11,721,611円
グローバル8資産ラップファンド (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<為替ヘッジあり>	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 (安定成長型)	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	228,421,540円
DIAM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
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	152,382,039円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	773,961,717円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,005,264,576円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	95,122,258円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	265,971,133円
DIAM 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)	686,570,224円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	133,496,940円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	172,284,428円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	172,035,194円
DIAM 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
リスクコントロール	36,245,544円
投資のソムリエ<DC年金>	294,714,139円
DIAM 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
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	31,576,270円
DIAM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)	12,968,413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
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	9,568,065円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	29,534,589円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	622,063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)	126,295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)	83,555円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	1,732,862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)	13,744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)	111,606円
インカム重視マルチアセット運用ファンド112021-04 (適格機関投資家限定)	557,287円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	57,490,733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)	75,883円
MSC iCコア・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	958,242,351円
DIAM外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	63,352,968円
DIAM外国株式バッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	1,191,786,446円
DIAM先進国株式バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,189,774,417円
外国株式バッシブ・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・私募 (適格機関投資家限定)	73,837,834円
DIAM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アセット運用ファンド (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(フランスファンド (FOF:用) (適格機関投資家専用)	2,898,910円
DIAM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
DIAM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
DIAM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
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	22,177,017円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,568,925円
DIAM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
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,953,136円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	28,909,778円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	204,390,999円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	306,392,875円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	998,858,127円
DIAM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
DIAM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
DIAM アナ 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
DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	13,689,728円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,498,392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)	128,366,149円
DIAM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
DIAM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
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)	63,324,997円
DIAM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	当	等	収	益	9,113,239,420円					
受	取	配	当	金	9,080,104,798					
受	取		利	息	12,472					
支	の	他	収	益	33,540,265					
支	払		利	息	△418,115					
(B) 有	価	証	券	売	買	損	益	89,816,332,579		
売			買				益	130,353,926,209		
売			買				損	△40,537,593,630		
(C) 先	物	取	引	等	取	引	損	益	1,292,545,584	
取				引			益	2,927,958,743		
取				引			損	△1,635,413,159		
(D) そ	の	他					費	用	△203,677,815	
(E) 当	期	損	益				金(A + B + C + D)	100,018,439,768		
(F) 前	期	繰	越				損	益	376,135,937,658	
(G) 解	約	差					損	益	金	△371,018,562,768
(H) 追	加	信	託	差			損	益	金	424,405,087,958
(I) 合							計(E + F + G + H)	529,540,902,616		
次	期	繰	越				損	益	金(I)	529,540,902,616

(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) (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)

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19期（決算日 2022年2月21日）

（計算期間 2021年2月23日～2022年2月21日）

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	ポイント 111,885.82	% 2.8	% 97.7	% -	百万円 217,863
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
19期（2022年2月21日）	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注3）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。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一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

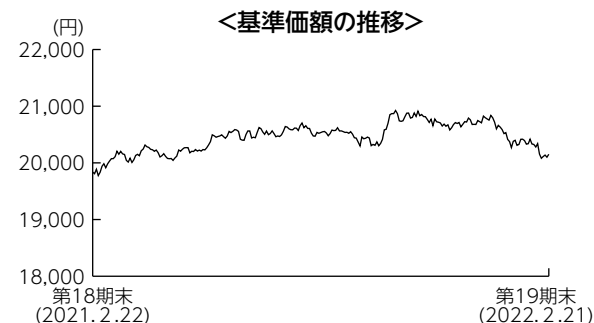
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 2 月 22 日	円 19,836	% -	ポイント 124,229.95	% -	% 98.4	% -
2 月 末	19,776	△0.3	124,359.44	0.1	99.0	-
3 月 末	20,213	1.9	126,595.03	1.9	95.3	-
4 月 末	20,206	1.9	126,569.17	1.9	97.6	-
5 月 末	20,477	3.2	128,227.80	3.2	98.9	-
6 月 末	20,443	3.1	128,117.08	3.1	97.7	-
7 月 末	20,584	3.8	128,989.36	3.8	98.8	-
8 月 末	20,579	3.7	128,937.19	3.8	98.7	-
9 月 末	20,439	3.0	128,115.00	3.1	98.8	-
10 月 末	20,879	5.3	130,788.36	5.3	98.8	-
11 月 末	20,647	4.1	129,217.14	4.0	98.6	-
12 月 末	20,775	4.7	130,157.13	4.8	99.3	-
2022 年 1 月 末	20,418	2.9	128,015.91	3.0	99.0	-
(期 末) 2022 年 2 月 21 日	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

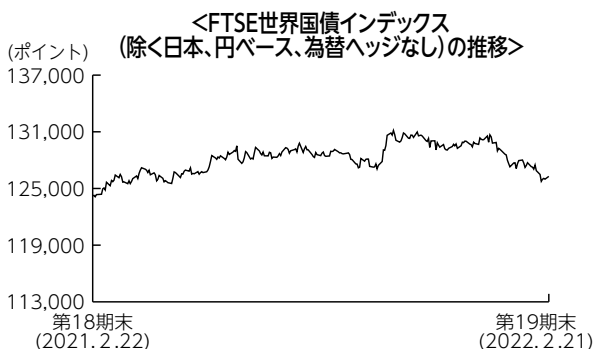


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,152円となり、前期末比で1.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

F O M C（米連邦公開市場委員会）による2022年複数回の利上げ示唆やインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもF O M Cによる早期テーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）や2022年複数回の利上げとの見方から円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことから基準価額は上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、新型コロナウイルスのオミクロン株の重症化リスクが高くない可能性があるという報告やインフレ懸念、F O M Cの早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についてもE C B（欧州中央銀行）がパンデ

ミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、F O M Cの早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて円安ドル高が進みました。ユーロ／円は、E C Bがパンデミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

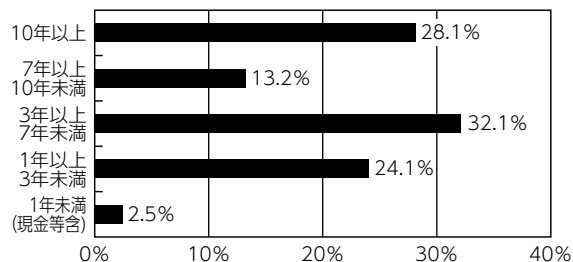
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

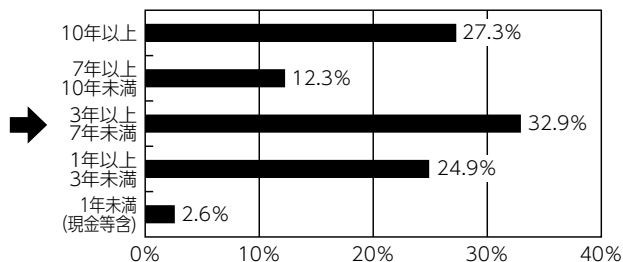
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	42.4%	43.3%	△0.9%
カナダ	2.0%	2.0%	0.0%
計	44.3%	45.2%	△0.9%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.8%	0.0%
計	0.8%	0.8%	0.0%
欧州			
オーストリア	1.5%	1.6%	△0.1%
ベルギー	2.5%	2.6%	△0.1%
フィンランド	0.6%	0.7%	0.0%
フランス	10.6%	10.7%	△0.2%
ドイツ	7.5%	7.7%	△0.2%
アイルランド	0.8%	0.9%	0.0%
イタリア	9.5%	9.8%	△0.3%
オランダ	1.8%	1.9%	△0.1%
スペイン	6.1%	6.1%	0.0%
ユーロ計	40.9%	41.9%	△1.0%
デンマーク	0.5%	0.5%	0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	0.0%
英国	6.6%	6.6%	0.0%
ポーランド	0.6%	0.7%	0.0%
ノルウェー	0.2%	0.3%	0.0%
計	49.2%	50.3%	△1.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	2.8%	2.3%	0.5%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
計	3.6%	3.2%	0.4%
中近東			
イスラエル	0.4%	0.4%	0.0%
計	0.4%	0.4%	0.0%
現金など	1.6%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

期末

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

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.013%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保 管 費 用)	(2)	(0.012)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	3	0.013	
期中の平均基準価額は20,455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23日から2022年2月21日まで)

公社債

			買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 268,986	千アメリカ・ドル 208,086	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 12,930	千カナダ・ドル 11,930	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 9,151	千オーストラリア・ドル 25,829	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,943	千シンガポール・ドル 1,051	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 17,354	千イギリス・ポンド 23,217	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 2,356	千イスラエル・シケル 2,830	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 7,060	千デンマーク・クローネ 8,562	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 4,563	千ノルウェー・クローネ 1,066	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 8,059	千スウェーデン・クローナ 9,098	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 34,009	千メキシコ・ペソ 31,722	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 69,942	千オフショア・人民元 -	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 8,092	千マレーシア・リンギット 3,048	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 6,845	千ポーランド・ズロチ 10,987	
国	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 3,107	千ユーロ 3,037
		オランダ	国債証券	8,961	7,954
		ベルギー	国債証券	8,673	9,501
		フランス	国債証券	35,154	35,216
		ドイツ	国債証券	29,446	28,519
		スペイン	国債証券	20,859	19,722
		イタリア	国債証券	34,035	34,844
		フィンランド	国債証券	1,917	1,829
	オーストリア	国債証券	5,708	5,408	

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等 (2021年2月23日から2022年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 584,890	千アメリカ・ドル 583,959	千円 67,190,361	% 47.3	% -	% 21.3	% 16.7	% 9.3	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 30,950	千カナダ・ドル 31,321	千円 2,828,620	2.0	-	1.0	0.6	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 26,270	千オーストラリア・ドル 26,417	千円 2,185,214	1.5	-	1.1	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,070	千シンガポール・ドル 7,353	千円 629,080	0.4	-	0.3	0.1	0.1	
イギリス	千イギリス・ポンド 45,350	千イギリス・ポンド 52,558	千円 8,228,549	5.8	-	4.4	0.8	0.6	
イスラエル	千イスラエル・シケル 15,260	千イスラエル・シケル 16,525	千円 593,263	0.4	-	0.2	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 29,720	千デンマーク・クローネ 34,886	千円 611,555	0.4	-	0.4	0.1	-	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 26,720	千ノルウェー・クローネ 26,440	千円 339,233	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 29,060	千スウェーデン・クローナ 31,703	千円 388,054	0.3	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 182,626	千メキシコ・ペソ 183,799	千円 1,043,651	0.7	-	0.4	0.2	0.1	
中 国	千オフショア・人民元 69,550	千オフショア・人民元 70,200	千円 1,277,451	0.9	-	0.4	0.3	0.2	
マレーシア	千マレーシア・リングギット 26,830	千マレーシア・リングギット 27,661	千円 759,920	0.5	-	0.3	0.2	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 24,380	千ポーランド・ズロチ 23,028	千円 662,640	0.5	-	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	8,040	8,505	1,108,814	0.8	-	0.6	0.2	0.1	
オランダ	17,350	19,673	2,564,646	1.8	-	1.2	0.4	0.2	
ベルギー	21,000	23,852	3,109,389	2.2	-	1.6	0.4	0.1	
フランス	95,460	106,041	13,823,543	9.7	-	6.2	2.6	0.9	
ドイツ	69,560	78,033	10,172,441	7.2	-	4.3	1.9	1.0	
スペイン	55,960	61,598	8,030,031	5.7	-	3.6	1.5	0.6	
イタリア	85,330	92,683	12,082,236	8.5	-	5.0	2.4	1.0	
フィンランド	6,020	6,268	817,158	0.6	-	0.3	0.2	0.1	
オーストリア	13,495	14,981	1,952,943	1.4	-	0.9	0.3	0.2	
合 計	-	-	千円 140,398,802	98.9	-	53.9	30.0	15.0	

(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) 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	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		末 償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
					千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,180	2,246	258,512	2026/01/31	
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	350	355	40,862	2024/01/31	
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	4,980	5,012	576,759	2023/01/31	
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	3,890	3,965	456,290	2024/01/31	
US T N/B 0.125 01/15/24	国債証券	0.1250	5,000	4,874	560,850	2024/01/15	
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	2,490	2,452	282,145	2027/01/31	
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	3,280	3,250	373,976	2025/01/31	
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	3,390	3,174	365,233	2028/01/31	
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	1,500	1,418	163,164	2026/01/31	
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	840	976	112,356	2026/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	680	768	88,430	2042/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,440	1,624	186,902	2043/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,770	1,816	208,954	2046/02/15	
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	900	1,068	122,986	2039/02/15	
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	700	902	103,811	2031/02/15	
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	630	824	94,919	2036/02/15	
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,200	1,659	190,943	2041/02/15	
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,984	228,383	2044/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,070	3,512	404,149	2049/02/15	
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	550	719	82,811	2038/02/15	
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	750	1,018	117,206	2040/02/15	
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	4,770	4,360	501,670	2051/02/15	
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	2,180	2,165	249,125	2026/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,080	2,127	244,840	2045/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,640	1,845	212,366	2047/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,540	2,886	332,094	2048/02/15	
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	5,320	5,450	627,135	2024/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	4,300	4,338	499,241	2025/02/15	
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,110	4,301	494,897	2029/02/15	
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	2,370	2,484	285,836	2028/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	4,370	4,410	507,447	2023/02/15	
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,550	3,622	416,791	2027/02/15	
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,300	1,316	151,436	2024/02/29	
US T N/B 1.5 02/28/23	国債証券	1.5000	1,000	1,003	115,513	2023/02/28	
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,550	2,616	301,058	2026/02/28	
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,660	1,710	196,774	2025/02/28	
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	1,800	1,827	210,279	2023/02/28	
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	6,860	6,409	737,420	2031/02/15	
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	4,110	3,824	440,015	2041/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,270	3,079	354,288	2050/02/15	
US T N/B 1.375 02/15/23	国債証券	1.3750	4,000	4,012	461,696	2023/02/15	
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,063	122,319	2027/02/28	
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	2,970	2,881	331,543	2030/02/15	
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	4,000	3,894	448,050	2024/02/15	
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	1,000	983	113,136	2025/02/28	
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	3,020	2,889	332,523	2028/02/29	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	2,500	2,372	273,020	2026/02/28	
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	4,080	4,130	475,221	2024/03/31	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	2,000	2,007	231,000	2023/03/31	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	2,150	2,209	254,220	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	2,260	2,297	264,403	2026/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	3,020	3,065	352,693	2023/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	1,800	1,694	195,021	2027/03/31	
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	4,810	4,686	539,213	2024/03/15	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	1,300	1,252	144,149	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	2,910	2,801	322,294	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	2,570	2,461	283,275	2026/03/31	
US T N/B 0.5 03/15/23	国債証券	0.5000	2,000	1,986	228,603	2023/03/15	
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	3,000	3,014	346,892	2023/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,760	1,798	206,967	2026/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	2,490	2,534	291,636	2023/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,350	385,452	2024/04/30	
US T N/B 0.25 04/15/23	国債証券	0.2500	2,000	1,978	227,648	2023/04/15	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	3,170	3,049	350,891	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	5,000	4,880	561,546	2024/04/15	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,000	1,868	215,027	2027/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	3,000	2,871	330,348	2026/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,000	1,916	220,510	2025/04/30	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	710	945	108,785	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	800	1,058	121,762	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,040	1,378	158,590	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	980	1,087	125,135	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	810	1,051	121,019	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	1,900	2,061	237,247	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	4,300	4,403	506,624	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,530	1,799	207,027	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	500	556	64,083	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,290	1,455	167,456	2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,810	1,857	213,700	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	1,630	1,896	218,229	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	2,100	1,727	198,775	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,090	3,463	398,477	2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	540	717	82,505	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	3,890	3,839	441,813	2041/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	2,620	2,636	303,364	2023/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	4,240	4,328	497,992	2024/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,320	3,361	386,804	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,430	4,683	538,845	2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	2,810	2,899	333,573	2029/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,700	4,824	555,104	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	500	692	79,692	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	3,090	3,067	352,896	2026/05/15	
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	2,900	2,913	335,277	2023/05/31	
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	4,770	4,816	554,195	2024/05/31	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	3,780	2,961	340,805	2050/05/15	
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,050	2,075	238,821	2026/05/31	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	6,740	6,567	755,601	2031/05/15	
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,331	383,330	2023/05/31	
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	2,530	2,620	301,472	2025/05/31	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,500	1,398	160,926	2027/05/31
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	3,000	2,960	340,582	2023/05/15
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,000	3,844	442,351	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	2,000	1,943	223,611	2024/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	4,220	3,807	438,060	2030/05/15
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	3,000	2,868	330,051	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	4,470	4,257	489,888	2025/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	3,460	3,461	398,325	2023/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	790	815	93,823	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	1,450	1,453	167,188	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	1,820	1,851	213,090	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,345	154,794	2024/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	1,540	1,434	165,079	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,000	2,881	331,507	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/15/23	国債証券	0.2500	2,800	2,762	317,851	2023/06/15
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,852	328,217	2025/06/30
US T N/B 0.25 06/15/24	国債証券	0.2500	3,780	3,666	421,912	2024/06/15
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	3,310	3,180	365,912	2026/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	1,860	1,928	221,936	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,370	2,375	273,331	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	3,690	3,704	426,196	2024/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,336	383,859	2023/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	1,600	1,573	181,003	2023/07/15
US T N/B 0.125 07/31/23	国債証券	0.1250	2,640	2,594	298,501	2023/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	3,000	2,833	326,019	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,500	3,234	372,176	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	1,000	949	109,262	2025/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	3,200	3,037	349,465	2026/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,072	123,419	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	710	871	100,296	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,110	1,379	158,727	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	430	458	52,757	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	1,750	1,982	228,144	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	790	1,056	121,546	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,170	1,420	163,489	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	3,690	3,475	399,893	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	740	809	93,126	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	2,680	2,700	310,769	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	1,880	2,034	234,124	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	1,490	1,479	170,247	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	4,330	4,405	506,928	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	3,920	3,993	459,456	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	1,710	1,675	192,809	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,710	3,085	355,027	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,530	2,583	297,208	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,090	3,047	350,619	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	3,730	3,948	454,270	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,640	1,694	194,934	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,380	3,316	381,610	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	820	825	94,960	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	2,170	2,214	254,829	2023/08/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	3,570	3,241	372,977	2041/08/15	
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	3,500	2,867	329,970	2040/08/15	
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,040	3,267	375,941	2050/08/15	
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	7,160	6,739	775,493	2031/08/15	
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	5,920	5,322	612,401	2030/08/15	
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	1,079	124,173	2026/08/31	
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,440	2,417	278,180	2024/08/31	
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	1,000	947	109,055	2025/08/31	
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	3,500	3,396	390,848	2024/08/15	
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,963	225,931	2023/08/15	
US T N/B 0.125 08/31/23	国債証券	0.1250	530	520	59,850	2023/08/31	
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,000	2,853	328,352	2028/08/31	
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	4,340	4,030	463,722	2027/08/31	
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	4,000	3,814	438,917	2026/08/31	
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,410	1,470	169,205	2025/09/30	
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,930	2,966	341,339	2024/09/30	
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	1,500	1,499	172,549	2023/09/30	
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	840	859	98,938	2023/09/30	
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,961	225,697	2023/09/15	
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	1,050	967	111,270	2027/09/30	
US T N/B 0.25 09/30/23	国債証券	0.2500	2,500	2,455	282,514	2023/09/30	
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,900	1,883	216,718	2026/09/30	
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	3,000	2,875	330,846	2028/09/30	
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,840	326,815	2025/09/30	
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	2,370	2,270	261,294	2026/09/30	
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	2,000	1,937	222,946	2024/09/15	
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	2,000	2,031	233,787	2024/10/31	
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,920	2,002	230,442	2025/10/31	
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	4,500	4,514	519,388	2023/10/31	
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	3,690	3,779	434,853	2023/10/31	
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	1,350	1,338	153,996	2026/10/31	
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,000	3,862	444,455	2028/10/31	
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,200	2,191	252,123	2024/10/31	
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,000	2,778	319,655	2027/10/31	
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	2,000	1,937	222,892	2026/10/31	
US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	0.6250	3,500	3,410	392,359	2024/10/15	
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	2,000	1,890	217,463	2025/10/31	
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	1,030	118,560	2028/11/15	
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	900	1,108	127,573	2027/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,790	1,990	229,031	2044/11/15	
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	510	663	76,330	2040/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,220	1,300	149,607	2042/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	760	857	98,608	2041/11/15	
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,360	1,682	193,639	2043/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,140	2,316	266,523	2047/11/15	
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	4,400	3,786	435,703	2050/11/15	
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	3,700	3,389	389,951	2051/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	650	726	83,611	2045/11/15	
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	920	1,011	116,391	2046/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	4,690	4,768	548,611	2024/11/15	
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	910	1,199	138,021	2039/11/15	

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	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	2,660	3,242	373,069	2048/11/15		
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	2,827	325,339	2049/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	4,690	4,767	548,526	2025/11/15		
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	3,670	3,949	454,385	2028/11/15		
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	5,520	5,642	649,272	2023/11/15		
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,140	2,157	248,248	2026/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,335	383,829	2027/11/15		
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	2,000	2,023	232,852	2023/11/30		
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	2,810	2,401	276,361	2040/11/15		
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	1,770	1,678	193,091	2041/11/15		
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,794	206,452	2026/11/30		
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	1,940	1,919	220,879	2029/11/15		
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	3,520	3,344	384,823	2031/11/15		
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	6,000	5,497	632,515	2030/11/15		
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	2,000	1,862	214,326	2027/11/30		
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	2,000	1,948	224,196	2026/11/30		
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	2,000	1,946	223,971	2028/11/30		
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	2,000	1,991	229,167	2024/11/30		
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	2,590	2,456	282,592	2025/11/30		
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	1,490	1,454	167,340	2024/11/15		
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,124	359,482	2023/12/31		
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,361	271,659	2025/12/31		
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	3,048	350,735	2024/12/31		
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	1,740	1,735	199,641	2026/12/31		
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,952	224,672	2023/12/15		
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	1,390	1,353	155,753	2026/12/31		
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,600	1,603	184,484	2024/12/31		
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	1,500	1,447	166,596	2028/12/31		
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,841	326,950	2025/12/31		
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	2,430	2,260	260,078	2027/12/31		
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	3,710	3,643	419,185	2024/12/15		
小計	—	—	584,890	583,959	67,190,361	—		
(カナダ)			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 0.25 02/01/23	国債証券	0.2500	500	495	44,751	2023/02/01		
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	200	197	17,807	2024/02/01		
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	537	48,581	2024/03/01		
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	460	462	41,759	2023/03/01		
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	692	62,548	2025/03/01		
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,300	1,228	110,932	2026/03/01		
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	400	390	35,242	2027/03/01		
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,461	131,967	2024/04/01		
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	1,000	988	89,230	2023/05/01		
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	695	62,790	2026/06/01		
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,000	1,271	114,826	2029/06/01		
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	520	715	64,624	2033/06/01		
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	390	535	48,333	2037/06/01		
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,550	1,583	143,008	2024/06/01		
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	540	695	62,770	2041/06/01		
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,212	109,543	2023/06/01		
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	420	426	38,543	2028/06/01		
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	900	918	82,937	2025/06/01		

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		
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	700	675	60,979	2027/06/01	
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	630	56,956	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	1,810	1,734	156,601	2030/06/01	
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	1,970	1,907	172,277	2031/06/01	
CANADA 0.25 08/01/23	国債証券	0.2500	700	689	62,232	2023/08/01	
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	440	439	39,675	2024/09/01	
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	880	888	80,238	2023/09/01	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,550	1,488	134,402	2025/09/01	
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,070	1,036	93,644	2026/09/01	
CANADA 0.5 11/01/23	国債証券	0.5000	620	610	55,141	2023/11/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	610	759	68,622	2045/12/01	
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	580	648	58,602	2048/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,430	2,348	212,098	2051/12/01	
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	710	639	57,733	2053/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	400	36,137	2064/12/01	
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,500	1,338	120,867	2030/12/01	
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	600	578	52,208	2031/12/01	
小計	—	—	30,950	31,321	2,828,620	—	
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	760	785	64,983	2047/03/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	190	199	16,492	2025/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	1,480	1,528	126,464	2024/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	1,810	1,985	164,228	2026/04/21	
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	1,120	1,181	97,774	2023/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,000	1,075	88,946	2029/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	880	1,073	88,815	2033/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	760	879	72,734	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	800	810	67,006	2028/05/21	
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,550	1,587	131,338	2030/05/21	
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	740	743	61,485	2041/05/21	
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	990	900	74,452	2032/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	620	672	55,650	2039/06/21	
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	1,300	1,221	101,046	2031/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	530	550	45,578	2035/06/21	
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	930	736	60,943	2051/06/21	
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	310	291	24,079	2026/09/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	1,160	1,208	99,940	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,630	1,697	140,408	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,260	1,316	108,875	2029/11/21	
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	900	855	70,797	2032/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	1,600	1,427	118,110	2031/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,450	1,370	113,335	2025/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	940	908	75,142	2024/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,560	1,409	116,583	2030/12/21	
小計	—	—	26,270	26,417	2,185,214	—	
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	280	284	24,320	2024/02/01	
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	200	201	17,243	2023/02/01	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	730	789	67,560	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	420	465	39,811	2046/03/01	
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	440	412	35,308	2050/03/01	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	380	418	35,777	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	380	396	33,923	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	340	350	29,947	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	420	428	36,631	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	470	500	42,793	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	180	185	15,907	2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	700	715	61,239	2023/07/01
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	200	193	16,586	2031/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	480	486	41,584	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	550	572	48,948	2024/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	370	395	33,869	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	280	316	27,103	2033/09/01
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	50	47	4,041	2051/10/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	200	192	16,482	2025/11/01
小 計	-	-	7,070	7,353	629,080	-
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	910	1,198	187,615	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,080	1,487	232,834	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	770	1,369	214,476	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	510	537	84,226	2049/01/22
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	760	657	102,874	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	390	365	57,179	2039/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	1,800	1,760	275,652	2024/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	400	378	59,298	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	500	468	73,305	2028/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	1,500	1,486	232,735	2023/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	800	766	119,924	2026/01/30
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,310	1,455	227,867	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	890	1,197	187,505	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	1,470	1,462	229,020	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,010	1,283	200,906	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	750	735	115,172	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,030	1,025	160,497	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	390	367	57,480	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	870	1,352	211,735	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,210	1,322	207,050	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	980	1,365	213,801	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	960	1,692	264,929	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	800	809	126,754	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	700	701	109,749	2027/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	960	954	149,441	2023/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	450	423	66,261	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,600	1,440	225,486	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	800	711	111,373	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	720	1,022	160,094	2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	980	994	155,756	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	480	497	77,913	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	790	810	126,909	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	860	1,154	180,758	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,140	1,171	183,379	2037/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	540	564	88,306	2054/10/22

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	970	724	113,407	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	500	571	89,527	2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	1,040	985	154,333	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	360	289	45,252	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	930	953	149,261	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	910	883	138,310	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	600	553	86,710	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	1,130	1,083	169,622	2026/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	560	732	114,725	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	880	1,302	203,854	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	980	1,496	234,327	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,000	1,557	243,803	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,020	1,784	279,345	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	780	910	142,526	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	860	1,240	194,254	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	870	1,118	175,105	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	850	1,379	215,906	2049/12/07
小 計	-	-	45,350	52,558	8,228,549	-
(イスラエル)		%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	1,300	1,939	69,626	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,390	1,668	59,882	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	2,610	2,729	97,979	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	2,100	2,237	80,332	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	1,350	1,299	46,637	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	2,320	2,422	86,951	2023/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	1,000	906	32,543	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,030	2,091	75,096	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	1,160	1,231	44,214	2028/09/28
小 計	-	-	15,260	16,525	593,263	-
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	2,020	1,812	31,777	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	7,580	12,594	220,783	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	5,320	5,663	99,274	2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	7,130	7,244	126,993	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	4,370	4,426	77,595	2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	3,300	3,144	55,131	2031/11/15
小 計	-	-	29,720	34,886	611,555	-
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	3,770	3,706	47,558	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	1,900	1,878	24,102	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	5,800	5,950	76,342	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,800	3,784	48,551	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	2,064	26,486	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	1,800	1,814	23,276	2023/05/24
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	3,730	3,529	45,283	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	2,750	2,691	34,538	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	1,100	1,020	13,095	2031/09/17
小 計	-	-	26,720	26,440	339,233	-
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,270	4,718	57,750	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	1,840	1,865	22,828	2028/05/12

銘柄	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)			%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	7,980	8,544	104,583	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	2,150	2,061	25,236	2031/05/12	
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	3,147	38,531	2032/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	4,700	4,821	59,017	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	3,250	3,330	40,769	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,170	3,213	39,335	2029/11/12	
小計	—	—	29,060	31,703	388,054	—	
(メキシコ)			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	22,143	20,617	117,071	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	8,000	7,945	45,118	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	17,109	17,831	101,253	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	17,000	16,945	96,218	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	17,883	101,546	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	18,000	18,103	102,793	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	11,643	11,266	63,973	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	12,654	12,543	71,223	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	13,125	13,738	78,010	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,085	6,015	34,156	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	6,000	5,948	33,775	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	19,796	20,900	118,678	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	14,059	79,832	2023/12/07	
小計	—	—	182,626	183,799	1,043,651	—	
(中国)			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	1,100	1,166	21,228	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,000	5,914	107,628	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	17,000	17,130	311,720	2026/08/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	5,000	5,024	91,437	2024/09/02	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	4,950	5,121	93,188	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	14,500	14,631	266,248	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	国債証券	2.5600	15,000	15,083	274,470	2023/10/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	3,000	3,023	55,026	2031/11/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	3,000	3,104	56,500	2027/12/03	
小計	—	—	69,550	70,200	1,277,451	—	
(マレーシア)			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	817	22,469	2027/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,239	34,042	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,208	88,140	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	1,898	52,164	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,204	33,102	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,400	1,518	41,716	2037/04/07	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,000	917	25,192	2031/04/15	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,015	55,366	2028/06/15	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,000	1,016	27,921	2024/06/14	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,505	68,829	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	2,700	2,849	78,268	2048/07/06	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,700	1,666	45,788	2034/07/05	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	2,700	2,785	76,521	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,153	59,172	2043/09/30	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	500	513	14,096	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	800	819	22,508	2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	500	532	14,619	2033/11/07	
小計	—	—	26,830	27,661	759,920	—	

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	
(ポーランド)			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,613	46,426	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	2,910	2,738	78,807	2028/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,240	64,471	2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	2,680	2,451	70,538	2025/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,180	2,068	59,511	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,343	67,436	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,250	2,097	60,362	2027/07/25	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	2,740	2,760	79,430	2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	210	194	5,590	2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	1,000	967	27,838	2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,900	2,362	67,981	2030/10/25	
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,400	1,190	34,246	2026/10/25	
小 計	-	-	24,380	23,028	662,640	-	
(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	600	715	93,311	2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	270	289	37,710	2031/03/18	
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	320	344	44,947	2024/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	710	831	108,340	2025/03/13	
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	570	596	77,813	2023/03/20	
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	220	201	26,216	2041/04/22	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	420	448	58,429	2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	340	358	46,691	2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	630	729	95,067	2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	390	405	52,905	2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	520	544	71,027	2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	640	666	86,860	2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	390	431	56,310	2037/05/15	
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	350	327	42,749	2035/05/15	
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	560	560	73,123	2027/05/15	
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	660	616	80,393	2031/10/18	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	450	436	56,912	2030/10/18	
小 計	-	-	8,040	8,505	1,108,814	-	
(ユーロ…オランダ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,130	1,820	237,294	2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,140	1,731	225,699	2047/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	610	507	66,184	2052/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	850	1,107	144,358	2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,060	1,590	207,300	2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	980	1,197	156,063	2033/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	400	366	47,727	2038/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	630	628	81,879	2040/01/15	
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	1,310	1,321	172,313	2024/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	270	265	34,662	2029/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	920	918	119,747	2027/01/15	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	450	464	60,613	2023/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,130	1,155	150,680	2026/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,130	1,194	155,728	2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,280	1,298	169,317	2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	980	1,019	132,861	2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,000	1,038	135,341	2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	790	792	103,283	2029/07/15	

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	
(ユーロ…オランダ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30		国債証券	0.0000	750	732	95,503	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31		国債証券	0.0000	540	522	68,087	2031/07/15
小 計		—	—	17,350	19,673	2,564,646	—
(ユーロ…ベルギー)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 5.5 03/28/28		国債証券	5.5000	1,190	1,579	205,883	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41		国債証券	4.2500	1,110	1,726	225,101	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26		国債証券	4.5000	430	511	66,618	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32		国債証券	4.0000	730	975	127,215	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35		国債証券	5.0000	890	1,356	176,852	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33		国債証券	1.2500	710	757	98,749	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45		国債証券	3.7500	520	802	104,603	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47		国債証券	1.6000	670	730	95,183	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50		国債証券	1.7000	670	742	96,847	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57		国債証券	2.2500	350	442	57,642	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66		国債証券	2.1500	420	528	68,887	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71		国債証券	0.6500	330	239	31,190	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26		国債証券	1.0000	1,110	1,156	150,786	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24		国債証券	2.6000	1,020	1,089	142,056	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31		国債証券	1.0000	930	967	126,153	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23		国債証券	2.2500	830	860	112,180	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28		国債証券	0.8000	670	692	90,232	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40		国債証券	0.4000	430	384	50,166	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29		国債証券	0.9000	1,050	1,091	142,303	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34		国債証券	3.0000	590	745	97,225	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38		国債証券	1.9000	520	597	77,842	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25		国債証券	0.8000	1,140	1,175	153,216	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27		国債証券	0.8000	840	869	113,351	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37		国債証券	1.4500	440	473	61,703	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30		国債証券	0.1000	800	774	101,002	2030/06/22
BELGIUM 0.5 10/22/24		国債証券	0.5000	670	684	89,179	2024/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/31		国債証券	0.0000	770	724	94,451	2031/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23		国債証券	0.2000	660	667	86,984	2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27		国債証券	0.0000	510	504	65,775	2027/10/22
小 計		—	—	21,000	23,852	3,109,389	—
(ユーロ…フランス)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23		国債証券	0.0000	900	905	118,033	2023/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/27		国債証券	0.0000	900	893	116,427	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26		国債証券	0.0000	2,460	2,459	320,568	2026/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/24		国債証券	0.0000	1,150	1,158	151,067	2024/02/25
FRANCE OAT 03/25/24		国債証券	0.0000	2,520	2,538	330,929	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25		国債証券	0.0000	2,970	2,982	388,857	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23		国債証券	0.0000	2,200	2,214	288,740	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23		国債証券	8.5000	1,030	1,139	148,583	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26		国債証券	3.5000	2,520	2,885	376,190	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41		国債証券	4.5000	2,250	3,645	475,175	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55		国債証券	4.0000	1,260	2,208	287,887	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60		国債証券	4.0000	730	1,332	173,752	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29		国債証券	5.5000	2,540	3,473	452,785	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35		国債証券	4.7500	1,550	2,325	303,111	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45		国債証券	3.2500	1,600	2,317	302,054	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48		国債証券	2.0000	1,690	2,027	264,241	2048/05/25

銘柄	当	期				末		
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額			邦貨換算金額
(ユーロ…フランス)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	2,000	2,153	280,743	2050/05/25		
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	1,890	1,661	216,658	2052/05/25		
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	650	564	73,560	2053/05/25		
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	820	934	121,829	2066/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	600	409	53,334	2072/05/25		
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	1,980	2,095	273,231	2024/05/25		
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	3,240	3,783	493,197	2030/05/25		
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	3,270	3,369	439,218	2028/05/25		
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,090	3,351	436,918	2031/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	2,490	2,541	331,291	2025/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	2,220	2,240	292,119	2029/05/25		
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,540	2,676	348,849	2034/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	2,770	2,823	368,124	2026/05/25		
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	2,460	2,568	334,893	2027/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,270	1,168	152,287	2040/05/25		
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	2,530	2,604	339,501	2023/05/25		
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	2,590	2,716	354,108	2036/05/25		
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	1,690	1,931	251,834	2039/06/25		
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	740	658	85,778	2044/06/25		
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	3,130	3,379	440,558	2023/10/25		
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	1,800	2,207	287,769	2025/10/25		
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	2,840	3,255	424,434	2027/10/25		
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,630	2,424	315,993	2038/10/25		
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,100	3,213	418,890	2032/10/25		
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,380	2,511	327,439	2024/11/25		
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,220	2,306	300,662	2025/11/25		
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,150	2,164	282,208	2026/11/25		
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	2,420	2,490	324,648	2028/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	2,330	2,190	285,531	2031/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	2,800	2,670	348,092	2030/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,550	2,465	321,428	2029/11/25		
小計	—	—	95,460	106,041	13,823,543	—		
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千円			
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	840	948	123,666	2024/01/04		
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,160	1,551	202,289	2028/01/04		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	710	1,060	138,228	2030/01/04		
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,240	1,840	239,989	2031/01/04		
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,640	2,539	331,104	2037/01/04		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,660	1,702	221,937	2025/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	1,810	1,860	242,473	2026/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,390	1,413	184,200	2029/02/15		
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	920	939	122,528	2023/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,640	1,691	220,524	2028/02/15		
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,750	1,830	238,578	2024/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	1,960	1,994	260,015	2027/02/15		
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	1,660	1,640	213,861	2031/02/15		
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,690	1,680	219,101	2030/02/15		
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	1,030	1,037	135,296	2023/04/14		
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,540	1,555	202,804	2024/04/05		
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,250	1,261	164,486	2025/04/11		
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	1,430	1,440	187,818	2026/04/10		

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,950	2,035	265,395	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	1,650	1,693	220,794	2023/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,200	1,150	149,983	2035/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,350	1,282	167,216	2036/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	710	962	125,497	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,100	1,438	187,564	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	940	1,571	204,821	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	890	1,406	183,381	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	1,760	2,588	337,393	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,140	2,048	267,093	2040/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,660	2,590	337,716	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	1,890	2,844	370,749	2046/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	340	293	38,310	2052/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	1,820	2,202	287,112	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	1,470	1,534	200,020	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,000	2,061	268,687	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,680	1,691	220,559	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,810	1,840	239,894	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	2,930	3,045	397,055	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,340	1,387	180,840	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,610	1,605	209,236	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,720	1,515	197,499	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	700	688	89,817	2031/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	400	354	46,263	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,000	1,983	258,522	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	500	497	64,872	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	450	444	57,879	2031/08/15
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,130	1,141	148,776	2024/10/18
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	1,280	1,292	168,527	2023/10/13
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	1,050	1,056	137,737	2026/10/09
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,400	1,412	184,079	2025/10/10
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	670	677	88,267	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,200	1,202	156,812	2027/11/15
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	500	499	65,155	2028/11/15
小 計	-	-	69,560	78,033	10,172,441	-
(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	1,580	2,146	279,779	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,130	1,239	161,636	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,100	1,516	197,750	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,160	1,224	159,683	2023/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,400	1,397	182,120	2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	350	340	44,369	2027/01/31
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,160	1,113	145,100	2028/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	800	789	102,872	2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,450	1,519	198,019	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,190	1,293	168,562	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,240	1,300	169,567	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,270	1,353	176,490	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,440	1,504	196,136	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,170	1,223	159,528	2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	610	580	75,615	2032/04/30

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,850	1,793	233,770	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,190	1,087	141,787	2031/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	990	995	129,797	2023/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	860	860	112,236	2024/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,370	1,703	222,091	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	970	1,494	194,794	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,250	1,907	248,683	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	920	1,238	161,501	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,370	1,577	205,608	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,460	1,580	206,074	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,220	1,776	231,601	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,240	1,383	180,316	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,310	1,367	178,225	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,200	1,268	165,354	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	1,240	1,249	162,917	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,420	1,434	187,009	2023/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	600	544	70,953	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	130	115	15,067	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,200	1,211	157,965	2027/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	1,540	1,655	215,832	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,030	1,326	172,940	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	910	1,514	197,484	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,060	1,310	170,797	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	930	1,112	145,026	2048/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	300	227	29,687	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,170	950	123,969	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,380	1,475	192,408	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,500	1,570	204,667	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,460	1,520	198,168	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,180	1,159	151,089	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	1,110	1,198	156,228	2023/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,100	1,036	135,128	2031/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,080	1,005	131,124	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,370	1,399	182,486	2030/10/31
小計	-	-	55,960	61,598	8,030,031	-
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,300	1,291	168,400	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	1,000	998	130,164	2024/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,280	1,783	232,520	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,660	2,072	270,150	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,430	1,497	195,200	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,080	1,075	140,225	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,400	1,386	180,688	2026/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,120	1,190	155,201	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,020	1,227	159,980	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,390	1,512	197,148	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	590	597	77,858	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	320	272	35,457	2072/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,790	2,031	264,838	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,630	1,872	244,062	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	1,320	1,307	170,477	2032/03/01

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	820	929	121,160	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,010	1,168	152,264	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,540	1,774	231,373	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	1,070	1,084	141,403	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	920	932	121,560	2023/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	900	839	109,392	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	770	715	93,310	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	900	771	100,534	2037/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,080	1,017	132,594	2028/03/15
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	590	504	65,821	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,110	1,093	142,518	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,000	930	121,342	2031/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国債証券	0.0000	1,000	994	129,643	2024/04/15
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	990	956	124,655	2026/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	1,470	2,019	263,279	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,480	192,978	2023/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	810	839	109,403	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,340	1,378	179,643	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,100	1,135	148,013	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,460	1,504	196,073	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	920	974	127,019	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	240	220	28,724	2032/06/01
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	国債証券	0.6000	500	505	65,929	2023/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	680	716	93,373	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,239	161,638	2024/07/01
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	500	475	61,960	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	900	937	122,157	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,610	2,160	281,700	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,330	1,875	244,464	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,034	265,239	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,040	1,092	142,411	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,330	1,478	192,718	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,610	1,450	189,092	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,170	1,107	144,315	2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	1,000	1,006	131,207	2023/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	600	576	75,134	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	940	1,041	135,760	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	970	1,387	180,919	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	990	1,153	150,425	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,680	2,044	266,502	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,390	1,982	258,409	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	970	968	126,221	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	900	761	99,299	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,140	1,209	157,653	2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	400	371	48,394	2052/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,210	1,313	171,238	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	570	731	95,390	2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	690	707	92,242	2036/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,430	1,417	184,755	2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	980	991	129,249	2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	930	967	126,187	2023/10/01

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…イタリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,190	1,370	178,690	2023/11/01	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	350	452	58,980	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,790	2,321	302,647	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	2,050	2,626	342,385	2029/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	1,040	1,068	139,252	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	550	586	76,490	2025/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	970	1,017	132,608	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,230	1,249	162,836	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	1,170	1,236	161,223	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,000	1,096	142,937	2028/12/01	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	1,180	1,093	142,509	2031/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,480	1,477	192,595	2030/12/01	
小計	-	-	85,330	92,683	12,082,236	-	
(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	220	177	23,186	2052/04/15	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	260	273	35,684	2024/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	250	256	33,383	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	280	318	41,553	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	490	500	65,291	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	290	306	39,982	2034/04/15	
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	470	481	62,729	2023/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	260	238	31,114	2036/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	430	491	64,026	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	420	488	63,688	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	250	339	44,288	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	370	374	48,819	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	330	341	44,573	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	100	101	13,230	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	500	510	66,608	2027/09/15	
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	280	282	36,810	2023/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	230	208	27,147	2040/09/15	
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	240	230	30,093	2031/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	170	163	21,288	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	180	181	23,654	2024/09/15	
小計	-	-	6,020	6,268	817,158	-	
(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	210	398	51,885	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	430	490	63,891	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	770	778	101,527	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	775	799	104,275	2028/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	530	505	65,876	2031/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	690	666	86,824	2030/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	740	890	116,106	2026/03/15	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	890	1,328	173,218	2037/03/15	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	290	274	35,831	2051/03/20	
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	250	203	26,524	2071/04/20	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	650	664	86,564	2027/04/20	
AUSTRIA 0.0 04/20/23	国債証券	0.0000	200	201	26,239	2023/04/20	
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	70	70	9,164	2025/04/20	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	680	821	107,048	2034/05/23	
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	250	183	23,878	2120/06/30	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	470	695	90,658	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	670	894	116,617	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	650	654	85,320	2023/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	800	806	105,126	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	350	469	61,196	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	450	473	61,744	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	480	495	64,647	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	640	670	87,454	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	140	128	16,772	2036/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	780	808	105,434	2023/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	300	254	33,233	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	190	186	24,248	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	150	165	21,628	2086/11/02
小 計	—	—	13,495	14,981	1,952,943	—
合 計	—	—	—	—	140,398,802	—

■投資信託財産の構成

2022年2月21日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 140,398,802	% 98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,603,315	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	142,002,117	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、141,683,656千円、99.8%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21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.06円、1カナダ・ドル=90.31円、1オーストラリア・ドル=82.72円、1シンガポール・ドル=85.55円、1イギリス・ポンド=156.56円、1イスラエル・シェケル=35.899円、1デンマーク・クローネ=17.53円、1ノルウェー・クローネ=12.83円、1スウェーデン・クローナ=12.24円、1メキシコ・ペソ=5.678円、1オフショア・人民元=18.197円、1マレーシア・リングgit=27.471円、1ポーランド・ズロチ=28.774円、1ユーロ=130.36円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	142,002,117,999円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	794,768,295
公 社 債(評価額)	140,398,802,240
未 収 利 息	769,298,727
前 払 費 用	39,248,737
(B) 負 債	37,199,000
未 払 解 約	37,199,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	141,964,918,999
元 本	70,448,298,510
次 期 繰 越 損 益	71,516,620,489
(D) 受 益 権 総 口 数	70,448,298,510口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	20,152円

(注1) 期首元本額	69,085,269,493円	DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	154,405,852円
追加設定元本額	27,244,251,872円	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	340,795,660円
一部解約元本額	25,881,222,855円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	412,429,256円
(注2) 期末における元本の内訳		9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	180,716,406円
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	7,932,936,286円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	87,293,544円
MITOラップ型ファンド(安定型)	10,339,634円	DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,181,097,770円
MITOラップ型ファンド(中立型)	40,206,625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)	515,001円
MITOラップ型ファンド(積極型)	116,655,366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)	358,315円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	57,288,539円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	100,794,148円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,587,798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)	418,167円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,681,845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)	546,045円
たわらノーロード 先進国債券	13,393,825,381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)	30,957,907円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	237,469,433円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型) 21-06	461,773,967円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,697,389,145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)	294,771円
たわらノーロード バランス (堅実型)	48,164,130円	DIAM海苔フルレンジ外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	5,739,805,045円
たわらノーロード バランス (標準型)	234,951,241円	DIAM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,636,710,982円
たわらノーロード バランス (積極型)	48,864,225円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,562,881,929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)	6,482,910円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,405,812,637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)	328,688,088円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	53,529,486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)	382,425,252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)	645,235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)	74,160,647円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	421,372,128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)	2,643,196円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	250,634,953円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	364,777円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	17,641,800円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,078,910円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	41,091,423円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	26,244,851円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	8,714,858円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,149,968円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	681,339円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,109,913円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	16,361,009円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,296,983,167円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	48,455,016円
One DC 先進国債券インデックスファンド	579,039,841円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,982,846,491円
Oneグローバルバランス	6,106,309円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,578,600,509円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	711,700,267円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,769,411,536円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,226,508,317円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	118,777,737円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,403,942,419円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	155,311,687円
DIAM DCバランス30インデックスファンド	398,546,899円	DIAMアクサグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,842,758,601円
DIAM DCバランス50インデックスファンド	832,352,900円	DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	419,588,655円
DIAM DCバランス70インデックスファンド	708,824,350円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,247,697円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	14,028,565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)	357,842,695円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	469,729,710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)	352,697,590円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	33,691,463円	DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	479,890,739円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	134,924,668円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	57,398,790円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	124,156,154円	期末元本合計	70,448,298,510円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	214,713,670円		
フルーズコントロール	314,234,233円		

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,669,252,055	円
	受取利息	2,669,419,651	
	支払利息	△167,596	
(B)	有価証券売買損益	△631,639,253	
	売却益	7,707,170,489	
	売却損	△8,338,809,742	
(C)	その他の費用	△18,689,995	
(D)	当期損益金(A+B+C)	2,018,922,807	
(E)	前期繰越損益金	67,952,264,861	
(F)	解約差損益金	△26,936,052,307	
(G)	追加信託差損益金	28,481,485,128	
(H)	計(D+E+F+G)	71,516,620,489	
	次期繰越損益金(H)	71,516,620,489	

(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シブ・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シブ・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		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 総額
	円	%	（円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	（円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク）				
10期(2018年4月18日)	12,241	20.9	ポイント	%	%	%	%	百万円
11期(2019年4月18日)	12,260	0.2	273,007.15	21.9	92.1	7.1	0.7	66,443
12期(2020年4月20日)	12,260	0.2	276,323.22	1.2	94.4	4.4	0.6	61,535
13期(2021年4月19日)	9,723	△20.7	225,442.54	△18.4	64.7	34.8	0.4	41,166
14期(2022年4月18日)	14,848	52.7	347,921.32	54.3	93.2	6.1	0.7	58,156
	14,507	△2.3	343,415.90	△1.3	84.0	15.2	0.6	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

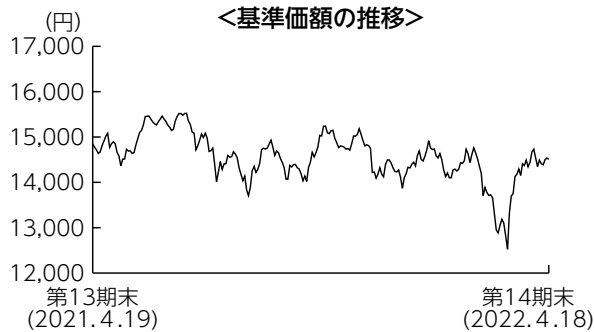
年 月 日	基 準 価 額		MSCIエマージング・ マーケット・インデックス (円換算ベース、 配当込み、 為替ハッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期 首) 2021年 4 月19日	円 14,848	% -	ポイント 347,921.32	% -	% 93.2	% 6.1	% 0.7
4 月 末	15,081	1.6	353,070.95	1.5	92.6	6.7	0.7
5 月 末	15,145	2.0	355,462.51	2.2	89.3	10.6	0.7
6 月 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) 騰落率は期首比です。

(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）

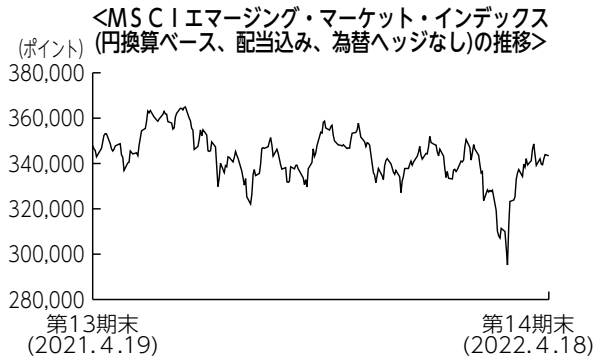


基準価額の推移

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た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MSCIE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 リ	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 ン 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 ェ 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・リングgit 27,434 (-)	百株 58,387.71	千マレーシア・リングgit 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 イ	百株 114,059 (-)	千タイ・パーツ 334,982 (△82)	百株 120,757	千タイ・パーツ 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 ギ リ シ ャ	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	イ	135,777	千タイ・パーツ 82	145,242 (-)	千タイ・パーツ 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	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
メキシコ		千□	千メキシコ・ペソ	千□	千メキシコ・ペソ
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	157.9	26,174	165.6	26,352	
GRUPO TELEVISIA SAB	(-)	(-)	(-)	(-)	
CEMEX SAB DE CV	142.6	6,842	163.7	7,271	
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	(-)	(-)	(-)	(-)	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	1,334.6	18,177	1,428.3	17,273	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	(-)	(-)	(-)	(-)	
	18.1	1,255	21.1	1,558	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
	61.5	1,312	67.4	1,513	
	(-)	(△63)	(-)	(-)	
	58.1	6,152	71.3	7,478	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
ブラジル		千□	千ブラジル・レアル	千□	千ブラジル・レアル
SUL AMERICA SA	-	-	15.356	516	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	(-)	(-)	(-)	(-)	
ENERGISA SA	23.4	916	12.8	469	
KLABIN SA	(-)	(-)	(-)	(-)	
BANCO INTER SA	11.7	547	21.1	962	
GETNET ADQUIRENCIA E SERVICOS	(-)	(-)	(-)	(-)	
BANCO BTG PACTUAL SA	19.1	468	17.3	471	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
	10.2	758	2.2	399	
	(9)	(-)	(-)	(-)	
	-	-	5.275	29	
	(5.275)	(-)	(-)	(-)	
	65	2,107	60.4	1,491	
	(50.1)	(-)	(-)	(-)	
南アフリカ		千□	千南アフリカ・ランド	千□	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		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	
TRIP.COM GROUP LTD ADR	294.2	289.44	669	84,845	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・生活必需品小売り
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・生活必需品小売り
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	インタラクティブ・メディアおよびサービス
YANDEX NV	190.65	256.01	484	61,424	インタラクティブ・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	インタラクティブ・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
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	235.57	342.05	167	21,275	娯楽
AUTOHOME INC ADR	37.89	38.67	110	13,936	インタラクティブ・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
I-MAB 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	インタラクティブ・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	インタラクティブ・メディアおよびサービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
RLX TECHNOLOGY INC ADR	80	490.92	101	12,811	タバコ	
DIDI GLOBAL INC ADR	—	268.13	65	8,355	陸運・鉄道	
KE HOLDINGS INC ADR	68.69	205.47	288	36,544	不動産管理・開発	
CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	—	63.36	34	4,358	情報技術サービス	
DADA NEXUS LTD ADR	—	41.79	38	4,859	インターネット販売・通信販売	
JD.COM INC ADR	528.21	—	—	—	インターネット販売・通信販売	
LEGEND BIOTECH CORP ADR	—	33.09	134	17,035	バイオテクノロジー	
LI AUTO INC ADR	121.2	320.49	823	104,381	自動車	
XPENG INC ADR	93.72	224.58	604	76,615	自動車	
OZON HOLDINGS PLC ADR	—	45.37	52	6,667	インターネット販売・通信販売	
LUFAX HOLDING LTD ADR	112.72	328.01	179	22,687	消費者金融	
GLOBANT SA	21.45	—	—	—	情報技術サービス	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	1,154.1	—	—	—	インターネット販売・通信販売	
HELLO GROUP INC ADR	77.93	126.41	61	7,814	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
BAOZUN INC-SPN ADR	41.12	—	—	—	インターネット販売・通信販売	
PINDUODUO INC ADR	240.48	253.68	1,015	128,641	インターネット販売・通信販売	
YUM CHINA HOLDINGS INC	244.85	243.75	1,019	129,194	ホテル・レストラン・レジャー	
IQIYI INC ADR	154.4	154.4	63	8,058	娯楽	
POLYUS PJSC GDR	39.46	67.87	26	3,353	金属・鉱業	
HUTCHMED CHINA LTD ADR	37.61	61.36	105	13,385	医薬品	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	256.08	245.84	646	81,937	航空貨物・物流サービス	
BEIGENE LTD ADR	28.31	25.97	473	59,994	バイオテクノロジー	
小計	株数 銘柄数	金額 比率	19,505.23	22,283.08	15,303	1,938,597
	66銘柄	64銘柄	—	—	—	<3.1%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
JIANGXI COPPER CO LTD	670	670	946	15,278	金属・鉱業	
JIANGSU EXPRESS	900	900	741	11,976	運送インフラ	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	1,620	1,800	846	13,662	旅客航空輸送業	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	64	64	672	10,860	飲料	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	785	735	3,109	50,211	建設資材	
BEIJING ENTERPRISES	215	150	406	6,564	ガス	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	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	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	2,580	1,980	950	15,348	インターネット販売・通信販売	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	700	1,080	2,808	45,349	石油・ガス・消耗燃料	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	460	515.9	877	14,164	不動産管理・開発	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	405	330	1,207	19,505	パーソナル用品	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,420	1,420	0	0	自動車	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	5,656	5,036	4,285	69,213	医薬品	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	2,436.2	2,321.2	6,302	101,778	不動産管理・開発	
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,988.88	1,908.88	7,511	121,309	不動産管理・開発	
CITIC LTD	3,470	3,300	2,877	46,473	コングロメリット	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	960	680	318	5,139	運送インフラ	
LENOVO GROUP LTD	4,540	4,120	3,193	51,566	コンピュータ・周辺機器	
PETRO CHINA CO LTD	11,200	11,920	4,863	78,543	石油・ガス・消耗燃料	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	1,121.9	1,105.9	1,066	17,217	保険	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	15,432	13,872	5,548	89,613	石油・ガス・消耗燃料	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	490	370	449	7,254	情報技術サービス	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	1,530	1,430	2,293	37,043	ソフトウェア	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	501	451	4,929	79,610	ガス	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	2,080	2,760	1,854	29,953	ガス	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,520	740	436	7,051	運送インフラ	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	3,160	1,252	1,116	18,036	不動産管理・開発	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	1,140	740	1,040	16,803	運送インフラ	
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD	1,460	2,440	1,168	18,875	金属・鉱業	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	870	760	1,843	29,764	不動産管理・開発	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	910	965	837	13,527	運送インフラ	
CHINA EVERBRIGHT LTD	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		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,654	1,570	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	インタラクティブ・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
SHENZHOU 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)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	495	—	—	—	金属・鉱業
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	535	535	667	10,783	電子装置・機器・部品
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	1,676	1,676	581	9,392	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	—	1,020	750	12,124	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	330	250	474	7,655	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	313	446	1,168	18,871	電気設備
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	4,941.42	4,741.42	2,915	47,092	不動産管理・開発
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	2,400	2,370	1,080	17,453	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	5,968	5,798	2,359	38,110	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	650	1,380	487	7,867	不動産管理・開発
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	448	403	4,465	72,113	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	670	610	5,679	91,717	繊維・アパレル・贅沢品
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	200	200	364	5,878	家庭用品
FOSUN INTERNATIONAL	1,430.28	1,080.28	896	14,480	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	3,000	3,060	853	13,787	不動産管理・開発
CHINA AOYUAN GROUP LTD	850	—	—	—	不動産管理・開発
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	1,620	2,640	934	15,093	繊維・アパレル・贅沢品
KINGSOFT CORP LTD	520	492	1,170	18,911	娯楽
SINOTRUK HONG KONG LTD	350	340	318	5,139	機械
CHINA RAILWAY GROUP LTD	3,180	2,350	1,203	19,431	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	1,010	1,110	788	12,727	食品
DONGYUE GROUP	—	780	693	11,198	化学
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	425	475	715	11,552	通信機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	2,840	2,520	1,695	27,389	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	1,604	1,570	3,011	48,631	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,100	—	—	—	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD - H	—	2,390	700	11,309	機械
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	980	610	718	11,605	医薬品
SUN ART RETAIL GROUP LTD	835	2,265	586	9,474	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO	760	672	1,185	19,144	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	—	1,690	799	12,909	石油・ガス・消耗燃料
CHINA RESOURCES CEMENT	1,120	1,040	693	11,202	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
ZOOMLION 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		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	1,065	2,165	1,028	16,608	資本市場
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	9,860	9,860	0	0	半導体・半導体製造装置
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	3,230	3,230	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
HAIDLAO 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
HANSHI 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	インタラクティブ・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 MIXC 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)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
GF SECURITIES CO LTD	682	682	761	12,291	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	252	276	808	13,060	自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD	484	924	1,069	17,280	資本市場
3SBIO INC	905	905	576	9,310	バイオテクノロジー
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	940	—	—	—	医薬品
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,610	—	—	—	資本市場
CHINA LITERATURE LTD	162	284	917	14,814	メディア
FLAT GLASS GROUP CO LTD	—	340	1,004	16,225	半導体・半導体製造装置
DALI FOODS GROUP CO LTD	1,465	1,465	597	9,653	食品
CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	640	—	—	—	各種消費者サービス
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	650	650	648	10,466	不動産管理・開発
BOC AVIATION LTD	107	105	639	10,327	商社・流通業
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	262	340	892	14,413	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	540	900	1,101	17,790	自動車
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	688	796	1,437	23,216	資本市場
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2,015	2,070	13,165	212,617	ライフサイエンス・ツール/サービス
GANFENG LITHIUM CO LTD	—	132	1,362	22,000	金属・鉱業
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	519,873.43 202銘柄	518,431.88 200銘柄	728,718 —	11,768,810 <18.7%>
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	320	270	6,048	26,299	通信機器
ACER INC	2,065.32	1,515.32	4,258	18,515	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	445.54	415.54	14,814	64,417	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	266.16	246.16	9,797	42,602	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	1,319.28	1,159.28	5,437	23,642	建設資材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	190	—	—	—	電子装置・機器・部品
TAIWAN BUSINESS BANK	4,572.67	—	—	—	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	540	480	5,184	22,542	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	380	450	5,422	23,579	コンピュータ・周辺機器
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	770	700	14,350	62,399	電子装置・機器・部品
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	479.75	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
QUANTA COMPUTER INC	1,818.58	1,558.58	13,388	58,217	コンピュータ・周辺機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	807.77	—	—	—	不動産管理・開発
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	437.6	387.6	5,678	24,691	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,447.61	2,262.08	4,241	18,443	銀行
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	841.69	1,371.69	4,698	20,428	自動車部品
CHINA STEEL CORP	7,590.58	6,900.58	27,291	118,675	金属・鉱業
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	889.73	—	—	—	保険
ADVANTECH CO LTD	206.75	216.75	7,943	34,543	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS INC	2,133.04	2,283.04	5,810	25,265	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,206.63	1,136.63	28,358	123,315	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CORP	790	900	5,751	25,007	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,234.27	2,304.27	29,840	129,757	各種電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	5,371.94	4,671.94	8,900	38,700	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	958	1,158	12,216	53,123	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP	1,278.2	1,478.2	20,916	90,953	海運業
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,688.24	1,658.24	5,041	21,920	コンプロマリット
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	217.68	317.68	6,178	26,868	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE CO LTD	113.22	103.22	4,815	20,938	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	352.85	322.85	12,914	56,155	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	2,426.33	2,236.33	23,481	102,106	化学
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	2,265.94	2,065.94	16,382	71,239	化学
GIANT MANUFACTURING	161.51	211.51	5,488	23,866	レジャー用品
MEDIATEK INC	915.07	895.07	74,469	323,824	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	4,169.36	4,459.42	33,490	145,628	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	4,669.44	4,927.52	11,949	51,960	銀行
HOTAI MOTOR CO LTD	190	170	9,826	42,727	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		
			外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額		
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル 千円		
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	890	890	6,719	29,219	無線通信サービス
YUANITA 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・生活必需品小売り
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
SYNNEX 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
EMEMORY 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
WIWYNN 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		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 120	百株 110	千台湾・ドル 3,355	千円 14,588	家庭用耐久財
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 195,688.08 87銘柄	187,786.5 86銘柄	1,896,266 -	8,245,725 <13.1%>	
(イギリス) POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	百株 156.67	百株 -	千イギリス・ポンド -	千円 -	金属・鉱業
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 156.67 1銘柄	-銘柄	-	<-%>	
(トルコ) AKBANK TAS	百株 2,388.37	百株 2,388.37	千トルコ・リラ 2,245	千円 19,452	銀行
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	448.98	448.98	1,236	10,713	航空宇宙・防衛
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	961.86	891.95	3,148	27,281	金属・鉱業
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	46.68	46.68	1,428	12,376	自動車
KOC HOLDING AS	537.7	537.7	2,190	18,980	コングロマリット
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	900	510.26	888	7,701	コングロマリット
TURK HAVA YOLLARI	442.06	-	-	-	旅客航空輸送業
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	626.54	486.15	1,123	9,738	無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI AS	1,141.53	1,814.55	2,522	21,854	銀行
TURKIYE IS BANKASI	662.05	911.35	982	8,512	銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	62.01	59.02	1,532	13,280	石油・ガス・消耗燃料
YAPI VE KREDI BANKASI AS	2,392.3	-	-	-	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING AS	210.58	-	-	-	銀行
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	277.55	217.03	1,837	15,918	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 11,098.21 14銘柄	8,312.04 11銘柄	19,136 -	165,812 <0.3%>	
(メキシコ) ALFA SAB DE CV	百株 -	百株 2,223	千メキシコ・ペソ 3,281	千円 20,821	コングロマリット
GRUPO BIMBO SAB DE CV	850	869	5,021	31,862	食品
GRUMA SAB DE CV	106.15	103.6	2,642	16,770	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	164.6	178.6	2,825	17,927	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV	349	349	2,499	15,859	コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	1,621	1,514	20,706	131,400	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	530.25	784.25	3,961	25,136	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	76.35	83.35	2,084	13,230	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	863	753	2,138	13,570	家庭用品
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	120.4	112.9	4,685	29,733	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV	1,939.52	1,832.52	19,703	125,030	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE CV	21,166.78	18,088.78	39,994	253,791	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	966	1,227	4,979	31,596	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	231	235	2,906	18,446	飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	3,200	3,093	24,082	152,817	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	240.85	202.95	6,183	39,238	運送インフラ
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	292	-	-	-	ガス
TELESITES SAB DE CV	773	-	-	-	各種電気通信サービス
OPERADORA DE SITIOS MEXICANOS SA DE CV	-	773	2,011	12,763	各種電気通信サービス
BECLÉ SAB DE CV	384	384	1,838	11,664	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 33,873.9 18銘柄	32,806.95 18銘柄	151,545 -	961,661 <1.5%>	
(フィリピン) AYALA LAND INC	百株 4,255	百株 4,567	千フィリピン・ペソ 15,527	千円 37,693	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	943.3	1,133.3	6,533	15,860	コングロマリット
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	1,075.2	937.2	9,231	22,409	銀行
AYALA CORP	185.83	153.73	11,806	28,660	コングロマリット
GLOBE TELECOM INC	14.2	25.7	6,291	15,272	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	461.2	550.3	12,128	29,442	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,934.8	1,578.4	8,760	21,265	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORP	325.9	339.4	7,432	18,043	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST	615.75	800.15	4,400	10,683	銀行

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
BDO UNIBANK INC	1,222.33	1,088.33	13,985	33,948	銀行
MEGAWORLD CORP	8,790	-	-	-	不動産管理・開発
PLDT INC	52.6	52.6	9,636	23,392	無線通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	6,363.75	5,967.75	21,961	53,311	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	548.4	425.5	4,999	12,136	食品
SM INVESTMENTS CORP	164.63	130.43	11,380	27,624	コンプロマリット
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	9,019	9,019	3,454	8,385	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP	957	-	-	-	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MANILA ELECTRIC COMPANY	177.1	177.1	6,414	15,571	電力
PUREGOLD PRICE CLUB INC	676	-	-	-	食品・生活必需品小売り
GT CAPITAL HOLDINGS INC	66.01	66.01	3,379	8,204	コンプロマリット
AC ENERGY CORP	-	6,894	5,859	14,224	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MONDE NISSIN CORP	-	3,147	4,191	10,175	食品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	37,848 20銘柄	37,052.9 19銘柄	167,375 -	406,304 <0.6%>
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	36,313.83	36,020.92	158,095	24,577	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	27.73	30.95	88,857	13,813	銀行
BANCO DE CHILE	27,690.44	25,409.25	220,552	34,286	銀行
EMPRESAS CMPC SA	601.53	630.23	86,656	13,471	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	224.18	191.38	129,081	20,066	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	105.81	105.81	61,845	9,614	飲料
ENEL AMERICAS SA	19,059.81	15,968.88	144,518	22,466	電力
COLBUN SA	5,804.23	-	-	-	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
EMBOTELLADORA ANDINA SA	200.26	-	-	-	飲料
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	74.92	78.85	534,642	83,114	化学
FALABELLA SA	561.57	488.73	125,212	19,465	複合小売り
CENCOSUD SA	811.21	759.72	114,109	17,739	食品・生活必需品小売り
CENCOSUD SHOPPING SA	292.31	-	-	-	不動産管理・開発
ENEL CHILE SA	14,696.15	29,777.57	68,190	10,600	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	106,463.98 14銘柄	109,462.29 11銘柄	1,731,764 -	269,218 <0.4%>
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	231.25	212.84	529,971	17,934	電力
ECOPETROL SA	2,812.3	3,126.78	1,046,220	35,405	石油・ガス・消耗燃料
BANCOLOMBIA SA	129.5	120.06	524,662	17,755	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	309.57	270.16	1,099,010	37,191	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	228.2	103.99	372,596	12,609	各種金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,710.82 5銘柄	3,833.83 5銘柄	3,572,461 -	120,895 <0.2%>
(クウェート)	百株	百株	千クウェート・ディナール	千円	
KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	2,546.84	3,443.16	340	141,574	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	1,262.48	1,229.02	82	34,234	無線通信サービス
GULF BANK KSCP	1,426.6	-	-	-	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	4,183.85	4,310.49	448	186,556	銀行
AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	532.37	688.52	83	34,894	航空貨物・物流サービス
MABANEH CO KPSC	532.93	272.82	23	9,856	不動産管理・開発
BOUBYAN BANK KSCP	839.09	602.72	54	22,752	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,324.16 7銘柄	10,546.73 6銘柄	1,033 -	429,869 <0.7%>
(カタール)	百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR NATIONAL BANK	2,728.04	2,704.78	6,453	224,391	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	902.99	1,090.64	839	29,199	銀行
OOREDOO QSC	400.49	438.16	311	10,831	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	284.78	295.91	545	18,972	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	246.05	271.76	493	17,150	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	510.28	340.3	418	14,541	銀行

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カタル)	百株	百株	千カタル・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>	株数・金額 銘柄数<比率>	15,655	544,329	
			12銘柄	<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>	株数・金額 銘柄数<比率>	71,127	2,406,954	
			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		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(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		複合小売り
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
CIPLA 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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円			
YES BANK LTD	7,148.5	7,148.5	17,369	17,369			銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	345.17	414.63	15,308	25,564			建設資材
BHARAT FORGE LTD	158.49	180.24	13,212	22,064			自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	967.13	924.72	50,559	84,433			金属・鉱業
ITC LTD	1,874.66	1,739.81	46,896	78,317			タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	86.76	84.2	19,922	33,269			化学
UNITED PHOSPHORUS LTD	297.92	279.32	22,866	38,187			化学
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	25.21	39.29	11,195	18,696			医薬品
SIEMENS INDIA LTD	36.37	36.01	8,883	14,835			コンプロマリット
INFO EDGE INDIA LTD	42.16	52.47	24,943	41,655			インタラクティブ・メディアおよびサービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	257.69	229.9	18,078	30,190			パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	406.6	366.01	51,623	86,211			情報技術サービス
MINDTREE LTD	-	36.05	14,776	24,677			情報技術サービス
MARICO LTD	266.96	362.41	18,834	31,453			食品
PAGE INDUSTRIES LTD	3.78	2.91	13,041	21,779			繊維・アパレル・贅沢品
DLF LTD	337.09	354.05	13,853	23,136			不動産管理・開発
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,403.37	1,788.14	41,037	68,533			電力
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE 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
JUBILANT FOODWORKS LTD	43.88	49.14	18,168	30,341			自動車
MUTHOOT FINANCE LTD	57.44	40.89	11,370	19,989			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	24.25	40.12	8,819	14,728			資本市場
ADANI TOTAL GAS LTD	389.9	377.5	12,312	20,561			銀行
GODREJ PROPERTIES LTD	-	158.08	39,533	66,020			ガス
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	-	69.71	11,176	18,664			不動産管理・開発
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	-	222.29	16,233	27,110			消費者金融
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	-	166.24	13,856	23,141			消費者金融
ZOMATO LTD	-	129.53	10,107	16,879			商業サービス・用品
BERGER PAINTS INDIA LTD	-	1,256.44	10,541	17,604			インターネット販売・通信販売
ADANI TRANSMISSIONS LTD	125.56	109.81	7,951	13,279			化学
AVENUE SUPERMARTS LTD	-	157.9	42,486	70,953			電力
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	88.1	92.95	38,024	63,501			食品・生活必需品小売り
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	115.17	113.49	15,419	25,750			保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	190.44	276.04	14,933	24,939			保険
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	48.93	77.33	14,686	24,526			旅客航空輸送業
	240.46	251.49	28,843	48,168			保険
小計	株数	株数	金額	金額			
	50,386.72	52,387.94	4,299,658	7,180,430			
	96銘柄	106銘柄	-	<11.4%>			
(パキスタン)	百株	百株	千パキスタン・ルピー	千円			
MCB BANK LTD	124	-	-	-			銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	218.68	-	-	-			石油・ガス・消耗燃料
HABIB BANK LTD	193	-	-	-			銀行
小計	株数	株数	金額	金額			
	535.68	-	-	-			
	3銘柄	1銘柄	-	<-%>			
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円			
ANEKA TAMBANG TBK PT	5,717	5,717	1,589,326	14,145			金属・鉱業
BARITO PACIFIC TBK PT	14,709	14,484	1,260,108	11,214			化学
UNITED TRACTORS TBK PT	848.01	905.01	2,696,929	24,002			石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	3,529	3,529	2,161,512	19,237			食品

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	
(インドネシア)	百株	百株	千円	千円	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	4,805	4,854	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
SEMEN 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)	百株	百株	千円	千円	
ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	1,142.69	732.54	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
EMAAR 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
EMAAR 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)	百株	百株	千円	千円	
BRF SA	296.92	472.92	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		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円			
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2,994.47	2,871.47	7,560	203,688			銀行
AMERICANAS SA	154	361.71	1,018	27,431			インターネット販売・通信販売
BRASKEM SA	-	123	536	14,457			化学
ENGIE BRASIL SA	179.87	73.87	325	8,770			独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALPARGATAS SA	85	194	440	11,859			繊維・アパレル・贅沢品
LOCALIZA RENT A CAR	389.89	352.89	2,017	54,362			陸運・鉄道
LOJAS RENNER SA	450.37	563.2	1,505	40,572			複合小売り
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	379.04	559.04	839	22,621			石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA	144	575	1,332	35,892			石油・ガス・消耗燃料
TOTVS SA	236	279	976	26,307			ソフトウェア
EQUATORIAL ENERGIA SA	685	560	1,449	39,059			電力
JBS SA	695	483	1,858	50,071			食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	508.69	588.17	909	24,497			電力
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	179.98	188.98	950	25,599			水道
HYPERA SA	182	195	755	20,351			医薬品
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	1,271.16	3,546.48	5,138	138,445			資本市場
MAGAZINE LUIZA SA	1,810	1,682	1,010	27,234			複合小売り
HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	-	386	961	25,893			石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA BRASIL SA	322.28	286.28	1,538	41,440			各種電気通信サービス
VIA S/A	683	-	-	-			専門小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	423	458	1,198	32,278			保険
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	591	2,456.61	2,554	68,830			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	299	299	690	18,615			食品・生活必需品小売り
AMBEV SA	2,925.95	2,773.95	4,077	109,857			飲料
NATURA &CO HOLDING SA	571	498	1,245	33,541			パーソナル用品
TIM SA	622	466	636	17,149			無線通信サービス
REDE D'OR SAO LUIZ SA	-	222	942	25,400			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
RUMO SA	797	855	1,573	42,383			陸運・鉄道
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	109,231 44銘柄	2,942,785 -			<4.7%>
(チェコ)	百株	百株	千チェコ・コルナ	千円			
KOMERCNI BANKA AS	62.5	36.64	3,057	17,113			銀行
CEZ	98.49	88.2	8,837	49,463			電力
MONETA MONEY BANK AS	269.89	269.89	2,469	13,821			銀行
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	14,364 3銘柄	80,398 -			<0.1%>
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円			
SKC CO LTD	-	14.72	230,368	23,704			化学
CHEIL WORLDWIDE INC	73	50.14	123,344	12,692			メディア
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	20.68	22.26	197,891	20,363			自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	18.56	16.95	361,035	37,150			保険
DB INSURANCE CO LTD	38.43	34.5	237,705	24,459			保険
COWAY CO LTD	23.34	36.97	244,002	25,107			家庭用耐久財
KT&G CORP	64.55	66.64	531,787	54,720			タバコ
S-1 CORPORATION	7.94	1.07	7,329	754			商業サービス・用品
KOREA GAS CORP	13.03	-	-	-			ガス
CJ CORP	10.01	10.01	87,287	8,981			コンプロマリット
KAKAO CORP	175.75	180.92	1,725,976	177,603			インタラクティブ・メディアおよびサービス
CJ ENM CO LTD	2.99	7.61	99,158	10,203			娯楽
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	24.97	-	-	-			機械
KMW CO LTD	13.34	-	-	-			通信機器
SK TELECOM CO LTD	25.24	22.04	131,138	13,494			無線通信サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	215.11	200.59	167,492	17,234			資本市場
NCSOFT CORPORATION	10.26	9.06	401,358	41,299			娯楽
LG UPLUS CORP	156.81	146.06	208,135	21,417			各種電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	152.61	200.52	420,089	43,227			電気設備

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	5.62	5.29	463,933	47,738	パーソナル用品
LG CHEM LTD	28.06	26.33	1,329,665	136,822	化学
LG CHEM LTD	4.99	4.99	130,239	13,401	化学
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	2.03	1.02	50,235	5,169	パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	273.94	255.17	1,028,335	105,815	銀行
HYUNDAI MERCHANT MARINE	-	151.96	405,733	41,749	海運業
S-OIL CORP	24.6	23.35	251,012	25,829	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	65.26	83.1	282,955	29,116	化学
MERITZ SECURITIES CO LTD	202.52	202.52	137,106	14,108	資本市場
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	52.63	46.18	187,490	19,292	資本市場
POSCO CHEMICAL CO LTD	13.38	20.82	271,701	27,958	建設資材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	10.44	8.75	168,000	17,287	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	16.75	13.99	114,578	11,790	専門小売り
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	22.28	19.26	188,170	19,362	機械
HYUNDAI MOBIS	41.29	38.05	783,830	80,656	自動車部品
SK HYNIX INC	333.67	318.1	3,435,480	353,510	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	45.34	42.06	185,694	19,108	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	15.15	15.15	133,320	13,718	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	92.1	80.41	1,423,257	146,453	自動車
HYUNDAI STEEL CO	45.33	60.59	250,236	25,749	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	211.14	183.71	202,081	20,794	銀行
KIA CORPORATION	163.27	153.03	1,173,740	120,777	自動車
KOREA ZINC CO LTD	4.65	4.7	294,220	30,275	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER CORP	164.88	142.75	310,481	31,948	電力
HANWHA CORP	24.18	-	-	-	コンピュータ・ソフトウェア
KOREAN AIR CO LTD	97.24	94.37	296,793	30,540	旅客航空輸送業
CJ LOGISTICS	4.51	1.29	16,770	1,725	陸運・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	10.93	11.99	182,248	18,753	化学
DOUZONE BIZON CO LTD	10.2	-	-	-	ソフトウェア
HLB INC	48.88	67.89	207,064	21,306	レジャー用品
LG ELECTRONICS INC	66.67	60.7	767,855	79,012	家庭用耐久財
LOTTE CORP	15.91	-	-	-	コンピュータ・ソフトウェア
LG CORP	52.51	48.25	353,672	36,392	コンピュータ・ソフトウェア
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	91.63	91.63	101,709	10,465	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	47.63	46.31	196,122	20,181	建設・土木
NAVER CORP	75.17	71.42	2,203,307	226,720	インタラクティブ・メディアおよびサービス
L&F CO LTD	-	14.49	340,659	35,053	電子装置・機器・部品
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	22.41	29.32	219,020	22,537	資本市場
OTTOGI CORP	0.66	-	-	-	食品
AMOREPACIFIC GROUP	20.01	23.47	111,834	11,507	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	87.13	43.02	118,950	12,239	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO HOLDINGS INC	46.03	42.5	1,200,625	123,544	金属・鉱業
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	88.11	82.93	202,349	20,821	建設・土木
SAMSUNG SDI CO LTD	33.81	31.92	1,956,696	201,344	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	35.6	30.59	480,263	49,419	電子装置・機器・部品
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	-	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		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
HANA FINANCIAL GROUP	190.41	172.18	807,524	83,094	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	11.32	11.38	224,755	23,127	航空貨物・物流サービス
CELLTRION PHARM INC	9.88	10.17	89,089	9,167	医薬品
LOTTE SHOPPING CO	5.38	4.57	43,003	4,425	複合小売り
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	—	24.99	116,078	11,944	保険
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	43.61	37.28	241,201	24,819	保険
AMOREPACIFIC CORP	17.7	17.9	289,085	29,746	パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	30.26	—	—	—	消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	34.79	29.24	606,730	62,432	石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	4.66	3.85	148,610	15,291	食品
STX PAN OCEAN CO LTD	195.95	201.72	133,336	13,720	海運業
LG INNOTEK CO LTD	7.64	7.85	312,822	32,189	電子装置・機器・部品
SK INC	19.45	24.01	601,450	61,889	コンプロマリット
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	ライフサイエンス・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	コンプロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	10.33	9.96	831,660	85,577	ライフサイエンス・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 : 9,377.78	株 数 : 9,438.09	外 貨 建 金 額 : 63,133,776	邦 貨 換 算 金 額 : 6,496,465	
	銘 柄 数 < 比 率 >	銘 柄 数 < 比 率 >	< 10.3% >	< 10.3% >	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
EVE ENERGY CO LTD	90.32	88.32	629	12,491	電気設備
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	54	59.4	69	1,376	電子装置・機器・部品
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	—	34	348	6,913	電子装置・機器・部品
ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	58	—	—	—	電子装置・機器・部品
BEIJING THUNISOFT CORP LTD	64	—	—	—	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	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	30	30	68	1,362	飲料
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
SHUIJIAHUANG 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	コンプロマリット
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 SANJIU 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	
			外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円 千オフショア・人民元	千円
INSPIR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	35.7	35.7	97	1,926
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	149	—	—	—
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	127	127	122	2,423
O-FILM TECH CO LTD	86	86	53	1,067
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	500	367	262	5,205
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	124.8	233.81	807	16,023
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	139	108	291	5,782
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	48	5.6	20	416
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	69	69	130	2,581
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	382	382	207	4,114
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	13	—	—	—
DONG-E-E-JIAO CO LTD	49	49	159	3,169
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	153	153	147	2,919
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	210	210	137	2,724
HUADONG MEDICINE CO LTD	75	75	257	5,105
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	50	50	200	3,980
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	—	62	25	504
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	66	66	147	2,926
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	—	119	254	5,051
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	48	45	938	18,611
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	74	111	583	11,581
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	149.5	149.5	129	2,562
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	177	177	138	2,749
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	178	153	618	12,264
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	59.4	59.4	81	1,622
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	38	53.2	97	1,924
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	160	160	71	1,418
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	21	21	197	3,923
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	364.8	364.8	229	4,544
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	143	143	110	2,195
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	291.54	271.54	793	15,738
SHANXI SECURITIES CO LTD	275	275	154	3,065
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	445	838	493	9,790
NEW HOPE LIUHE CO LTD	199	199	311	6,169
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	—	239	375	7,452
DHC SOFTWARE CO LTD	38	38	25	506
IFLYTEK CO LTD	113	135	561	11,134
HESTEEL CO LTD	1,047	1,047	281	5,586
GOERTEK INC	87	78	248	4,932
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	213	213	163	3,236
BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD	575	—	—	—
BANK OF NINGBO CO LTD	191	192	735	14,590
LENS TECHNOLOGY CO LTD	146	124	132	2,634
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	474	474	225	4,475
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	283	283	175	3,480
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	376	376	287	5,698
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	124	416.6	432	8,586
WESTERN SECURITIES CO LTD	227	227	159	3,169
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	82	47	145	2,887
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	38	38	296	5,887
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUSTRY GROUP	107	—	—	—
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	278.4	267.08	718	14,251
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	48	44	607	12,044
WULIANGYE YIBIN CO LTD	146	128	2,174	43,137
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	208	208	119	2,376
SUNING.COM CO LTD	237	237	83	1,654
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,256	855	351	6,970

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	
(中国)	百株	百株	千円・千ユーロ・千人民元	千円	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	499	253	430	8,536	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	—	34	110	2,183	家庭用耐久財
MIDEA GROUP CO LTD	136	—	—	—	家庭用耐久財
GUOSEN SECURITIES CO LTD	170	—	—	—	資本市場
PING AN BANK CO LTD	614	601	986	19,575	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	302.8	155.8	334	6,625	食品
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	1,287	712	312	6,200	資本市場
CHINA VANKE CO LTD	374	319	679	13,478	不動産管理・開発
ZTE CORP	216	243	551	10,936	通信機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	285	285	190	3,776	機械
WEICHAI POWER CO LTD	170	47	59	1,179	機械
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	42	42	144	2,868	医薬品
GF SECURITIES CO LTD	391	219	391	7,767	資本市場
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	211	211	251	4,997	電気設備
BYD CO LTD	71	59	1,393	27,643	自動車
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	341	341	158	3,138	電子装置・機器・部品
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	39	48.3	393	7,813	化学
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	—	29	209	4,160	化学
LB GROUP CO LTD	110	110	229	4,545	化学
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	—	179	246	4,885	化学
NANJI E-COMMERCE CO LTD	129	—	—	—	メディア
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	—	129	284	5,649	化学
CHACHA FOOD CO LTD	29	29	171	3,397	食品
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	80	80	199	3,952	医薬品
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15	27	705	13,998	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	36	36	25	505	食品
HUAFON CHEMICAL CO LTD	—	342	292	5,807	化学
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	494	—	—	—	金属・鉱業
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	55.5	55.5	70	1,400	娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12	30	561	11,132	飲料
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	156	156	132	2,627	化学
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	66	66	338	6,713	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	6	6	31	633	家庭用耐久財
NINESTAR CORP	57	57	236	4,683	コンピュータ・周辺機器
YUNDA HOLDING CO LTD	70.2	70.2	121	2,413	航空貨物・物流サービス
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	338	338	109	2,165	半導体・半導体製造装置
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	120	120	109	2,180	娯楽
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	42	67.2	320	6,351	機械
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	16	16	75	1,491	医薬品
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	5	15	463	9,193	医薬品
JIUGUI LIQUOR CO LTD	—	23	368	7,317	飲料
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	151	151	86	1,707	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	53	53	55	1,095	ソフトウェア
SF HOLDING CO LTD	150	142	711	14,114	航空貨物・物流サービス
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	—	18	184	3,659	建設関連製品
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	236	236	134	2,658	資本市場
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	—	25	207	4,124	半導体・半導体製造装置
SHANDONG SINOcera FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	65	—	—	—	化学
BANK OF SHANGHAI CO LTD	637.9	637.9	430	8,541	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	—	389	356	7,068	ソフトウェア
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	—	23	244	4,852	家庭用耐久財
CSC FINANCIAL CO LTD	136	136	330	6,560	資本市場
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	50	—	—	—	航空宇宙・防衛
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	21	29.4	367	7,288	化学
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	—	126	362	7,193	医薬品
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	164	133	292	5,806	化学
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	31	31	256	5,093	飲料

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	株数	株数	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	千円	千円	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	225	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		
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	-	7	75	1,489	自動車部品		
ZHEJIANG WOLVO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	27	27	98	1,948	医薬品		
GUANGZHOU WONDFO 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		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	1,077	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
IMEIK 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	—	4.55	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
CRRG CORP LTD	—	770	405	8,034	機械
JIANGSU HENGRUI 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		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	270	193	355	7,055	機械
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	—	1,273	332	6,590	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	766	103	64	1,272	銀行
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	79	79	373	7,410	医薬品
GUANGHUI ENERGY CO LTD	—	72	62	1,239	石油・ガス・消耗燃料
GEMDALE CORP	106	106	161	3,193	不動産管理・開発
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	221	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	103	124	1,049	20,821	化学
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	—	970	383	7,600	電気設備
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	935	927	1,124	22,304	金属・鉱業
FOUNDER SECURITIES CO LTD	580	—	—	—	資本市場
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	316	316	299	5,935	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NARI TECHNOLOGY CO LTD	243	136.2	388	7,707	電気設備
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	298	298	129	2,565	エネルギー設備・サービス
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	67	62	1,129	22,412	専門小売り
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	—	2,359	528	10,481	金属・鉱業
TSINGTAO BREWERY CO LTD	6	—	—	—	飲料
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	250	250	104	2,067	各種金融サービス
ALUMINIUM 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・生活必需品小売り
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
HUNDSUN 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		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
XIAMEN C & D INC	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 PIENZHUANG 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 JUHUA CO LTD	226	226	274	5,446	化学
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	262	262	98	1,959	金属・鉱業
BEIJING TIAN TAN 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
JONJEE 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	1,980	医薬品
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	119	—	—	—	送迎インフラ
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
HENGTONG 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
LONGI 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		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	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
HUAAN SECURITIES 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・アロパイダー/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・生活必需品小売り
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 銘柄数<比率>	株数	135,213	2,682,111	
	76,994.14 358銘柄	82,390.45 388銘柄	-	<4.3%>	
(マレーシア)	百株	百株	千円	千円	
AMMB HOLDINGS BHD	814	803	293	8,786	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	141	-	-	-	食品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,589	3,731	1,899	56,774	銀行
DIGI.COM BHD	2,353	1,540	592	17,725	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	897.2	479.2	328	9,827	運送インフラ
RHB BANK BHD	834.8	1,408.8	835	24,975	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	317	317	237	7,088	コンピュータリット
TOP GLOVE CORP BHD	2,627	3,823	684	20,458	ヘルスケア機器・用品
GAMUDA BHD	1,002	-	-	-	建設・土木
GENTING BHD	1,072	1,049	482	14,425	ホテル・レストラン・レジャー
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	252.56	202.56	391	11,711	銀行
HONG LEONG BANK BHD	349.08	339.08	701	20,963	銀行
IOI CORP BHD	1,908.13	1,908.13	822	24,586	食品
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	226	221	601	17,970	食品
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	116	116	272	8,142	飲料
MALAYAN BANKING BHD	2,543.75	2,859.75	2,513	75,149	銀行
MISC BHD	1,008.8	1,008.8	770	23,041	海運業
NESTLE MALAYSIA BHD	41	41	547	16,375	食品
PPB GROUP BHD	462.6	462.6	792	23,704	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	223	223	474	14,186	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	396	554	932	27,890	ガス
GENTING MALAYSIA BHD	2,198	2,198	652	19,516	ホテル・レストラン・レジャー
TELEKOM MALAYSIA BHD	595	595	299	8,965	各種電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	1,396.5	1,463.5	1,309	39,158	電力

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
QL RESOURCES BHD	509.5	254.5	126	3,781	食品
DIALOG GROUP BHD	2,339.44	1,837.44	477	14,282	エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	8,914.5	8,512.5	3,975	118,845	銀行
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	828	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
SUPERMAX CORP BHD	745.71	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
SIME DARBY BERHAD	1,395	2,348	565	16,916	コンプロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,072	1,058	488	14,612	ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD	1,701	1,345	485	14,515	無線通信サービス
MAXIS BHD	1,308	1,052	407	12,171	無線通信サービス
INARI AMERTRON BHD	—	1,313	380	11,383	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 銘柄数<比率>	49,304.57 38銘柄	48,744.86 35銘柄	27,348 —	817,609 <1.3%>
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	71.63	71.63	1,917	16,527	金属・鉱業
BIDVEST GROUP LTD	162	160.66	3,425	29,524	コンプロマリット
CLICKS GROUP LTD	155.31	134.09	4,011	34,582	食品・生活必需品小売り
DISCOVERY LTD	211.37	249.05	4,227	36,439	保険
GOLD FIELDS LTD	557.34	515.31	11,483	98,989	金属・鉱業
REMGRO LTD	260	283.02	4,094	35,291	各種金融サービス
NORTHAM PLATINUM LTD	236.02	—	—	—	金属・鉱業
HARMONY GOLD MINING CO LTD	285.37	363.08	2,504	21,589	金属・鉱業
EXXARO RESOURCES LTD	141.15	154.24	3,612	31,136	石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	38.02	47.36	10,182	87,772	銀行
MTN GROUP LTD	1,063.52	992.79	17,383	149,847	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	265.08	241.13	8,283	71,399	金属・鉱業
FIRSTRAND LTD	3,039.68	2,949.79	20,613	177,685	各種金融サービス
NASPERS LTD	265.6	126.73	19,303	166,394	インターネット販売・通信販売
NEDBANK GROUP LTD	234.74	268.1	5,903	50,884	銀行
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	29.67	31.16	6,169	53,182	金属・鉱業
SASOL LTD	312.58	330.95	12,202	105,182	化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD	325.94	294.74	6,870	59,227	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	182.1	142.2	3,119	26,893	専門小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	842.71	794.67	13,238	114,115	銀行
SPAR GROUP LTD/THE	94.14	95.11	1,563	13,479	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	542.19	560.8	3,293	28,390	複合小売り
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	241.12	217.55	3,917	33,768	医薬品
ABSA GROUP LTD	391.86	420.97	7,475	64,439	銀行
TIGER BRANDS LTD	118.03	129.81	1,906	16,430	食品
SANLAM LTD	1,195.61	1,091.85	7,491	64,573	保険
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	489.66	475.83	10,307	88,854	金属・鉱業
KUMBA IRON ORE LTD	31.73	44.97	2,923	25,199	金属・鉱業
RMI HOLDINGS	358.36	393.52	1,879	16,197	保険
VODACOM GROUP PTY LTD	432.18	367.03	5,429	46,802	無線通信サービス
NEPI ROCKCASTLE PLC	221.85	333.57	3,194	27,537	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	2,929.73	2,992.44	3,659	31,547	保険
REINET INVESTMENTS SCA	77.43	64.7	2,140	18,451	資本市場
PEPKOR HOLDINGS LTD	—	1,003.74	2,231	19,233	専門小売り
MULTICHOICE GROUP LTD	272.58	270.72	3,471	29,923	メディア
SIBANYE STILLWATER LTD	1,755.33	1,547.9	9,394	80,978	金属・鉱業
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	—	287.27	5,588	48,175	金属・鉱業

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
BID CORP LTD	180.86	192.56	6,065	52,280	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	240,479	2,072,930	<3.3%>
(タイ)	百株	百株	千タイ・バーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL	277	—	—	—	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
BUMRUNGRAD 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
SRIAWAD 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>	株数・金額 銘柄数<比率>	258,902	973,472	<1.5%>
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
MBANK	—	6.34	—	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	株数	株数	期末		業種等		
			株数	株数		評価額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円			
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN LPP SA	164.47	166.5	1,349	39,831	石油・ガス・消耗燃料		
SANTANDER BANK POLSKA SA	0.67	0.61	676	19,959	繊維・アパレル・贅沢品		
CD PROJEKT RED SA	16	19.52	561	16,552	銀行		
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	42.92	46.78	781	23,050	娯楽		
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	578.12	489.95	1,862	54,961	銀行		
CYFROWY POLSAT SA	885.35	1,293.98	864	25,518	石油・ガス・消耗燃料		
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	122.39	200	546	16,121	メディア		
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	521.92	521.92	486	14,352	電力		
DINO POLSKA SA	363.09	332.7	1,110	32,776	保険		
ALLEGRO.EU SA	34.34	26.31	888	26,222	食品・生活必需品小売り		
	228.95	276.48	771	22,759	インターネット販売・通信販売		
小計	株数・金・額 銘柄数<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	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・金・額 銘柄数<比率>	528.78 3銘柄	490.62 3銘柄	276,681 -	100,609 <0.2%>		
(ユーロ圏・ギリシャ)	百株	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・金・額 銘柄数<比率>	356.81 4銘柄	3,362.06 7銘柄	926 -	126,771 <0.2%>		
合計	株数・金・額 銘柄数<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	株数	株数	期末		業種等		
			株数	株数		評価額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
(タイ)							
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		証券	証券	千タイ・パーツ	千円		
		9,465	-	-	-		
合計	証券数・金・額 銘柄数<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		期末
	□数	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額
(メキシコ)	千□		千□	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	□数 銘柄数<比率>	金額 1,455,775 6銘柄<0.5%>	1,311,175 6銘柄<0.4%>	39,702 -	251,939 -
(ブラジル)	千□		千□	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	□数 銘柄数<比率>	金額 122,756 6銘柄<0.2%>	182.1 5銘柄<0.2%>	4,748 -	127,918 -
(南アフリカ)	千□		千□	千南アフリカ・ランド	千円
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	259.878		190.305	2,679	23,097
小計	□数 銘柄数<比率>	金額 259,878 1銘柄<0.0%>	190,305 1銘柄<0.0%>	2,679 -	23,097 -
合計	□数 銘柄数<比率>	金額 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		期末
		買	建	建
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	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
投資信託財産総額	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・リングギット=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 ー ル ・ ロ ー ン 等	7,055,858,395
株 式(評価額)	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 拠 金	2,603,601,135
(B) 負 債	221,356,632
未 払 金	217,825,632
未 払 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 I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>
8,165,233,734円
D I A M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
M I T O ラップ型ファンド (安定型) 5,065,871円
M I T O ラップ型ファンド (中立型) 19,255,020円
M I T O 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 I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) 345,994,625円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) 463,152,779円
D I A M 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 I A M 8資産バランスファンドN<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V A (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 (FOF s用) (適格機関投資家専用) 7,828,376円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定) 40,668,920円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定) 248,047,269円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (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	
	その他の収益	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	16,463,925,031	
	売買損	△20,914,181,277	
(C)	先物取引等取引損益	△592,117,607	
	取引益	1,566,330,273	
	取引損	△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。

エマージング債券パッシブ・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シブ・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	純資産総額
	円	%	ポイント	%			
10期 (2018年4月18日)	17,815	△0.6	87,698.99	△1.0	96.4	-	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J. P. 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)。

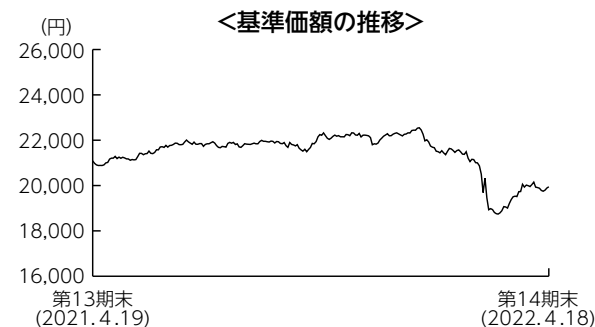
■当期中の基準価額と市況の推移

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	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) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年4月20日から2022年4月18日まで）



基準価額の推移

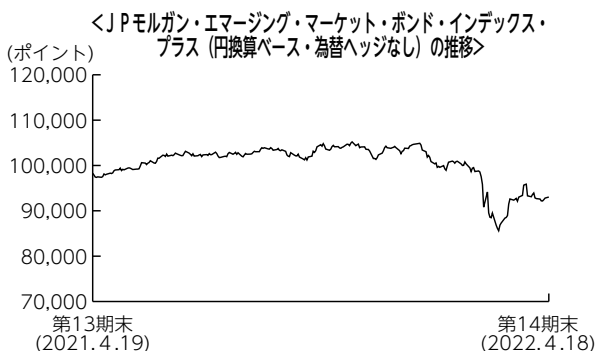
当期末の基準価額は19,947円となり、前期末比で5.4%下落しました。

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、労働市場の引き締め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。



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。

ポートフォリオについて

ベンチマークである J P 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%
ウルグアイ	0.8%	0.5%	0.3%	
計	48.2%	43.9%	4.2%	
欧州	ハンガリー	4.5%	3.3%	1.2%
	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%	
アジア・オセアニア	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、J P 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)	3円 (3)	0.013% (0.013)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(0)	(0.000)	
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	千アメリカ・ドル
			2,747,556	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 B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 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	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	
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	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	
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				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		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	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		期末
	評価額	比率	
公社債	千円 133,968,997	% 96.3	
コール・ローン等、その他	5,083,944	3.7	
投資信託財産総額	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 ・ コ 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 債 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 金	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専用) (適格機関投資家専用)	19,931,763円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	92,241,468円
エマージング債券バッションファンド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)	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 損 益	17,626,879,424	
	売 買 損 益	△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。

J-R E I T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-R E I T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R E I T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R E I T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R E I T指数		投資証券 組入比率	不動産 投信先 物比率	純資産 総額
	期 騰 落 率	中 落 率	(配当込み) ベンチマーク	期 騰 落 率			
12期(2018年6月6日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
13期(2019年6月6日)	18,181	3.1	3,386.35	3.1	97.8	1.7	35,462
14期(2020年6月8日)	20,819	14.5	3,880.89	14.6	97.4	2.0	33,154
15期(2021年6月7日)	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2	41,885
16期(2022年6月6日)	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2	88,531
	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	97.6	2.3	199,921

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) 東証R E I T指数(配当込み)の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)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・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P Xは、同指数の指数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、J P X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J P X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)。

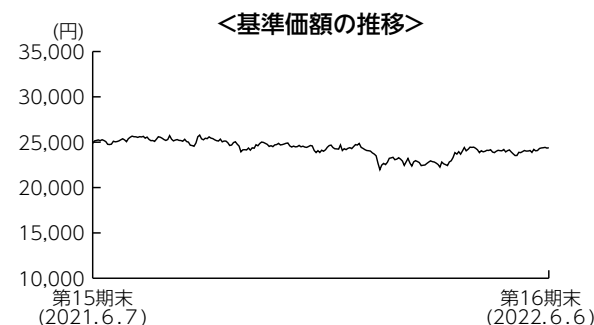
■当期中の基準価額と市況の推移

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 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配 当 込 み) (ベ ン チ マ ー ク)	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 6 月 7 日	円	%	ポ イ ン ト	%	%	%
	24,869	—	4,660.79	—	97.6	2.2
6 月 末	25,249	1.5	4,732.24	1.5	97.6	2.2
7 月 末	25,437	2.3	4,767.40	2.3	98.8	1.2
8 月 末	25,373	2.0	4,755.00	2.0	98.2	1.7
9 月 末	24,579	△1.2	4,605.71	△1.2	95.8	2.4
10 月 末	24,872	0.0	4,660.54	△0.0	97.8	2.2
11 月 末	23,858	△4.1	4,470.13	△4.1	90.7	2.4
12 月 末	24,686	△0.7	4,624.94	△0.8	97.8	2.2
2022 年 1 月 末	23,340	△6.1	4,372.24	△6.2	97.4	2.5
2 月 末	22,657	△8.9	4,243.65	△8.9	97.3	2.6
3 月 末	24,221	△2.6	4,536.64	△2.7	97.5	2.4
4 月 末	23,935	△3.8	4,483.12	△3.8	92.3	2.4
5 月 末	24,363	△2.0	4,563.32	△2.1	97.3	2.6
(期 末) 2022 年 6 月 6 日	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	97.6	2.3

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年6月8日から2022年6月6日まで）

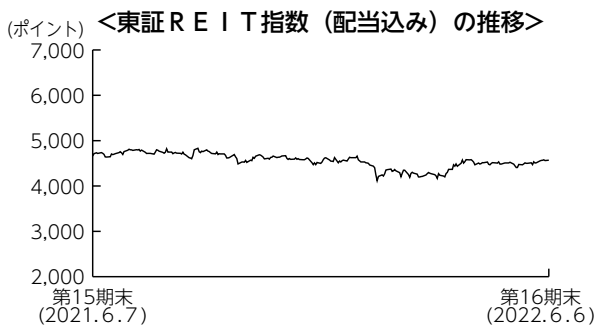


基準価額の推移

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)	1円 (0)	0.003% (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
(投資証券)	(1)	(0.002)	
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
	千口	千円	千円	千円	千口	千円	千円	千円
国内								
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	
	(-)		(-)		(-)		(-)	
森ヒ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	
	(-)		(-)		(-)		(-)	
アクティブア・プロパティーズ投資法人	16.738		7,748,557		11.166		4,729,881	
	(-)		(-)		(-)		(-)	
GLP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	
	(-)		(-)		(-)		(-)	
One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□		千円		千□		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
		(-)		(-)		(-)		(-)
CRE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
		(-)		(-)		(-)		(-)
NTT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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	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 (-)
インヴェンシブル投資法人	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
	百万円	百万円	百万円	百万円
国内 不動産投信指数先物取引	18,774	15,886	-	-

(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 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 362,336	百万円 422	% 0.1	百万円 234,027	百万円 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	当 期
	買 付 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 価 額	比 率
不動産ファンド			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テート投資法人			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
日本フ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)		当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率	
不動産ファンド	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イト投資法人	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 ・ 金 額	472.255	1,025.069	195,071,937	—
	銘 柄 数<比 率>	61銘柄<97.6%>	61銘柄<97.6%>	—	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、CRE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、One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イト投資法人、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 ー ル ・ 口 ー ン 等	9,924,691,323
投 資 証 券(評価額)	195,071,937,150
未 収 入 金	373,786,980
未 収 配 当 金	1,098,130,310
差 入 委 託 証 拠 金	△59,359,800
(B) 負 債	6,487,439,313
未 払 金	6,096,928,313
未 払 解 約 金	390,511,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	199,921,746,650
元 本	81,973,373,034
次 期 繰 越 損 益 金	117,948,373,616
(D) 受 益 権 総 口 数	81,973,373,034口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	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
 一部解約元本額 104,449,745,533円

(注2) 期末における元本の内訳

M I T O ラップ型ファンド (安定型)	484,095円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	1,717,515円
M I T O 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 エポリューション	3,270,803円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	127,599,856円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	168,835,185円
D I A M 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 I A M 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 I A M 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 I A M 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)	760,808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20-08 (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 I 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	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 I A M 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) (適格機関投資家専用)	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 (T I P S活用型)	141,000,699円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	30,493,320円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	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)	配当等収当益	6,593,740,373円	
	受取配当金	6,590,445,292	
	受取利息	12,539	
	その他の収益	4,406,968	
	支払利息	△1,124,426	
(B)	有価証券売買損益	△19,639,284,044	
	売却益	2,322,804,698	
	売却損	△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)	計(D+E+F+G)	117,948,373,616	
	次期繰越損益金(H)	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 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国 REIT インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産額 総
	円	期中騰落率	ポイント	期中騰落率		
11期(2018年6月22日)	11,979	1.8	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 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

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

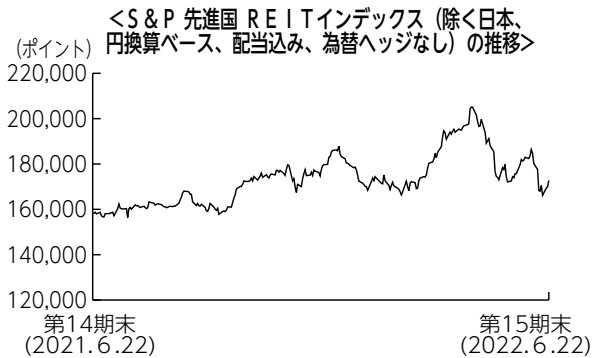
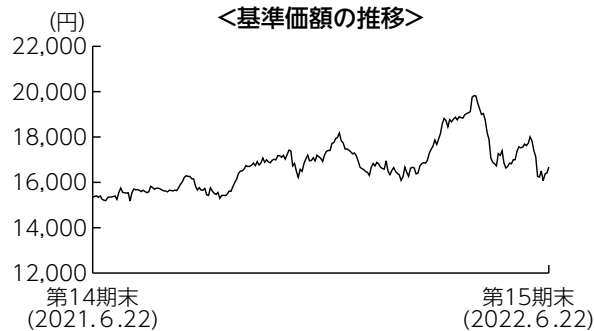
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰 落 率	期 騰 落	中 率	
(期 首) 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) 騰落率は期首比です。

■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加え、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て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) 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 INVNT & 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 (0.084)	5,274 (60)	85.8 (-)	6,083 (-)
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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
CAMDEN PROPERTY TRUST	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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ORION OFFICE REIT INC	39.605 (25.252)	640 (-)	48.132 (-)	741 (-)
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 (△4)	1,682.7 (-)	1,105 (-)
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 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	86.209 (-)	2,367 (-)	99.799 (-)	2,704 (-)
DIGITALBRIDGE GROUP INC	507.857 (-)	3,628 (-)	746.406 (-)	5,083 (-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	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 INV 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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
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□	千オーストラリア・ドル	千□	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 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
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 (6.46)	765 (42)	141.533 (-)	877 (-)
HOME CO DAILY NEEDS REIT	759.24 (374.004)	1,082 (530)	906.771 (-)	1,216 (-)
HEALTHCO REIT	159.265 (-)	293 (-)	87.778 (-)	138 (-)
CENTURIA OFFICE REIT	437.602 (-)	1,003 (-)	488.986 (-)	1,095 (-)
AVENTUS GROUP	226.775 (△170.002)	774 (△572)	233.236 (-)	774 (-)
WAYPOINT REIT LTD	806.09 (△21.228)	2,178 (△58)	954.977 (-)	2,531 (-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	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 (0.21457)	2,448 (-)	8,162 (-)
CHAMPION REIT	1,925 (-)	7,538 (-)	2,230 (-)	8,597 (-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	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)	- (△0.21457)	305.25 (-)	3 (-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	5,835.4 (-)	12,379 (-)	6,430.8 (-)	13,626 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	3,817.6 (-)	11,202 (△31)	4,324.4 (-)	12,585 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	2,479.8 (-)	3,906 (△1)	2,818.3 (-)	4,420 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	3,586 (-)	6,671 (△26)	3,970.8 (-)	7,346 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	1,526.6 (-)	939 (-)	1,771 (-)	1,081 (-)
ASCOTT RESIDENCE TRUST	2,078.5 (-)	2,174 (△4)	2,382 (-)	2,473 (-)
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 (1,069.91)	1,506 (458)	4,069.2 (-)	1,766 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	849.4 (-)	1,023 (△3)	937.5 (-)	1,103 (-)
CAPITALAND CHINA TRUST	1,144.8 (-)	1,373 (-)	1,256.8 (-)	1,488 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	715.6 (-)	216 (△9)	996.7 (-)	293 (-)
AJMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	451.7 (-)	647 (△3)	504.8 (-)	715 (-)
PARKWAY LIFE REIT	387.3 (-)	1,859 (△2)	448.9 (-)	2,164 (-)
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	- (-)	- (△2)	2,759.1 (-)	130 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	2,173.1 (-)	5,826 (△0.68061)	2,488.6 (-)	6,606 (-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	2,461.2 (-)	4,840 (△5)	2,816.3 (-)	5,479 (-)
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	1,195 (△603.48)	1,047 (△517)	1,179.4 (-)	1,040 (-)
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	- (-)	- (-)	313.2 (-)	131 (-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	2,360.4 (-)	2,600 (△33)	3,255 (-)	3,558 (-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	1,074.8 (-)	665 (-)	1,262.5 (-)	767 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
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
	(-)	(-)	(-)	(-)
OUÉ 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□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	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□	千イギリス・ポンド	千□	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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
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 LI	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	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イスラエル	千□	千イスラエル・シケル	千□	千イスラエル・シケル
REIT 1 LTD	157.562	3,177	181.198	3,740
	(-)	(-)	(-)	(-)
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	87.076	876	23.453	219
	(-)	(-)	(-)	(-)
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	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□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	313.4	747	343.8	820
	(-)	(△3)	(-)	(-)
ユーロ (アイルランド)	千□	千ユーロ	千□	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□	千ユーロ	千□	千ユーロ
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4.781	105	4.387	96
	(△18.604)	(-)	(-)	(-)
VASTNED RETAIL	19.064	466	22.698	543
	(-)	(-)	(-)	(-)
WERELDHAVE NV	40.773	586	46.515	641
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	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□	千ユーロ	千□	千ユーロ
BEFIMMO	25.803	1,020	30.753	1,198
	(-)	(-)	(-)	(-)
COFINIMMO SA	32.746	4,266	37.41	4,889
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL ESTATES	9.371	662	11.04	768
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	24.855	649	28.305	741
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	160.242	5,965	180.812	6,657
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	9.915	1,166	11.58	1,340
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	41.877	4,645	46.408	5,123
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV	30.116	760	33.301	842
	(-)	(-)	(-)	(-)
XIOR STUDENT HOUSING NV	20.671	1,030	21.96	1,075
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	60.455	7,020	69.268	7,984
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	33.864	2,105	38.571	2,397
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALTAREA	3.947	632	4.342	671
	(-)	(△18)	(-)	(-)
KLEPIERRE	216.142	4,605	249.876	5,274
	(-)	(△70)	(-)	(-)
COVIVIO	52.496	3,782	60.831	4,338
	(-)	(-)	(-)	(-)
MERCIALYS	40.088	352	41.163	360
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARMILA SA	39.205	546	47.86	660
	(-)	(△9)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	134.349	8,772	163.439	10,582
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALTAREA SCA-RTS	-	-	1.672	4
	(1.672)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ドイツ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	61.156	580	69.728	653
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	108.844	1,916	189.799	3,435
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	293.908	2,399	330.438	2,652
	(-)	(△25)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	36.39 (-)	182 (△4)	45.091 (-)	223 (-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	368.517 (-)	3,654 (△16)	424.548 (-)	4,130 (-)
ユーロ (イタリア)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	44.176 (-)	178 (-)	55.103 (-)	218 (-)
COIMA RES SPA	18.292 (-)	139 (-)	10.696 (-)	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	柄	期首(前期末)		当期		比率
		数	数	外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
不動産ファンド (アメリカ)						
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		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	
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比	率
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
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
	□ 数	□ 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	%
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
NEXPOINT 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	金額	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千円	千口	千円	千口	%
CLIPPER REALTY INC	5.086	5,261	5.086	38	5,261	0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC	110.619	141,489	72.797	1,036	141,489	0.3
VICI PROPERTIES INC	252.573	1,208,722	296.576	8,855	1,208,722	2.2
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	15.65	—	—	—	—	—
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	37.21	83,240	23.62	609	83,240	0.1
DIGITALBRIDGE GROUP INC	238.549	—	—	—	—	—
小計	11,651.995	42,548,156	7,979.351	311,730	42,548,156	—
	156銘柄<74.6%>		151銘柄<76.0%>			76.0
(カナダ)	千口	千円	千口	千円	千口	%
SMARTCENTRES REIT	33.365	62,039	21.535	588	62,039	0.1
CANADIAN APT PPTYS REIT	40.179	121,625	26.099	1,153	121,625	0.2
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	67.209	56,225	42.878	533	56,225	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	52.733	50,982	32.504	483	50,982	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	72.829	99,841	46.43	947	99,841	0.2
ALLIED PROPERTIES REIT	29.143	69,315	19.099	657	69,315	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV TR	44.246	—	—	—	—	—
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	12.866	17,011	8.213	161	17,011	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10.875	33,861	7.546	321	33,861	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	31.111	22,477	17.493	213	22,477	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INV	21.592	28,158	16.748	267	28,158	0.1
INTERWEST REAL ESTATE INVEST	31.544	29,048	22.588	275	29,048	0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	43.997	42,572	33.05	403	42,572	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	8.583	11,211	6.458	106	11,211	0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT	—	3,700	4.643	35	3,700	0.0
DREAM INDUSTRIAL REIT	42.899	46,971	36.406	445	46,971	0.1
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	5,917	15.423	56	5,917	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	37.879	48,409	27.533	459	48,409	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	14.568	82,304	9.835	780	82,304	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	22.019	11,194	16.803	106	11,194	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	74.537	70,893	48.913	672	70,893	0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	8.825	8,028	5.26	76	8,028	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24.18	28,919	17.147	274	28,919	0.1
PLAZA RETAIL REIT	20.611	7,388	16.376	70	7,388	0.0
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE	—	4,126	10.116	39	4,126	0.0
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES	19.145	—	—	—	—	—
SLATE GROCERY REIT	10.657	11,902	7.969	112	11,902	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT	—	8,018	7.458	76	8,018	0.0
PRIMARIS REIT	—	18,637	13.944	176	18,637	0.0
SLATE OFFICE REIT	11.634	7,795	15.735	73	7,795	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT	7.088	10,314	7.481	97	10,314	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	24.752	32,344	17.944	306	32,344	0.1
小計	819.066	1,051,238	579.627	9,972	1,051,238	—
	27銘柄<2.0%>		30銘柄<1.9%>			1.9
(オーストラリア)	千口	千円	千口	千円	千口	%
BWP TRUST	224.791	53,228	144.478	562	53,228	0.1
MIRVAC GROUP	1,846.984	235,226	1,217.477	2,483	235,226	0.4
CROMWELL PROPERTY GROUP	865.185	31,619	466.932	333	31,619	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	236.221	58,007	157.855	612	58,007	0.1
GPT GROUP	911.007	235,276	591.472	2,484	235,276	0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP	229.128	34,635	189.484	365	34,635	0.1
ABACUS PROPERTY GROUP	196.651	32,080	126.389	338	32,080	0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	154.369	30,022	98.14	316	30,022	0.1
STOCKLAND	1,128.82	254,913	737.402	2,691	254,913	0.5
INGENIA COMMUNITIES GROUP	134.675	40,046	109.543	422	40,046	0.1
DEXUS	505.128	288,109	332.461	3,042	288,109	0.5

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	金額	比率	率
(オーストラリア)	千□	千円	千□	千円		%
GOODMAN GROUP	789.54	523,576	523.576	9,178	869,275	1.6
VICINITY CENTRES	1,826.547	1,193,493	1,193.493	2,243	212,507	0.4
CHARTER HALL GROUP	220.887	145,638	145.638	1,625	153,934	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	136.67	96,915	96.915	332	31,483	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	513.792	341,231	341.231	934	88,551	0.2
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	212.974	162,422	162.422	469	44,456	0.1
ARENA REIT	159.242	103,753	103.753	422	39,993	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	260.875	186,309	186.309	806	76,404	0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT	73.145	63,933	63.933	172	16,348	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	516.215	329,249	329.249	740	70,162	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73.965	65,661	65.661	206	19,589	0.0
GDI PROPERTY GROUP	247.876	178,986	178.986	170	16,104	0.0
HOME CONSORTIUM LTD	85.98	-	-	-	-	-
RURAL FUNDS GROUP	160.193	126.29	126.29	334	31,696	0.1
IRONGATE GROUP	256.148	181.194	181.194	341	32,348	0.1
SCENTRE GROUP	2,437.607	1,606,393	1,606.393	4,208	398,610	0.7
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	-	140,343	140.343	115	10,899	0.0
HOME CONSORTIUM LTD	-	53,607	53.607	241	22,847	0.0
HOMECO DAILY NEEDS REIT	213.11	439,583	439.583	580	54,955	0.1
HEALTHCO REIT	-	71,487	71.487	105	10,020	0.0
CENTURIA OFFICE REIT	179.274	127.89	127.89	225	21,317	0.0
AVENTUS GROUP	176.463	-	-	-	-	-
WAYPOINT REIT LTD	382.777	212,662	212.662	480	45,519	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	15,356.239 31銘柄<6.9%>	10,522.248 32銘柄<6.4%>	37,590	3,560,193	- 6.4
(香港)	千□	千円	千□	千円		%
LINK REIT	977.72	648.62	648.62	41,835	727,527	1.3
PROSPERITY REIT	597	353	353	843	14,671	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	761	682	682	2,066	35,935	0.1
CHAMPION REIT	937.07	632.07	632.07	2,218	38,580	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	451	342	342	1,231	21,410	0.0
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	680	436	436	2,816	48,979	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	4,403.79 6銘柄<1.7%>	3,093.69 6銘柄<1.6%>	51,012	887,106	- 1.6
(シンガポール)	千□	千円	千□	千円		%
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	2,169.309	1,573,909	1,573.909	3,368	331,393	0.6
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,544.76	1,037.96	1,037.96	2,854	280,843	0.5
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,006.99	668.49	668.49	1,076	105,894	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,370.62	985.82	985.82	1,616	159,071	0.3
STARHILL GLOBAL REIT	656.8	412.4	412.4	239	23,534	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST	891.616	588.116	588.116	670	65,965	0.1
KEPPEL REIT	951.5	598.9	598.9	676	66,586	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	622.9	326.6	326.6	728	71,659	0.1
ESR LOGOS REIT	1,148.73	1,558.24	1,558.24	638	62,859	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	365.2	277.1	277.1	357	35,170	0.1
CAPITALAND CHINA TRUST	450.18	338.18	338.18	388	38,264	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	608.8	327.7	327.7	91	9,027	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	216.895	163,795	163.795	221	21,756	0.0
PARKWAY LIFE REIT	179	117.4	117.4	564	55,560	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	2,759.1	-	-	-	-	-
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	913.12	597.62	597.62	1,500	147,587	0.3
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,028.2	673.1	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	124.4	149	14,687	0.0

銘柄	期首(前期末)		当期			末
	□数	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(シンガポール)	千口	千口	千口	千シンガポール・ドル	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	
OUÉ COMMERCIAL REIT	1,120.355	787,955	303	29,847	0.1	
LENLEASE 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・金額 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 —	— 3.5
(ニュージーランド)	千口	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	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・金額 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 —	— 0.4
(イギリス)	千口	千口	千口	千イギリス・ポンド	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	
HAMMERSON 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	
	□数	金額	□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	□数・金額	11,724.532	8,148.22	18,267	3,052,903	-
	銘柄数<比率>	34銘柄<5.6%>	34銘柄<5.5%>	-	-	5.5
(イスラエル)	千口		千口	千イスラエル・シケル	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	□数・金額	85.363	125.35	1,745	68,963	-
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.1%>	2銘柄<0.1%>	-	-	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	□数・金額	244.45	246.257	1,375,444	145,109	-
	銘柄数<比率>	7銘柄<0.2%>	11銘柄<0.3%>	-	-	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	□数・金額	131.74	101.34	198	28,494	-
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	-	-	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	□数・金額	521.155	125.78	158	22,808	-
	銘柄数<比率>	2銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	-	-	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	□数・金額	54.038	36.028	766	109,967	-
	銘柄数<比率>	4銘柄<0.2%>	4銘柄<0.2%>	-	-	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	□数・金額	146.589	100.616	5,000	717,379	-
	銘柄数<比率>	9銘柄<1.3%>	9銘柄<1.3%>	-	-	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	金額	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(ユーロ…フランス)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円	%
ALTAREA	1,643	1,248	1,248	160	23,095	0.0
KLEPIERRE	93.81	60,076	60,076	1,241	178,144	0.3
COVIVIO	22,853	14,518	14,518	829	119,029	0.2
MERCIALYS	19,022	17,947	17,947	151	21,678	0.0
CARMILA SA	21,853	13,198	13,198	196	28,135	0.1
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	64,946	35,856	35,856	1,946	279,210	0.5
小計	口数・金額 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)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円	%
HAMBORNER REIT AG	32,106	23,534	23,534	200	28,697	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	84,625	3,67	3,67	44	6,391	0.0
小計	口数・金額 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)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	119,135	82,605	82,605	530	76,139	0.1
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	27,656	18,955	18,955	93	13,474	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	15,863	102,599	102,599	998	143,214	0.3
小計	口数・金額 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)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	25,287	14,36	14,36	51	7,323	0.0
COIMA RES SPA	-	7,596	7,596	75	10,777	0.0
小計	口数・金額 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	口数・金額 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		期末	
	評価額	比率	評価額	比率
投資信託受益証券、投資証券	千円	%	千円	%
コール・ローン等、その他	55,595,607	98.5	842,071	1.5
投資信託財産総額	56,437,679	100.0	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 ー ル ・ ロ ー ン 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

先進国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
先進国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)	92,995,102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 DC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
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10)	179,983,530円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20)	232,723,605円
DIAMDC 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
DIAM 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-2045)	36,458,019円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	18,413,243円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,367,743円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-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-2040)	42,933,275円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	19,741,762円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	12,168,821円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	2,125,847円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	276,893,448円
DIAM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 (株式先物活用品) 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 (株式先物活用品) 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
AMOne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
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	31,286,199円
DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	80,722,535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)	194,641,132円
DIAM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
DIAM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)	配当等収益	2,249,560,788円	
	受取配当金	2,170,878,662	
	受取利息	1,204,472	
	その他の収益	77,775,326	
	支払利息	△297,672	
(B)	有価証券売買損益	1,466,080,453	
	売買益	20,774,196,674	
	売買損	△19,308,116,221	
(C)	その他費用	△65,480,614	
(D)	当期損益金(A+B+C)	3,650,160,627	
(E)	前期繰越損益金	27,471,618,273	
(F)	解約差損益金	△94,232,927,308	
(G)	追加信託差損益金	85,524,453,040	
(H)	計(D+E+F+G)	22,413,304,632	
	次期繰越損益金(H)	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。