

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11月8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	ベビーファンド*	以下の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。
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	エ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。
	エ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。
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。	
運用方法	主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、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、実質的に国内株式、国内債券、先進国株式(除く日本)、先進国債券(除く日本)、先進国債券(除く日本、ヘッジあり)、新興国株式、新興国債券、国内リート、先進国リート(除く日本)に投資します。 なお、先進国株式(除く日本)については各ファンドにおいてその全部または一部の為替ヘッジを行います。 (注)一部の通貨については流動性の観点等から為替ヘッジが困難であるため、主要国通貨で代替的にヘッジする場合があります。 各資産クラスへの配分比率は以下を基本とします。	
	資産クラス	(堅実型) (標準型) (積極型)
	国内株式	4% 7% 13%
	国内債券	36% 17% 3%
	先進国株式(除く日本)	0% 6% 16%
	先進国株式(除く日本、ヘッジあり)	12% 21% 24%
	先進国債券(除く日本)	3% 4% 1%
	先進国債券(除く日本、ヘッジあり)	33% 23% 13%
	新興国株式	1% 1% 2%
	新興国債券	8% 6% 3%
国内リート	2% 10% 13%	
先進国リート(除く日本)	1% 5% 12%	
組入制限	時価変動等により、各資産クラスの組入比率が基本配分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。 ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。	
	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。	
配分方針	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。)および売買取引(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、配分金額を決定します。ただし、配分対象額が少額の場合は配分を行わない場合があります。	

*ベビーファンドとは、たわらノーロード バランス(堅実型)、たわらノーロード バランス(標準型)、たわらノーロード バランス(積極型)です。

<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。

運用報告書(全体版)

第7期<決算日2024年10月15日>

たわらノーロード バランス
(堅実型) / (標準型) / (積極型)

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」は、2024年10月15日に第7期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

アセットマネジメントOne株式会社

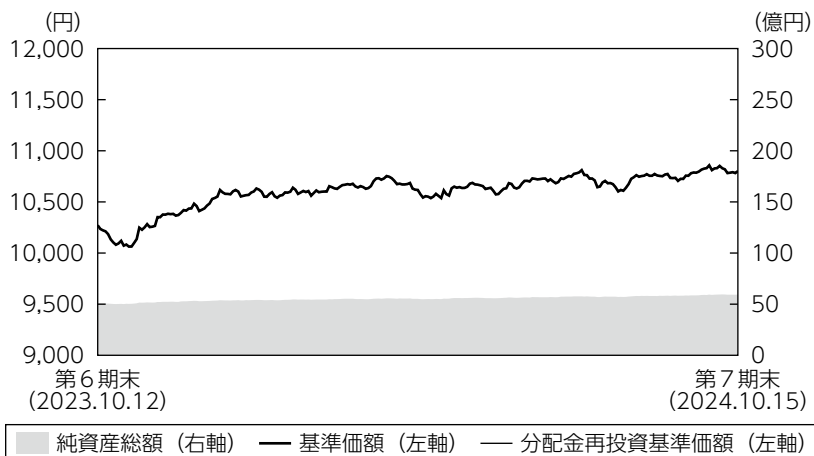
東京都千代田区丸の内1-8-2

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

■当期の運用経過（2023年10月13日から2024年10月15日まで）

たわらノーロード バランス（堅実型）

基準価額等の推移



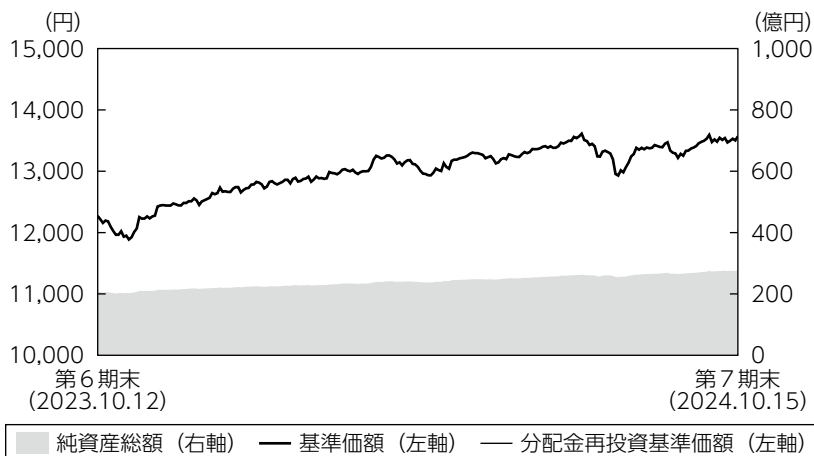
第7期首：10,271円
第7期末：10,801円
(既払分配金0円)
騰落率：5.2%
(分配金再投資ベース)

- (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

マイナス金利政策解除や利上げなどの日銀の金融政策正常化の動きの中で国内の長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと、またそれに伴い国内リートが下落したことがマイナスに寄与しました。一方、米欧の利下げ観測が強まり、その後利下げが決定されたことを背景に本邦以外の主要国の長期金利が低下（債券価格は上昇）したこと、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感、米欧の利下げ決定等から国内外の株式や外国リートが上昇したこと等がプラスに寄与しました。

たわらノーロード バランス (標準型) 基準価額等の推移



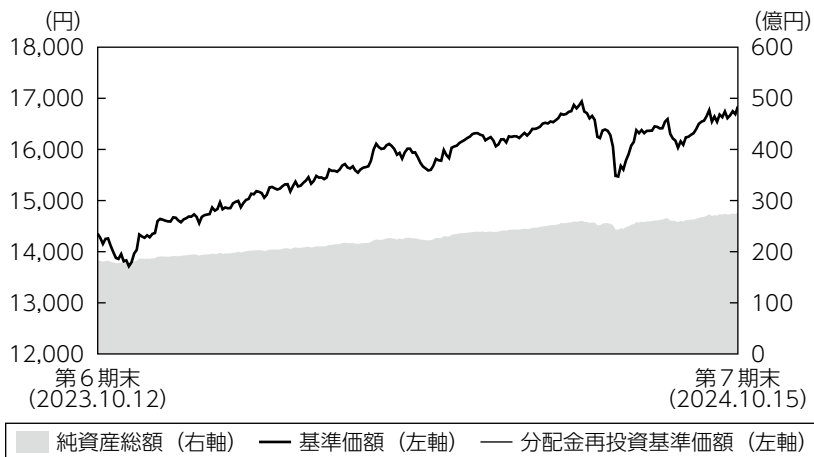
第7期首：12,272円
 第7期末：13,568円
 (既払分配金0円)
 騰落率：10.6%
 (分配金再投資ベース)

- (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

マイナス金利政策解除や利上げなどの日銀の金融政策正常化の動きの中で国内の長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと、またそれに伴い国内リートが下落したことがマイナスに寄与しました。一方、米欧の利下げ観測が強まり、その後利下げが決定されたことを背景に本邦以外の主要国の長期金利が低下（債券価格は上昇）したこと、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感、米欧の利下げ決定等から国内外の株式や外国リートが上昇したこと等がプラスに寄与しました。

たわらノーロード バランス (積極型) 基準価額等の推移



第7期首：14,351円
 第7期末：16,839円
 (既払分配金0円)
 騰落率：17.3%
 (分配金再投資ベース)

- 純資産総額 (右軸) — 基準価額 (左軸) — 分配金再投資基準価額 (左軸)
- (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

マイナス金利政策解除や利上げなどの日銀の金融政策正常化の動きの中で国内の長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと、またそれに伴い国内リートが下落したことがマイナスに寄与しました。一方、米欧の利下げ観測が強まり、その後利下げが決定されたことを背景に本邦以外の主要国の長期金利が低下（債券価格は上昇）したこと、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感、米欧の利下げ決定等から国内外の株式や外国リートが上昇したこと等がプラスに寄与しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2023年末までは、一進一退の動きとなりました。2024年1月から3月にかけては、円安ドル高の進行や海外株式市場の堅調さなどを要因として上昇しました。その後、ほぼ横ばいの推移となりましたが、8月上旬には円高ドル安の進行や米国景気の先行き不安などを受けて急落しました。期末にかけては、米国経済指標の改善などを受けて金融市場全体が徐々に落ち着きを取り戻し、緩やかに値を戻す展開となりました。

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2024年1月にかけて、金融政策の正常化観測が強まった一方で、国債の需給の引き締めりなどから利回りは低下しました。1月から7月にかけては、マイナス金利政策解除などの日銀の金融政策正常化の動きの中で利回りは上昇しました。8月初に米景気後退懸念を背景としたリスク回避の動きから大幅に利回りが低下した後、期末にかけては目立った材料を欠く中で、米国金利の上昇に連れて利回りが上昇しました。

先進国株式市場は上昇しました。米政府機関閉鎖の懸念などから調整して始まりましたが、2023年11月以降は米欧などで早期利下げ観測が浮上し長期金利が低下したことから多くの市場が上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化や米大型ハイテク株の下落などが重しとなり調整する場面も見られましたが、パウエルF R B（米連邦準備理事会）議長が、2024年9月の利下げを示唆したことなどから反発し、利下げ後も更なる利下げ期待から高値圏で期末を迎えました。

先進国債券市場では、米国債およびドイツ国債の利回りはともに低下しました。米国債は、米国のインフレの鈍化、米雇用者数の伸び鈍化や失業率の悪化などを受けて、F R Bが利下げのペースを早めるという観測から利回りは低下しました。ドイツ国債についてもヨーロッパの景気悪化懸念を受け、E C B（欧州中央銀行）が利下げを開始し利回りは低下しました。

新興国株式市場（円換算ベース）は上昇しました。米国の利下げ観測を受け新興国市場でも金利低下期待から堅調に推移しました。なかでも半導体関連を中心にハイテク株が堅調であった台湾、景気拡大を背景に堅調な企業業績が続くインド、2024年9月に金融緩和策を中心とした大規模な景気刺激策を発表した中国などが上昇しました。

新興国債券市場は上昇（利回りは低下）しました。米国のインフレ鈍化、米雇用者数の伸び鈍化や失業率の悪化などを受けて、F R Bによる利下げ観測が高まり、2024年9月には0.5%の利下げを決定したことなどから米長期国債は上昇しました。それに連れた動きや対米国債スプレッド（利回り格差）の縮小なども相まって新興国債券は上昇しました。

国内リート市場は下落しました。前半は日銀の金融政策正常化への警戒感から下落する局面もありましたが、2024年3月の金融政策決定会合でマイナス金利解除が決定されると先行き不透明感が払しょくされ、また金融緩和的な環境が当面続くとの観測が広がり反発しました。後半は日米の金融政策を巡る思惑などから方向感に欠ける展開となりました。期末にかけては自民党総裁選挙の結果を受けて日銀の追加利上げペース加速への懸念が強まり、軟調な推移となりました。

先進国リート市場は上昇しました。期前半は米国や豪州で早期利下げ観測が浮上し、先進国リート市場は上昇しました。その後は利下げ観測が後退し、上値の重い展開となりました。2024年7月から8月にかけて日米などの株式市場では調整がありましたが、先進国リート市場では米長期金利の低下が下支えとなり影響は限定的でした。期末にかけては米豪での利下げ期待や欧州の景況感指数改善などを受けて上昇基調となりました。

為替市場では円は主要通貨に対してまちまちの動きとなりました。ドル／円相場は、内外の金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に円安ドル高の推移となった後、2024年7月に日銀が追加利上げに踏み切り、更なる利上げにも前向きな姿勢を示したこと等から急速に円高ドル安が進みました。その他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等を背景に概ね円安現地通貨高となった後、急速に円高現地通貨安となりましたが、前期末比ではまちまちの結果となりました。

ポートフォリオについて

各ファンドは、マザーファンドを通じて国内外の株式、債券およびリートに投資を行いました。また、各ファンドは基本配分比率に基づき、各マザーファンドの組入れを行い、先進国株式については各ファンドにおいてその一部または全部の為替ヘッジを行いました。

○組入ファンドの当作成期間の騰落率および期末時点の組入比率

投資対象資産	組入ファンド	騰落率	組入比率		
			(堅実型)	(標準型)	(積極型)
国内株式	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	19.0%	4.0%	7.0%	13.2%
国内債券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△1.4%	35.4%	16.4%	2.4%
先進国株式	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	32.7%	12.4%	27.6%	41.0%
先進国債券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.4%	3.0%	4.0%	1.0%
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.7%	32.9%	22.9%	12.8%
新興国株式	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	24.3%	1.0%	1.0%	2.2%
新興国債券	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	13.0%	8.0%	6.0%	3.0%
国内リート	J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	△4.2%	2.0%	9.9%	12.8%
先進国リート	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	29.2%	1.0%	5.0%	12.0%
現金等	-	-	0.1%	0.2%	△0.3%

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

各組入ファンドはベンチマーク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。

○組入ファンドのベンチマーク

組入ファンド	ベンチマーク
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	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）
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	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）
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	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）
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	JPMエルガン・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）
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	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）

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、各ファンドとも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
	(堅実型)	(標準型)	(積極型)
当期分配金（税引前）	－円	－円	－円
対基準価額比率	－%	－%	－%
当期の収益	－円	－円	－円
当期の収益以外	－円	－円	－円
翌期繰越分配対象額	1,399円	3,567円	6,839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

各ファンドでは、各ファンドとも各資産の保有比率が基本配分比率に維持され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、高位組入れを維持します。

各組入ファンドは、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。

■分配金のお知らせ

各ファンド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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■各ファンドが投資対象とする「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、先物取引等の指図範囲の規定を追加しました。

(2024年4月12日)

たわらノーロード バランス (堅実型)

■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 物比率	債券組 入率	新株予 約権社 債(換 社債)比	債券先 物比率	投資信 託受益 証券組 入比率	純資産 総額
	円	円	%							
3期 (2020年10月12日)	10,795	0	2.7	16.1	0.5	78.6	—	—	3.2	百万円 1,316
4期 (2021年10月12日)	11,205	0	3.8	16.6	0.5	79.1	—	—	3.2	2,805
5期 (2022年10月12日)	10,094	0	△9.9	16.2	0.6	78.8	—	—	3.2	3,850
6期 (2023年10月12日)	10,271	0	1.8	16.5	0.5	78.6	—	—	3.2	5,098
7期 (2024年10月15日)	10,801	0	5.2	16.8	0.5	79.8	—	—	3.2	5,933

(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(轉換社債)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む場合があります。

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

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンド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 組 比	株 式 入 率	株 先 比	式 物 率	債 組 比	券 入 率	新株予約権 付社債 (転換入 組比率)	債 先 比	券 物 率	投資信託 受益証券 組入比率	
	円	騰落率											
(期首) 2023年10月12日	10,271	—	%	16.5		%		%	78.6	%	—	—	%
10月 末	10,064	△2.0		16.1		0.4		78.9	—	—	—	—	3.2
11月 末	10,420	1.5		16.6		0.4		78.2	—	—	—	—	3.1
12月 末	10,601	3.2		16.5		0.4		77.2	—	—	—	—	3.1
2024年1月 末	10,591	3.1		17.2		0.5		79.7	—	—	—	—	3.1
2月 末	10,627	3.5		16.8		0.5		80.0	—	—	—	—	3.1
3月 末	10,746	4.6		17.0		0.5		78.2	—	—	—	—	3.1
4月 末	10,613	3.3		17.2		0.6		79.7	—	—	—	—	3.1
5月 末	10,577	3.0		16.5		0.6		78.8	—	—	—	—	3.0
6月 末	10,721	4.4		17.2		0.5		79.1	—	—	—	—	3.1
7月 末	10,682	4.0		15.7		0.5		77.3	—	—	—	—	3.1
8月 末	10,751	4.7		16.0		0.5		84.6	—	—	—	—	3.2
9月 末	10,811	5.3		15.9		0.5		78.3	—	—	—	—	3.1
(期末) 2024年10月15日	10,801	5.2		16.8		0.5		79.8	—	—	—	—	3.2

(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む場合があります。

(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む場合があります。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	(2023年10月13日 ～2024年10月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	15円	0.144%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,604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)	(6)	(0.055)	
(販売会社)	(7)	(0.066)	
(受託会社)	(2)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	3	0.030	(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)	(2)	(0.023)	
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.002)	
合計	19	0.176	

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

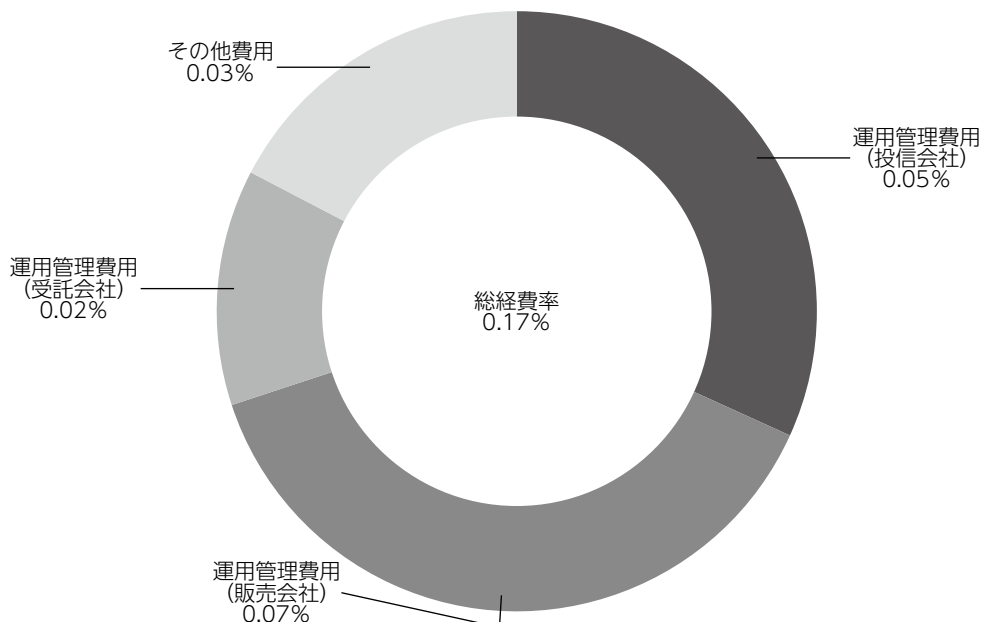
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.17%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年10月13日から2024年10月15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	19,468	87,202	21,311	98,021
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	381,719	467,252	112,436	137,427
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	8,737	70,945	16,660	146,374
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	13,853	32,749	9,210	21,694
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	363,759	423,052	151,198	177,004
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	17,273	28,885	19,389	33,212
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	38,486	91,157	34,155	80,583
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	15,658	36,000	6,657	15,589
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	11,329	21,559	14,530	27,730

■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	253,817,954千円	543,120,579千円	31,603,919千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	542,954,940千円	1,358,478,801千円	85,776,771千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.46	0.39	0.36

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年10月13日から2024年10月15日まで）

【たわらノーロード バランス（堅実型）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

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	38千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	1千円
(B)／(A)	2.7%

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

【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 146,325	百万円 48,109	% 32.9	百万円 107,492	百万円 43,412	% 40.4

平均保有割合 0.0%

(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。

(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 1,492	百万円 1,322	百万円 6,162

(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 384

【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 857,837	百万円 90,054	% 10.5	百万円 845,016	百万円 122,439	% 14.5

平均保有割合 0.4%

(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等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【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等はありません。

【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等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

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 106,474	百万円 29,661	% 27.9	百万円 111,881	百万円 44,414	% 39.7
不動産投信指数先物取引	19,793	14,935	75.5	19,997	9,881	49.4

平均保有割合 0.1%

(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。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 5,098

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 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	51,075	49,232	239,029
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,460,247	1,729,530	2,101,726
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	83,810	75,887	737,651
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	69,724	74,367	179,032
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,468,845	1,681,406	1,954,803
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	33,805	31,689	59,965
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	190,731	195,062	475,268
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	42,862	51,863	117,860
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	30,435	27,233	60,311

■投資信託財産の構成

2024年10月15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	239,029	4.0
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,101,726	35.2
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	737,651	12.3
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	179,032	3.0
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,954,803	32.7
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	59,965	1.0
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	475,268	8.0
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	117,860	2.0
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	60,311	1.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	50,465	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	5,976,114	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2024年10月15日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,670,461,664千円、99.9%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは269,811,439千円、97.5%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは313,319,426千円、97.0%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは105,309,597千円、99.5%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは116,746,982千円、99.4%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは94,618,399千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.67円、1カナダ・ドル=108.49円、1オーストラリア・ドル=100.67円、1香港・ドル=19.28円、1シンガポール・ドル=114.47円、1ニューージーランド・ドル=91.16円、1台湾・ドル=4.65円、1イギリス・ポンド=195.57円、1イスラエル・シェケル=39.731円、1スイス・フラン=173.63円、1トルコ・リラ=4.37円、1デンマーク・クローネ=21.88円、1ノルウェー・クローネ=13.86円、1スウェーデン・クローナ=14.36円、1メキシコ・ペソ=7.704円、1フィリピン・ペソ=2.604円、100チリ・ペソ=16.114円、100コロンビア・ペソ=3.557円、1クウェート・ディナール=487.05円、1カタール・リアル=41.13円、1サウジアラビア・リアル=39.92円、1インド・ルピー=1.79円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=40.82円、1ブラジル・レアル=26.744円、1チェコ・コルナ=6.462円、100韓国・ウォン=11.03円、1オフショア・人民元=21.093円、1マレーシア・リンギット=34.816円、1南アフリカ・ランド=8.52円、1タイ・バーツ=4.49円、1ポーランド・ズロチ=38.019円、100ハンガリー・フォリント=40.708円、1ユーロ=163.25円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年10月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	6,674,368,584円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	50,465,398
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)	239,029,526
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,101,726,025
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	737,651,560
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	179,032,189
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,954,803,236
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	59,965,115
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	475,268,806
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)	117,860,676
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	60,311,767
未 収 入 金	698,254,286
(B) 負 債	740,497,372
未 払 金	723,710,336
未 払 解 約 金	12,521,572
未 払 信 託 報 酬	4,151,856
そ の 他 未 払 費 用	113,608
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,933,871,212
元 本	5,494,010,099
次 期 繰 越 損 益 金	439,861,113
(D) 受 益 権 総 口 数	5,494,010,099口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	10,801円

(注) 期首における元本額は4,963,502,940円、当期中における追加設定元本額は1,630,399,116円、同解約元本額は1,099,891,957円です。

■損益の状況

当期 自2023年10月13日 至2024年10月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	31,837円
受 取 利 息	33,992
支 払 利 息	△2,155
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	247,991,407
売 買 益	449,651,399
売 買 損	△201,659,992
(C) 信 託 報 酬 等	△8,708,781
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	239,314,463
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△164,052,567
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	364,599,217
(配 当 等 相 当 額)	(491,574,842)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△126,975,625)
(G) 合 計(D+E+F)	439,861,113
次 期 繰 越 損 益 金(G)	439,861,113
追 加 信 託 差 損 益 金	364,599,217
(配 当 等 相 当 額)	(492,979,711)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△128,380,494)
分 配 準 備 積 立 金	275,713,042
繰 越 損 益 金	△200,451,146

(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	111,980,331円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	492,979,711
(d) 分 配 準 備 積 立 金	163,732,711
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	768,692,753
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	1,399.15
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

たわらノーロード バランス (標準型)

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付(転換)社債比率	債券先物比率	債券先物比率	投資信託受益証券投資比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率								
3期 (2020年10月12日)	円 11,242	円 0	% 3.1	% 33.6	% 1.0	% 48.8	% -	% -	% -	% 15.1	百万円 4,584
4期 (2021年10月12日)	12,641	0	12.4	34.2	1.0	49.0	-	-	-	15.4	9,918
5期 (2022年10月12日)	11,499	0	△9.0	33.2	1.4	49.2	-	-	-	15.2	14,312
6期 (2023年10月12日)	12,272	0	6.7	33.8	1.0	48.7	-	-	-	15.3	20,683
7期 (2024年10月15日)	13,568	0	10.6	34.3	1.1	49.5	-	-	-	15.1	27,690

(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む場合があります。

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

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンド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	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	新株予約権付社債(転換社債)組入率	債券先物比率	債券先物比率	投資信託受益証券組入率
	円	騰落率								
(期首) 2023年10月12日	12,272	—	33.8	1.0	48.7	—	—	—	—	15.3
10月 末	11,924	△2.8	33.1	1.0	49.3	—	—	—	—	15.2
11月 末	12,484	1.7	33.8	0.9	48.7	—	—	—	—	15.1
12月 末	12,741	3.8	33.4	1.0	47.7	—	—	—	—	15.3
2024年1月 末	12,860	4.8	34.5	1.2	49.8	—	—	—	—	15.1
2月 末	12,951	5.5	34.5	1.1	49.8	—	—	—	—	15.1
3月 末	13,258	8.0	33.8	1.1	48.8	—	—	—	—	15.2
4月 末	13,130	7.0	34.1	1.4	49.7	—	—	—	—	15.3
5月 末	13,144	7.1	33.7	1.2	49.0	—	—	—	—	15.0
6月 末	13,407	9.2	34.6	1.2	49.2	—	—	—	—	15.0
7月 末	13,312	8.5	32.4	1.2	48.0	—	—	—	—	15.2
8月 末	13,392	9.1	32.8	1.2	51.6	—	—	—	—	15.2
9月 末	13,476	9.8	33.0	1.3	48.9	—	—	—	—	15.0
(期末) 2024年10月15日	13,568	10.6	34.3	1.1	49.5	—	—	—	—	15.1

(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む場合があります。

(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む場合があります。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	(2023年10月13日 ～2024年10月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	19円	0.144%	(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13,004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)	(9)	(0.067)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	1	0.004	(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)	(0)	(0.003)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	3	0.024	(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)	(2)	(0.017)	
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.004)	
合計	23	0.174	

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

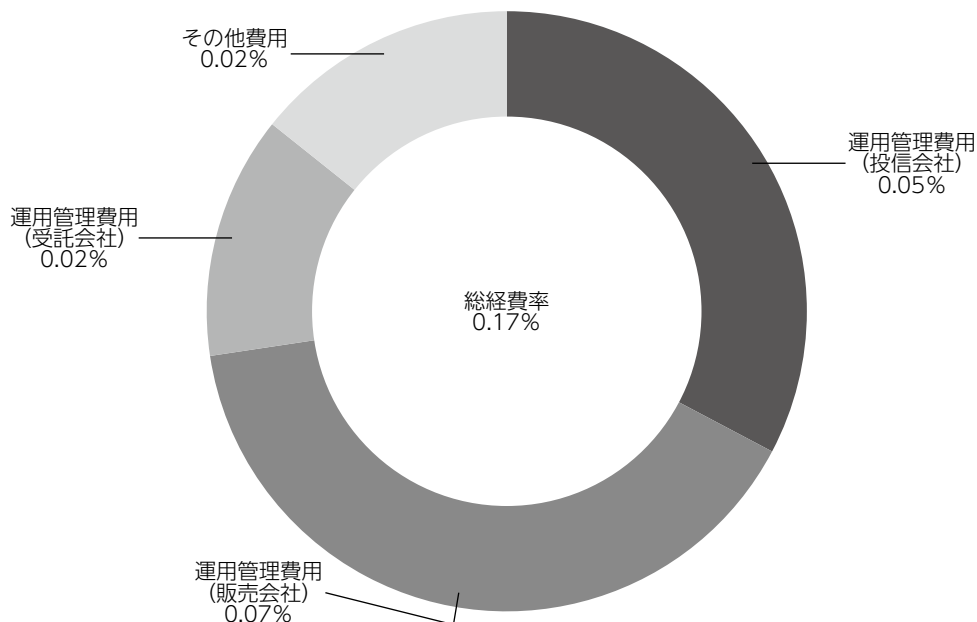
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.17%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年10月13日から2024年10月15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	151,438	680,136	116,769	535,080
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,250,047	1,529,723	251,008	306,857
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	126,171	1,052,604	100,527	868,503
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	104,457	246,071	21,074	48,934
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	1,892,269	2,202,851	578,650	678,554
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	53,249	89,464	43,672	76,320
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	143,865	339,288	42,344	98,680
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	487,632	1,123,083	151,096	354,456
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	156,520	296,932	144,995	275,994

■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	253,817,954千円	543,120,579千円	31,603,919千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	542,954,940千円	1,358,478,801千円	85,776,771千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.46	0.39	0.36

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年10月13日から2024年10月15日まで）

【たわらノーロード バランス（標準型）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

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	455千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	23千円
(B)／(A)	5.0%

(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 146,325	百万円 48,109	% 32.9	百万円 107,492	百万円 43,412	% 40.4

平均保有割合 0.3%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,492	百万円 1,322	百万円 6,162

(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 384

【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 857,837	百万円 90,054	% 10.5	百万円 845,016	百万円 122,439	% 14.5

平均保有割合 0.8%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該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等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【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等はありません。

【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等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

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 106,474	百万円 29,661	% 27.9	百万円 111,881	百万円 44,414	% 39.7
不動産投信指数先物取引	19,793	14,935	75.5	19,997	9,881	49.4

平均保有割合 1.3%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 5,098

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期	末
	□ 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	365,096	399,765	1,940,901
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,742,786	3,741,825	4,547,066
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	759,835	785,480	7,635,105
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	375,581	458,964	1,104,911
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,141,246	5,454,865	6,341,826
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	137,925	147,503	279,120
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	576,508	678,028	1,652,017
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	870,556	1,207,093	2,743,118
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	618,762	630,286	1,395,833

■投資信託財産の構成

2024年10月15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	1,940,901	6.9
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,547,066	16.3
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,635,105	27.3
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,104,911	4.0
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,341,826	22.7
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	279,120	1.0
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,652,017	5.9
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	2,743,118	9.8
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,395,833	5.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	305,943	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	27,945,845	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2024年10月15日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,670,461,664千円、99.9%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは269,811,439千円、97.5%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは313,319,426千円、97.0%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは105,309,597千円、99.5%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは116,746,982千円、99.4%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは94,618,399千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.67円、1カナダ・ドル=108.49円、1オーストラリア・ドル=100.67円、1香港・ドル=19.28円、1シンガポール・ドル=114.47円、1ニューージーランド・ドル=91.16円、1台湾・ドル=4.65円、1イギリス・ポンド=195.57円、1イスラエル・シェケル=39.731円、1スイス・フラン=173.63円、1トルコ・リラ=4.37円、1デンマーク・クローネ=21.88円、1ノルウェー・クローネ=13.86円、1スウェーデン・クローナ=14.36円、1メキシコ・ペソ=7.704円、1フィリピン・ペソ=2.604円、100チリ・ペソ=16.114円、100コロンビア・ペソ=3.557円、1クウェート・ディナール=487.05円、1カタール・リアル=41.13円、1サウジアラビア・リアル=39.92円、1インド・ルピー=1.79円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=40.82円、1ブラジル・レアル=26.744円、1チェコ・コルナ=6.462円、100韓国・ウォン=11.03円、1オフショア・人民元=21.093円、1マレーシア・リンギット=34.816円、1南アフリカ・ランド=8.52円、1タイ・バーツ=4.49円、1ポーランド・ズロチ=38.019円、100ハンガリー・フォリント=40.708円、1ユーロ=163.25円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年10月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	33,561,093,984円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	305,943,401
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)	1,940,901,920
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	4,547,066,298
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	7,635,105,141
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,104,911,469
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	6,341,826,659
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	279,120,326
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	1,652,017,558
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)	2,743,118,897
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,395,833,506
未 収 入 金	5,615,248,809
(B) 負 債	5,870,715,949
未 払 金	5,819,962,038
未 払 解 約 金	31,612,289
未 払 信 託 報 酬	18,686,839
そ の 他 未 払 費 用	454,783
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	27,690,378,035
元 本	20,408,688,697
次 期 繰 越 損 益 金	7,281,689,338
(D) 受 益 権 総 口 数	20,408,688,697口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	13,568円

■損益の状況

当期 自2023年10月13日 至2024年10月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	139,470円
受 取 利 息	148,631
支 払 利 息	△9,161
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,274,614,212
売 買 益	3,544,024,120
売 買 損	△1,269,409,908
(C) 信 託 報 酬 等	△35,988,215
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	2,238,765,467
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	529,136,983
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,513,786,888
(配 当 等 相 当 額)	(3,571,302,288)
(売 買 損 益 相 当 額)	(942,484,600)
(G) 合 計(D+E+F)	7,281,689,338
次 期 繰 越 損 益 金(G)	7,281,689,338
追 加 信 託 差 損 益 金	4,513,786,888
(配 当 等 相 当 額)	(3,578,129,311)
(売 買 損 益 相 当 額)	(935,657,577)
分 配 準 備 積 立 金	2,767,902,450

(注) 期首における元本額は16,853,980,652円、当期中における追加設定元本額は5,649,136,478円、同解約元本額は2,094,428,433円です。

(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	582,477,197円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	923,211,781
(c) 収 益 調 整 金	4,513,786,888
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,262,213,472
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	7,281,689,338
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	3,567.94
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

たわらノーロード バランス (積極型)

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付(転換)社債比率	債券先物比率	投資信託受益証券投資比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率							
3期 (2020年10月12日)	円 11,248	円 0	% 1.9	% 52.6	% 1.6	% 19.2	% -	% -	% 25.6	百万円 3,655
4期 (2021年10月12日)	13,735	0	22.1	53.5	1.6	19.2	-	-	25.6	8,137
5期 (2022年10月12日)	12,728	0	△7.3	52.4	2.1	19.4	-	-	25.5	11,980
6期 (2023年10月12日)	14,351	0	12.8	53.0	1.6	19.2	-	-	25.3	18,332
7期 (2024年10月15日)	16,839	0	17.3	54.3	1.7	19.4	-	-	25.0	27,662

(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む場合があります。

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

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンド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	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	新株予約権付社債(転換社債)組入率	債券先物比率	債券先物比率	投資信託受益証券組入率
	円	騰落率								
(期首) 2023年10月12日	14,351	—	53.0	1.6	19.2	—	—	—	—	25.3
10月 末	13,795	△3.9	52.4	1.6	19.5	—	—	—	—	25.3
11月 末	14,631	2.0	52.7	1.4	19.2	—	—	—	—	25.4
12月 末	14,995	4.5	52.4	1.5	18.6	—	—	—	—	25.5
2024年1月 末	15,320	6.8	53.5	1.8	19.8	—	—	—	—	25.2
2月 末	15,563	8.4	53.3	1.6	19.8	—	—	—	—	25.3
3月 末	16,108	12.2	52.6	1.7	19.1	—	—	—	—	25.3
4月 末	15,989	11.4	52.8	2.1	19.6	—	—	—	—	25.5
5月 末	16,098	12.2	52.6	1.9	19.4	—	—	—	—	25.3
6月 末	16,546	15.3	53.4	1.8	19.5	—	—	—	—	25.1
7月 末	16,364	14.0	51.3	1.9	18.9	—	—	—	—	25.4
8月 末	16,416	14.4	52.9	1.9	19.2	—	—	—	—	25.0
9月 末	16,545	15.3	52.1	2.1	19.2	—	—	—	—	25.0
(期末) 2024年10月15日	16,839	17.3	54.3	1.7	19.4	—	—	—	—	25.0

(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む場合があります。

(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む場合があります。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	(2023年10月13日 ～2024年10月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	23円	0.144%	(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15,688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)	(9)	(0.055)	
(販売会社)	(10)	(0.066)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	1	0.004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	1	0.007	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.004)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.003)	
(d) その他費用	5	0.029	(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)	(3)	(0.019)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(1)	(0.006)	
合計	29	0.184	

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

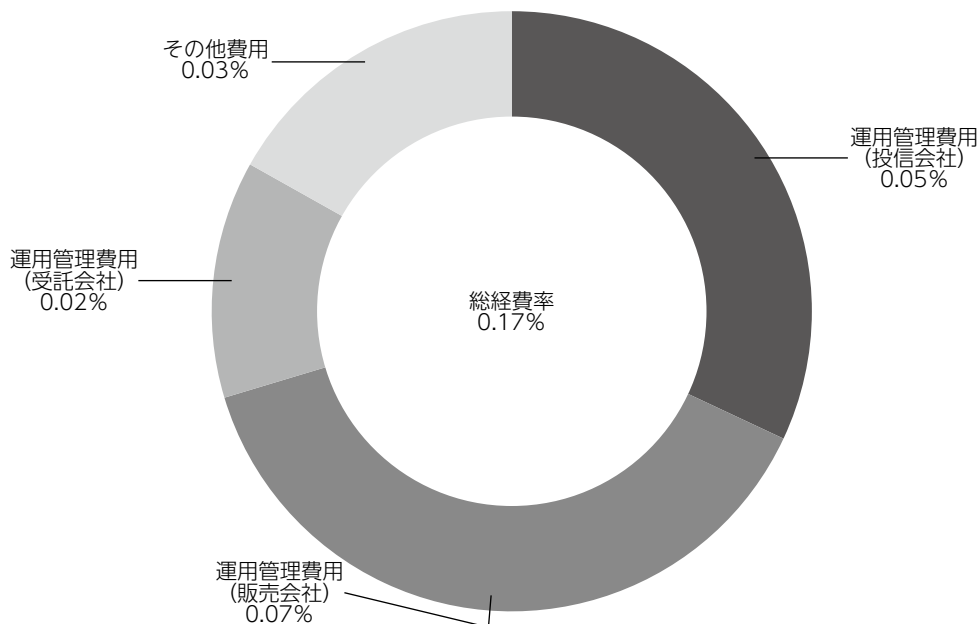
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.17%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年10月13日から2024年10月15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	297,988	1,354,230	143,236	671,691
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	258,568	316,312	69,624	84,848
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	229,501	1,959,843	57,586	473,785
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	35,018	82,580	4,074	9,396
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	1,481,374	1,724,741	503,013	590,840
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	109,633	183,684	37,943	63,252
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	100,031	235,837	17,527	39,686
J-R-E-I-Tインデックス ファンド・マザーファンド	771,497	1,783,201	210,985	491,354
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	456,520	875,791	260,216	493,713

■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	253,817,954千円	543,120,579千円	31,603,919千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	542,954,940千円	1,358,478,801千円	85,776,771千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.46	0.39	0.36

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年10月13日から2024年10月15日まで）

【たわらノーロード バランス（積極型）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

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	891千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	29千円
(B)／(A)	3.3%

(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 146,325	百万円 48,109	% 32.9	百万円 107,492	百万円 43,412	% 40.4

平均保有割合 0.5%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,492	百万円 1,322	百万円 6,162

(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 384

【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 857,837	百万円 90,054	% 10.5	百万円 845,016	百万円 122,439	% 14.5

平均保有割合 0.1%

(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。

【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等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【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等はありません。

【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等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

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 106,474	百万円 29,661	% 27.9	百万円 111,881	百万円 44,414	% 39.7
不動産投信指数先物取引	19,793	14,935	75.5	19,997	9,881	49.4

平均保有割合 1.6%

(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。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 5,098

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 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	595,293	750,045	3,641,548
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	368,709	557,653	677,660
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	994,025	1,165,940	11,333,295
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	83,541	114,486	275,613
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,074,798	3,053,158	3,549,602
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	243,979	315,669	597,340
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	257,226	339,731	827,754
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	993,410	1,553,923	3,531,290
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,303,470	1,499,774	3,321,400

■投資信託財産の構成

2024年10月15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	3,641,548	13.0
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	677,660	2.4
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,333,295	40.6
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	275,613	1.0
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,549,602	12.7
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	597,340	2.1
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	827,754	3.0
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	3,531,290	12.6
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,321,400	11.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	179,154	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	27,934,660	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2024年10月15日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,670,461,664千円、99.9%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは269,811,439千円、97.5%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは313,319,426千円、97.0%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは105,309,597千円、99.5%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは116,746,982千円、99.4%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは94,618,399千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.67円、1カナダ・ドル=108.49円、1オーストラリア・ドル=100.67円、1香港・ドル=19.28円、1シンガポール・ドル=114.47円、1ニューージーランド・ドル=91.16円、1台湾・ドル=4.65円、1イギリス・ポンド=195.57円、1イスラエル・シェケル=39.731円、1スイス・フラン=173.63円、1トルコ・リラ=4.37円、1デンマーク・クローネ=21.88円、1ノルウェー・クローネ=13.86円、1スウェーデン・クローナ=14.36円、1メキシコ・ペソ=7.704円、1フィリピン・ペソ=2.604円、100チリ・ペソ=16.114円、100コロンビア・ペソ=3.557円、1クウェート・ディナール=487.05円、1カタール・リアル=41.13円、1サウジアラビア・リアル=39.92円、1インド・ルピー=1.79円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=40.82円、1ブラジル・レアル=26.744円、1チェコ・コルナ=6.462円、100韓国・ウォン=11.03円、1オフショア・人民元=21.093円、1マレーシア・リンギット=34.816円、1南アフリカ・ランド=8.52円、1タイ・バーツ=4.49円、1ポーランド・ズロチ=38.019円、100ハンガリー・フォリント=40.708円、1ユーロ=163.25円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年10月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	34,288,208,074円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	179,153,973
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)	3,641,548,023
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	677,660,382
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	11,333,295,320
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	275,613,610
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	3,549,602,504
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	597,340,581
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	827,754,981
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)	3,531,290,299
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	3,321,400,561
未 収 入 金	6,353,547,840
(B) 負 債	6,625,507,168
未 払 金	6,585,177,290
未 払 解 約 金	21,700,728
未 払 信 託 報 酬	18,181,292
そ の 他 未 払 費 用	447,858
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	27,662,700,906
元 本	16,427,524,863
次 期 繰 越 損 益 金	11,235,176,043
(D) 受 益 権 総 口 数	16,427,524,863口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	16,839円

(注) 期首における元本額は12,774,730,047円、当期中における追加設定元本額は5,305,395,020円、同解約元本額は1,652,600,204円です。

■損益の状況

当期 自2023年10月13日 至2024年10月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	135,086円
受 取 利 息	143,916
支 払 利 息	△8,830
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,402,158,072
売 買 益	4,757,985,833
売 買 損	△1,355,827,761
(C) 信 託 報 酬 等	△33,960,971
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,368,332,187
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,556,397,083
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,310,446,773
(配 当 等 相 当 額)	(4,273,158,957)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,037,287,816)
(G) 合 計(D+E+F)	11,235,176,043
次 期 繰 越 損 益 金(G)	11,235,176,043
追 加 信 託 差 損 益 金	6,310,446,773
(配 当 等 相 当 額)	(4,281,266,401)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,029,180,372)
分 配 準 備 積 立 金	4,924,729,270

(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	599,441,189円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,768,890,998
(c) 収 益 調 整 金	6,310,446,773
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,556,397,083
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	11,235,176,043
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	6,839.24
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

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22期（決算日 2024年2月7日）

（計算期間 2023年2月8日～2024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22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	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。
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
	期騰落率	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
18期 (2020年2月7日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
19期 (2021年2月8日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
20期 (2022年2月7日)	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336
21期 (2023年2月7日)	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9	396,982
22期 (2024年2月7日)	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	2.5	542,130

(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）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、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章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指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、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

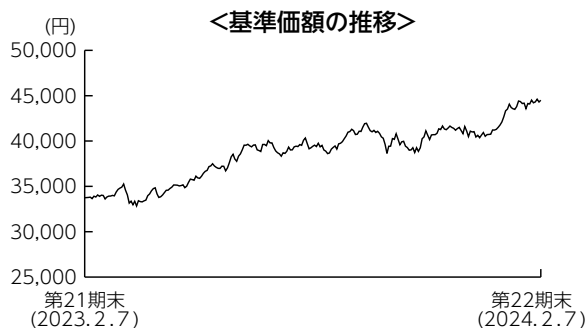
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(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) 2023年 2 月 7 日	円	%	ポイント	%	%	%
	33,751	—	3,251.81	—	98.0	1.9
2 月 末	33,931	0.5	3,269.12	0.5	98.8	1.3
3 月 末	34,508	2.2	3,324.74	2.2	96.1	4.4
4 月 末	35,438	5.0	3,414.45	5.0	97.9	2.4
5 月 末	36,715	8.8	3,537.93	8.8	97.3	2.8
6 月 末	39,491	17.0	3,805.00	17.0	98.4	1.7
7 月 末	40,083	18.8	3,861.80	18.8	97.5	2.5
8 月 末	40,253	19.3	3,878.51	19.3	97.5	2.6
9 月 末	40,464	19.9	3,898.26	19.9	97.6	2.6
10 月 末	39,253	16.3	3,781.64	16.3	97.3	2.7
11 月 末	41,378	22.6	3,986.65	22.6	97.7	2.4
12 月 末	41,289	22.3	3,977.63	22.3	96.9	3.2
2024年 1 月 末	44,516	31.9	4,288.36	31.9	97.8	2.1
(期 末) 2024年 2 月 7 日	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	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（2023年2月8日から2024年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は44,494円となり、前期末比で31.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

日米の長期金利差などを要因として円安ドル高が進行したことや、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や海外投資家による日本株買いなどを要因として日本株が大きく上昇したことから、基準価額も上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2023年3月末までは、日米の金融政策、欧米での金融機関の破綻などを要因として一進一退の展開となりました。その後、4月から9月半ばまでは、円安ドル高の進行、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や欧米投資家による日本株買いなどを要因として大きく上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化などを要因として一時的に下落する場面もありましたが、期末にかけては円安ドル高の流れを受けて上昇しました。

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	17.3%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.3
4	銀行業	6.4
5	化学	6.1
6	卸売業	5.9
7	医薬品	5.2
8	サービス業	5.2
9	機械	5.2
10	小売業	4.4



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	16.9%
2	輸送用機器	8.9
3	情報・通信業	7.4
4	卸売業	7.1
5	銀行業	6.9
6	化学	5.8
7	機械	5.2
8	サービス業	4.5
9	医薬品	4.4
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	3.6%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.1
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.0
5	日本電信電話	日本・円	1.7
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
7	武田薬品工業	日本・円	1.3
8	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
9	第一三共	日本・円	1.2
10	任天堂	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,161銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.8%
2	ソニーグループ	日本・円	2.7
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.3
4	キーエンス	日本・円	1.7
5	東京エレクトロン	日本・円	1.6
6	三菱商事	日本・円	1.6
7	日立製作所	日本・円	1.5
8	日本電信電話	日本・円	1.5
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.5
10	信越化学工業	日本・円	1.4
組入銘柄数		2,148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31.8%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、ベンチマークに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)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	1	0.001	
期中の平均基準価額は38,764円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2023年2月8日から2024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
		68,285.4 (56,521.786)	152,756,646 (-)	58,527.986	124,543,615

(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	百万円	百万円	百万円
	122,918	121,163	-	-

(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	277,300,261千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	438,574,353千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.63

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年2月8日から2024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 152,756	百万円 103,694	% 67.9	百万円 124,543	百万円 58,472	% 46.9

(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 1,537	百万円 1,475	百万円 5,468

(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 198

(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)	4,122千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B) / (A)	0.1%

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、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。

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
テレビ朝日ホールディングス		千株	千円	ハイパー	千株	千円	シークス	千株	千円		千株	千円			
スカパーJ SATホールディングス	33.3	35.6	78,498	あい ホールディングス	2.5	1.6	20.5	22	34,342		20.5	22			
日本BS放送	121.3	113.9	94,878	ディー・ブイエックス	23.1	24.8	61,032	3.9	1.9		3.9	1.9			
ビジョン	9.8	10.6	35,139	ダイワボウホールディングス	3.5	1.9	2,036	7.2	8.1		7.2	8.1			
スマートバリュー	4.4	2.4	2,186	マツコホールディングス	59	68.5	215,364	1.4	0.7		1.4	0.7			
USEN-NEXT HOLDINGS	18.1	22.1	25,061	ラクト・ジャパン	35.4	36.6	295,179	890.1	1,039.9		890.1	1,039.9			
ワイヤレスゲート	3	1.9	750	グリムス	5.7	6	13,512	1,140.3	1,289.8		1,140.3	1,289.8			
コネクショ	12.3	16.4	68,634	メディアスホールディングス	6	6.5	13,351	丸紅	2.1	4.7		2.1	4.7		
日本通信	5.5	2.8	800	バスターホールディングス	21.1	23.4	27,963	67.9	70.9		67.9	70.9			
クロップス	8.9	-	-	メデアスホールディングス	11.8	12.5	16,175	7.8	9.7		7.8	9.7			
KDDI	126.2	144.3	34,199	リスターホールディングス	9.2	9	6,705	126.5	135.5		126.5	135.5			
ソフトバンク	2.1	0.9	918	ジオリーブグループ	13.8	13.2	39,930	20.7	21.5		20.7	21.5			
光通信	1,754.4	43,620.3	7,999,963	大光	2.7	1.6	2,134	56	64.7		56	64.7			
エムティーアイ	KDDI	1,058	5,211,586	OCHIホールディングス	5.2	3.6	2,300	1.9	1		1.9	1			
GMOインターネットグループ	2,199.3	2,360	4,589,020	TOKAIホールディングス	2.9	1.6	2,560	1,056.8	1,165.6		1,056.8	1,165.6			
ファイバーゲート	7.3	7.9	7,394	黒谷	71.3	84	84,420	7.6	7.4		7.6	7.4			
アドマテックホールディングス	3.1	1.8	423	Cominix	3.7	2.2	1,344	15.4	16.4		15.4	16.4			
KADOKAWA	72.3	77.5	250,945	三洋貿易	2.4	1.4	1,188	0.6	0.4		0.6	0.4			
学研ホールディングス	22.8	24.4	24,644	ビューティガレージ	14.9	17.5	22,505	2	2,435		2	2,435			
ゼンリン	23.3	25.1	21,435	ワイン・パートナーズ	2.3	4.9	10,520	1.1	10.7		1.1	10.7			
昭文社ホールディングス	5.6	2.9	1,078	ミタチ産業	10.5	10.1	12,726	38.9	46.9		38.9	46.9			
インプレスホールディングス	10.8	6.6	1,168	シッパルホールディングス	3.3	1.9	2,133	2.1	3.1		2.1	3.1			
アイネット	8.4	8.9	17,132	明治電機工業	51.9	55.6	123,320	894.6	936.3		894.6	936.3			
松竹	7.8	7.6	77,558	デリカフーズホールディングス	5.5	5.8	8,479	6.4	6.3		6.4	6.3			
東宝	85.7	81.6	386,294	スターティアホールディングス	5.2	3	1,782	903.1	3,065.3		903.1	3,065.3			
東映	3.8	4.8	96,624	コマダホールディングス	2.5	1.8	2,842	5.1	14.6		5.1	14.6			
NTTデータグループ	429.6	383.4	800,730	ビーバンドコム	35.3	37.9	104,869	33.4	35.8		33.4	35.8			
ピー・シー・エー	7.8	8.4	13,255	アセンテック	1.7	0.9	363	5.7	6.1		5.7	6.1			
ビジネスブレイン太田昭宏	5.9	5.7	12,768	富士興産	4.7	5.9	3,363	10.1	10.9		10.1	10.9			
DTS	29.1	30.9	112,630	協栄産業	2.9	1.9	4,145	12.3	14.7		12.3	14.7			
スクウェア・エニックス・ホールディングス	68.8	67	416,606	フルサト・マルカホールディングス	1.1	0.7	2,093	13.3	14.1		13.3	14.1			
シーイーシー	19.2	18.5	30,691	ヤマエグループホールディングス	14.3	13.8	34,099	13	12.1		13	12.1			
カプコン	136	131.1	738,617	小野建	8.2	8.7	27,013	3.6	3.9		3.6	3.9			
アイ・エス・ピー	7	7.5	11,790	南陽	13.4	15.4	28,490	6.6	3.7		6.6	3.7			
ジャストテック	8.4	9	11,934	佐島電機	2.5	1.4	3,102	25.9	27.8		25.9	27.8			
SCSK	111.7	102.6	272,043	エコトレーディング	8	8.6	19,986	9.6	10.3		9.6	10.3			
NSW	5.4	6.3	18,685	伯東	2.5	1.3	1,602	11.7	11.6		11.7	11.6			
アイネス	9.5	11.4	16,917	コンドレーテック	8.3	8.9	51,798	11.6	12.5		11.6	12.5			
TKC	24.6	23.3	88,307	中山福	11.1	11.9	14,399	32.9	35.2		32.9	35.2			
富士ソフト	15.5	29.5	188,800	ナガイレーベン	6.6	3.9	1,407	3.5	2.1		3.5	2.1			
NSD	48.8	52.3	140,373	三菱食品	18.2	19.6	45,942	1.4	2.2		1.4	2.2			
コナミグループ	58.6	54.9	507,111	松田産業	13.4	14.3	72,644	8.7	9.2		8.7	9.2			
番井コンピュータホールディングス	9.5	9.1	23,241	第一興商	10.9	11.8	31,222	25	29		25	29			
JBCホールディングス	9.9	9.7	38,121	メディバルホールディングス	27.9	59.9	120,279	39.8	37.2		39.8	37.2			
ミロク情報サービス	12.5	13.3	25,961	SPK	149.7	157.3	373,194	29.2	30.6		29.2	30.6			
ソフトバンクグループ	791.6	723.4	4,787,461	萩原電気ホールディングス	6.4	6.9	13,882	8.5	8.3		8.5	8.3			
卸売業 (7.3%)				アズワン	21.2	24.2	133,027	19.2	18.3		19.2	18.3			
高千穂交易	4.5	4.9	19,526	スズデン	5.1	5.4	12,123	4.4	2.5		4.4	2.5			
オルパルシステムホールディングス	2	1.1	2,060	尾家産業	3.1	1.6	2,945	26.5	25.6		26.5	25.6			
伊藤忠食品	2.7	3.5	27,405	シモジマ	9.9	10.4	13,478	35.9	42.8		35.9	42.8			
エレマテック	1.3	13.9	25,117	ドウシシャ	15.3	14.3	30,358	36.3	35.6		36.3	35.6			
あらた	11	23.7	73,588	小津産業	2.9	1.5	2,479	18.6	19.8		18.6	19.8			
トーマンデバイス	2.1	2.2	11,726	高速	7.5	9.2	21,675	4.6	4.3		4.6	4.3			
東京エレクトロン デバイス	5.4	15.4	100,562	たげびし	5.6	5.9	11,859	35.8	38.4		35.8	38.4			
円谷フーズホールディングス	12.4	26.6	47,507	リックス	2.7	2.6	9,282	41	43.8		41	43.8			
双日	153.3	172.3	641,300	丸文	12.9	13.8	21,307	7.4	7.9		7.4	7.9			
アルフレックス ホールディングス	144.9	155.3	371,865	ハビネット	12.3	13.2	37,501	15.4	10.9		15.4	10.9			
横浜冷凍	39.4	42.1	46,731	機本総業ホールディングス	5.8	6.1	7,917	19.4	20.8		19.4	20.8			
神栄	1.8	1	1,712	日本ライフライン	42.3	45.4	59,519	6.2	6		6.2	6			
ラサ商事	5.8	6.3	10,621	タカショー	12.5	13.5	6,709	5.8	6.2		5.8	6.2			
アルコニック	19	20.4	28,580	IDOM	43.7	40.9	36,932	15.9	15.7		15.9	15.7			
神戸物産	111.8	119.7	443,847	進和	9.6	9.5	23,132	21.3	22.8		21.3	22.8			
				エスケイジャパン	3.2	1.7	1,207	11.8	14.1		11.8	14.1			
				ダイトロン	5.7	6.1	18,788	9.4	13.1		9.4	13.1			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末				
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		
バリューHR		千株	千円		千株	千円	日総工業		千株	千円		千株	千円	タナベコンサルティンググループ		千株	千円		千株	千円		
M&Aキャピタルパートナーズ	13	12.2	29,206	6	6.222	18,222	キュービネットホールディングス	10.5	—	—	5	5.2	5,610	ナガワ	3.7	4.7	33,793	3.7	4.7	33,793		
ライオンエクスプレスホールディングス	5.1	6	6,222	19	20.4	12,728	RPAホールディングス	19	20.4	5,385	東京都競馬	11.8	12.6	57,708	常磐興産	4.3	2.5	3,092	4.3	2.5	3,092	
ERIホールディングス	3.2	1.9	3,562	4.3	1.9	1,508	スプリックス	7.7	6.4	18,022	カナモト	25.7	23.3	67,104	ニシオホールディングス	13	14	55,090	13	14	55,090	
アビスト	2	1	3,115	3.3	3.5	1,242	マネジメントソリューションズ	3.3	3.5	1,242	アゴラ ホスピタリティグループ	70.2	43.4	998	トラंस・コスモス	17.4	18.7	55,165	70.2	43.4	998	
シグマクシスホールディングス	21.3	20.3	34,185	2	2	622	テノホールディングス	1.5	0.8	414	乃村工藝社	61.2	65.6	56,940	藤田観光	6.2	6	40,200	61.2	65.6	56,940	
ウィルグループ	11.7	12.5	14,900	4.7	3.8	5,909	プロレド・パートナーズ	4.7	3.8	5,909	日本管財	14.8	—	—	トーカイ	12.5	13.3	28,209	14.8	—	—	
エスコロー・エージェンツ・ジャパン	13.5	7.9	1,106	2.1	2.2	3,577	and factory	3.6	2	622	白洋舎	1.1	1	2,736	セコム	142.9	153.1	1,639,701	1.1	1	2,736	
メドピア	11	13.2	9,081	1.8	0.9	452	テノホールディングス	1.5	0.8	414	セントラル警備保障	7.5	8.1	20,841	メイテックグループホールディングス	55.9	54.1	164,680	7.5	8.1	20,841	
レアジョブ	2.4	1.3	1,186	16.8	15.5	6,851	プロンティア・マネジメント	4.7	3.8	5,909	丹靑社	27	29.1	23,483	応用地質	13.1	14	30,184	27	29.1	23,483	
リクルートホールディングス	1,039	1,112.8	6,435,322	2.1	2.2	3,577	ピアラ	2	1.2	376	メイトピアホールディングス	55.9	54.1	164,680	船井総研ホールディングス	29.5	31.3	77,373	55.9	54.1	164,680	
エラン	18.6	19.9	21,074	1.8	0.9	452	ゴロ・ホールディングス	2.1	2.2	3,577	進学会ホールディングス	4.2	1.7	433	オオバ	7.9	4.5	4,540	4.2	1.7	433	
土木管理総合試験所	5.3	3.1	1,010	—	16.1	44,355	ギークス	1.8	0.9	452	いであ	2.8	1.8	3,834	学究社	5.6	6	12,486	2.8	1.8	3,834	
日本郵政	1,839.2	1,766.2	2,500,939	43.1	41.1	30,866	アンピスホールディングス	—	16.1	44,355	学究社	5.6	6	12,486	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	5.6	6	12,486	
ベルシステム24ホールディングス	18.8	16.1	28,802	8.3	20.5	16,338	カープスホールディングス	43.1	41.1	30,866	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	ナック	6.5	12.8	6,937	15.5	16.1	60,455	
鎌倉新書	15.9	12.8	7,936	4.7	5.1	5,630	フォーラムエンジニアリング	8.3	20.5	16,338	ナック	6.5	12.8	6,937	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	6.5	12.8	6,937	
SAMN	3.2	1.3	421	16.8	15.5	6,851	FAST FITNESS JAPAN	4.7	5.1	5,630	ステップ	5.8	5.5	11,088	ステップ	5.8	5.5	11,088	5.8	5.5	11,088	
一蔵	1.5	0.8	494	10.9	11.7	25,353	ダイレクトマーケティングミックス	16.8	15.5	6,851	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
グローバルキッズCOMPANY	1.9	1.2	786	2.1	2.2	3,000	ロビンズ	2.1	2.2	3,000	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
エアトリ	9.1	11	20,009	10.9	11.7	25,353	LITALICO	10.9	11.7	25,353	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
アトリエ	11	8.9	5,918	—	0.6	963	コンフィデンス・インタワークス	—	0.6	963	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
ストライク	6.9	6.4	30,976	5.7	3.4	1,547	アドバンテッジリスクマネジメント	5.7	3.4	1,547	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
ソラスト	38.7	41.4	23,598	78.1	75.3	118,635	リロググループ	78.1	75.3	118,635	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
セラク	5	4.6	5,147	9.8	10.5	8,158	東祥	9.8	10.5	8,158	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
インソース	34.8	32.6	25,395	—	9.1	33,488	ID&Eホールディングス	—	9.1	33,488	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
ペイカレント・コンサルティング	111	110.5	345,754	2.7	3.1	5,614	ビーウィズ	2.7	3.1	5,614	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
Orchestra Holdings	3	3.2	3,168	29.5	28.8	36,316	TREホールディングス	29.5	28.8	36,316	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
アイモパイル	7.3	20.1	9,105	6.3	5.7	10,807	人・夢・技術グループ	6.3	5.7	10,807	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
キャリアインデックス	4.2	2.3	457	—	13	10,647	NISSOホールディングス	—	13	10,647	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
MS-Japan	4.1	5.5	6,963	26.7	27.3	68,058	大栄環境	26.7	27.3	68,058	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
船場	1.5	1.4	1,379	—	15.8	40,416	日本管財ホールディングス	—	15.8	40,416	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
ジョビエレベーターサービスホールディングス	50	48.7	105,386	—	7.2	42,840	M&A総研ホールディングス	—	7.2	42,840	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
フルテック	1.7	1	1,128	36.7	43.7	77,523	エイチ・アイ・エス	36.7	43.7	77,523	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
グリーンズ	4.2	2.4	4,917	4.4	6.8	17,761	ラックランド	4.4	6.8	17,761	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
ツナググループホールディングス	3.5	1.9	1,649	24	23.6	145,706	共立メンテナンス	24	23.6	145,706	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
GAMEWITH	3.7	2.8	873	15	16	25,536	イチネンホールディングス	15	16	25,536	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
MS&Consulting	1.4	1	590	7.2	7.7	46,893	建設技術研究所	7.2	7.7	46,893	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
ウェルビー	10.3	7.5	6,382	10	9.8	9,261	スペース	10	9.8	9,261	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
エック・ティール・エス	1.9	1.7	4,867	6	14.1	15,777	燎ホールディングス	6	14.1	15,777	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
ミダグホールディングス	8.6	9.1	15,388	0.6	3	9,420	Sバル興業	0.6	3	9,420	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
				4.6	2.4	2,726	東京テアトル	4.6	2.4	2,726	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。
(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		末
		買建額	売建額	額
国内	T O P I X	百万円 13,328		百万円 -

■投資信託財産の構成

2024年2月7日現在

項目	当期		末
	評価額	比率	率
株式	千円 528,947,749		% 97.5
コール・ローン等、その他	13,775,214		2.5
投資信託財産総額	542,722,964		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	542,722,857,274円
一 般 株 式	12,373,197,806
株 式 (評価額)	528,947,749,730
未 収 入 金	569,015,410
未 収 入 委 託 証 拠 金	703,427,711
未 収 入 委 託 証 拠 金	129,466,617
(B) 負 債	592,021,000
未 払 解 約 金	592,021,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	542,130,836,274
元 本	121,842,817,407
期 繰 越 損 益	420,288,018,867
(D) 受 取 益 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	121,842,817,407円 44,494円

(注1) 期首元本額 117,622,712,134円
追加設定元本額 59,907,077,380円
一部解約元本額 55,686,972,107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 234,935,632円
MHAM TOP I Xオープン 2,457,094,087円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用> 3,281,412,558円
One DC 国内株式インデックスファンド 30,809,632,061円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド 4,610,201,313円
MITO ラップ型ファンド (安定型) 1,572,967円
MITO ラップ型ファンド (中立型) 9,370,446円
MITO ラップ型ファンド (積極型) 21,079,024円
グローバル8資産ラップファンド (安定型) 21,608,149円
グローバル8資産ラップファンド (中立型) 28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド (積極型) 17,989,649円
たわらノーロード TOP I X 2,226,070,109円
たわらノーロード バランス (8資産均等型) 1,698,970,509円
たわらノーロード バランス (堅実型) 49,358,924円
たわらノーロード バランス (標準型) 360,326,830円
たわらノーロード バランス (積極型) 607,683,019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) 2,285,856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) 141,103,494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) 406,039,337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) 347,897,665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) 481,585,965円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型) 365,246円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 1,354,848円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 27,592,829円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 4,404,483円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 12,596,334円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金> 33,412,337,171円
Oneグローバルバランス 41,793,827円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 914,089,355円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 3,328,302,554円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 3,866,884,412円
DIAM DC バランス30インデックスファンド 294,884,221円
DIAM DC バランス50インデックスファンド 964,080,357円
DIAM DC バランス70インデックスファンド 1,090,311,381円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 28,196,964円
マネックス資産設計ファンド (育成型) 1,070,522,519円
マネックス資産設計ファンド エコリユージョン 14,869,106円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 283,994,414円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 332,963,584円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 563,739,113円
投資のソムリエ 8,462,984,252円
フルズコントロール 331,322,523円
投資のソムリエ<DC年金> 830,639,366円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> 315,192,706円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> 1,094,963,321円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 940,176,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド 3,070,818,810円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 79,256,153円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 40,575,661円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 8,224,319円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 177,810,319円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金> 506,888,540円
リスクコントロール世界分散ファンド 1,363,308,339円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 230,928,569円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 80,685,240円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 43,107,354円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 26,468,340円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> 499,441,883円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) 6,256,314円
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け> 1,630,752円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け> 32,054,533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) 1,852,453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) 1,973,535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) 1,168,075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) 1,140,107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) 21,514,902円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 (適格機関投資家限定) 4,850,093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) 21-06 179,053,363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) 1,676,651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) 22-05 82,171,987円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産分配) 22-10 373,974,618円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定) 3,244,839円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 271,164,256円
AMIONeマルチアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定) 13,265,462円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) 22,573,361円
日興資産設計戦略ファンド (インカム重視) (儲蓄型) (適格機関投資家限定) 42,437,517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) 3,180,848円
リスクコントロール世界8資産バランス (FOF) (向) (適格機関投資家限定) 3,641,563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) 34,738,163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) 67,464,810円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 2,592,057円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 10,658,140円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 3,391,442円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 80,001円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 1,346,974円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 17,271,356円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 278,577,105円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 397,261,876円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 1,219,167,945円
DIAMグローバル・セット・バランスVA (適格機関投資家限定) 10,308,559円
DIAMグローバル・セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) 14,774,714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) 148,488,928円
DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家限定) 28,546,667円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 53,149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) 157,074,573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) 8,107,544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) 38,324,573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) 100,737,648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) 130,670,328円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 17,344,200円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定) 7,096,700円
動的パッケージファンド<DC年金> 26,832,017円
コア資産形成ファンド 13,890,277円
MHAMトピックスファンド 785,854,154円
MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用) 44,680,531円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定] 3,152,105,329円
MHAM日本株バッシブファンド [適格機関投資家限定] 1,885,462,391円
期末元本合計 121,842,817,407円
担保資産 121,842,817,407円

(注3) 代用として担保を提供している資産はありません。

■損益の状況

当期 自2023年2月8日 至2024年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	10,425,561,919	円
	受取配当金	10,381,192,543	
	受取利息	112,936	
	その他の収益	47,949,906	
	支払利息	△3,693,466	
(B)	有価証券売買損益	111,503,767,553	
	売却益	123,369,784,497	
	売却損	△11,866,016,944	
(C)	先物取引等取引損益	3,953,117,580	
	取引益	4,399,997,660	
	取引損	△446,880,080	
(D)	その他費用	△2,081,296	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	125,880,365,756	
(F)	前期繰越損益金	279,360,210,690	
(G)	解約差損益金	△154,955,776,199	
(H)	追加信託差損益金	170,003,218,620	
(I)	計(E+F+G+H)	420,288,018,867	
	次期繰越損益金(I)	420,288,018,867	

(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》

■当投資信託において保有していた株式会社東芝の株式について、同社による有価証券報告書等の虚偽記載により当投資信託が被った損失の回復を図るために提訴した損害賠償請求訴訟が和解により終結したため、2023年12月に当該和解金を計上いたしました。

(2023年12月20日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第21期 (決算日 2024年2月14日)

(計算期間 2023年2月15日～2024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21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月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	%	ポイント	%				
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	百万円 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
20期 (2023年2月14日)	12,411	△3.6	367.66	△3.6	99.7	—	—	554,514
21期 (2024年2月14日)	12,339	△0.6	365.56	△0.6	99.6	—	—	535,043

(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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。
なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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)。

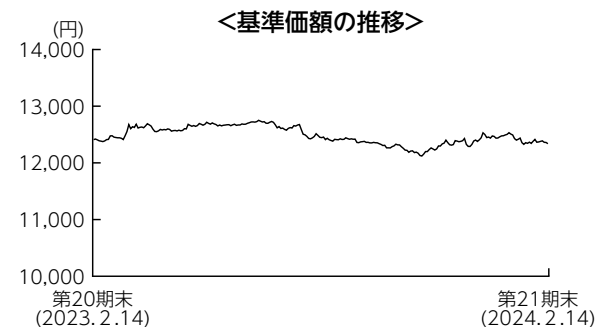
■当期中の基準価額と市況の推移

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	債券先物率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期 首) 2023年 2月14日	円 12,411	% -	ポイント 367.66	% -	% 99.7	% -	% -
2 月 末	12,476	0.5	369.57	0.5	99.6	-	-
3 月 末	12,649	1.9	374.74	1.9	99.8	-	-
4 月 末	12,680	2.2	375.61	2.2	100.1	-	-
5 月 末	12,668	2.1	375.27	2.1	99.7	-	-
6 月 末	12,700	2.3	376.29	2.3	99.5	-	-
7 月 末	12,505	0.8	370.43	0.8	99.1	-	-
8 月 末	12,415	0.0	367.76	0.0	96.7	-	-
9 月 末	12,326	△0.7	365.13	△0.7	99.5	-	-
10 月 末	12,130	△2.3	359.31	△2.3	99.8	-	-
11 月 末	12,385	△0.2	366.88	△0.2	99.4	-	-
12 月 末	12,436	0.2	368.38	0.2	99.7	-	-
2024年 1 月 末	12,344	△0.5	365.75	△0.5	99.6	-	-
(期 末) 2024年 2月14日	12,339	△0.6	365.56	△0.6	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（2023年2月15日から2024年2月14日まで）

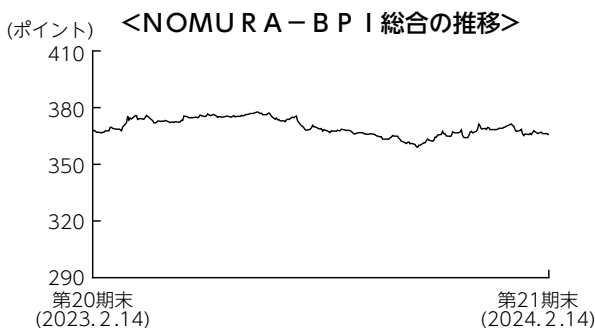


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,339円となり、前期末比で0.6%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。期初から2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、基準価額は上昇しました。7月以降は、日銀が金融政策を修正する中で、基準価額は下落基調となりました。11月以降は国内債券に対する堅調な需要を受けて基準価額の上昇が見られましたが、2024年1月から期末にかけては日銀が金融政策を追加修正する可能性が高まったことなどから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。期初から2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、利回りは大きく上下しました。7月以降は、日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決めたことなどをを受けて、利回りは上昇しま

した。11月以降は、国内債券に対する堅調な需要を受けて利回りは低下しました。2024年1月から期末にかけては日銀のマイナス金利政策解除の観測が高まったことなどから利回りは上昇しました。

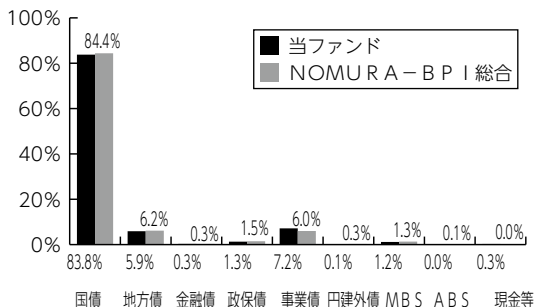
ポートフォリオについて

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。

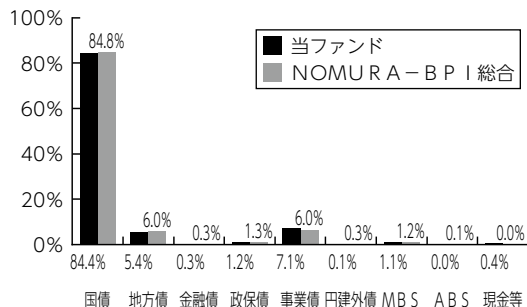
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

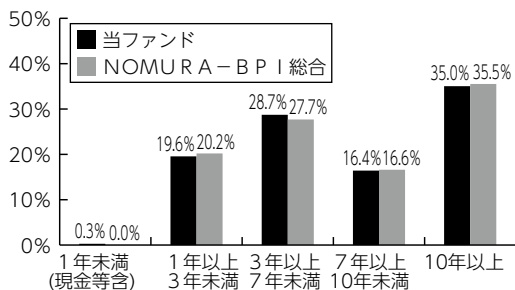


期末

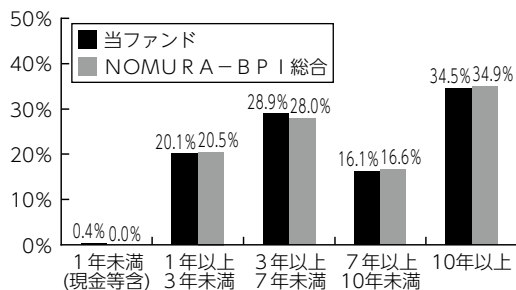


○残存年限別構成比

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0.6%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 (2023年2月15日から2024年2月14日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	内		
	国債証券	716,806,028	720,895,402 (-)
	地方債証券	-	3,669,163 (-)
	特殊債証券	-	1,030,325 (316,495)
	社債証券	-	1,872,481 (-)

(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 (2023年2月15日から2024年2月14日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 716,806	百万円 57,522	% 8.0	百万円 727,467	百万円 67,522	% 9.3

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	464,585,000	451,739,708	84.4	—	52.8	21.6	10.1	
地 方 債 証 券	29,139,330	29,000,791	5.4	4.5	3.2	1.7	0.5	
特 殊 債 証 券	27,236,846	27,002,386	5.0	—	3.3	1.3	0.5	
金 融 債 証 券	1,600,000	1,591,110	0.3	—	—	0.2	0.1	
普 通 社 債 証 券	24,520,000	23,641,007	4.4	0.1	2.1	1.8	0.4	
合 計	547,081,176	532,975,004	99.6	4.6	61.4	26.7	11.6	

(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 4 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,500,000	1,500,075	2025/03/01
1 4 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,700,000	3,704,033	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,230,000	3,244,082	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	180,000	184,120	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	71,449	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	40,872	2025/03/20
4 4 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,000,000	999,940	2025/04/01
4 4 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	1,999,620	2025/05/01
4 4 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,800,000	1,799,406	2025/06/01
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,980,000	3,999,462	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	256,255	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	51,318	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	92,493	2025/06/20
4 5 1 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	12,500,000	12,489,875	2025/08/01
1 4 5 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	7,300,000	7,303,431	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,300,000	3,317,325	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	400,000	412,292	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	144,526	2025/09/20
4 5 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,900,000	2,894,548	2025/12/01
1 4 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,700,000	4,699,530	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,620,000	3,632,959	2025/12/20
8 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	72,569	2025/12/20
8 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	175,927	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	
4 5 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	900,000	899,658	2026/01/01
1 4 7 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	5,750,000	5,736,200	2026/03/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,520,000	3,518,521	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	590,000	614,355	2026/03/20
8 6 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	125,454	2026/03/20
8 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	125,204	2026/03/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	3,610,000	3,599,855	2026/06/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,090,000	4,087,586	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	590,000	619,966	2026/06/20
8 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	10,484	2026/06/20
1 4 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,680,000	1,674,556	2026/09/20
3 4 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,570,000	3,567,215	2026/09/20
9 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	470,000	495,154	2026/09/20
9 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	116,172	2026/09/20
1 5 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,470,000	1,464,575	2026/12/20
3 4 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,890,000	4,885,110	2026/12/20
9 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,160,000	1,224,565	2026/12/20
1 5 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,900,000	1,891,507	2027/03/20
1 5 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,890,000	1,887,089	2027/03/20
3 4 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,540,000	4,533,008	2027/03/20
9 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	370,000	391,115	2027/03/20
9 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	670,000	710,293	2027/03/20
1 5 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	5,210,000	5,179,677	2027/06/20

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	
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,500,000	4,488,030	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	550,000	588,835	2027/06/20
96回 利付国庫債券(20年)	2.1000	120,000	127,675	2027/06/20
154回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,400,000	1,394,750	2027/09/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,070,000	4,054,737	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	707,104	2027/09/20
98回 利付国庫債券(20年)	2.1000	160,000	170,848	2027/09/20
155回 利付国庫債券(5年)	0.3000	5,700,000	5,715,162	2027/12/20
156回 利付国庫債券(5年)	0.2000	4,300,000	4,295,055	2027/12/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,850,000	5,820,984	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	803,587	2027/12/20
157回 利付国庫債券(5年)	0.2000	4,400,000	4,389,308	2028/03/20
158回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,600,000	3,576,672	2028/03/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	6,600,000	6,557,232	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	830,000	895,528	2028/03/20
101回 利付国庫債券(20年)	2.4000	230,000	250,021	2028/03/20
159回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,100,000	2,083,326	2028/06/20
160回 利付国庫債券(5年)	0.2000	900,000	896,715	2028/06/20
161回 利付国庫債券(5年)	0.3000	1,700,000	1,700,714	2028/06/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,400,000	2,380,944	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	500,000	545,590	2028/06/20
103回 利付国庫債券(20年)	2.3000	160,000	173,902	2028/06/20
104回 利付国庫債券(20年)	2.1000	110,000	118,614	2028/06/20
162回 利付国庫債券(5年)	0.3000	1,400,000	1,398,726	2028/09/20
163回 利付国庫債券(5年)	0.4000	3,000,000	3,010,860	2028/09/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,950,000	4,900,648	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	640,000	691,891	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	542,805	2028/09/20
164回 利付国庫債券(5年)	0.2000	1,700,000	1,687,437	2028/12/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,690,000	3,646,900	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	600,000	650,166	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	690,000	741,115	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,460,000	2,428,020	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	350,000	377,223	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	478,627	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,130,000	4,072,634	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	460,000	504,629	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	740,000	807,909	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,700,000	2,660,040	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	110,000	124,787	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,370,000	1,501,136	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,800,000	5,707,142	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	410,000	450,827	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	360,000	397,911	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	111,942	2030/02/20
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,150,000	5,059,617	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	530,000	587,589	2030/03/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	470,000	518,273	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,050,000	3,971,146	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	555,000	610,111	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	470,000	510,857	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,100,000	4,010,661	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	640,000	700,774	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	620,473	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	232,534	2030/11/20
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,500,000	5,366,845	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	350,000	388,598	2030/12/20
362回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,210,000	4,097,466	2031/03/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	671,682	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	510,000	563,733	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	593,184	2031/03/20
363回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,070,000	4,919,370	2031/06/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	370,000	406,974	2031/06/20
364回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,950,000	5,754,780	2031/09/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	910,000	995,094	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	227,966	2031/11/20
365回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,430,000	5,236,366	2031/12/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	30,000	32,606	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	630,000	689,472	2031/12/20
366回 利付国庫債券(10年)	0.2000	4,880,000	4,731,208	2032/03/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	200,000	219,108	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	130,000	141,415	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	360,000	388,825	2032/03/20
367回 利付国庫債券(10年)	0.2000	5,700,000	5,510,076	2032/06/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	480,000	522,571	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,060,000	1,136,691	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	980,000	1,058,694	2032/06/20
368回 利付国庫債券(10年)	0.2000	4,750,000	4,577,860	2032/09/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	850,000	925,658	2032/09/20
369回 利付国庫債券(10年)	0.5000	5,220,000	5,150,208	2032/12/20
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,060,000	1,155,007	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	430,000	472,342	2032/12/20
370回 利付国庫債券(10年)	0.5000	4,900,000	4,822,384	2033/03/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,230,000	1,329,716	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	750,000	804,367	2033/03/20
371回 利付国庫債券(10年)	0.4000	5,200,000	5,058,716	2033/06/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	250,000	272,517	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,250,000	2,452,657	2033/06/20
372回 利付国庫債券(10年)	0.8000	5,300,000	5,338,001	2033/09/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	230,000	259,299	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,240,000	2,442,473	2033/09/20
373回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,200,000	1,182,948	2033/12/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	150,000	167,725	2033/12/20
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,290,000	1,393,703	2033/12/20

銘柄	当	期		末
		利率	額面金額	
(国債証券)	%	千円	千円	
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	393,546	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,730,000	2,922,055	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	303,960	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,290,000	2,450,139	2034/06/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	280,944	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	2,930,000	3,103,192	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	313,731	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	3,160,000	3,279,574	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	461,116	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,440,000	2,529,108	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	323,002	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	2,740,000	2,866,067	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	388,287	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	3,020,000	3,121,653	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	357,981	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	2,280,000	2,301,933	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	341,709	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,280,000	2,140,509	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	412,664	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	2,580,000	2,353,218	2036/06/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,140,000	2,018,041	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	381,212	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,840,000	1,750,244	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	724,240	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,820,000	1,747,691	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,760,000	1,662,443	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	732,170	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,930,000	1,816,940	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,430,000	2,278,538	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	909,832	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,750,000	2,533,245	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,250,000	2,063,587	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,003,749	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,540,000	1,447,061	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,350,000	2,136,009	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,014,041	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,590,000	1,416,610	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,520,000	1,326,412	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	818,337	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,900,000	1,649,352	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,740,000	1,502,507	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,114,646	2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,380,000	1,205,098	2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,360,000	2,050,202	2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,299,840	2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,400,000	2,074,008	2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,020,000	1,767,378	2040/12/20

銘柄	当	期		末
		利率	額面金額	
(国債証券)	%	千円	千円	
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,355,760	2041/03/20
176回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,500,000	2,177,675	2041/03/20
177回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,750,000	1,490,195	2041/06/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,060,000	1,162,088	2041/09/20
178回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,800,000	2,416,932	2041/09/20
179回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,200,000	1,890,306	2041/12/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,370,000	1,499,465	2042/03/20
180回 利付国庫債券(20年)	0.8000	2,520,000	2,277,072	2042/03/20
181回 利付国庫債券(20年)	0.9000	1,900,000	1,742,262	2042/06/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,360,000	1,464,638	2042/09/20
182回 利付国庫債券(20年)	1.1000	2,150,000	2,035,319	2042/09/20
183回 利付国庫債券(20年)	1.4000	1,700,000	1,688,661	2042/12/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	850,000	898,509	2043/03/20
184回 利付国庫債券(20年)	1.1000	1,880,000	1,769,700	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,210,000	1,297,144	2043/06/20
185回 利付国庫債券(20年)	1.1000	2,100,000	1,969,632	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	1,030,000	1,085,002	2043/09/20
186回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,900,000	1,904,313	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,060,000	1,095,764	2043/12/20
187回 利付国庫債券(20年)	1.3000	500,000	482,860	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,000,000	1,032,470	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,410,000	1,453,949	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,130,000	1,163,719	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,150,000	1,141,835	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,870,000	1,853,656	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	1,340,000	1,349,661	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,720,000	1,667,454	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,300,000	1,257,906	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,150,000	982,985	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	1,520,000	1,153,011	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,500,000	1,188,690	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,220,000	986,199	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,790,000	1,510,348	2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,080,000	908,452	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,040,000	872,092	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,730,000	1,446,193	2047/12/20
1回 利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	126,511	2048/03/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,660,000	1,383,377	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,120,000	907,625	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	1,330,000	1,126,895	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,060,000	852,515	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	330,000	365,445	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	720,000	547,336	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,100,000	810,128	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,300,000	952,718	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,300,000	948,844	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	596,343	2050/03/20

銘	柄	当 期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(国債証券)				
6 6回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,090,000	791,677 2050/03/20
6 7回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,270,000	971,626 2050/06/20
6 8回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,340,000	1,021,401 2050/09/20
6 9回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,360,000	1,062,323 2050/12/20
4回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	720,000	793,389 2051/03/20
7 0回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,400,000	1,089,788 2051/03/20
7 1回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,480,000	1,148,021 2051/06/20
7 2回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,290,000	997,118 2051/09/20
7 3回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,390,000	1,071,606 2051/12/20
5回	利付国庫債券 (40年)	2.0000	710,000	749,781 2052/03/20
7 4回	利付国庫債券 (30年)	1.0000	1,390,000	1,160,872 2052/03/20
7 5回	利付国庫債券 (30年)	1.3000	1,320,000	1,188,316 2052/06/20
7 6回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,320,000	1,215,733 2052/09/20
7 7回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,600,000	1,543,632 2052/12/20
6回	利付国庫債券 (40年)	1.9000	940,000	969,976 2053/03/20
7 8回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,800,000	1,653,048 2053/03/20
7 9回	利付国庫債券 (30年)	1.2000	1,600,000	1,396,880 2053/06/20
8 0回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,700,000	1,713,226 2053/09/20
8 1回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	200,000	192,046 2053/12/20
7回	利付国庫債券 (40年)	1.7000	880,000	864,503 2054/03/20
8回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	990,000	900,286 2055/03/20
9回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,890,000	1,252,408 2056/03/20
1 0回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,930,000	1,499,783 2057/03/20
1 1回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,040,000	775,236 2058/03/20
1 2回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,420,000	938,236 2059/03/20
1 3回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	2,090,000	1,362,889 2060/03/20
1 4回	利付国庫債券 (40年)	0.7000	2,100,000	1,461,096 2061/03/20
1 5回	利付国庫債券 (40年)	1.0000	2,340,000	1,795,271 2062/03/20
1 6回	利付国庫債券 (40年)	1.3000	1,700,000	1,429,513 2063/03/20
小	計	-	464,585,000	451,739,708 -
(地方債証券)				
5回	東京都公募債 20年	2.1100	100,000	102,178 2025/03/19
2 1 3回	神奈川県公募債	0.5340	100,000	100,461 2025/03/19
1 4 4回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	401,568 2025/03/25
1 4 6回	共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	603,186 2025/05/23
2 7年度 4回	千葉県公募債	0.6020	200,000	201,294 2025/07/25
1 4 8回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	502,880 2025/07/25
7回	東京都公募債 20年	2.1600	100,000	103,173 2025/09/19
1回	静岡県公募債 20年	2.1800	100,000	103,196 2025/09/19
1 5 0回	共同発行市場公募地方債	0.5100	300,000	301,635 2025/09/25
2 7年度 1 5回	愛知県公募債 10年	0.4710	100,000	100,483 2025/11/27
1 5 3回	共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	100,479 2025/12/25
2 7年度 9回	千葉県公募債	0.0950	100,000	99,716 2026/03/25
1 5 7回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	119,607 2026/04/24
9回	東京都公募債 20年	2.4400	200,000	210,298 2026/06/19
1 5 9回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,224 2026/06/25
1 6 0回	共同発行市場公募地方債	0.0500	500,000	497,755 2026/07/24

銘	柄	当 期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(地方債証券)				
1回	兵庫県公募債 15年	1.6600	200,000	206,898 2026/07/29
2 8年度 6回	北海道公募債	0.0700	100,000	99,557 2026/08/31
7 6 0回	東京都公募債	0.0450	100,000	99,497 2026/09/18
1 0回	東京都公募債 20年	2.3300	300,000	316,152 2026/09/18
4回	京都市公募債 20年	2.5100	100,000	105,820 2026/09/18
4 1 3回	大阪府公募債 10年	0.0210	100,000	99,385 2026/10/28
1 9 0回	大阪府公募債 5年	0.0010	300,000	297,792 2026/12/25
1 6 6回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	498,905 2027/01/25
令和3年度 3回	仙台市公募債 5年	0.0010	300,000	297,768 2027/01/28
2 8年度 8回	福岡県公募債	0.2400	100,000	99,941 2027/02/24
1 6 9回	共同発行市場公募地方債	0.2050	500,000	498,950 2027/04/23
4 1 9回	大阪府公募債 10年	0.1960	100,000	99,713 2027/04/27
2回	静岡県公募債 15年	1.4060	100,000	103,695 2027/06/25
5回	兵庫県公募債 12年	0.6870	100,000	101,282 2027/07/07
1 7 3回	共同発行市場公募地方債	0.2150	400,000	398,672 2027/08/25
2 9年度 4回	大阪市公募債	0.1500	200,000	198,716 2027/09/21
1 7 4回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,375 2027/09/24
2 4年度 1回	福岡県公募債 15年	1.3290	100,000	103,700 2027/11/29
1 7 8回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	99,513 2028/01/25
1 7 9回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	497,510 2028/02/25
2 9年度 6回	広島市公募債	0.2300	300,000	298,389 2028/02/25
2 9年度 1 3回	京都府公募債	0.2000	109,330	108,537 2028/03/16
5回	兵庫県公募債 15年	1.3100	300,000	311,415 2028/05/26
7 8 3回	東京都公募債	0.2200	110,000	109,153 2028/06/20
4回	静岡県公募債 15年	1.3380	100,000	104,014 2028/06/23
3 0年度 8回	北海道公募債	0.2490	400,000	396,768 2028/08/31
3 0年度 7回	神戸市公募債 30年	0.2540	300,000	297,681 2028/09/20
第 9 1回	川崎市公募債	0.1850	200,000	197,832 2028/09/20
7回	静岡県公募債 20年	2.3200	300,000	325,803 2028/09/21
3 0年度 3回	広島県公募債	0.2540	100,000	99,224 2028/09/25
3 0年度 3回	堺市公募債	0.1950	100,000	98,742 2028/12/19
2 3 7回	神奈川県公募債	0.1350	200,000	197,008 2028/12/20
2 0回 2号	福岡県公募債	2.0500	100,000	107,617 2028/12/20
6回	大阪市公募債 20年	2.2100	200,000	216,702 2028/12/20
1 7回	横浜市公募債 20年	2.0700	100,000	107,737 2028/12/20
6回	北九州市公募債 20年	2.0300	100,000	107,471 2028/12/20
3 0年度 6回	福岡県公募債	0.2000	200,000	197,622 2028/12/21
1 8 9回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	98,855 2028/12/25
3 0年度 1 4回	北海道公募債	0.1950	400,000	394,936 2028/12/28
1 8回	東京都公募債 20年	2.2200	100,000	108,736 2029/03/19
3 0年度 1 9回	愛知県公募債	0.1150	200,000	196,408 2029/03/28
3 0年度 3回	岡山県公募債 10年	0.1500	200,000	196,756 2029/03/29
1 9 4回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	294,294 2029/05/25
6回	川崎市公募債 20年	2.2100	200,000	217,928 2029/05/25
令和元年度 1回	福岡県公募債	0.0290	200,000	195,300 2029/06/21
9回	兵庫県公募債 15年	1.0200	100,000	102,798 2029/07/13
1 1回	神奈川県公募債 20年	2.0800	100,000	108,530 2029/07/20

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	
196回 共同発行市場公募地方債	0.0600	500,000	488,870	2029/07/25
796回 東京都公募公債	0.0400	200,000	195,152	2029/09/20
令和元年度 9回 静岡県公募公債	0.0500	200,000	195,262	2029/09/20
令和元年度 3回 横浜市公募公債	0.0500	400,000	390,400	2029/10/16
令和元年度 16回 兵庫県公募公債	0.0500	200,000	195,074	2029/10/23
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	109,761	2029/12/20
17回 さいたま市公募公債	0.1100	200,000	195,662	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	0.1350	200,000	195,830	2030/01/30
21年度 2回 福岡県公募公債 (20年)	2.2300	100,000	110,220	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	97,629	2030/02/25
802回 東京都公募公債	0.1300	400,000	391,140	2030/03/19
511回 名古屋市長公募公債 10年	0.0750	200,000	194,898	2030/03/27
令和2年度 1回 京都府公募公債	0.1350	400,000	390,784	2030/04/12
令和2年 2回 大阪府公募公債	0.1310	300,000	292,668	2030/05/22
9回 埼玉県公募公債 20年	2.1500	100,000	110,017	2030/05/24
8回 静岡県公募公債 15年	0.8280	200,000	203,708	2030/06/07
令和2年度 10回 静岡県公募公債	0.1350	100,000	97,296	2030/09/20
令和2年 5回 福岡県公募公債	0.1350	100,000	97,228	2030/10/23
36回 2年 宮城県公募公債 10年	0.1350	250,000	242,980	2030/10/28
令和2年度 1回 福島県公募公債	0.1350	200,000	194,252	2030/11/27
令和2年度 1回 高知県公募公債	0.1350	200,000	194,252	2030/11/27
22年度 14回 愛知県公募公債	2.0870	300,000	330,165	2030/12/13
9回 京都市公募公債 20年	2.1430	200,000	220,734	2030/12/17
813回 東京都公募公債	0.1790	300,000	292,077	2030/12/20
16回 神奈川県公募公債 20年	2.0900	300,000	330,453	2031/01/24
464回 大阪府公募公債 10年	0.0720	200,000	192,918	2031/01/28
令和2年度 19回 北海道公募公債	0.1450	100,000	96,870	2031/02/26
令和2年度 14回 京都府公募公債	0.2140	200,000	194,634	2031/03/12
令和2年 7回 広島県公募公債	0.2140	200,000	194,680	2031/03/19
251回 神奈川県公募公債 10年	0.1990	200,000	194,474	2031/03/20
令和2年度 14回 静岡県公募公債	0.1400	200,000	193,670	2031/03/20
令和3年度 1回 長野県公募公債 10年	0.1900	200,000	194,180	2031/04/16
令和3年度 2回 兵庫県公募公債	0.1750	100,000	96,880	2031/04/25
467回 大阪府公募公債 10年	0.1640	200,000	193,604	2031/04/28
469回 大阪府公募公債 10年	0.1280	200,000	192,658	2031/06/27
11回 北九州市公募公債 20年	2.0190	300,000	329,586	2031/07/18
令和3年 5回 千葉県公募公債	0.1050	200,000	191,810	2031/09/25
472回 大阪府公募公債 10年	0.1000	200,000	191,586	2031/09/29
474回 大阪府公募公債 10年	0.1190	300,000	287,223	2031/11/28
19回 神奈川県公募公債 20年	1.8180	100,000	108,645	2032/01/30
227回 共同発行市場公募地方債	0.2440	500,000	482,465	2032/02/25
228回 共同発行市場公募地方債	0.1990	500,000	480,210	2032/03/25
258回 神奈川県公募公債 10年	0.2900	300,000	289,497	2032/06/18
24年度 2回 福岡県公募公債 (20年)	1.6350	300,000	321,906	2032/08/16
10回 大阪府公募公債 20年	1.7200	200,000	215,816	2032/09/24
24年度 12回 神戸市公募公債	1.7110	200,000	215,950	2032/12/17
14回 千葉県公募公債 20年	1.1370	100,000	102,889	2033/04/15

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 埼玉県公募公債 20年	1.5990	100,000	106,953	2033/05/20
1回 東京都公募公債 30年	2.2100	200,000	224,866	2033/06/20
14回 埼玉県公募公債 20年	1.5460	300,000	318,219	2034/05/08
26年度 4回 愛知県公募公債 20年	1.5420	200,000	212,100	2034/05/15
29回 横浜市公募公債 20年	1.5280	100,000	105,940	2034/05/26
16回 名古屋市長公募公債 20年	1.5200	100,000	105,842	2034/06/09
5回 群馬県公募公債 20年	1.5290	100,000	105,941	2034/06/16
17回 北九州市公募公債 20年	1.5290	100,000	105,799	2034/06/20
31回 東京都公募公債 20年	1.2380	200,000	205,728	2034/09/20
15回 埼玉県公募公債 20年	1.1660	100,000	101,888	2035/02/16
2回 横浜市公募公債 30年	2.4900	100,000	115,694	2035/03/20
18回 千葉県公募公債 20年	1.1380	100,000	101,490	2035/04/13
17回 名古屋市長公募公債 20年	1.2030	100,000	102,088	2035/05/28
13回 大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	101,743	2035/09/28
14回 大阪府公募公債 20年	0.5400	100,000	93,216	2036/09/29
21回 千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	91,915	2036/10/15
3回 神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	117,612	2037/03/19
29年度 2回 広島市公募公債	0.6160	200,000	185,874	2037/08/18
29年度 5回 札幌市公募公債 20年	0.5970	300,000	277,719	2037/09/18
30年度 2回 仙台市公募公債 20年	0.7290	100,000	92,618	2038/10/18
30年度 7回 福岡市公募公債	0.7010	200,000	184,544	2038/10/19
2019年度 5回 福岡市長公募公債 20年	0.2860	100,000	85,242	2039/07/29
2回 兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	113,464	2040/03/19
22年度 8回 福岡市公募公債	2.2800	100,000	112,418	2040/09/20
令和2年 2回 広島県公募公債	0.4640	100,000	85,941	2040/09/21
23年度 7回 札幌市公募公債 30年	2.0970	100,000	109,178	2041/09/20
5回 川崎市公募公債 30年	2.0970	100,000	108,991	2042/03/20
24年度 12回 愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	109,203	2042/09/19
14回 東京都公募公債 30年	2.0500	100,000	107,627	2043/06/19
27年度 8回 愛知県公募公債 30年	1.5790	150,000	147,594	2045/06/20
27年度 2回 広島県公募公債 30年	0.7110	100,000	81,807	2046/03/22
6回 埼玉県公募公債 30年	0.9570	200,000	171,040	2046/12/20
令和元年度 7回 愛知県公募公債	0.3690	300,000	212,850	2049/06/18
令和元年 3回 福岡県公募公債 30年	0.4320	200,000	144,450	2049/06/18
12回 埼玉県公募公債 30年	0.4740	300,000	217,158	2049/12/20
令和3年度 6回 神戸市公募公債 30年	0.7130	200,000	151,146	2051/06/20
小 計	-	29,139,330	29,000,791	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
21回 政保中部国際空港債	0.4500	100,000	100,401	2025/03/17
24回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4500	500,000	502,040	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	100,349	2025/04/25
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	2.0400	400,000	409,928	2025/06/20
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	100,571	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	100,469	2025/08/29
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,706	2025/09/19
85回 中日本高速道路債券	0.0700	300,000	298,986	2025/10/21
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	100,443	2025/11/20

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	
2 3 回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	103,358	2025/12/19
6 1 回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	102,881	2025/12/19
F 5 3 8 回 地方公共団体金融機構債券	0.0200	500,000	497,820	2025/12/25
4 0 回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,648	2026/03/13
3 3 回 政保日本政策投資銀行社債	0.0200	300,000	298,941	2026/03/16
8 7 回 中日本高速道路債券	0.0600	400,000	397,924	2026/03/18
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	104,754	2026/03/20
2 7 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0200	300,000	298,920	2026/03/31
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	99,599	2026/04/20
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	398,380	2026/04/28
8 0 回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	103,368	2026/09/18
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,460	2026/09/18
3 2 5 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,460	2026/09/18
7 9 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	309,873	2026/11/06
9 1 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	99,662	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	99,707	2027/01/29
F 1 4 7 回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	206,076	2027/03/19
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	299,007	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	797,536	2027/04/30
9 6 回 地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	497,990	2027/05/28
7 2 回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	198,316	2027/06/18
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	99,661	2027/07/16
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	297,939	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	99,449	2027/12/17
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	103,914	2027/12/20
7 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	296,307	2027/12/20
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	298,044	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	99,208	2028/10/16
9 回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	206,138	2028/12/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	214,862	2028/12/20
9 3 回 都市再生債券	1.1020	100,000	102,925	2029/06/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	327,294	2029/06/28
2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	328,032	2029/08/28
1 2 回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	204,900	2029/09/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	217,514	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	109,439	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	101,254	2030/05/28
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	203,884	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	216,362	2030/10/29
1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	541,375	2030/10/31
1 2 1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	109,893	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	192,776	2031/05/30
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	383,484	2031/06/13
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	108,901	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	108,696	2031/12/26
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	216,450	2031/12/26
1 5 6 回 日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	384,036	2032/04/14

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	
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	107,062	2032/07/28
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	107,963	2032/09/14
1 5 回 国際協力機構債	1.7240	100,000	107,271	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	214,502	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	105,383	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	586,595	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	105,372	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	105,597	2034/04/28
3 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	520,115	2034/09/28
4 2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	298,458	2035/01/26
2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	306,267	2035/02/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	100,422	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	102,214	2035/06/20
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	204,606	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	103,148	2035/06/29
第 2 6 2 回 政保道路債	1.1090	500,000	504,910	2035/11/30
1 7 2 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	179,802	2036/06/20
2 8 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.3100	200,000	182,272	2036/08/29
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	93,194	2037/04/28
3 1 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	187,104	2037/07/31
2 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	233,730	2037/09/18
3 3 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	92,332	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	90,651	2038/04/20
F 1 7 4 回 地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	323,085	2038/05/28
2 1 0 回 高速道路機構債	0.6770	100,000	91,457	2038/09/17
5 0 回 高速道路機構債	0.5000	300,000	261,801	2039/03/18
7 7 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	249,837	2039/09/28
1 2 5 回 日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	423,105	2040/04/24
2 8 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	299,532	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	105,683	2040/08/31
4 0 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	39,840	39,922	2041/03/10
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	262,347	2043/12/18
2 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	14,543	15,049	2044/08/10
2 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	91,485	95,618	2044/10/10
3 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	137,552	142,813	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	97,988	2045/06/20
3 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	19,385	20,065	2045/07/10
1 回 高速道路機構債	2.9900	300,000	365,850	2045/09/20
2 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	190,616	2045/10/31
1 6 9 回 高速道路機構債	1.2000	100,000	90,510	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	93,062	2046/01/31
4 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	16,717	17,291	2046/06/10
5 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	19,533	20,123	2046/09/10
5 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	20,588	21,207	2046/10/10
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	176,331	2047/03/20
6 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	25,093	25,777	2047/05/10
6 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	61,990	63,137	2047/09/10

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	
3 6 回 高速道路機構債	2.8400	300,000	357,984	2048/03/20
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	27,869	28,479	2048/09/10
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	34,215	34,555	2049/03/10
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	34,841	35,184	2049/05/10
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	38,462	38,743	2049/07/10
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	39,819	39,807	2049/11/10
3 9 8 回 政保道路債	0.4220	300,000	215,955	2049/12/28
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	45,186	44,313	2050/02/10
1 0 回 地方公共団体金融機構債券 3 0 年	0.5170	300,000	218,448	2050/04/28
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	50,831	50,142	2050/05/10
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	76,186	2050/06/20
1 6 5 回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	152,808	2050/06/20
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	52,733	52,311	2050/08/10
4 1 8 回 高速道路機構債	0.6300	200,000	148,552	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	150,504	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	199,941	190,849	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	67,846	65,087	2052/02/10
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	67,335	64,691	2052/03/10
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	67,696	64,966	2052/04/10
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	211,506	201,639	2052/11/10
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	211,575	201,595	2053/01/10
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	144,312	137,350	2053/03/10
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	215,997	205,032	2053/04/10
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	214,077	203,291	2053/05/10
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	373,440	355,589	2053/10/10
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	74,406	70,786	2053/12/10
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	76,806	72,208	2054/03/10
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	248,163	231,548	2055/03/10
1 6 2 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	97,883	2055/03/19
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	330,528	309,275	2055/05/10
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	254,616	238,524	2055/09/10
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	260,364	243,979	2056/05/10
1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	794,556	742,520	2056/07/10
4 1 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	135,102	2061/02/28
小 計	-	27,236,846	27,002,386	-
(金融債券)	%	千円	千円	
い第 8 4 3 号 利付商工債	0.1200	100,000	99,735	2025/08/27
3 6 9 回 利附信金中金債 (5 年)	0.0600	400,000	398,876	2025/08/27
い第 8 5 1 号 利付商工債	0.0900	300,000	298,101	2026/04/27
3 7 7 回 利附信金中金債 (5 年)	0.0400	300,000	298,296	2026/04/27
い第 8 5 4 号 利付商工債	0.0800	300,000	297,708	2026/07/27
い第 8 5 5 号 利付商工債	0.0800	200,000	198,394	2026/08/27
小 計	-	1,600,000	1,591,110	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
1 0 回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	100,381	2025/02/28
2 6 回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	100,504	2025/05/21
2 9 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,544	2025/06/11

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	
1 2 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	100,653	2025/06/20
3 9 回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	307,218	2025/06/20
4 9 7 回 関西電力社債	1.0020	100,000	100,872	2025/06/20
1 3 回 電源開発社債	2.0400	200,000	204,598	2025/06/20
1 2 回 新生銀行社債	0.3600	400,000	398,596	2025/07/09
4 2 回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	205,810	2025/09/19
2 7 回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	398,236	2025/12/19
1 4 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,314	2025/12/19
2 6 回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	198,672	2026/03/18
4 2 回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,504	2026/03/24
9 6 回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,312	2026/04/15
1 6 3 回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	298,002	2026/04/15
2 8 回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	297,675	2026/04/21
4 9 3 回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,446	2026/05/25
1 0 6 回 住友不動産社債	0.4000	100,000	99,866	2026/05/26
2 4 回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,476	2026/06/03
4 0 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,148	2026/06/03
3 5 回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	297,507	2026/06/05
1 1 回 グレディ・アグリコル・エス・エー・限有社債 (2016)	0.4000	100,000	99,016	2026/06/10
5 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	99,523	2026/06/19
7 9 回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	298,149	2026/06/19
8 3 回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	198,766	2026/06/19
6 1 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	496,800	2026/06/19
6 9 回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	297,672	2026/06/19
4 回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	125,644	2026/06/19
3 0 7 回 北陸電力社債	1.0550	100,000	101,459	2026/06/25
9 0 回 中日本高速道路債	0.0500	200,000	198,712	2026/07/27
2 0 回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	297,354	2026/07/27
3 回 野村ホールディングス社債	0.2800	300,000	296,466	2026/09/04
9 1 回 中日本高速道路債	0.0400	500,000	496,400	2026/09/17
6 2 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	496,395	2026/09/18
1 7 回 パナソニック社債	0.4700	100,000	99,897	2026/09/18
2 7 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2200	200,000	198,732	2026/10/16
4 8 8 回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,574	2026/10/23
3 3 回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	299,535	2026/12/14
3 4 回 西日本高速道路債	0.3350	200,000	199,972	2027/02/16
1 2 回 リソナ銀行劣後社債	2.4640	100,000	104,231	2027/03/15
8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	105,786	2027/04/20
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	299,376	2027/04/23
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	299,703	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	199,262	2027/05/07
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	298,335	2027/07/16
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	106,514	2027/09/17
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	100,996	2027/09/24
2 5 回 フランス相互証券銀行 (BF CM) 円債債 (2017)	0.5100	300,000	295,200	2027/10/12
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,148	2027/10/22
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	197,394	2027/10/25

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	99,222	2027/11/19
1 7 回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	296,820	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	297,744	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	389,284	2028/06/02
7 回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	198,098	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	98,784	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	107,938	2029/03/21
2 3 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	98,027	2029/04/12
1 4 回 プリザーストン社債	0.3750	300,000	294,570	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	102,704	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	392,104	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	390,344	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	194,654	2029/07/25
7 回 ニッコンHD社債	0.2800	300,000	290,241	2029/10/11
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	193,470	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	108,359	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	195,508	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	97,017	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	97,265	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	194,260	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	390,836	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	97,185	2030/06/25
3 回 ガイドグループHD社債	0.5100	300,000	292,026	2030/07/16
3 1 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	193,402	2030/08/09
6 回 横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	193,926	2030/09/17
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	388,756	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	107,357	2030/09/27
1 7 回 ダイセル社債	0.5000	300,000	290,607	2030/12/13
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	288,195	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	217,508	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	192,236	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	187,466	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	95,906	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	287,508	2031/04/25
5 8 回 川崎重工業社債	0.3000	300,000	284,229	2031/07/15
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	286,134	2031/09/19

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 3 6 回 東北電力社債	0.2900	300,000	284,712	2031/09/25
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	473,415	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	190,592	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	193,142	2032/01/23
3 2 0 回 四国電力社債	0.5340	300,000	288,636	2032/04/23
5 0 7 回 九州電力社債	0.6440	200,000	193,290	2032/05/25
4 回 ENEOSホールディングス社債	0.8340	300,000	291,132	2032/06/15
9 回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	93,318	2036/06/02
2 3 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	181,972	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	181,886	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	91,027	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	90,425	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	90,459	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	177,542	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	89,098	2038/05/25
8 回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	181,828	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	88,282	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	87,864	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	85,896	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	170,884	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	82,501	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	84,566	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	168,514	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	168,008	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	82,981	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	91,760	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	84,283	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	74,850	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	146,124	2051/07/14
5 7 回 東京瓦斯社債	0.6930	300,000	191,754	2057/12/25
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	68,471	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	66,718	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	68,042	2060/12/17
小 計	-	24,520,000	23,641,007	-
合 計	-	547,081,176	532,975,004	-

■投資信託財産の構成

2024年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
	532,975,004	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,195,447	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	535,170,451	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月14日)現在

項 目	当 期 末		
(A) 資 産	535,170,451,990円		
コ ー ー ン 等	1,146,537,036		
公 社 債(評価額)	532,975,004,601		
未 収 利 息	851,415,151		
前 払 費	197,495,202		
(B) 負 債	127,352,000		
未 払 金	127,352,000		
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	535,043,099,990		
元 本	433,635,920,893		
次 期 繰 越 損 益	101,407,179,097		
(D) 受 取 権 益 総 額	433,635,920,893円		
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	12,393円		
(注1) 期首元本額	446,785,885,792円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,203,233,548円
追加設定元本額	581,209,223,036円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	40,681,178円
一部解約元本額	594,359,187,935円	Oneグローバル最適化バラン (安定型) <ラップ向け>	165,621,139円
(注2) 期末における元本の内訳		インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	1,183,200,695円
D I A M国内債券バッシ ョン・ファンド	26,445,559,786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)	1,182,101,124円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	56,606,049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)	1,143,992,121円
M I T O ラップ型ファンド (中立的型)	87,780,257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)	711,889,754円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	46,315,205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)	1,156,117,973円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	777,318,271円	インカム重視マルチアセット運用ファンド1 2021-04 (適格機関投資家限定)	3,005,245,833円
グローバル8資産ラップファンド (中立的型)	271,566,704円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式・債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	1,992,568,129円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	40,009,486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)	1,048,536,393円
たわらノーロード 国内債券	19,198,371,011円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式・債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	2,040,423,193円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	5,643,042,131円	予約モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	1,944,132,777円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,562,213,631円	D I A M国内債券バッシ ョン・ファンド	10,164,316,653円
たわらノーロード バランス (標準型)	3,036,245,918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)	1,179,872,920円
たわらノーロード バランス (積極型)	418,452,135円	投資のソムリエ・私塾 (適格機関投資家限定)	2,899,325,828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)	192,215,501円	A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	597,580,172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)	2,441,981,254円	D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	267,019,349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)	2,731,291,553円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンド1 (適格機関投資家限定)	2,397,299,626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)	824,901,392円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンド1 V (適格機関投資家限定)	2,408,636,925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)	243,747円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンド1 V (適格機関投資家限定)	2,381,224,582円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	37,274,547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)	1,953,854,751円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	20,761,641円	リスコントロール世界8資産バランスファンド (F O F 5用) (適格機関投資家専用)	38,996,223円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	193,622,319円	A M O n e コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	465,443,530円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,019,391円	D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	149,736,384円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	62,284円	D I A Mグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	96,780,040円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,288,509,146円	D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	21,757,666円
Oneグローバルバラン	99,032,940円	D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	57,519,512円
D I A Mバラン	10,956,808,045円	D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	30,515,732円
D I A Mバラン	16,342,447,363円	D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	383,617円
D I A Mバラン	7,495,480,579円	D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,811,312円
D I A M DCバラン	2,655,296,811円	D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	93,208,060円
D I A M DCバラン	2,757,571,061円	D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,672,002,806円
D I A M DCバラン	520,501,398円	D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,146,463,178円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	74,055,112円	D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,390,842,814円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,816,801,094円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	56,186,546円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	4,416,875円	D I A Mグローバル・アセット・バランVA2 (適格機関投資家限定)	133,021,861円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	5,297,839,731円	D I A M アクア グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,599,270,535円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	2,349,035,825円	D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	102,733,521円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	482,650,017円	D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	576,326円
投資のソムリエ	90,500,056,135円	D I A M世界アセットバランスファンド 2VA (適格機関投資家限定)	1,492,236,253円
グループコントロール	1,148,797,889円	D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	29,216,169円
投資のソムリエ<DC年金>	8,880,659,007円	D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	276,501,966円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	6,325,921,180円	D I A M世界アセットバランスファンド 3VA (適格機関投資家限定)	483,425,446円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,157,585,678円	D I A M世界アセットバランスファンド 4VA (適格機関投資家限定)	784,416,491円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,420,751,107円	D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	205,921,080円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	34,063,239,343円	D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	58,717,183円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	514,904,079円	コアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	387,569,601円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	264,258,876円	動的パッケージファンド<DC年金>	213,242,040円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	91,237,587円	コア資産形成ファンド	109,306,062円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	2,029,090,803円	たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	21,839,360,333円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,536,190,751円	M H A M動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	24,944,266,426円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,558,314,912円	M H A M日本債券バッシ ョン・ファンド [適格機関投資家限定]	18,573,817,425円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,200,480,373円	M H A M動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	117,422,889円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	679,094,815円	期末元本合計	433,635,920,893円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	280,353,329円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	172,141,111円		

■損益の状況

当期 自2023年2月15日 至2024年2月14日

項	目	当	期
(A) 配	当 等 収 益	3,407,110,674	円
受	取 利 息	3,409,137,096	
支	払 利 息	△2,026,422	
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	△9,054,042,305	
売	買 益	4,732,773,783	
売	買 損	△13,786,816,088	
(C) 当	期 損 益 金(A+B)	△5,646,931,631	
(D) 前	期 繰 越 損 益 金	107,728,829,513	
(E) 解	約 差 損 益 金	△145,497,077,749	
(F) 追	加 信 託 差 損 益 金	144,822,358,964	
(G) 合	計(C+D+E+F)	101,407,179,097	
次	期 繰 越 損 益 金(G)	101,407,179,097	

(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22期（決算日 2024年2月15日）

（計算期間 2023年2月16日～2024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22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 (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	純資産 総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率			
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
21期(2023年2月15日)	62,397	9.8	2,036,206.59	10.1	95.5	2.4	856,221
22期(2024年2月15日)	83,633	34.0	2,736,922.65	34.4	96.4	1.8	1,360,958

(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

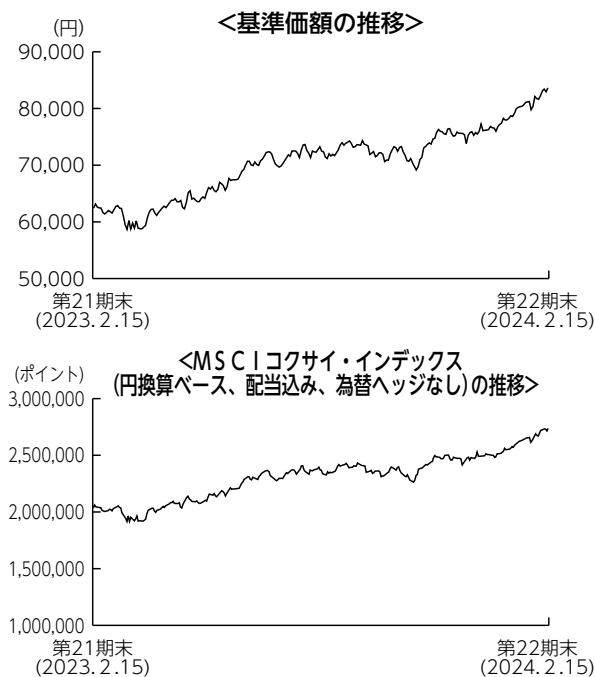
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2023年 2月 15日	62,397	% -	2,036,206.59	% -	% 95.5	% 2.4
2月 末	62,015	△0.6	2,024,295.30	△0.6	95.3	2.7
3月 末	61,720	△1.1	2,015,006.82	△1.0	94.3	3.6
4月 末	63,410	1.6	2,069,847.33	1.7	96.3	1.1
5月 末	66,369	6.4	2,168,855.48	6.5	96.0	2.0
6月 末	71,589	14.7	2,341,072.28	15.0	95.7	2.3
7月 末	72,676	16.5	2,377,166.85	16.7	96.3	1.7
8月 末	73,956	18.5	2,418,481.90	18.8	95.1	2.9
9月 末	72,169	15.7	2,360,275.52	15.9	96.8	1.3
10月 末	69,734	11.8	2,281,682.14	12.1	96.3	1.9
11月 末	75,211	20.5	2,460,561.81	20.8	96.5	1.6
12月 末	76,550	22.7	2,507,429.81	23.1	96.4	1.5
2024年 1月 末	81,230	30.2	2,657,966.51	30.5	95.7	2.7
(期 末) 2024年 2月 15日	83,633	34.0	2,736,922.65	34.4	96.4	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（2023年2月16日から2024年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は83,633円となり、前期末比で34.0%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米欧中央銀行の利上げ長期化観測が懸念されていたところに、一転して早期利下げ観測が浮上したことから多くの株式市場が上昇しました。加えて、為替市場で各国中央銀行と日銀の金融政策の方向性の違いから全ての通貨に対し円安となったことも寄与し、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

先進国株式市場は多くの市場が上昇しました。期前半はF R B（米連邦準備理事会）やE C B（欧州中央銀行）の利上げ長期化観測から上値の重い展開となりました。2023年10月にはイスラエル情勢の緊迫化や長期金利上昇への警戒感から下落しましたが、11月以降は米欧などで早期利下げ観測が浮上し長期金利が低下したことから米

国など多くの株式市場は上昇しました。その後は早期利下げ観測は後退したものの、大型ハイテク株などに牽引され上昇しました。

為替市場は全ての通貨に対し円安となりました。米ドルは期前半、F R Bの利上げ長期化観測や日銀の金融政策修正観測の後退などから日米の金融政策の方向性の違いが意識され円安米ドル高が進行しました。2023年11月に米国で早期利下げ観測が浮上し円の下落幅は縮小しましたが、2024年に入ると米国の利下げ観測は後退し、改めて円安米ドル高となりました。ユーロなどに対しても各中央銀行の金融政策の方向性の違いなどから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	10.6%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.7
3	資本財	6.5
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.2
5	銀行	6.2
6	エネルギー	5.6
7	メディア・娯楽	5.0
8	各種金融	4.8
9	半導体・半導体製造装置	4.8
10	ヘルスケア機器・サービス	4.6

期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.5%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.0
3	半導体・半導体製造装置	7.7
4	資本財	6.7
5	金融サービス	6.6
6	メディア・娯楽	6.4
7	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.3
8	銀行	5.1
9	一般消費財・サービス流通・小売り	4.8
10	エネルギー	4.4



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で34.4%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.4%下回りました。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) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	1円 (1) (0) (0) (0)	0.002% (0.001) (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)	10 (10) (0) (0)	0.015 (0.015) (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)	17 (12) (5)	0.024 (0.016) (0.007)	(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	29	0.041	
期中の平均基準価額は70,616円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2023年2月16日から2024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	201,199.39 百株 (8,428.59)	千アメリカ・ドル 2,176,298 (△375)	116,394.14 百株	千アメリカ・ドル 1,154,025
	カ ナ ダ	24,189.81 百株 (387.18)	千カナダ・ドル 139,511 (-)	13,131.73 百株	千カナダ・ドル 71,369
	オーストラリア	35,636.27 百株 (△668.68)	千オーストラリア・ドル 95,709 (-)	18,254.35 百株	千オーストラリア・ドル 51,278
	香 港	49,114 百株 (-)	千香港・ドル 154,405 (-)	29,493 百株	千香港・ドル 76,166
	シンガポール	60,335 百株 (35,288.22)	千シンガポール・ドル 15,583 (△49)	12,378 百株	千シンガポール・ドル 7,120
	ニュージーランド	2,918.52 百株 (-)	千ニュージーランド・ドル 2,741 (-)	- 百株	- 千ニュージーランド・ドル
	国	イ ギ リ ス	147,852.82 百株 (△1,691.59)	千イギリス・ポンド 111,828 (△638)	80,572.83 百株
イスラエル		1,810.83 百株 (-)	千イスラエル・シケル 9,910 (-)	3,689.04 百株	千イスラエル・シケル 7,214

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ス イ ス	百株 9,308.82 (796.67)	千スイス・フラン 79,635 (△383)	百株 9,910.6	千スイス・フラン 42,987	
	デ ン マ ー ク	百株 3,613.64 (2,397.1)	千デンマーク・クローネ 204,868 (-)	百株 2,066.9	千デンマーク・クローネ 114,086	
	ノ ル ウ ェ ー	百株 3,294.23 (-)	千ノルウェー・クローネ 51,942 (△40)	百株 1,342.07	千ノルウェー・クローネ 21,391	
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 16,692.57 (546.4)	千スウェーデン・クローナ 288,680 (-)	百株 15,731.31	千スウェーデン・クローナ 219,117	
	ユ ー ロ 圏	ア イ ル ラ ン ド	百株 1,955.04 (-)	千ユーロ 5,255 (-)	百株 1,811.3	千ユーロ 10,624
		オ ラ ン ダ	百株 11,847.24 (2,024.76)	千ユーロ 49,648 (△57)	百株 9,609.12	千ユーロ 29,076
		ベ ル ギ ー	百株 880.49 (112.17)	千ユーロ 5,791 (-)	百株 490.21	千ユーロ 2,703
		ル ク セ ン ブ ル グ	百株 1,091.52 (-)	千ユーロ 2,425 (-)	百株 1,827.65	千ユーロ 1,572
		フ ラ ン ス	百株 12,278.26 (129.1)	千ユーロ 91,329 (△81)	百株 7,834.61	千ユーロ 52,133
		ド イ ツ	百株 15,631.14 (-)	千ユーロ 68,716 (△464)	百株 10,234.72	千ユーロ 35,105
		ス イ ス	百株 383.65 (-)	千ユーロ 4,036 (△39)	百株 95.19	千ユーロ 737
		ポ ル ト ガ ル	百株 2,186.26 (-)	千ユーロ 1,421 (-)	百株 -	千ユーロ -
		ス ペ イ ン	百株 23,314.77 (17,297.92)	千ユーロ 20,669 (△4)	百株 30,997.66	千ユーロ 11,683
		イ タ リ ア	百株 33,079.8 (-)	千ユーロ 14,241 (△1)	百株 12,925.86	千ユーロ 7,258
	口	フ ィ ン ラ ン ド	百株 10,192.13 (640.8)	千ユーロ 11,591 (-)	百株 2,298.9	千ユーロ 2,543
		オ ー ス ト リ ア	百株 277.66 (-)	千ユーロ 1,178 (-)	百株 -	千ユーロ -

(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	カナダ	証券	千カナダ・ドル	証券	千カナダ・ドル
		(2,968)	(-)	(-)	(-)

(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
アメリカ	千□	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
		8.981	1,023	3.582	338
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	(-)	(-)	(-)	(-)	
BOSTON PROPERTIES INC	11.195	620	5.253	283	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	38.286	711	17.066	274	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
PROLOGIS INC	50.042	5,776	25.541	2,751	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11.994	2,086	7.408	1,265	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
CAMDEN PROPERTY TRUST	11.902	1,192	8.322	781	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
EQUINIX INC	5.046	3,731	2.146	1,501	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
CROWN CASTLE INC	29.18	3,127	18.278	1,754	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4.621	1,015	3.073	660	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
EQUITY RESIDENTIAL	19.452	1,146	11.402	687	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	41.098	781	19.936	328	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
SBA COMMUNICATIONS CORP	7.459	1,648	4.504	874	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
WELLTOWER INC	30.066	2,390	11.303	881	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
KIMCO REALTY	33.13	608	17.597	289	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
IRON MOUNTAIN INC	9.102	513	-	-	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22.334	1,508	15.53	1,032	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
HOST HOTELS & RESORTS INC	40.57	664	21.932	343	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
MID AMERICA	11.957	1,754	7.998	1,156	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
REALTY INCOME CORP	61.574	3,413	8.304	409	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
REGENCY CENTERS CORP	12.938	788	10.342	607	
	(-)	(-)	(-)	(-)	

	買 付		売 付	
	□ 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
UDR INC	18.219	625	9.286	322
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	11.263	1,305	3.256	342
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	9.624	2,632	5.407	1,424
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	12.875	1,666	9.06	1,158
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	30.71	1,365	18.045	750
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	39.178	1,222	14.307	429
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	21.499	3,052	3.575	386
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	13.283	1,584	3.934	461
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	-	-	72.327	596
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	30.077	5,546	16.904	2,911
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	24.66	1,518	15.328	825
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	47.041	794	89.412	1,345
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	18.257	637	9.439	317
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	19.821	636	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	11.157	547	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	-	-	2.199	26
	(2.199)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	32.109	994	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	754.156	1,632	486.626	1,108
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	130.224	498	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	110.515	470	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	83.445	1,701	42.152	851
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	656.486	1,689	478.229	1,197
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT DUMMY	87	4,495	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
LINK REIT	60.6	2,397	-	-
	(-)	(1)	(-)	(-)
LINK REIT-RTS	-	-	52.503	209
	(52.503)	(△1)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	-	-	-	-
	(-)	(△3)	(-)	(-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	628.1	1,689	457.7	1,188
	(-)	(△13)	(-)	(-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	-	-	-	-
	(-)	(△17)	(-)	(-)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	-	-	24.589	25
	(24.589)	(26)	(-)	(-)
KEPPEL REIT	-	-	36.98	29
	(36.98)	(22)	(-)	(-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	-	-	-	-
	(-)	(△3)	(-)	(-)
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	-	-	119.111	385
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	235.62	1,460	191.367	1,133
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW	29.844	808	26.007	723
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	12.488	1,202	8.836	823
	(-)	(-)	(-)	(-)
KLEPIERRE	11.128	266	-	-
	(-)	(△21)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.942	255	-	-
	(13.535)	(-)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	-	-	-	-
	(△13.535)	(-)	(-)	(-)

(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 255,616	百万円 257,547	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	655,018,143千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,026,729,929千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.63

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2023年2月16日から2024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		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	11,415.95	14,153.69	241,999	36,418,548	大規模小売り
ABBOTT LABORATORIES	2,180.54	2,650.14	29,697	4,469,172	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	795.05	1,091.22	1,761	265,047	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,124.58	1,390.28	25,521	3,840,710	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	2,016.32	2,466.44	44,075	6,632,889	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	584.05	694.37	41,985	6,318,439	ソフトウェア
CHUBB LTD	521.17	628.23	15,587	2,345,784	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	277.73	342.61	7,434	1,118,890	化学
ALLSTATE CORP	329.39	396.52	6,399	963,051	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	837.7	1,013.35	19,747	2,971,748	コンゴロマリット
AMGEN INC	666.76	815.06	23,642	3,557,951	バイオテクノロジー
HESS CORP	352.71	414.96	5,922	891,310	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	795.36	954.49	20,130	3,029,392	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	626.53	773.42	6,094	917,168	電力
AFLAC INC	726.73	847.3	6,686	1,006,310	保険
AMERICAN INTL GROUP	938.43	1,081.5	7,480	1,125,775	保険
ANALOG DEVICES	633.36	762.33	14,203	2,137,519	半導体・半導体製造装置
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	864.52	1,024.32	5,845	879,733	建設関連製品
VALERO ENERGY CORP	484.9	540.42	7,622	1,147,047	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	108.31	132.52	4,373	658,116	ソフトウェア
APPLE INC	20,001.34	23,826.92	438,772	66,030,908	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	1,068.03	1,280.53	23,842	3,588,010	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	139.61	169.36	1,937	291,545	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	694.12	815.04	4,341	653,385	食品
AMEREN CORP	316.21	406.44	2,788	419,654	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	99.36	-	-	-	電子装置・機器・部品
AUTODESK INC	269.07	320.74	8,408	1,265,446	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	518.47	629.63	15,797	2,377,353	専門サービス
AUTOZONE INC	24.51	27.16	7,406	1,114,555	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	95.14	115.42	2,382	358,490	容器・包装
BALL CORP	402.23	462.88	2,869	431,884	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,619.51	1,993.18	79,464	11,958,552	金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	969.68	1,163.87	6,340	954,221	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	631.74	802.19	3,179	478,540	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	350.61	439.38	10,484	1,577,744	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	289.58	344.76	5,978	899,701	電気設備
VERIZON COMM INC	5,240.12	6,415.22	25,757	3,876,187	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	291.91	316.07	2,589	389,655	保険
BEST BUY CO INC	254.05	305.68	2,280	343,173	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	30.21	30.21	990	149,077	ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	353.37	420.53	5,635	848,089	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	672.13	836.97	3,090	465,154	電力
BOEING CO	702.82	866.01	17,612	2,650,567	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INC	144.56	144.56	1,165	175,343	専門サービス
BORGWARNER INC	278	370.1	1,152	173,438	自動車用部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,753.52	2,219.59	14,638	2,202,902	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	144.94	172.33	1,272	191,496	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	195.29	260.64	4,058	610,791	娯楽

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	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	27.31	34.11	4,029	606,324	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,659.49	3,197.71	15,633	2,352,701	医薬品
ONEOK INC	569.8	867.02	5,991	901,732	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	97.09	97.09	1,194	179,701	保険
UNITED RENTALS INC	88.83	107.88	7,055	1,061,824	商社・流通業
SEMPRA	385.67	983.72	6,832	1,028,285	総合公益事業
FEDEX CORP	309.91	367.46	8,702	1,309,647	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	118.5	133.02	2,598	391,015	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	743.44	915.2	9,528	1,433,890	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	384.05	483.08	2,770	416,927	飲料
QUANTA SERVICES INC	175.6	232.71	4,948	744,676	建設・土木
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,017.65	1,017.65	489	73,663	メディア
CSX CORP	2,635.36	3,042.11	11,255	1,693,886	陸上運輸
COTERRA ENERGY INC	999.16	1,147.11	2,742	412,754	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	269.78	269.78	1,103	166,131	食品
CONSTELLATION BRANDS INC	193.43	246.29	5,999	902,883	飲料
CARDINAL HEALTH INC	344.21	382.98	3,965	596,806	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARLISLE COS INC	61.19	75.2	2,612	393,169	建設関連製品
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	1,322.91	1,484.08	2,266	341,038	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	658.5	779.69	24,693	3,716,134	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	126.31	146.08	2,414	363,366	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	970.73	-	-	-	各種電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	3,650.43	4,423.91	77,874	11,719,271	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	302.36	389.11	3,774	568,004	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	198.78	228.76	2,537	381,923	保険
CINTAS CORP	111.73	141.69	8,680	1,306,391	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	5,161.36	6,184.56	31,095	4,679,632	通信機器
CLEVELAND-CLIFFS INC	693.71	835.13	1,631	245,450	金属・鉱業
CLOROX COMPANY	157.94	183.05	2,786	419,295	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	5,108.54	6,273.48	37,195	5,597,545	飲料
COPART INC	540.11	1,283.73	6,318	950,873	商業サービス・用品
COGNEX CORP	204.32	-	-	-	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	988.65	1,213.09	10,154	1,528,192	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	345.46	383.76	9,033	1,359,425	ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	74.34	89.28	3,570	537,376	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NRG ENERGY, INC.	283.64	348.74	1,815	273,220	電力
COMCAST CORP-CL A	5,492.1	6,281.71	26,395	3,972,295	メディア
CONAGRA BRANDS INC	619.81	736.39	1,968	296,220	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	438.55	517.36	4,492	676,114	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	366.03	441.28	2,489	374,675	総合公益事業
COOPER COS INC	63.42	79.71	2,969	446,822	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	252.81	304.36	1,869	281,414	飲料
CORNING INC	957.58	1,265.61	4,018	604,715	電子装置・機器・部品
WOLFSPEED INC	156.84	-	-	-	半導体・半導体製造装置
SEALED AIR CORP	176.1	-	-	-	容器・包装
HEICO CORP-CL A	94.63	116.14	1,798	270,662	航空宇宙・防衛
MANHATTAN ASSOCIATES INC	-	94.42	2,349	353,526	ソフトウェア
CUMMINS INC	178.03	212.5	5,534	832,960	機械
DARLING INTERNATIONAL INC	200.32	238.06	995	149,822	食品
DR HORTON INC	406.02	457.84	6,661	1,002,499	家庭用耐久財
DANAHER CORP	861.23	1,070.45	26,546	3,994,921	ライフサイエンス・ツール/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	
MOODY'S CORP	206.82	245.21	8,986	1,352,371	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	629.06	759.97	5,832	877,659	情報技術サービス
TARGET CORP	577.14	711.89	10,324	1,553,740	生活必需品流通・小売り
DEERE & CO	362.03	413.61	15,914	2,395,031	機械
MORGAN STANLEY	1,604.05	1,898.13	15,944	2,399,456	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	270.24	335.74	6,001	903,093	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	500.52	619.75	5,101	767,767	不動産管理・開発
DECKERS OUTDOOR CORP	-	41.74	3,539	532,729	繊維・アパレル・贅沢品
THE WALT DISNEY CO	2,274.04	2,794.06	31,170	4,690,853	娯楽
DOLLAR TREE INC	281.49	317.56	4,442	668,480	生活必需品流通・小売り
DOVER CORP	178.42	225.99	3,635	547,174	機械
OMNICOM GROUP	265.7	305.86	2,623	394,881	メディア
DTE ENERGY CO	237.92	337	3,549	534,182	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	964.73	1,181.23	10,789	1,623,690	電力
DARDEN RESTAURANTS INC	156.76	177.01	2,852	429,275	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	676.67	842.27	3,552	534,645	大規模小売り
BANK OF AMERICA CORP	9,008.68	10,908.1	36,138	5,438,488	銀行
CITIGROUP INC	2,418.65	2,941.7	15,879	2,389,675	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	167.9	167.9	1,378	207,494	化学
EATON CORP PLC	496.76	611.13	16,843	2,534,848	電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	343.37	417.15	12,545	1,887,952	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	244.16	-	-	-	メディア
ECOLAB INC	325.5	381.51	8,277	1,245,699	化学
REVVITY INC	156.49	179.72	1,861	280,089	ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	348.38	388.01	5,551	835,467	娯楽
SALESFORCE INC	1,248.76	1,483.57	42,897	6,455,633	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	33.72	33.72	1,186	178,531	保険
EMERSON ELECTRIC CO	738.89	879.6	9,344	1,406,309	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	175.67	245.32	2,771	417,101	ガス
ENTERGY CORP	260.97	307.36	3,014	453,665	電力
EOG RESOURCES INC	734.98	903.94	10,034	1,510,112	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	151.56	187.3	4,688	705,627	専門サービス
EQT CORP	409.96	597.29	1,968	296,264	石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	289.95	358.46	5,113	769,520	パーソナルケア用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	199.74	224.15	2,818	424,150	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	5,193.82	6,116.07	61,674	9,281,387	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	155.34	177.11	905	136,278	化学
NEXTERA ENERGY INC	2,449.25	3,099.21	17,358	2,612,307	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	47.16	60.19	2,779	418,280	資本市場
FAIR ISAAC CORP	29.62	37.75	4,884	735,030	ソフトウェア
ASSURANT INC	58.23	87.66	1,505	226,611	保険
FASTENAL CO	729.41	856.03	6,003	903,442	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	843.62	1,054.1	3,532	531,574	銀行
M&T BANK CORP	207.66	249.58	3,398	511,407	銀行
FIRST HORIZON CORP	696.34	-	-	-	銀行
FISERV INC	760.76	917.18	13,297	2,001,107	金融サービス
FORD MOTOR CO	4,943.79	5,859.08	7,359	1,107,456	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	379.16	474.77	1,270	191,266	資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,801.8	2,146.28	7,984	1,201,536	金属・鉱業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	15.87	15.84	2,364	355,881	銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	262.69	333.44	7,958	1,197,681	保険

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		
DENTSPLY SIRONA INC	255.99	—	—	—		ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	287.25	346.34	9,320	1,402,568		航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	749.19	885.17	5,520	830,825		食品
GENUINE PARTS CO	173.74	207.69	2,991	450,200		販売
GILEAD SCIENCES INC	1,563.88	1,900.11	13,878	2,088,560		バイオテクノロジー
GARTNER INC	95.64	119.88	5,392	811,580		情報技術サービス
MCKESSON CORP	179.8	208.54	10,452	1,572,925		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	3,102.42	3,764.94	278,229	41,870,692		半導体・半導体製造装置
GRACO INC	—	239.85	2,118	318,863		機械
GENERAL ELECTRIC CO	1,369.1	1,646.58	24,122	3,630,179		コンプロマリット
WW GRAINGER INC	54.66	67.77	6,400	963,165		商社・流通業
HALLIBURTON CO	1,115.7	1,392.51	4,762	716,691		エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	497.39	1,176.37	6,572	989,077		飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	424.3	503	19,015	2,861,629		資本市場
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	243.2	287.28	6,038	908,666		航空宇宙・防衛
HASBRO INC	154.37	163.59	861	129,715		レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	174.31	174.31	1,284	193,276		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	51.85	68.78	1,329	200,151		航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	186.95	225	4,303	647,577		食品
HP INC	1,259.55	1,341.36	3,833	576,919		コンピュータ・周辺機器
F5 INC	69.24	89.81	1,654	249,036		通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	153.22	181.25	1,331	200,399		容器・包装
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	76.15	1,632	245,732		バイオテクノロジー
JUNIPER NETWORKS INC	437.15	578.81	2,143	322,550		通信機器
HOLOGIC INC	306.95	383.99	2,808	422,709		ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT INC	1,275.83	1,527.31	54,712	8,233,733		専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	228.8	296.68	2,551	384,012		バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	388.51	490.54	1,412	212,605		食品
CENTERPOINT ENERGY INC	787.91	977.76	2,674	402,436		総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	36.02	49.17	2,197	330,717		建設関連製品
HUBBELL INC	69.03	78.2	2,812	423,294		電気設備
HUMANA INC	158.44	186.41	6,753	1,016,326		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	103.48	122.76	2,670	401,923		陸上運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,814.91	2,153.85	2,739	412,297		銀行
BIOGEN INC	176.03	219.1	4,836	727,831		バイオテクノロジー
IDEX CORP	90.65	110.45	2,507	377,344		機械
ILLINOIS TOOL WORKS	387.9	464.63	11,807	1,776,862		機械
INTUIT INC	335.01	427.34	28,081	4,226,029		ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	101.62	125	7,007	1,054,483		ヘルスケア機器・用品
TRANE TECHNOLOGIES PLC	292.93	351.54	9,590	1,443,253		建設関連製品
INTEL CORP	5,124.32	6,392.05	28,246	4,250,811		半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	319.79	409.93	3,254	489,698		化学
INTERNATIONAL PAPER CO	441.53	534.19	1,844	277,587		容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	456.79	540.63	1,714	258,072		メディア
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	95.06	118.57	2,078	312,726		金融サービス
JABIL CIRCUIT INC	—	195.86	2,767	416,540		電子装置・機器・部品
INCYTE CORP	244.49	316.54	1,832	275,765		バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	3,270.95	3,669.56	57,149	8,600,462		医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	394.02	456.59	4,175	628,442		保険
KLA CORPORATION	177.34	204.32	13,359	2,010,434		半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	783.84	969.85	4,057	610,666		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	
			株数	株数			
(アメリカ)	百株	百株					
KELLANOVA	329.41	424.51		2,291		344,912	食品
KEYCORP	1,189.55	1,440.72		1,996		300,504	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	421.73	529.32		6,267		943,143	家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	188.14	227.27		17,849		2,686,214	資本市場
KROGER CO	827.75	1,033.85		4,723		710,863	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	172.6	200.26		18,337		2,759,656	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	58.9	74.46		3,183		479,068	電子装置・機器・部品
PACKAGING CORP OF AMERICA	110.29	134.51		2,224		334,809	容器・包装
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	-	202.6		1,545		232,511	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES	200.36	233.13		2,676		402,761	情報技術サービス
PLUG POWER INC	561.49	-		-		-	電気設備
LENNAR CORP	323.61	376.67		5,795		872,213	家庭用耐久財
ELI LILLY & CO	1,006.41	1,230.21		93,165		14,020,405	医薬品
BATH & BODY WORKS INC	281.56	346.38		1,519		228,732	専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	179.37	-		-		-	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	911.89	1,108.84		15,991		2,406,589	航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	371.89	448.25		5,927		892,053	ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	296.95	338.42		14,152		2,129,792	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	235.3	302.89		2,226		335,118	保険
LOWE'S COS INC	774.78	884.86		20,080		3,021,858	専門小売り
DOMINION ENERGY INC	1,018.28	1,265.01		5,674		854,005	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	404.01	404.01		1,729		260,221	ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	320.31	402.79		2,617		393,942	食品
MCDONALD'S CORPORATION	914.13	1,110.35		31,996		4,815,221	ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	425.05	495.71		20,879		3,142,201	資本市場
EVEREST GROUP LTD	53.53	66.7		2,474		372,438	保険
MARKEL GROUP INC	16.74	20.13		2,957		445,004	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	776.95	915.1		7,873		1,184,886	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	621.47	756.06		14,948		2,249,647	保険
MASCO CORP	289.37	345.61		2,539		382,123	建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	77.36	93.65		5,052		760,281	建設資材
METLIFE INC	847.99	974.05		6,657		1,001,907	保険
MEDTRONIC PLC	1,660.79	2,021.17		16,913		2,545,260	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	974.96	-		-		-	娯楽
CVS HEALTH CORP	1,636.16	1,973.56		15,079		2,269,384	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	3,156.72	3,864.48		48,622		7,317,258	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	543.62	652.5		5,328		801,956	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	114.55	128.76		2,937		442,010	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	8,819.04	10,756.09		440,451		66,283,490	ソフトウェア
MICRON TECH INC	1,356.54	1,680.37		13,750		2,069,307	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	695.97	816.68		6,580		990,345	半導体・半導体製造装置
3M CO	693.96	825.77		7,631		1,148,504	コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	63.11	-		-		-	家庭用耐久財
ENTEGRIS INC	177.09	236.75		3,105		467,339	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	64.45	76.74		1,881		283,079	ライフサイエンス・ツール/サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	205.78	248.47		7,935		1,194,271	通信機器
ILLUMINA INC	198.33	243.79		3,431		516,346	ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	693.25	827.77		4,857		730,983	電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	117.16	146.13		1,925		289,776	バイオテクノロジー
NETAPP INC	282.65	327.85		2,877		432,991	コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	419.84	-		-		-	家庭用耐久財

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	
NEWMONT CORP	992.87	1,736.08	5,576	839,175	金属・鉱業
NVR INC	4.05	4.83	3,623	545,275	家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	1,574.85	1,877.2	19,960	3,003,820	繊維・アパレル・贅沢品
NORDSON CORP	64.47	75.48	1,990	299,559	機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	289.97	341.4	8,612	1,296,043	陸上運輸
EVERSOURCE ENERGY	430.42	518.61	2,959	445,328	電力
NISOURCE INC	532.7	645.43	1,638	246,517	総合公益事業
NORTHERN TRUST CORP	248.36	328.68	2,597	390,955	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	183.61	220.98	9,863	1,484,415	航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	4,724.91	5,582.86	27,093	4,077,318	銀行
NUCOR CORP	316.6	374.96	6,789	1,021,680	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	285.54	364.22	5,666	852,811	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	466.54	576.3	7,786	1,171,773	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,147.44	997.74	5,717	860,358	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	116.3	148.54	6,404	963,738	陸上運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	77.57	90.84	9,531	1,434,446	専門小売り
ORACLE CORP	1,992.12	2,507.07	28,645	4,310,903	ソフトウェア
PACCAR INC	648.01	777.44	8,292	1,248,006	機械
PTC INC	136.65	180.85	3,268	491,931	ソフトウェア
EXELON CORP	1,216.64	1,571.97	5,363	807,162	電力
PARKER HANNIFIN CORP	161.01	192.11	10,026	1,508,874	機械
PAYCHEX INC	405.19	491.52	6,007	904,047	専門サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	96.51	114.52	3,467	521,762	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	887.37	1,136.87	2,961	445,683	電力
PEPSICO INC	1,714.95	2,105.84	35,277	5,308,840	飲料
PENTAIR PLC	198.04	255.45	1,915	288,243	機械
PFIZER INC	6,989.45	8,623.81	23,379	3,518,328	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	327.96	403.19	1,428	214,975	水道
CONOCOPHILLIPS	1,591.69	1,839.94	20,261	3,049,140	石油・ガス・消耗燃料
PG&E CORP	1,782.57	3,061.39	5,005	753,258	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	284.45	362.19	8,161	1,228,292	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	2,244.42	2,710.33	10,949	1,647,825	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	510.1	598.05	8,843	1,330,838	銀行
BROWN & BROWN INC	306.5	369.07	3,033	456,549	保険
GARMIN LTD	199.11	232.81	2,859	430,341	家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	283.41	357.48	5,008	753,698	化学
COSTCO WHOLESALE CORP	551.82	676.03	48,821	7,347,152	生活必需品流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	277.07	342.93	3,647	548,897	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	145.36	165.74	2,116	318,561	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,967.79	3,594.41	55,939	8,418,380	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	731.78	898.08	16,879	2,540,182	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	601	742.43	4,363	656,627	総合公益事業
PULTE GROUP INC	290.5	339.5	3,524	530,430	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	336.53	400.68	5,568	838,026	金融サービス
QUALCOMM INC	1,401.58	1,702.86	26,213	3,944,918	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	234.37	291.41	3,400	511,735	資本市場
EXACT SCIENCES CORP	233.86	260.45	1,617	243,362	バイオテクノロジー
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	-	87.47	2,577	387,858	金属・鉱業
REGENERON PHARMACEUTICALS	133.97	160.52	15,214	2,289,616	バイオテクノロジー
REPLIGEN CORP	67.3	85.76	1,766	265,915	ライフサイエンス・ツール/サービス
RESMED INC	186.28	228.99	4,134	622,188	ヘルスケア機器・用品

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
(アメリカ)	百株	百株					
US BANCORP	1,766	2,292.27		9,283	1,397,103		銀行
SEAGEN INC	168.6	—		—	—		バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	458.51	563.09		4,778	719,183		保険
ROSS STORES INC	441.71	508.78		7,351	1,106,306		専門小売り
ROLLINS INC	259.2	457.08		2,022	304,377		商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	131.2	163.44		8,853	1,332,394		ソフトウェア
ROCKWELL AUTOMATION INC	146.33	173.27		4,850	729,928		電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	274.77	374.64		4,369	657,554		ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	164.67	192.58		2,082	313,404		化学
ACCENTURE PLC-CL A	788.43	956.12		35,470	5,337,901		情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,686.45	2,088.47		14,913	2,244,372		食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	132.32	162.17		4,462	671,526		保険
AXON ENTERPRISE INC	—	110.39		2,989	449,935		航空宇宙・防衛
THE TRAVELERS COMPANIES INC	295.95	348.35		7,545	1,135,591		保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	750.43	893.54		5,597	842,312		金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	49.56	54.52		20,381	3,067,176		ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,774.1	2,179.9		10,409	1,566,453		エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,813.79	2,301.45		14,506	2,183,013		資本市場
POOL CORP	46.6	63.05		2,413	363,196		販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	261.44	321.14		3,912	588,832		ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	186.42	—		—	—		食品
SEI INVESTMENTS CO	144.77	144.77		953	143,485		資本市場
ELEVANCE HEALTH INC	299.28	361.39		18,290	2,752,508		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENCORA INC	191.04	257.01		5,951	895,692		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	319.21	355.91		2,800	421,470		保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	304.76	375		11,663	1,755,258		化学
CENTENE CORP	700.8	824.87		6,391	961,919		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	73.3	—		—	—		銀行
SMITH (A.O.) CORP	148.56	195.63		1,587	238,967		建設関連製品
SNAP-ON INC	70.68	82.04		2,158	324,877		機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	467.76	543.92		5,787	870,932		保険
ADVANCE AUTO PARTS	71.65	—		—	—		専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	485.33	576.12		3,746	563,812		電力
SOUTHERN CO	1,360.27	1,667.22		11,305	1,701,352		電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,653.26	1,987.29		7,036	1,058,997		銀行
SOUTHWEST AIRLINES	197	197		664	100,057		旅客航空輸送
AT&T INC	8,882.01	10,942.28		18,503	2,784,575		各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	2,316.39	2,770.81		41,842	6,296,802		石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	192.7	225.92		2,002	301,398		機械
STATE STREET CORP	461.98	504.16		3,604	542,477		資本市場
STARBUCKS CORP	1,428.19	1,751.61		16,477	2,479,683		ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	229.37	229.37		2,746	413,317		金属・鉱業
STRYKER CORP	426.35	518.49		18,117	2,726,439		ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	554.71	676.48		39,190	5,897,780		娯楽
GEN DIGITAL INC	730.86	925.83		1,973	297,047		ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	203.18	274		1,619	243,735		陸上運輸
SYNOPSIS INC	187.79	233.14		13,119	1,974,351		ソフトウェア
SYSCO CORP	625.21	764.19		6,037	908,523		生活必需品流通・小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	446.32	534.63		20,410	3,071,506		ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	55.32	69.85		1,739	261,815		ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	1,347.81	1,692.5		2,229	335,445		医薬品

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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TERADYNE INC	185.12	220.66	2,241	337,284	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,137.01	1,389.08	21,929	3,300,156	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	258.24	298.41	2,575	387,643	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	487.95	588.51	32,266	4,855,746	ライフサイエンス・ツール/サービス
GLOBE LIFE INC	121.53	149.73	1,876	282,449	保険
TORO CO	-	146.44	1,394	209,931	機械
DAVITA INC	68.13	68.13	840	126,530	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	136.9	168.08	3,958	595,656	専門小売り
BIO-TECHNE CORP	206.52	259.34	1,818	273,664	ライフサイエンス・ツール/サービス
TRIMBLE INC	286.76	375.04	2,183	328,535	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	53	61.75	2,717	409,002	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	356.84	413.16	2,147	323,193	食品
UGI CORP	241.6	-	-	-	ガス
MARATHON OIL CORP	840.59	929.52	2,081	313,199	石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	777.69	931.33	23,293	3,505,438	陸上運輸
RTX CORP	1,830.61	2,234.86	20,424	3,073,665	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,165.09	1,413.9	73,090	10,999,336	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	80.96	99.03	1,601	240,996	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VF CORP	378.87	517.62	890	133,982	繊維・アパレル・贅沢品
PARAMOUNT GLOBAL	786.63	813.26	1,072	161,429	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	321.4	394.11	16,469	2,478,430	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	164.52	200.95	4,844	729,109	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	917.06	1,071.24	2,307	347,248	生活必需品流通・小売り
WALMART INC	1,878.96	2,261.8	38,133	5,738,777	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	505.78	621.22	12,372	1,861,895	商業サービス・用品
WATERS CORP	75.11	87.86	2,789	419,826	ライフサイエンス・ツール/サービス
WATSCO INC	-	48.89	1,895	285,292	商社・流通業
WEBSTER FINANCIAL CORP	222.85	-	-	-	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	96.41	114.64	4,679	704,216	ライフサイエンス・ツール/サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	126.79	156.04	1,954	294,117	食品
VAIL RESORTS INC	52.35	65.23	1,462	220,085	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	407.23	494.51	2,773	417,340	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	202.73	284	3,836	577,363	機械
WHIRLPOOL CORP	68.32	-	-	-	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	188.33	253.19	2,679	403,239	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	127.57	153.79	1,618	243,496	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	115.96	529.69	2,956	444,878	資本市場
CME GROUP INC	443.42	541.32	11,648	1,752,926	資本市場
WILLIAMS COS INC	1,518.9	1,807.81	5,974	899,149	石油・ガス・消耗燃料
DICK'S SPORTING GOODS INC	-	85.51	1,427	214,812	専門小売り
LKQ CORP	315.04	438.82	2,143	322,595	販売
ALLIANT ENERGY CORP	339.66	405.24	1,930	290,469	電力
WEC ENERGY GROUP INC	383.18	478.82	3,670	552,321	総合公益事業
CARMAX INC	186.73	224.14	1,630	245,425	専門小売り
TJX COMPANIES INC	1,452.28	1,724.69	16,758	2,522,033	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	67.3	77.85	1,969	296,358	電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,560.49	1,560.49	497	74,913	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	173.28	235.28	989	148,852	コングロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	150.92	192.71	3,163	476,050	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	79.96	-	-	-	銀行
CBRE GROUP INC	410.89	485.77	4,220	635,196	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY GLOBAL PLC	157.79	—	—	—	各種電気通信サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,172.22	1,525.88	2,790	419,992	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	41.15	51.37	2,180	328,151	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	53.87	71.27	5,310	799,237	半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CORP	41.87	60.3	851	128,123	化学
T-MOBILE US INC	784.34	806.97	13,026	1,960,299	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	429.72	594.74	3,240	487,609	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	425.61	485.02	1,433	215,687	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	48.71	61.26	1,324	199,324	資本市場
CELANESE CORP	138.41	162.73	2,410	362,808	化学
DEXCOM INC	487.1	585.53	6,836	1,028,759	ヘルスケア機器・用品
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	195.54	3,651	549,486	建設関連製品
EXPEDIA GROUP INC	191.86	219.78	2,963	445,913	ホテル・レストラン・レジャー
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	240.27	309.69	2,402	361,563	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	131.23	155.36	6,080	915,004	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	360.34	—	—	—	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	698.96	873.85	11,942	1,797,156	資本市場
LIVE NATION	204.44	235.97	2,109	317,469	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	34.74	42.26	11,072	1,666,364	ホテル・レストラン・レジャー
TRANSDIGM GROUP INC	61.48	84.96	9,746	1,466,678	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	1,074.66	1,282.61	59,665	8,979,096	金融サービス
CELSIUS HOLDINGS INC	—	236.23	1,477	222,402	飲料
WESTERN UNION CO	467.12	—	—	—	金融サービス
OWENS CORNING	132.27	132.27	1,891	284,705	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	151.08	206.79	2,512	378,105	専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	178.61	300.64	2,316	348,644	商社・流通業
FIRST SOLAR INC	119.03	155.79	2,465	370,991	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	153	183.98	3,614	543,969	専門サービス
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	72.63	6,395	962,448	コンピュータ・周辺機器
AECOM TECHNOLOGY CORP	—	210.94	1,895	285,191	建設・土木
DELTA AIR LINES INC	215.92	215.92	881	132,704	旅客航空輸送
INSULET CORP	88.34	101.58	1,917	288,599	ヘルスケア機器・用品
DISCOVER FINANCIAL	332.36	391.88	4,275	643,465	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	387.62	470.54	6,719	1,011,189	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	56.88	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	145.47	172.55	7,949	1,196,327	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	266.9	—	—	—	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	57.15	69.13	12,072	1,816,813	大規模小売り
ULTA BEAUTY INC	60.73	72.63	3,824	575,567	専門小売り
INVESCO LTD	385.3	—	—	—	資本市場
MSCI INC	98.07	119.48	6,843	1,029,925	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,930.16	2,367.46	21,122	3,178,721	タバコ
VISA INC	2,035.26	2,448.21	67,952	10,226,174	金融サービス
KEURIG DR PEPPER INC	928.16	1,607.6	4,999	752,395	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	228.09	317.51	3,825	575,678	水道
MARATHON PETROLEUM CORP	631.37	615.28	10,452	1,572,978	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	161.82	214.3	1,704	256,516	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	2,578.77	2,983.12	4,943	743,876	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	228.48	368.91	4,580	689,302	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	333.42	404.21	3,825	575,690	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	47.13	64.81	1,816	273,393	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SPLUNK INC	208.98	247.88	3,829	576,338	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	70.9	81.62	2,270	341,639	情報技術サービス
HCA HEALTHCARE INC	287.52	307.02	9,377	1,411,191	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	189.74	216.63	5,332	802,432	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	77.92	107.06	1,308	196,946	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	88.44	102.95	2,804	421,996	金融サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	224.34	-	-	-	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	321.09	389.38	9,109	1,370,954	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	163.43	192.42	2,792	420,257	専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	258.3	332.63	2,938	442,207	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	69.11	93.98	1,267	190,775	自動車用部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	127.09	156.08	2,883	433,973	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	310.59	342.95	2,162	325,507	専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	278.99	334.44	4,414	664,354	生活必需品流通・小売り
FORTINET INC	811.66	1,005.99	7,130	1,073,062	ソフトウェア
HYATT HOTELS CORP	-	66.47	857	129,109	ホテル・レストラン・レジャー
HORIZON PHARMA PLC	276.13	-	-	-	バイオテクノロジー
TESLA INC	3,319.53	4,357.58	82,231	12,375,077	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	69.14	-	-	-	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	170.46	215.39	2,834	426,633	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,712.1	2,080.56	7,983	1,201,378	自動車
ALLY FINANCIAL INC	392.3	392.3	1,413	212,770	消費者金融
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	96.61	118.95	3,033	456,470	資本市場
APTIV PLC	343.1	430.97	3,410	513,275	自動車用部品
PHILLIPS 66	594.04	683.58	9,926	1,493,803	石油・ガス・消耗燃料
META PLATFORMS INC	2,845.33	3,387.66	160,331	24,128,238	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	225.14	278.48	6,780	1,020,345	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	200.87	248.5	4,221	635,221	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	253.33	311.78	24,692	3,716,045	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	369.42	468.54	17,257	2,597,116	ソフトウェア
WORKDAY INC	255.47	310.6	9,387	1,412,736	ソフトウェア
ABBVIE INC	2,201.98	2,688.95	46,900	7,058,081	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	587.56	702.24	12,926	1,945,359	医薬品
NEWS CORP/NEW-CL A	542.11	542.11	1,410	212,195	メディア
CDW CORP	164.65	202.62	4,852	730,229	電子装置・機器・部品
HOWMET AEROSPACE INC	475.9	631.1	3,999	601,946	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	210.9	257.1	1,858	279,619	情報技術サービス
SNAP INC	1,273.18	1,522.5	1,735	261,197	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	532.3	668.55	4,967	747,633	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	224.66	-	-	-	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	88.45	-	-	-	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	198.71	-	-	-	メディア
OKTA INC	178.28	218.31	1,912	287,796	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	176.53	-	-	-	ソフトウェア
BAKER HUGHES CO	1,262.92	1,521.6	4,389	660,623	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	181.67	217.85	2,240	337,185	食品
CNH INDUSTRIAL NV	-	1,619.62	2,032	305,889	機械
BROADCOM INC	502.59	676.79	85,425	12,855,726	半導体・半導体製造装置
ARES MANAGEMENT CORP	195.34	231.61	3,166	476,502	資本市場
MONGODB INC	90.21	109.06	5,305	798,481	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	84.53	105.65	2,062	310,369	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	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	613.21	—	—	—	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	168.56	232.73	5,135	772,864	ヘルスケア・テクノロジー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	242.12	—	—	—	電気設備
EVERGY INC	282.26	331.92	1,632	245,707	電力
ALLEGION PLC	101.4	134.23	1,760	264,987	建設関連製品
DAYFORCE INC	183.14	220.02	1,590	239,391	専門サービス
STERIS PLC	125.24	155.4	3,537	532,292	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	263.62	319.74	1,633	245,833	ソフトウェア
WIX.COM LTD	58.55	89.97	1,166	175,473	情報技術サービス
DROPBOX INC	304.79	418.01	1,354	203,879	ソフトウェア
KKR & CO INC	674.3	903.73	8,671	1,304,942	資本市場
FUTU HOLDINGS LTD ADR	50.5	50.5	252	37,975	資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	279.21	338.57	2,171	326,802	ソフトウェア
MODERNA INC	416.26	500.06	4,298	646,808	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	344.09	402.32	7,752	1,166,704	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	311.33	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CIGNA GROUP	382.14	451.63	15,292	2,301,389	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	327.7	386.69	3,327	500,692	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	876.67	1,060.37	5,681	855,003	化学
OVINTIV INC	316.03	391.6	1,660	249,871	石油・ガス・消耗燃料
AMCOR PLC	1,887.89	2,233.48	1,998	300,824	容器・包装
PINTEREST INC	697.46	909.36	3,257	490,195	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FOX CORP-A	365.01	365.01	1,104	166,164	メディア
FOX CORP-B	155.11	275.07	763	114,830	メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	425.86	—	—	—	専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	257.23	338.13	11,312	1,702,363	ソフトウェア
CHEWY INC	96.48	—	—	—	専門小売り
AVANTOR INC	782.14	971.57	2,370	356,756	ライフサイエンス・ツール/サービス
DYNATRACE INC	254.29	393.62	2,076	312,528	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	297.7	432.84	4,517	679,846	情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	138	169.18	1,734	261,091	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	1,018.98	1,243.79	6,840	1,029,478	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	528.55	626	5,685	855,679	機械
UBER TECHNOLOGIES INC	1,815.6	2,811.19	22,250	3,348,488	陸上運輸
CORTEVA INC	905.9	1,080.01	5,840	878,966	化学
MATCH GROUP INC	352.59	447.64	1,627	244,873	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FERGUSON PLC	257.02	308.68	5,974	899,102	商社・流通業
BILL HOLDINGS INC	119.88	162.43	1,051	158,299	ソフトウェア
BLACKSTONE INC	880.26	1,085.46	13,888	2,090,074	資本市場
PAYLOCITY HOLDING CORP	53.22	58.09	999	150,361	専門サービス
CARLYLE GROUP INC	245.3	348.47	1,534	230,898	資本市場
DATADOG INC	291.79	386.35	5,260	791,600	ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	256.89	308.9	2,681	403,548	コンピュータ・周辺機器
VERTIV HOLDINGS CO	—	532.34	3,458	520,486	電気設備
INGERSOLL RAND INC	514.79	619.76	5,360	806,672	機械
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	441.35	623.73	5,187	780,676	ヘルスケア機器・用品
PAYCOM SOFTWARE INC	63.41	89.41	1,692	254,641	専門サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	383.42	934.26	1,451	218,487	自動車
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	92.67	—	—	—	海上運輸
DRAFTKINGS INC	—	639	2,803	421,963	ホテル・レストラン・レジャー
UNITY SOFTWARE INC	308.39	409.67	1,430	215,224	ソフトウェア

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	
AON PLC	263.41	313.09	9,657	1,453,415	保険
WARNER BROS DISCOVERY INC	2,917.78	3,514.21	3,419	514,574	娯楽
TEXAS PACIFIC LAND CORP	7.36	9.06	1,301	195,882	石油・ガス・消耗燃料
BENTLEY SYSTEMS INC	225.66	336.34	1,734	260,975	ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	130.94	263.05	4,218	634,886	資本市場
UIPATH INC	-	534.39	1,389	209,173	ソフトウェア
AFFIRM HOLDINGS INC	185.28	-	-	-	金融サービス
AIRBNB INC	471.77	644.56	9,552	1,437,537	ホテル・レストラン・レジャー
CONSTELLATION ENERGY CORP	412.24	482.14	6,203	933,594	電力
MONDAY.COM LTD	-	43.08	947	142,595	ソフトウェア
ROYALTY PHARMA PLC	417.75	621.73	1,821	274,142	医薬品
ROBLOX CORP	450.19	664.77	2,934	441,582	娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	296.56	-	-	-	インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,508.26	1,841.48	2,222	334,489	医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	264.44	346.04	1,478	222,518	ホテル・レストラン・レジャー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	126.87	158.46	1,201	180,876	石油・ガス・消耗燃料
HF SINCLAIR CORP	202.99	255.6	1,521	228,945	石油・ガス・消耗燃料
SNOWFLAKE INC	285.82	426.08	10,055	1,513,250	情報技術サービス
DOORDASH INC	295.75	393.76	4,725	711,142	ホテル・レストラン・レジャー
ARISTA NETWORKS INC	293.67	392.38	10,424	1,568,761	通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	504.82	595.48	6,703	1,008,782	金融サービス
GLOBAL-E ONLINE LTD	-	158.93	650	97,893	大規模小売り
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	2,028.24	2,731.08	6,879	1,035,309	ソフトウェア
FNF GROUP	310.04	389.07	2,023	304,524	保険
JACOBS SOLUTIONS INC	166.15	187.23	2,701	406,555	専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	1,079.89	1,291.01	8,902	1,339,783	半導体・半導体製造装置
APA CORP	409.46	491.46	1,464	220,400	石油・ガス・消耗燃料
CONFLUENT INC	-	275.24	932	140,375	ソフトウェア
LINDE PLC	-	744.54	31,151	4,687,997	化学
ROBINHOOD MARKETS INC	-	735.66	984	148,129	資本市場
LUCID GROUP INC	449.1	1,439.27	496	74,725	自動車
U-HAUL HOLDING CO	119.81	119.81	762	114,816	陸上運輸
ASPEN TECHNOLOGY INC	37.21	37.21	671	101,002	ソフトウェア
TOAST INC	326.2	453.99	914	137,666	金融サービス
GRAB HOLDINGS LTD	1,683.28	2,795.15	953	143,438	陸上運輸
CATALENT INC	205.64	273.57	1,557	234,419	医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	611.18	687.01	2,702	406,625	消費者金融
VERALTO CORP	-	370.86	3,123	470,037	商業サービス・用品
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM	-	198.71	596	89,711	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE	-	281.91	1,882	283,354	娯楽
BUNGE GLOBAL SA	-	217.15	1,943	292,541	食品
KENVUE INC	-	2,640.38	5,040	758,542	パーソナルケア用品
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	633.78	730.13	2,286	344,025	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	52.37	67.99	1,792	269,823	ソフトウェア
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	222.09	277.13	4,292	645,973	電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	58.02	73.6	4,634	697,393	ソフトウェア
QORVO INC	141.44	141.44	1,606	241,779	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	153.35	184.44	1,099	165,483	メディア
LIBERTY GLOBAL LTD	-	360.34	707	106,502	各種電気通信サービス
SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	67.28	-	-	-	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	197.13	197.13	2,199	330,984	情報技術サービス

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		
ETSY INC	156.14	185.58	1,413	212,782	大規模小売り	
TRANSUNION	257.08	312.62	2,423	364,749	専門サービス	
ALCOA CORP	239.41	—	—	—	金属・鉱業	
ALBERTSONS COS INC	—	540.86	1,147	172,636	生活必需品流通・小売り	
BLOCK INC	669.1	843.06	5,683	855,244	金融サービス	
DUPONT DE NEMOURS INC	602.66	682.35	4,616	694,676	化学	
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	262.21	310.12	2,052	308,815	飲料	
WESTROCK CO	342.86	342.86	1,461	219,906	容器・包装	
KRAFT HEINZ CO	921.06	1,294.47	4,421	665,453	食品	
NOVOCURE LTD	123.17	—	—	—	ヘルスケア機器・用品	
FORTIVE CORP	426.08	553.7	4,627	696,441	機械	
WASTE CONNECTIONS INC	310.39	388.48	6,375	959,484	商業サービス・用品	
ALPHABET INC-CL A	7,443.29	9,072.3	132,401	19,925,048	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,563.84	1,867.11	2,843	427,934	コンピュータ・周辺機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	1,375.3	1,585.07	9,331	1,404,268	金融サービス	
SEA LTD ADR	439.08	580.7	2,479	373,065	娯楽	
EQUITABLE HOLDINGS INC	449.24	563.29	1,903	286,436	金融サービス	
ZILLOW GROUP INC-C	163.21	223.74	1,299	195,491	不動産管理・開発	
ALPHABET INC-CL C	6,916.6	7,929.18	116,669	17,557,661	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
ZSCALER INC	103.1	140.51	3,558	535,548	ソフトウェア	
ATLASSIAN CORP PLC	—	237.13	5,119	770,418	ソフトウェア	
LINDE PLC	620.82	—	—	—	化学	
ROKU INC	156.6	193.31	1,763	265,428	娯楽	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	140.85	150.49	4,323	650,609	メディア	
VISTRA CORP	496.33	496.33	2,197	330,664	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>	423,708.49 601銘柄	516,942.33 588銘柄	6,597,442 —	992,849,171 <73.0%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
AGNICO EAGLE MINES LTD	570.3	752.91	4,618	513,283	金属・鉱業	
BARRICK GOLD CORP	2,148.35	2,674.95	5,093	566,047	金属・鉱業	
BANK OF MONTREAL	825.85	1,097.27	13,755	1,528,772	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	1,494.35	1,836.39	11,639	1,293,562	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	409.67	517.06	5,290	587,935	銀行	
BCE INC	76.97	141.97	711	79,113	各種電気通信サービス	
BROOKFIELD CORP	1,771.31	2,110.45	11,335	1,259,797	資本市場	
SAPUTO INC	345.82	345.82	961	106,886	食品	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	923.11	923.11	734	81,665	総合公益事業	
DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	115.08	115.08	1,367	151,983	ソフトウェア	
CGI INC	279.18	310.91	4,781	531,448	情報技術サービス	
CCL INDUSTRIES INC	210.58	210.58	1,212	134,712	容器・包装	
CAE INC	408.08	408.08	1,044	116,106	航空宇宙・防衛	
CAMECO CORP	542.64	660.84	3,782	420,403	石油・ガス・消耗燃料	
ROGERS COMM-CL B	456.07	533.75	3,255	361,857	無線通信サービス	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,145.14	1,430.11	8,699	966,846	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,407.03	1,643.44	13,377	1,486,786	石油・ガス・消耗燃料	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	61.24	89.11	1,255	139,523	大規模小売り	
CANADIAN UTILITIES LTD	163.3	163.3	488	54,247	総合公益事業	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	732.33	836.93	14,606	1,623,415	陸上運輸	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	217.13	301.42	1,402	155,841	繊維・アパレル・贅沢品	
OPEN TEXT CORP	332.17	404.59	2,207	245,335	ソフトウェア	
EMPIRE CO LTD	294.33	206.08	693	77,093	生活必需品流通・小売り	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	期末		
			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	
KINROSS GOLD CORP	2,199.14	1,927.37	1,302	144,804	金属・鉱業
RB GLOBAL INC	132.86	266.41	2,478	275,509	商業サービス・用品
FORTIS INC	604.84	720.78	3,792	421,525	電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	742.03	854.21	1,000	111,171	金属・鉱業
TELUS CORP	318.9	318.9	746	82,935	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	342.08	435.51	1,809	201,112	保険
IMPERIAL OIL LTD	272.46	274.34	2,191	243,555	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	2,517.28	3,261.9	14,724	1,636,449	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	124.78	124.78	447	49,703	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,338.61	2,713.63	8,322	924,985	保険
LOBLAW CO LTD	216	248.03	3,371	374,732	生活必需品流通・小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,012.1	1,162.51	9,798	1,089,038	生活必需品流通・小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	358.44	422.79	3,100	344,569	自動車用部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	758.84	903.24	6,433	715,050	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	27.99	31.33	4,242	471,565	保険
METRO INC	286.29	350.59	2,454	272,829	生活必需品流通・小売り
EMERA INC	369.98	446.43	2,090	232,303	電力
ONEX CORP	101.57	101.57	1,045	116,248	資本市場
PAN AMERICAN SILVER CORP	193.23	553.73	929	103,266	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	655	898.64	3,413	379,324	保険
QUEBECOR INC-B	171.95	305.98	963	107,052	各種電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,719.47	2,135.23	27,982	3,109,940	銀行
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	1,163.63	1,440.17	16,527	1,836,854	陸上運輸
SHAW COMM INC-B	598.77	-	-	-	メディア
STANTEC INC	-	183.58	2,048	227,677	建設・土木
SUNCOR ENERGY INC	1,718.98	1,984.39	8,473	941,727	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	687.62	1,196.6	1,315	146,156	金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	573.26	658.96	3,362	373,654	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	199.79	248.37	5,279	586,747	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	96.65	130.97	1,620	180,057	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) CS	2,251.61	2,795.45	22,215	2,469,024	銀行
TC ENERGY CORP	1,237.53	1,571.54	7,989	887,976	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	81.02	81.02	863	95,943	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	98.39	98.39	1,685	187,361	生活必需品流通・小売り
INTACT FINANCIAL CORP	215.66	267.58	5,979	664,544	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	585.39	738.65	4,324	480,657	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	25.3	30.41	11,310	1,257,070	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	231.63	294.2	4,236	470,842	金属・鉱業
TOURMALINE OIL CORP	392.98	490.85	2,650	294,532	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	245.71	399.97	1,275	141,759	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	156.65	241.29	1,094	121,668	石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	338.33	472.49	1,289	143,306	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	681.79	821.64	3,725	414,031	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	362.04	415.08	4,268	474,375	大規模小売り
MEG ENERGY CORP	-	471.81	1,165	129,519	石油・ガス・消耗燃料
CENOVUS ENERGY INC W/I	1,677.15	2,267.67	4,982	553,707	石油・ガス・消耗燃料
ARC RESOURCES LTD	749.61	963.01	2,058	228,827	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	341.52	341.52	813	90,450	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	512.43	512.43	1,154	128,311	商業サービス・用品
TMX GROUP LTD	70.4	468.84	1,622	180,341	資本市場
BRP INC	43.07	43.07	382	42,516	レジャー用品

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IVANHOE MINES LTD	640.27	988.2	1,401	155,736	金属・鉱業
NUTRIEN LTD	661.77	773.39	5,116	568,675	化学
TFI INTERNATIONAL INC	93.99	115.91	2,275	252,942	陸上運輸
WSP GLOBAL INC	156.81	203.94	4,147	460,956	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	120.11	164.48	1,515	168,471	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	275.77	356.67	1,735	192,929	商業サービス・用品
NUVEI CORP	79.29	-	-	-	金融サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	161.03	161.03	549	61,046	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	425.01	522.49	2,844	316,130	資本市場
AIR CANADA	188.14	418.58	794	88,296	旅客航空輸送
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	353.84	451.13	4,676	519,786	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC	1,468.23	1,842.48	20,132	2,237,557	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	52.37	52.37	1,172	130,359	不動産管理・開発
HYDRO ONE LTD	462.25	462.25	1,856	206,319	電力
小 計	株 数 : 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	50,869.66 86銘柄	62,314.92 86銘柄	386,892 42,999,195	- <3.2%>
(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	217.54	283.06	1,456	142,126	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WESTPAC BANKING CORPORATION	4,377.12	5,201.9	12,546	1,224,710	銀行
FORTESCUE LTD	2,101.04	2,530.9	7,008	684,056	金属・鉱業
TELSTRA GROUP LTD	4,828.55	5,998.53	2,393	233,621	各種電気通信サービス
ASX LTD	236.64	312.15	2,084	203,471	資本市場
BHP GROUP LTD	6,313	7,757.07	35,643	3,479,185	金属・鉱業
AMPOL LTD	318.28	318.28	1,167	113,985	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	720.81	916.24	2,408	235,122	専門サービス
CSL LIMITED	601.03	736.93	20,648	2,015,455	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	61.34	93.17	1,693	165,334	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	3,796.33	4,762.58	6,077	593,181	運送インフラ
COCHLEAR LTD	78.36	104.46	3,437	335,530	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	2,132.29	2,576.92	2,208	215,563	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,112.29	2,556.04	29,156	2,845,990	銀行
RIO TINTO LIMITED	459.36	569.91	7,309	713,496	金属・鉱業
APA GROUP	1,643	2,228.29	1,793	175,090	ガス
ARISTOCRAT LEISU	766.75	868.29	3,794	370,374	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,816.64	3,600.82	2,279	222,484	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	607.67	693.36	3,842	375,076	建設資材
IGO LTD	919.47	919.47	639	62,375	金属・鉱業
ORICA LTD	638.62	638.62	1,037	101,233	化学
LEND LEASE CORP LTD	1,071.81	-	-	-	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	503.25	765.87	1,659	161,997	金属・鉱業
MACQUARIE GROUP LTD	466.42	567.01	10,541	1,028,989	資本市場
SUNCORP GROUP LTD	1,541.62	1,996.28	2,882	281,373	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,928.66	4,650.95	15,120	1,475,886	銀行
NEWCREST MINING LTD	1,128.15	-	-	-	金属・鉱業
QANTAS AIRWAYS LIMITED	1,126.59	1,126.59	643	62,790	旅客航空輸送
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,724.87	2,198.07	3,618	353,155	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,355.78	1,626.29	2,093	204,301	金属・鉱業
REECE LTD	315.58	315.58	728	71,125	商社・流通業
SANTOS LTD	4,173.58	4,788.09	3,538	345,383	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	527.74	648.97	2,086	203,657	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	259.85	394.2	1,323	129,170	金融サービス

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
WESFARMERS LTD	1,397.2	1,728.24	10,186	994,279	大規模小売り
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	2,354.31	2,821.53	8,797	858,726	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,543.2	1,838.4	6,522	636,675	生活必需品流通・小売り
SEEK LTD	384.05	585.13	1,420	138,674	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MINERAL RESOURCES LTD	211.79	288.65	1,640	160,147	金属・鉱業
BRAMBLES LTD	1,709.29	2,207.67	3,311	323,236	商業サービス・用品
PILBARA MINERALS LTD	3,279.47	4,044.96	1,415	138,189	金属・鉱業
CAR GROUP LTD	-	583.1	1,945	189,929	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AURIZON HOLDINGS LTD	2,228.49	2,228.49	878	85,704	陸上運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	792.33	1,349.1	1,493	145,776	飲料
XERO LTD	188.6	231.49	2,582	252,123	ソフトウェア
IDP EDUCATION LTD	237.81	449.23	984	96,117	各種消費者サービス
LOTTERY CORP LTD	2,912.7	2,912.7	1,433	139,879	ホテル・レストラン・レジャー
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	1,604.7	2,336.4	1,259	122,922	生活必需品流通・小売り
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	3,743.53	4,434.5	12,332	1,203,760	銀行
MEDIBANK PVT LTD	2,985.76	4,127.51	1,560	152,291	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	5,966.94	6,827.38	2,102	205,257	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	1,716.84	1,975.89	3,161	308,586	生活必需品流通・小売り
WISETECH GLOBAL LTD	148.23	273.25	2,049	200,012	ソフトウェア
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	87,275.27 52銘柄	103,988.51 51銘柄	257,940 -	25,177,588 <1.8%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,570	2,570	2,109	40,616	不動産管理・開発
CLP HOLDINGS LTD	1,972.96	2,417.96	15,583	299,987	電力
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	933.14	933.14	4,185	80,563	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,518.91	1,834.91	44,698	860,444	資本市場
MTR CORP	1,924.41	2,074.41	5,217	100,429	陸上運輸
HANG SENG BANK LTD	950.96	1,220.96	9,889	190,378	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,709.72	2,979.72	6,227	119,881	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,513.2	2,128.2	9,683	186,403	電力
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	-	2,020	5,181	99,740	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	15,364.06	15,364.06	8,742	168,286	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	2,609.04	3,369.04	14,941	287,627	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,199.95	6,804.95	12,997	250,200	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,730.66	1,730.66	1,623	31,249	不動産管理・開発
SINO LAND CO	4,112	6,592	5,247	101,009	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,805.65	2,045.65	14,605	281,164	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	530.2	530.2	3,234	62,258	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,801.56	2,151.56	18,202	350,392	機械
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,780	1,780	1,178	22,683	建設関連製品
AIA GROUP LTD	14,933.16	17,785.16	111,512	2,146,624	保険
HKT TRUST / HKT LTD	4,631.36	7,971.36	7,413	142,707	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	3,358	3,358	7,790	149,968	ホテル・レストラン・レジャー
SITC INTERNATIONAL CO LTD	1,400	1,400	1,867	35,951	海上運輸
SWIRE PROPERTIES LTD	2,016	2,016	3,003	57,823	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,961.35	2,561.35	6,262	120,553	不動産管理・開発
ESR GROUP LTD	2,164	4,652	4,377	84,267	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,465	-	-	-	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	2,650	2,650	3,418	65,806	飲料
WH GROUP LTD	9,315	10,010	4,594	88,445	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	3,104.45	3,694.45	15,202	292,651	コンプロマリット

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,661.95	2,661.95	9,396	180,886	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	97,686.69	117,307.69	358,389	6,899,003	
		29銘柄	29銘柄	-	<0.5%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE TECH ENG	1,442	1,718	657	73,465	航空宇宙・防衛	
SEMBCORP INDUSTRIES	-	1,622	901	100,689	総合公益事業	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	2,248.1	2,687.1	8,751	977,147	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	394	1,010	594	66,419	不動産管理・開発	
SEATRIM LTD	-	72,352.22	622	69,471	機械	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	155	155	414	46,327	コングロマリット	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	998	1,399	1,280	142,921	資本市場	
GENTING SINGAPORE LTD	7,611.93	7,611.93	776	86,686	ホテル・レストラン・レジャー	
KEPPEL LTD	1,849	2,496	1,789	199,812	コングロマリット	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,981.98	5,020.98	6,502	725,967	銀行	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	9,433.3	13,408.3	3,150	351,803	各種電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,627	2,440	1,742	194,512	旅客航空輸送	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,399.66	1,915.66	5,425	605,717	銀行	
UOL GROUP LIMITED	436	436	257	28,720	不動産管理・開発	
VENTURE CORP LTD	438	-	-	-	電子装置・機器・部品	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,585	2,585	814	90,913	食品	
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	3,065.9	4,052.9	1,146	128,059	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	37,664.87	120,910.09	34,828	3,888,636	
		15銘柄	16銘柄	-	<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	1,643.41	2,297.26	1,872	171,593	運送インフラ	
EBOS GROUP LTD	-	256.31	946	86,704	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
FISHER & PAYKEL	784.6	784.6	1,867	171,142	ヘルスケア機器・用品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,190.38	3,127.23	1,601	146,744	各種電気通信サービス	
MIGHTY RIVER POWER LTD	628.34	628.34	425	38,986	電力	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,321.57	2,393.08	1,354	124,138	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 >	6,568.3	9,486.82	8,066	739,309	
		5銘柄	6銘柄	-	<0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
ANTOFAGASTA PLC	459.63	612.95	1,027	194,393	金属・鉱業	
ASHTAD GROUP	543.04	668.51	3,456	653,808	商社・流通業	
SEVERN TRENT PLC	293.97	455.48	1,137	215,149	水道	
BARCLAYS PLC	20,224.17	22,290.23	3,165	598,763	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,241.96	1,241.96	588	111,268	家庭用耐久財	
BT GROUP PLC	9,041.98	9,041.98	947	179,257	各種電気通信サービス	
BUNZL PLC	385.93	539.79	1,720	325,533	商社・流通業	
CRH PLC	-	1,085.93	6,387	1,208,312	建設資材	
AVIVA PLC	3,486.83	4,292.05	1,826	345,474	保険	
CRODA INTERNATIONAL	167.82	205.73	1,000	189,335	化学	
DIAGEO PLC	2,829.74	3,468.58	9,949	1,882,169	飲料	
SCHRODERS PLC	1,103.66	1,103.66	439	83,198	資本市場	
DCC PLC	111.35	174.71	981	185,740	コングロマリット	
NATIONAL GRID PLC	4,605.69	5,474.62	5,485	1,037,705	総合公益事業	
KINGFISHER PLC	2,253.92	3,360.26	734	138,891	専門小売り	
BAE SYSTEMS PLC	3,796.23	4,573.88	5,625	1,064,246	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,628.77	3,256.71	7,812	1,477,956	タバコ	
HALMA PLC	510.66	622.08	1,362	257,716	電子装置・機器・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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
NEXT PLC	187.51	185.88	1,542	291,711	大規模小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	1,078.89	1,261.79	2,387	451,606	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	199.76	—	—	—	化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,574.26	1,931.17	3,374	638,286	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	2,209.35	2,590.74	5,663	1,071,337	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	24,887.38	29,731	18,454	3,490,949	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	7,381.79	8,563.99	2,014	381,035	保険
CENTRICA PLC	—	7,937.76	1,066	201,813	総合公益事業
UNILEVER PLC	3,166.86	3,824.37	15,243	2,883,695	パーソナルケア用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	905.69	1,151.34	1,177	222,808	水道
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	423.51	550.43	1,247	235,946	食品
PEARSON PLC	841.59	841.59	796	150,606	各種消費者サービス
PERSIMMON PLC	352.52	569.89	799	151,305	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	3,339.71	4,181.46	3,305	625,211	保険
RIO TINTO PLC	1,408.39	1,730.77	9,188	1,738,218	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	32,204.82	35,829.03	2,339	442,588	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	886.53	1,070.96	6,095	1,153,162	家庭用品
RELX PLC	2,404.03	2,891.43	9,645	1,824,697	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	3,121.14	3,748.45	1,527	288,955	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	11,219.24	13,032.32	4,068	769,674	航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	6,704.64	8,963.55	1,873	354,387	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	674.48	890.82	554	104,850	資本市場
SSE PLC	1,315.74	1,689.22	2,652	501,693	電力
BP PLC	23,470.86	25,715.29	12,253	2,317,963	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	1,288.93	1,521.96	1,776	335,990	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	516.95	516.95	826	156,368	コングロメリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	89.36	107.51	1,092	206,630	機械
STANDARD CHARTERED PLC	3,198.02	3,625.28	2,088	395,017	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	84,778.63	98,680.76	4,085	772,831	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	5,698.63	5,698.63	819	155,017	家庭用耐久財
TESCO PLC	9,342.47	10,307.35	2,857	540,496	生活必需品流通・小売り
3I GROUP PLC	1,247.51	1,494.86	3,569	675,285	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	1,076.79	1,259.3	1,382	261,448	ヘルスケア機器・用品
GSK PLC	4,995.5	6,260.67	10,442	1,975,464	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	414.94	633.56	5,614	1,062,115	資本市場
WPP PLC	1,427.85	1,760.61	1,347	254,919	メディア
ASTRAZENECA PLC	1,930.29	2,365.72	23,004	4,351,716	医薬品
WHITBREAD PLC	254.7	314.75	1,084	205,119	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC	233.09	233.09	1,020	193,086	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	522.29	522.29	677	128,096	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	217.52	268.74	2,053	388,398	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC	1,920.97	2,658.07	666	126,109	生活必需品流通・小売り
ADMIRAL GROUP PLC	213.25	400.84	1,021	193,206	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	164.89	164.89	763	144,482	家庭用耐久財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	184.55	184.55	362	68,600	医薬品
ABRDN PLC	2,858.31	2,858.31	460	87,107	資本市場
EXPERIAN PLC	1,127.09	1,401.33	4,707	890,435	専門サービス
MONDI PLC	588.87	675.54	913	172,838	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	369.42	369.42	306	58,058	資本市場
OCADO GROUP PLC	697.66	697.66	371	70,316	生活必需品流通・小売り
INFORMA PLC	1,861.95	2,239.61	1,788	338,340	メディア

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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
GLENORE PLC	12,257.76	15,701.88	6,145	1,162,585	金属・鉱業
ENTAIN PLC	744.51	969.24	904	171,139	ホテル・レストラン・レジャー
COCA-COLA HBC AG	213.38	310.35	739	139,844	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	862.23	1,358.28	672	127,290	保険
M&G PLC	2,704.01	2,704.01	594	112,380	金融サービス
ENDEAVOUR MINING PLC	-	280.75	356	67,395	金属・鉱業
WISE PLC	-	962.07	800	151,492	金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	2,521.8	3,820.71	413	78,203	専門小売り
HALEON PLC	6,227.66	8,367.29	2,645	500,494	パーソナルケア用品
SHELL PLC	9,059.72	10,110.99	25,252	4,776,958	石油・ガス・消耗燃料
AUTO TRADER GROUP PLC	1,108.33	1,431.88	1,020	193,075	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	-	271.04	4,500	851,382	ホテル・レストラン・レジャー
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,872.07	2,161.24	1,301	246,286	航空宇宙・防衛
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	351,435.94 77銘柄	417,024.34 81銘柄	281,373 -	53,227,458 <3.9%>
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	1,467.03	1,874.04	5,942	245,076	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,803.43	2,390.83	6,574	271,149	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	2,877.73	-	-	-	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	36.62	33.3	2,519	103,891	航空宇宙・防衛
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	125.74	-	-	-	半導体・半導体製造装置
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,629.44	1,629.44	2,861	118,002	銀行
ICL GROUP LTD	1,030.67	1,030.67	1,769	72,982	化学
NICE LTD	76.4	90.53	7,264	299,578	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	174.4	294.44	3,954	163,079	銀行
AZRIELI GROUP	46.72	46.72	1,105	45,606	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	9,268.18 10銘柄	7,389.97 8銘柄	31,991 -	1,319,366 <0.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	4,515.99	-	-	-	資本市場
LOGITECH INTL-REG	237.34	237.34	1,816	308,694	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED	3,418.82	4,077.36	39,481	6,709,019	食品
CIE FINANC RICHEMONT	644.58	805.41	10,812	1,837,390	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	872.21	1,070.11	24,312	4,131,490	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	52.36	53.11	1,204	204,686	機械
SIKA INHABER	177.93	233.97	5,729	973,686	化学
SGS SA-REG	7.48	229.78	1,909	324,554	専門サービス
NOVARTIS AG-REG SHS	2,693.94	3,120.75	27,400	4,656,113	医薬品
BALOISE HOLDING AG -R	56.75	58.3	829	140,876	保険
BARRY CALLEBAUT AG	4.6	4.6	597	101,461	食品
CLARIANT AG-REG	210.72	229.09	250	42,627	化学
SWISSCOM AG-REG	34.31	44.57	2,242	381,112	各種電気通信サービス
ABB LTD	1,945.38	2,474.95	9,632	1,636,851	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	198.42	264.54	965	163,989	専門サービス
GEBERIT AG	43.77	51.05	2,577	437,910	建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG	90.27	115.36	5,336	906,840	ライフサイエンス・ツール/サービス
LINDT & SPRUENGLI PART	1.37	1.61	1,822	309,700	食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.13	0.16	1,798	305,602	食品
GIVAUDAN-REG	11.73	13.92	5,115	869,293	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	187.71	221.6	9,692	1,647,094	保険
ROCHE HOLDING AG-BEARER	36.12	48.1	1,153	196,003	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	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
HOLCIM LTD	666.07	775.19	5,158	876,518	建設資材
TEMENOS GROUP	70.82	109.3	967	164,336	ソフトウェア
BACHEM HOLDING AG	46.73	46.73	295	50,146	ライフサイエンス・ツール/サービス
SONOVA HOLDING AG	69.84	81	2,307	392,145	ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG	68.87	78.9	2,251	382,515	海上運輸
STRAUMANN HOLDING AG	145.31	164.75	2,293	389,703	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	31.3	43	899	152,935	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	92.59	92.59	374	63,564	繊維・アパレル・贅沢品
HELVETIA HOLDING AG	-	49.06	599	101,875	保険
SCHINDLER NAMEN	27.2	42.09	914	155,349	機械
SWISS LIFE HOLDING AG	39.78	45.03	2,804	476,563	保険
BANQUE CANTONALE VAUD	49.03	49.03	518	88,065	銀行
EMS-CHEMIE HOLDING	8.1	12.45	779	132,438	化学
SWISS PRIME SITE AG	83.72	133.56	1,139	193,709	不動産管理・開発
AVOLTA AG	-	129.33	454	77,271	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	28.52	34.33	4,165	707,919	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD	260.31	321.14	1,520	258,395	資本市場
SWISS RE LTD	381.39	455.02	4,663	792,545	保険
BKW AG	31.94	31.94	420	71,535	電力
SIG GROUP AG	383.22	509.69	915	155,554	容器・包装
ALCON INC	612.85	749.22	5,091	865,232	ヘルスケア機器・用品
SANDOZ GROUP AG	-	573.47	1,631	277,244	医薬品
UBS GROUP AG	4,189.21	5,033.06	12,205	2,074,024	資本市場
VAT GROUP AG	33.25	41.31	1,752	297,850	機械
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
	22,761.98 43銘柄	22,956.87 45銘柄	208,806 -	35,482,442 <2.6%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
CARLSBERG AS-B	125.49	151.67	14,105	305,662	飲料
A P MOLLER A/S	6.63	6.63	7,170	155,381	海上運輸
AP MOLLER MAERSK A	3.59	5.43	5,766	124,963	海上運輸
DANSKE BANK A/S	853.71	1,023.03	19,882	430,855	銀行
GENMAB A/S	79.26	97.83	18,367	398,025	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS	238.59	547.95	20,060	434,709	化学
ROCKWOOL AS	8.73	8.73	1,889	40,938	建設関連製品
NOVO NORDISK A/S-B	2,063.49	4,980.24	421,776	9,139,897	医薬品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,254.36	1,545.21	29,108	630,784	電気設備
COLOPLAST-B	153.43	212.91	18,706	405,364	ヘルスケア機器・用品
DSV A/S	238.42	281.9	32,052	694,567	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S	113.67	177	6,331	137,199	ヘルスケア機器・用品
TRYG A/S	448.87	582.22	8,366	181,302	保険
PANDORA A/S	124.73	124.73	13,770	298,400	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	125.38	-	-	-	化学
ORSTED A/S	232.4	269.11	10,831	234,722	電力
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
	6,070.75 16銘柄	10,014.59 15銘柄	628,185 -	13,612,774 <1.0%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
MOWI ASA	563.75	731.18	14,448	205,596	食品
NORSK HYDRO ASA	1,629.71	2,211.82	12,448	177,136	金属・鉱業
TELENOR ASA	859.54	1,195.76	13,727	195,339	各種電気通信サービス
KONGSBERG GRUPPEN ASA	111.85	111.85	7,275	103,535	航空宇宙・防衛
ORKLA ASA	1,160.68	1,160.68	8,802	125,260	食品

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	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
EQUINOR ASA	1,156.17	1,298.95	34,292	487,979	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	198.34	294.14	10,597	150,807	化学
AKER BP ASA	387.23	409.33	10,708	152,375	石油・ガス・消耗燃料
SALMAR ASA	72.48	128.97	7,611	108,316	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	257.21	257.21	4,406	62,697	保険
ADEVINTA ASA	243.82	547.15	6,188	88,059	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DNB BANK ASA	1,193.19	1,439.09	29,472	419,394	銀行
小計	株数・金額 柄数<比率>	7,833.97 12銘柄	9,786.13 12銘柄	159,978 -	2,276,499 <0.2%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	3,341.22	3,960.72	66,757	955,973	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	1,942.04	2,418.69	35,409	507,065	機械
ERICSSON LM-B SHS	3,665.51	4,180	23,094	330,713	通信機器
GETINGE AB-B SHS	257.55	389.25	7,720	110,561	ヘルスケア機器・用品
INVESTOR AB-A SHS	584.37	-	-	-	金融サービス
LUNDBERGS B	78.59	148.72	8,152	116,748	金融サービス
SKF AB-B SHS	465.94	465.94	9,905	141,852	機械
SANDVIK AB	1,333.5	1,692.18	36,720	525,834	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,958.37	2,502.03	37,230	533,136	銀行
SKANSKA AB-B SHS	439.37	439.37	8,207	117,530	建設・土木
SWEDBANK AB	1,122.96	1,325.81	28,359	406,101	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	702.11	927.95	12,652	181,185	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,844.99	2,188.46	26,611	381,079	銀行
VOLVO AB-A SHS	241.98	241.98	6,591	94,390	機械
VOLVO AB-B SHS	1,916.25	2,375.69	63,157	904,418	機械
HOLMEN AB-B SHS	101.42	173.2	6,872	98,415	紙製品・林産品
TELE2 AB-B SHS	644.16	676.54	5,639	80,759	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	152.92	152.92	5,096	72,986	金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	213.25	213.25	7,107	101,781	金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	269.07	-	-	-	家庭用耐久財
SAAB AB-B	-	117.89	9,145	130,969	航空宇宙・防衛
SECURITAS AB-B SHS	760.85	760.85	8,091	115,872	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	2,263.92	2,715.48	68,104	975,252	金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	822.87	1,046.69	14,768	211,489	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	1,246.12	1,533.68	43,525	623,290	建設関連製品
TELIA CO AB	3,448.1	3,448.1	8,406	120,380	各種電気通信サービス
BOLIDEN AB	362.6	362.6	9,694	138,819	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	353.13	444.07	16,879	241,708	機械
KINNEVIK AB-B	362.78	-	-	-	金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER	729.42	729.42	4,655	66,661	不動産管理・開発
INDUTRADE AB	391.78	391.78	10,707	153,329	機械
HUSQVARNA AB-B SHS	477.69	477.69	3,664	52,480	機械
NIBE INDUSTRIER AB	1,858.45	2,128.32	13,978	200,176	建設関連製品
SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB	183.8	363.81	9,109	130,452	バイオテクノロジー
HEXAGON AB-B SHS	2,481.63	3,071.16	35,333	505,978	電子装置・機器・部品
SAGAX AB	280.22	280.22	7,033	100,720	不動産管理・開発
EPIROC AB-A	845.63	1,031.15	19,272	275,977	機械
EPIROC AB-B	412.05	614.87	10,108	144,753	機械
ESSITY AB-B	751.8	869	20,682	296,169	家庭用品
EQT AB	407.16	551.94	15,128	216,642	資本市場
EMBRACER GROUP AB	797.91	-	-	-	娯楽

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	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
VOLVO CAR AB	637.1	637.1	2,362	33,829	自動車
BEIJER REF AB	—	504.93	7,366	105,494	商社・流通業
LIFCO AB	268.35	396.31	10,625	152,151	コングロマリット
EVOLUTION AB	223.26	282.66	37,062	530,733	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP	4,203.56	—	—	—	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	155.39	276.38	7,185	102,901	コングロマリット
小 計	株 数 : 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	46,001.14 45銘柄	47,508.8 42銘柄	788,182 —	11,286,768 <0.8%>
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	907.48	—	—	—	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	199.53	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	207.61	250.25	2,051	331,366	食品
KINGSPAN GROUP PLC	174.51	218.6	1,772	286,350	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	324.22	398.69	1,483	239,554	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,345.37	1,641.56	1,356	219,115	銀行
AIB GROUP PLC	1,475.78	2,269.14	921	148,876	銀行
小 計	株 数 : 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,634.5 7銘柄	4,778.24 5銘柄	7,585 —	1,225,263 <0.1%>
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	733.77	907.75	13,639	2,203,108	航空宇宙・防衛
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	—	124.03	1,918	309,815	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE DSM NV	222.01	—	—	—	化学
ING GROEP NV-CVA	4,707.18	5,408.15	6,644	1,073,212	銀行
ASM INTERNATIONAL NV	59.78	72.73	4,062	656,206	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	155.84	155.84	825	133,256	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,258.84	1,466.67	3,907	631,092	生活必需品流通・小売り
HEINEKEN NV	320.26	437.59	3,813	615,901	飲料
AKZO NOBEL	226.27	260.32	1,756	283,648	化学
ASML HOLDING NV	506.05	614.91	52,476	8,475,991	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,155.12	1,217.72	2,266	366,111	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	320.47	387.24	5,520	891,607	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	869.19	1,040.58	4,338	700,786	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	274.12	345.44	1,374	222,065	ライフサイエンス・ツール/サービス
KONINKLIJKE KPN NV	4,757.39	4,960.95	1,589	256,814	各種電気通信サービス
HEINEKEN HOLDING NV-A	108.53	176.9	1,275	206,010	飲料
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	577.75	839.4	817	132,109	飲料
OCI NV	123.29	123.29	334	54,105	化学
FERRARI NV	154.35	188.5	6,701	1,082,373	自動車
ASR NEDERLAND NV	—	273.65	1,176	190,015	保険
CNH INDUSTRIAL NV	1,246.04	—	—	—	機械
PROSUS NV	1,025.26	2,208.42	6,426	1,038,008	大規模小売り
JDE PEET'S BV	143.85	143.85	322	52,138	食品
EXOR NV	141.42	141.42	1,360	219,695	金融サービス
EURONEXT NV	100.81	140.77	1,115	180,192	資本市場
IMCD NV	68.23	93.32	1,300	210,042	商社・流通業
NN GROUP NV	362.89	434.78	1,628	263,065	保険
ARGENX SE	67.53	90.78	3,279	529,766	バイオテクノロジー
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	925.02	1,256.11	3,422	552,866	娯楽
STELLANTIS NV	2,806.95	3,419.19	7,718	1,246,744	自動車
FERROVIAL SE	—	738.17	2,610	421,594	建設・土木
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	226.7	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ABN AMRO BANK NV	528.35	759.82	1,088	175,805	銀行
ADYEN NV	25.93	33.78	4,889	789,831	金融サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	24,199.19 31銘柄	28,462.07 31銘柄	149,603 -	24,163,985 <1.8%>
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	242.9	335.45	693	111,939	化学
LOTUS BAKERIES NV	-	0.77	692	111,808	食品
D'IETERN TRDG	27.36	27.36	479	77,512	販売
KBC GROUPE	322.13	359.62	2,269	366,521	銀行
SOFINA	22.81	22.81	501	80,980	金融サービス
SOLVAY SA	90.7	-	-	-	化学
AGEAS	181.36	240.86	926	149,623	保険
UCB SA	167.32	200.2	1,883	304,155	医薬品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	113.18	129.18	901	145,638	金融サービス
ELIA GROUP	40.78	40.78	428	69,161	電力
SYENSQO SA	-	112.17	926	149,670	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,053.27	1,295.06	7,500	1,211,559	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,261.81 10銘柄	2,764.26 11銘柄	17,202 -	2,778,571 <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)	668.78	811.29	2,041	329,761	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	178.24	230.38	1,270	205,181	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	558.55	760.02	1,120	180,945	エネルギー設備・サービス
AROUNDTOWN SA	1,132.25	-	-	-	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,537.82 4銘柄	1,801.69 3銘柄	4,432 -	715,888 <0.1%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	653.17	798.31	13,560	2,190,226	化学
AXA SA	2,280.92	2,717.13	8,323	1,344,480	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	837.2	981.92	2,894	467,551	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	31.2	31.2	552	89,197	航空宇宙・防衛
DANONE	791.5	965.32	5,861	946,737	食品
SAFRAN SA	425.57	510.62	8,982	1,450,906	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	183.05	314.27	1,170	189,033	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	291.23	291.23	972	157,111	建設・土木
BNP PARIBAS	1,390.23	1,608.93	8,675	1,401,242	銀行
THALES SA	128.86	150.23	2,070	334,495	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	198.39	250.63	5,513	890,598	情報技術サービス
EIFFAGE	117.84	127.06	1,220	197,141	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	294.05	334.67	3,248	524,666	メディア
L'OREAL	301.22	366.99	15,828	2,556,583	パーソナルケア用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	344.54	422.43	33,904	5,476,211	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	1,148.08	1,148.08	716	115,713	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	869.08	983.59	3,296	532,371	自動車用部品
PERNOD-RICARD	248.88	309.48	4,789	773,552	飲料
RENAULT SA	279.02	279.02	1,051	169,858	自動車
REMY COINTREAU	28.66	28.66	279	45,115	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	614.6	695.01	4,722	762,793	建設関連製品
SEB SA	25.96	25.96	287	46,501	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	1,004.09	1,166.35	2,522	407,485	銀行
VINCI S.A.	667.67	763.13	8,794	1,420,456	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		
SODEXO	98.22	129.1	1,002	161,855	ホテル・レストラン・レジャー	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	678.65	831.64	16,250	2,624,739	電気設備	
VIVENDI SE	989.44	989.44	1,024	165,487	メディア	
TOTALENERGIES SE	3,100.9	3,493.95	21,110	3,409,759	石油・ガス・消耗燃料	
VALEO	265.7	—	—	—	自動車用部品	
ORANGE	2,554.81	2,869.57	3,050	492,785	各種電気通信サービス	
HERMES INTL	39.16	48.8	10,465	1,690,332	繊維・アパレル・贅沢品	
DASSAULT SYSTEMES SA	819	1,015.97	4,353	703,248	ソフトウェア	
KERING	93.82	114.43	4,761	769,066	繊維・アパレル・贅沢品	
CARREFOUR SA	755.72	906.42	1,356	219,168	生活必需品流通・小売り	
SANOFI	1,424.61	1,744.57	14,956	2,415,725	医薬品	
UBISOFT ENTERTAINMENT	110.32	—	—	—	娯楽	
TELEPERFORMANCE	78.45	95.81	1,291	208,528	専門サービス	
EURAZEO	56.73	56.73	436	70,509	金融サービス	
ESSILORLUXOTTICA	356.82	452.65	8,632	1,394,392	ヘルスケア機器・用品	
CREDIT AGRICOLE SA	1,437.2	1,669.21	2,036	328,979	銀行	
WENDEL	54.49	—	—	—	金融サービス	
BIOMERIEUX	48.7	48.7	493	79,722	ヘルスケア機器・用品	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	31.09	38.55	928	149,998	ライフサイエンス・ツール/サービス	
ENGIE	2,217.51	2,770.54	3,982	643,322	総合公益事業	
ALSTOM	370.07	474.94	540	87,298	機械	
IPSEN SA	38.73	59.64	616	99,509	医薬品	
ARKEMA SA	63.92	104.89	1,016	164,166	化学	
LEGRAND SA	327.83	411.05	3,739	604,041	電気設備	
ADP	39.75	61.04	725	117,225	運送インフラ	
BUREAU VERITAS SA	397.29	397.29	986	159,398	専門サービス	
GETLINK	635.09	639.68	978	158,081	運送インフラ	
EDENRED	310.91	356.18	1,972	318,602	金融サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	172.93	172.93	668	107,927	ホテル・レストラン・レジャー	
WORLDLINE SA	299.16	362.32	434	70,226	金融サービス	
AMUNDI SA	104.36	112.88	676	109,303	資本市場	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	31,126.39 55銘柄	35,699.14 52銘柄	247,730 -	40,013,435 <2.9%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ADIDAS AG	219.74	245.5	4,292	693,375	繊維・アパレル・贅沢品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	415.77	497.83	5,036	813,422	自動車	
COMMERZBANK AG	1,410.36	1,587.92	1,664	268,791	銀行	
FRESENIUS SE & CO KGAA	489.48	588.14	1,533	247,750	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
UNITED INTERNET	100.1	—	—	—	各種電気通信サービス	
HANNOVER RUECK SE	71.05	96.38	2,229	360,071	保険	
GEA GROUP AG	174.9	255.13	955	154,408	機械	
CONTINENTAL AG	129.21	176.35	1,342	216,877	自動車用部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	1,247.72	1,517.35	6,395	1,033,022	航空貨物・物流サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	168.54	233.11	1,071	173,123	自動車	
MERCK KGAA	162.3	202.16	3,113	502,854	医薬品	
RWE AG	778.53	987.51	3,144	507,856	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
SAP SE	1,300.68	1,594.38	26,288	4,246,059	ソフトウェア	
E.ON SE	2,802.87	3,393.66	3,994	645,165	総合公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	133.76	178.86	1,126	181,945	家庭用品	
SIEMENS AG-REG	953.29	1,161.5	19,169	3,096,240	コングロマリット	
PUMA AG	162.1	172.1	717	115,832	繊維・アパレル・贅沢品	

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		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BAYER AG	1,213.29	1,473.29	4,135	667,970	医薬品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	196.44	241.91	1,698	274,294	家庭用品	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	995.29	1,237.37	8,108	1,309,682	自動車	
BASF SE	1,164.08	1,354.42	6,172	996,916	化学	
BEIERSDORF AG	129.4	157.43	2,160	349,000	パーソナルケア用品	
HEIDELBERG MATERIALS AG	208.09	215.86	1,777	287,153	建設資材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	238.55	336.32	1,324	213,975	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
ALLIANZ SE	509.4	614.13	15,021	2,426,292	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	723.42	1,086.47	803	129,842	旅客航空輸送	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	176.12	209.96	8,606	1,390,083	保険	
RHEINMETALL STAMM	55.96	66.62	2,427	392,111	航空宇宙・防衛	
VOLKSWAGEN AG	33.15	54.6	726	117,292	自動車	
VOLKSWAGEN AG PFD	222.69	304.25	3,583	578,799	自動車	
NEMETSCHKE SE	98.78	102.22	889	143,641	ソフトウェア	
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,537.16	2,826.37	3,371	544,622	資本市場	
BMW VORZUG	78.21	78.21	746	120,577	自動車	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	4,033.92	4,822.93	10,658	1,721,589	各種電気通信サービス	
SARTORIUS AG	28.47	36.51	1,202	194,250	ライフサイエンス・ツール/サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,590.23	1,979.36	6,530	1,054,870	半導体・半導体製造装置	
RATIONAL AG	5.16	5.42	405	65,526	機械	
CARL ZEISS MEDITEC AG	48.66	48.66	538	87,044	ヘルスケア機器・用品	
BECHTLE AG	81.39	145.21	720	116,403	情報技術サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	238.84	287.51	5,377	868,634	資本市場	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	72.94	86.92	1,914	309,286	航空宇宙・防衛	
WACKER-CHEMIE GMBH	-	29.91	289	46,706	化学	
SYMRISE AG	172.65	195.47	1,902	307,324	化学	
BRENNTAG SE	179.34	215.59	1,709	276,139	商社・流通業	
EVONIK INDUSTRIES AG	246.87	428.36	732	118,312	化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,054.74	-	-	-	各種電気通信サービス	
TALANX AG	-	103.49	697	112,580	保険	
LEG IMMOBILIEN SE	82.09	119.15	827	133,715	不動産管理・開発	
VONOVIA SE	859.37	1,074.78	2,769	447,363	不動産管理・開発	
KNORR-BREMSE AG	103.42	103.42	583	94,279	機械	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	343.18	449.62	2,415	390,128	ヘルスケア機器・用品	
DR ING HC F PORSCHE AG	151.74	183.71	1,464	236,551	自動車	
SIEMENS ENERGY AG	590.14	748.92	1,054	170,319	電気設備	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	566.93	834.68	2,886	466,198	機械	
ZALANDO SE	313.21	313.21	612	98,928	専門小売り	
SCOUT24 SE	100.48	100.48	653	105,491	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
COVESTRO AG	275.58	275.58	1,343	216,994	化学	
HELLOFRESH SE	178.56	178.56	220	35,690	生活必需品流通・小売り	
DELIVERY HERO SE	225.64	225.64	503	81,273	ホテル・レストラン・レジャー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,843.98 57銘柄	36,240.4 57銘柄	191,645 -	30,954,661 <2.3%>	
(ユーロ…スイス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DSM-FIRMENICH AG	-	288.46	2,685	433,772	化学	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄	288.46 1銘柄	2,685 -	433,772 <0.0%>	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	346.44	456.06	982	158,669	生活必需品流通・小売り	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	3,179.56	5,054.41	1,897	306,553	電力	

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…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	594.06	795.85	1,124	181,635	石油・ガス・消耗燃料	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,120.06	6,306.32	4,004	646,858	
		3銘柄	3銘柄	-	<0.0%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	7,795.92	9,390.14	10,127	1,635,756	電力	
REPSOL SA	1,787.13	1,950.49	2,707	437,279	石油・ガス・消耗燃料	
TELEFONICA S.A	6,649.75	7,557.2	2,701	436,378	各種電気通信サービス	
ENDESA S.A.	377.01	509.46	861	139,107	電力	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	235.71	348.36	1,271	205,431	建設・土木	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	7,351.18	9,146.52	8,401	1,357,089	銀行	
ACCIONA S.A.	26.42	50.05	551	89,005	電力	
NATURGY ENERGY GROUP SA	176.77	176.77	411	66,411	ガス	
BANCO SANTANDER SA	20,668.57	24,843.77	9,115	1,472,283	銀行	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	490.11	655.89	949	153,294	電力	
INDITEX	1,363.21	1,621.41	6,357	1,026,871	専門小売り	
ENAGAS	382.7	382.7	548	88,609	ガス	
GRIFOLS SA	319.82	319.82	339	54,834	バイオテクノロジー	
FERROVIAL SA	635.13	-	-	-	建設・土木	
CAIXABANK	5,660.59	6,300.95	2,514	406,175	銀行	
EDP RENOVAVEIS SA	396.88	396.88	553	89,393	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AMADEUS IT GROUP SA	547.12	688.48	4,269	689,682	ホテル・レストラン・レジャー	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	98.22	98.22	207	33,505	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AENA SME SA	99.89	116.03	1,925	311,009	運送インフラ	
CELLNEX TELECOM SAU	695.72	819.74	2,701	436,404	各種電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	55,757.85	65,372.88	56,516	9,128,526	
		20銘柄	19銘柄	-	<0.7%>	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ASSICURAZIONI GENERALI	1,446.13	1,446.13	2,970	479,771	保険	
INTESA SANPAOLO	20,509.73	23,301.03	6,559	1,059,448	銀行	
UNICREDIT SPA	2,411.49	2,446.66	7,282	1,176,266	銀行	
ENI SPA	3,151.96	3,532.07	5,122	827,339	石油・ガス・消耗燃料	
MEDIOBANCA SPA	867.92	867.92	996	161,004	銀行	
ENEL SPA	10,193.43	12,028.25	7,113	1,148,973	電力	
LEONARDO SPA	-	649.15	1,187	191,771	航空宇宙・防衛	
SNAM SPA	2,564.15	3,175.18	1,380	222,989	ガス	
TELECOM ITALIA SPA	9,082.86	19,705.16	541	87,526	各種電気通信サービス	
TERNA SPA	1,660.64	2,076.55	1,530	247,260	電力	
RECORDATI SPA	109.08	181.97	918	148,369	医薬品	
AMPLIFON SPA	123	202.49	630	101,847	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PRYSMIAN SPA	307.28	383.43	1,572	253,919	電気設備	
DIASORIN ITALIA SPA	24.29	24.29	210	34,046	ヘルスケア機器・用品	
MONCLER SPA	250.14	297.63	1,776	286,996	繊維・アパレル・贅沢品	
NEXI SPA	835.76	835.76	614	99,327	金融サービス	
FINECOBANK SPA	751.8	963.93	1,245	201,234	銀行	
BANCO BPM SPA	-	2,027.27	1,035	167,193	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	588.89	887.62	883	142,651	保険	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	418.79	418.79	448	72,513	各種電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	55,297.34	75,451.28	44,022	7,110,450	
		18銘柄	20銘柄	-	<0.5%>	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KESKO OYJ-B	352.52	352.52	606	97,992	生活必需品流通・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	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ	509.56	771.48	1,076	173,830	機械
UPM-KYMMENE OYJ	677.58	779.73	2,211	357,171	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	749.6	959.8	1,034	167,041	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	583.96	709.99	2,879	465,074	保険
FORTUM OYJ	541.94	736.99	803	129,752	電力
NOKIA OYJ	6,795.69	8,270.68	2,687	434,027	通信機器
ELISA OYJ	202.42	202.42	833	134,670	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	505.99	662.48	1,816	293,404	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	438.14	493	2,246	362,791	機械
ORION OYJ	135.59	135.59	537	86,769	医薬品
METSO CORPORATION	—	1,028.31	963	155,695	機械
NORDEA BANK ABP	—	4,924.03	5,288	854,183	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	11,492.99 11銘柄	20,027.02 13銘柄	22,984 —	3,712,404 <0.3%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	172.58	233.54	935	151,074	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	73.2	106.63	667	107,815	電力
VOEST-ALPINE AG	105.93	180.32	454	73,337	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	456.86	565.74	2,231	360,396	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	808.57 4銘柄	1,086.23 4銘柄	4,288 —	692,622 <0.1%>
(ユーロ…バミューダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AEGON LTD	2,324.33	2,324.33	1,252	202,279	保険
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	2,324.33 1銘柄	2,324.33 1銘柄	1,252 —	202,279 <0.0%>
合 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	1,372,550.07 1,212銘柄	1,726,233.38 1,199銘柄	— —	1,311,536,937 <96.4%>

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

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

(2) 外国新株予約権証券

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		
	証 券 数	証 券 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)	証 券	証 券	千カナダ・ドル	千円	
CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	—	2,968	0	0	
合 計	証 券 数 銘 柄 数<比 率>	— —銘柄	2,968 1銘柄	0 —	0 <0.0%>

(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			比率
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比	
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18.835	24.234	2,746	413,348		0.0
BOSTON PROPERTIES INC	18.531	24.473	1,547	232,835		0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58.993	80.213	1,472	221,628		0.0
PROLOGIS INC	115.173	139.674	18,227	2,743,050		0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	16.932	21.518	3,727	560,896		0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	13.271	16.851	1,581	237,969		0.0
EQUINIX INC	11.399	14.299	11,908	1,792,087		0.1
CROWN CASTLE INC	54.164	65.066	6,883	1,035,970		0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8.345	9.893	2,248	338,344		0.0
EQUITY RESIDENTIAL	46.054	54.104	3,173	477,534		0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68.971	90.133	1,519	228,690		0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	13.584	16.539	3,457	520,365		0.0
WELLTOWER INC	58.944	77.707	7,255	1,091,880		0.1
KIMCO REALTY	79.991	95.524	1,859	279,889		0.0
IRON MOUNTAIN INC	34.514	43.616	2,946	443,382		0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20.486	27.29	1,806	271,792		0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	91.777	110.415	2,144	322,689		0.0
MID AMERICA	13.578	17.537	2,193	330,130		0.0
REALTY INCOME CORP	76.685	129.955	6,678	1,005,030		0.1
REGENCY CENTERS CORP	19.311	21.907	1,318	198,433		0.0
UDR INC	41.516	50.449	1,759	264,735		0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	40.894	48.901	6,985	1,051,322		0.1
PUBLIC STORAGE	19.317	23.534	6,600	993,356		0.1
SUN COMMUNITIES INC	14.694	18.509	2,348	353,358		0.0
VENTAS INC	48.092	60.757	2,771	417,026		0.0
WEYERHAEUSER CO	89.893	114.764	3,790	570,455		0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	16.256	34.18	4,771	718,067		0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	36.258	45.607	6,486	976,181		0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	72.327	-	-	-		-
AMERICAN TOWER CORP	58.087	71.26	13,431	2,021,351		0.1
WP CAREY INC	23.664	32.996	1,842	277,227		0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42.371	-	-	-		-
AMERICAN HOMES 4 RENT	42.177	50.995	1,735	261,154		0.0
INVITATION HOMES INC	76.646	96.467	3,118	469,344		0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	30.095	41.252	1,860	280,043		0.0
VICI PROPERTIES INC	120.602	152.711	4,459	671,059		0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,612.427	1,923.33	146,658	22,070,635	-
		36銘柄<1.9%>	34銘柄<1.6%>	-	-	1.6
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		%
CANADIAN APT PPTYS REIT	8.722	8.722	429	47,770		0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14.424	14.424	265	29,560		0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	23.146	23.146	695	77,331	-
		2銘柄<0.0%>	2銘柄<0.0%>	-	-	0.0

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円		%	
MIRVAC GROUP	432.802	700.332	1,568	153,125		0.0	
GPT GROUP	219.223	349.447	1,551	151,446		0.0	
STOCKLAND	259.328	369.843	1,667	162,812		0.0	
DEXUS	163.989	163.989	1,280	125,014		0.0	
GOODMAN GROUP	214.602	255.895	6,806	664,412		0.0	
VICINITY CENTRES	545.645	545.645	1,113	108,651		0.0	
SCENTRE GROUP	647.197	825.454	2,542	248,163		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,482.786 7銘柄<0.1%>	3,210.605 7銘柄<0.1%>	16,531 -	1,613,625 -	- 0.1	
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円		%	
LINK REIT	262.516	410.116	15,317	294,868		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	262.516 1銘柄<0.0%>	410.116 1銘柄<0.0%>	15,317 -	294,868 -	- 0.0	
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円		%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	787.231	787.231	1,503	167,878		0.0	
CAPLAND ASCENDAS REIT	440.678	611.078	1,662	185,577		0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474.1	474.1	715	79,929		0.0	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405.5	405.5	551	61,572		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,107.509 4銘柄<0.0%>	2,277.909 4銘柄<0.0%>	4,433 -	494,957 -	- 0.0	
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円		%	
BRITISH LAND CO PLC	119.111	-	-	-		-	
LAND SECURITIES GROUP PLC	77.092	121.345	770	145,763		0.0	
SEGRO PLC	165.081	165.081	1,345	254,448		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	361.284 3銘柄<0.0%>	286.426 2銘柄<0.0%>	2,115 -	400,211 -	- 0.0	
(ベルギー)	千□	千□	千ユーロ	千円		%	
WAREHOUSES DE PAUW	27.206	31.043	786	127,056		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	27.206 1銘柄<0.0%>	31.043 1銘柄<0.0%>	786 -	127,056 -	- 0.0	
(フランス)	千□	千□	千ユーロ	千円		%	
GECINA SA	5.045	8.697	832	134,433		0.0	
KLEPIERRE	25.279	36.407	826	133,427		0.0	
COVIVIO	5.066	5.066	209	33,777		0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	-	18.477	1,275	205,983		0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13.535	-	-	-		-	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	48.925 4銘柄<0.0%>	68.647 4銘柄<0.0%>	3,142 -	507,622 -	- 0.0	
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	6,925.799 58銘柄<2.2%>	8,231.222 55銘柄<1.9%>	- -	25,586,308 -	- 1.9	

(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) 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		18,388		百万円 -
	S & P / T S E 6 0 I X F U T		785		百万円 -
	S P I 2 0 0 F U T U R E S		475		百万円 -
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E		968		百万円 -
	D J E U R O S T O X X 5 0		3,381		百万円 -

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

■投資信託財産の構成

2024年2月15日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	1,311,536,937		96.3
投資信託受益証券、投資証券	25,586,308		1.9
コール・ローン等、その他	24,345,898		1.8
投資信託財産総額	1,361,469,144		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、1,360,702,498千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.49円、1カナダ・ドル=111.14円、1オーストラリア・ドル=97.61円、1香港・ドル=19.25円、1シンガポール・ドル=111.65円、1ニュージーランド・ドル=91.65円、1イギリス・ポンド=189.17円、1イスラエル・シケル=41.24円、1スイス・フラン=169.93円、1デンマーク・クローネ=21.67円、1ノルウェー・クローネ=14.23円、1スウェーデン・クローナ=14.32円、1ユーロ=161.52円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,361,991,056,310円
一 般 株 式 (評 価 額)	12,858,145,403
株 式 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	1,311,536,937,030
資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	2,108,582,829
未 取 入 当 配 入 証 拠	23,477,725,872
未 取 入 委 託 証 拠	979,953,906
未 取 入 委 託 証 拠	1,045,069,259
未 取 入 委 託 証 拠	9,984,642,011
(B) 負 債	1,032,534,417
未 取 入 委 託 証 拠	734,979,417
未 取 入 委 託 証 拠	297,555,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,360,958,521,893
元 本	162,729,949,242
次 期 繰 越 損 益	1,198,228,572,651
(D) 受 取 基 準 価 額 (C / D)	162,729,949,242円
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	83,633円

(注1) 期首元本額	137,221,085,885円	4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	138,504,634円
追加設定元本額	76,071,759,274円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	931,825,289円
一部解約元本額	50,562,895,917円	9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	126,111,412円
(注2) 期末における元本の内訳		投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	62,279,509円
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,150,221,102円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	31,482,383円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,531,018円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	19,331,816円
MITO ラップ型ファンド (中立的)	6,233,160円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	137,756,308円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	15,643,534円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	4,571,353円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,027,667円	Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	26,922,113円
グローバル8資産ラップファンド (中立的)	19,283,292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)	14,029,309円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	13,461,739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)	14,048,261円
たわらノーロード 先進国株式	57,361,664,964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)	8,775,720円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	57,934,709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)	8,434,278円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,884,066,158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)	236,047円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	916,899,062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)	35,948,901円
たわらノーロード バランス (堅実型)	80,325,474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)	12,462,424円
たわらノーロード バランス (標準型)	756,198,335円	三菱UFJ活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	23,066,359円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,019,417,623円	MSCIコクア・イデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	340,464,020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)	1,335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)	34,977,326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)	33,236,783円	DIAM外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家専用)	1,003,831,300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)	203,020,399円	DIAM先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	197,607,732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)	238,815,086円	外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	1,138,795,896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)	417,682,501円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	293,977,211円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,447円	AMOneマルチアセット・インカム戦略 (シグナルヘッジ付) (適格機関投資家限定)	897,249円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	123,405円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	5,291,360円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	13,286,479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)	23,104,484円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,251,865円	リスクコントロール世界8資産(5資産)ファンド (FOF 5用) (適格機関投資家専用)	4,021,219円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	10,682,039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)	19,013,111円
たわらノーロード 全世界株式	1,964,292,693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)	36,934,397円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	57,042,872,613円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,418,942円
One DC 先進国株式インデックスファンド	3,356,391,099円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	8,754,286円
Oneグローバルバランス	22,754,981円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	927,720円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> >1安定型	135,514,309円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	29,206円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	746,042,424円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	284,746円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,008,349,921円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	14,185,996円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	81,254,701円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	101,538,091円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	228,321,872円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	190,422,402円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	237,223,346円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	668,030,631円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	17,324,819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)	26,599,230円
マネックス資産設計ファンド (有成型)	656,949,333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)	24,316,972円
マネックス資産設計ファンド エコリユーション	119,023,013円	DIAM アジア グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	162,198,269円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	157,468,415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)	5,202,502円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	184,448,070円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	131,734円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	308,125,677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)	56,771,450円
投資のソムリエ	9,174,564,014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)	4,446,099円
フルスクリーンコントロール	104,334,373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)	21,030,916円
投資のソムリエ<DC年金>	900,536,286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)	36,765,356円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	173,236,376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)	71,611,164円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	285,154,879円	動的パッケージファンド<DC年金>	13,568,830円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,018,133,616円	コア資産形成ファンド	7,035,145円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,329,950,094円	たわらノーロード 先進国株式(為替ヘッジなし) <ラップ専用>	2,827,749,610円
ワールドアセットバランス (基本コース)	106,137,745円	MHAM外国株式インデックスファンド	131,843,275円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	234,745,869円	たわらノーロード 先進国株式(為替ヘッジあり) <ラップ専用>	1,040,748,063円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	57,887,085円	MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定)	1,579,711,581円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	29,635,686円	MHAM外国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	1,932,759,205円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	8,910,823円	期末元本合計	162,729,949,242円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	191,573,092円		

■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2024年2月15日

項	目	当 期
(A) 配	当 等 収 益	20,832,085,328円
受	取 配 当 金	20,332,078,276
受	取 利 息	132,172,297
そ	の 他 収 益	368,792,120
支	払 利 息	△957,365
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	301,808,509,319
売	買 益	366,644,884,225
売	買 損	△64,836,374,906
(C) 先	物 取 引 等 取 引 損 益	2,947,135,821
取	引 益	6,012,458,571
取	引 損	△3,065,322,750
(D) そ	の 他 費 用	△254,583,222
(E) 当	期 損 益 金(A + B + C + D)	325,333,147,246
(F) 前	期 繰 越 損 益 金	719,000,490,991
(G) 解	約 差 損 益 金	△300,527,369,812
(H) 追	加 信 託 差 損 益 金	454,422,304,226
(I) 合	計(E + F + G + H)	1,198,228,572,651
次	期 繰 越 損 益 金(I)	1,198,228,572,651

(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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第21期（決算日 2024年2月21日）

（計算期間 2023年2月22日～2024年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率			
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
19期（2022年2月21日）	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964
20期（2023年2月21日）	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-	186,822
21期（2024年2月21日）	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	-	260,393

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

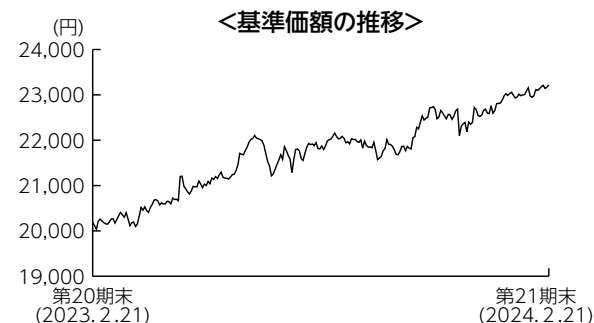
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023 年 2 月 21 日	円 20,182	% -	ポイント 126,494.96	% -	% 99.0	% -
2 月 末	20,261	0.4	126,903.56	0.3	98.9	-
3 月 末	20,517	1.7	128,532.24	1.6	98.7	-
4 月 末	20,668	2.4	129,370.99	2.3	98.6	-
5 月 末	21,198	5.0	132,828.99	5.0	98.8	-
6 月 末	22,045	9.2	138,284.08	9.3	98.7	-
7 月 末	21,569	6.9	135,227.94	6.9	98.7	-
8 月 末	22,157	9.8	138,880.03	9.8	98.9	-
9 月 末	21,834	8.2	136,810.50	8.2	98.6	-
10 月 末	21,807	8.1	136,724.14	8.1	98.7	-
11 月 末	22,569	11.8	141,488.31	11.9	98.5	-
12 月 末	22,596	12.0	141,801.08	12.1	98.5	-
2024 年 1 月 末	22,998	14.0	144,118.59	13.9	99.4	-
(期 末) 2024 年 2 月 21 日	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年2月22日から2024年2月21日まで）

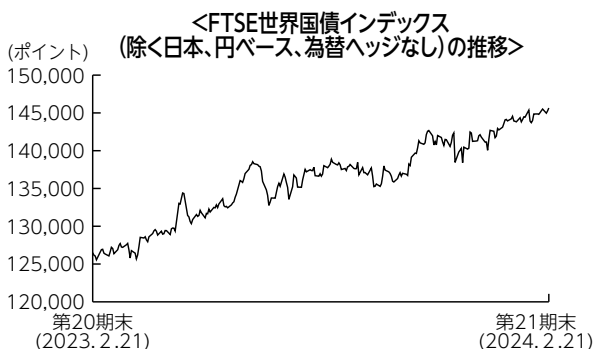


基準価額の推移

当期末の基準価額は23,220円となり、前期末比で15.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、F R Bが金融引き締めを継続する中、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

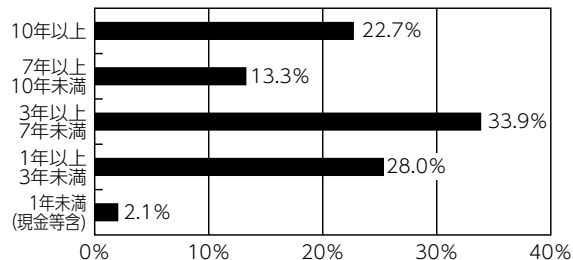
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

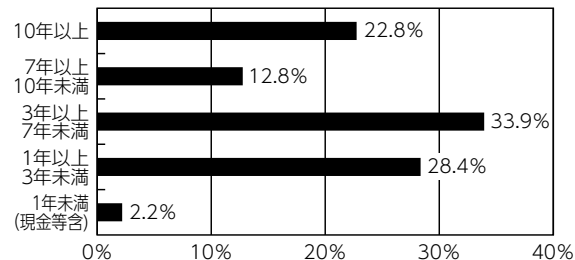
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

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

期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	46.7%	47.2%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	48.7%	49.2%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.9%	△0.0%
計	0.8%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.7%	1.8%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.0%	8.1%	△0.1%
ドイツ	6.3%	6.3%	△0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.3%	7.3%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	4.8%	4.9%	△0.1%
ユーロ計	31.8%	32.1%	△0.3%
デンマーク	0.3%	0.3%	△0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
英国	5.2%	5.2%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	38.1%	38.5%	△0.4%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.3%	1.4%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	8.3%	8.5%	△0.2%
シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	△0.0%
計	10.7%	11.0%	△0.3%
中近東			
イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など	1.3%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で15.1%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	3円	0.015%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	3	0.015	
期中の平均基準価額は21,728円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■売買及び取引の状況 (2023年2月22日から2024年2月21日まで)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等 (2023年2月22日から2024年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,460	2,371	356,089	2026/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	5,740	5,288	794,126	2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	4,000	600,691	2029/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	725	108,912	2025/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,819	573,587	2028/01/31
US T N/B 4.125 01/31/25	国債証券	4.1250	1,800	1,785	268,146	2025/01/31
US T N/B 3.5 01/31/30	国債証券	3.5000	3,400	3,261	489,813	2030/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	5,700	5,256	789,361	2026/01/31
US T N/B 3.5 01/31/28	国債証券	3.5000	2,380	2,310	346,875	2028/01/31
US T N/B 4.0 01/15/27	国債証券	4.0000	3,000	2,968	445,728	2027/01/15
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	4,300	4,243	637,175	2026/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	2,400	2,464	370,083	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,360	1,120	168,216	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,540	1,255	188,501	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,370	973	146,217	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	1,000	903	135,633	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,860	1,992	299,197	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	500	515	77,347	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,230	1,267	190,255	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,424	213,888	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	4,610	3,530	530,129	2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	5,000	3,219	483,415	2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	603	90,611	2038/02/15
US T N/B 3.625 02/15/53	国債証券	3.6250	3,800	3,277	492,149	2053/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	1,690	1,723	258,845	2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,636	395,854	2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	5,780	3,405	511,431	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	6,090	5,751	863,678	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,810	2,020	303,350	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	2,360	1,825	274,185	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,037	306,020	2048/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,981	297,545	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,830	4,477	672,407	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,540	4,283	643,206	2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,556	534,113	2027/02/15
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,189	328,837	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,917	287,912	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	9,690	7,896	1,185,695	2031/02/15
US T N/B 3.875 02/15/43	国債証券	3.8750	3,500	3,186	478,547	2043/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	5,100	3,485	523,327	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	4,420	2,712	407,376	2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	8,280	6,939	1,041,964	2032/02/15
US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	3.5000	7,900	7,436	1,116,617	2033/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,000	150,171	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	4,830	4,128	619,966	2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	5,210	4,844	727,417	2027/02/28
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,867	430,577	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	4,690	4,143	622,257	2028/02/29

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750	4,700	4,196	630,186	2029/02/28	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	5,170	4,766	715,767	2026/02/28	
US T N/B 1.5 02/15/25	国債証券	1.5000	4,550	4,397	660,307	2025/02/15	
US T N/B 4.0 02/28/30	国債証券	4.0000	3,000	2,955	443,775	2030/02/28	
US T N/B 4.0 02/29/28	国債証券	4.0000	3,200	3,163	474,993	2028/02/29	
US T N/B 4.0 02/15/26	国債証券	4.0000	4,000	3,956	594,070	2026/02/15	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	1,790	1,746	262,297	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	3,300	3,150	473,093	2026/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	3,200	2,856	428,894	2027/03/31	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	2,860	2,726	409,343	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	4,610	4,084	613,360	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	5,720	5,290	794,463	2026/03/31	
US T N/B 2.375 03/31/29	国債証券	2.3750	4,000	3,655	548,928	2029/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	4,000	3,786	568,508	2027/03/31	
US T N/B 3.625 03/31/30	国債証券	3.6250	3,300	3,183	478,087	2030/03/31	
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	4,000	3,868	580,908	2025/03/15	
US T N/B 3.625 03/31/28	国債証券	3.6250	3,800	3,703	556,131	2028/03/31	
US T N/B 4.625 03/15/26	国債証券	4.6250	3,630	3,634	545,751	2026/03/15	
US T N/B 3.875 03/31/25	国債証券	3.8750	1,050	1,038	155,949	2025/03/31	
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	2,000	1,954	293,521	2025/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	2,060	1,968	295,603	2026/04/30	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	5,100	4,508	677,014	2028/04/30	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,370	2,100	315,397	2027/04/30	
US T N/B 2.875 04/30/29	国債証券	2.8750	3,800	3,555	533,875	2029/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	6,000	5,533	830,889	2026/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/28	国債証券	3.5000	3,100	3,005	451,331	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,560	2,428	364,723	2025/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	6,000	5,713	857,953	2027/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/30	国債証券	3.5000	3,000	2,873	431,413	2030/04/30	
US T N/B 3.75 04/15/26	国債証券	3.7500	6,000	5,904	886,600	2026/04/15	
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	3,000	2,925	439,288	2025/04/15	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	759	839	126,116	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,210	1,197	179,777	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,630	1,601	240,549	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	1,080	869	130,615	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	950	933	140,155	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,290	1,790	268,860	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	5,560	3,696	555,136	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,430	1,201	180,401	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,290	1,011	151,893	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,620	1,251	187,879	2047/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/52	国債証券	2.8750	4,510	3,346	502,453	2052/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,730	1,226	184,132	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,830	2,224	334,027	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,300	2,015	302,659	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	4,600	3,435	515,839	2049/05/15	
US T N/B 3.625 05/15/53	国債証券	3.6250	3,510	3,029	454,981	2053/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	600	609	91,556	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	4,420	3,201	480,734	2041/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,950	3,823	574,086	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,860	4,594	689,924	2028/05/15	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	3,770	3,439	516,436	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,430	4,166	625,673	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	755	810	121,723	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	5,170	4,856	729,232	2026/05/15
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	8,380	4,185	628,531	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,250	2,135	320,676	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	8,740	7,316	1,098,697	2031/05/15
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	1,570	1,532	230,147	2025/05/31
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	3,760	3,143	472,092	2042/05/15
US T N/B 3.875 05/15/43	国債証券	3.8750	800	728	109,316	2043/05/15
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	8,050	7,264	1,090,860	2032/05/15
US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	3.3750	7,500	6,979	1,048,025	2033/05/15
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	2,980	2,632	395,230	2027/05/31
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,140	3,652	548,447	2028/05/31
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	7,050	5,653	848,990	2030/05/15
US T N/B 2.625 05/31/27	国債証券	2.6250	4,910	4,651	698,405	2027/05/31
US T N/B 2.75 05/31/29	国債証券	2.7500	3,300	3,065	460,240	2029/05/31
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	5,630	5,177	777,521	2026/05/31
US T N/B 3.625 05/31/28	国債証券	3.6250	2,500	2,435	365,721	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	1,690	1,595	239,555	2025/05/31
US T N/B 3.75 05/31/30	国債証券	3.7500	3,500	3,397	510,121	2030/05/31
US T N/B 3.625 05/15/26	国債証券	3.6250	3,500	3,434	515,746	2026/05/15
US T N/B 2.75 05/15/25	国債証券	2.7500	2,200	2,145	322,144	2025/05/15
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,040	1,012	152,073	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	2,880	2,715	407,729	2026/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	2,780	2,448	367,718	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,710	3,265	490,340	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,500	3,293	494,529	2025/06/30
US T N/B 3.25 06/30/27	国債証券	3.2500	4,200	4,057	609,214	2027/06/30
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	4,510	4,152	623,586	2026/06/30
US T N/B 3.25 06/30/29	国債証券	3.2500	3,500	3,329	500,000	2029/06/30
US T N/B 2.875 06/15/25	国債証券	2.8750	2,420	2,361	354,536	2025/06/15
US T N/B 4.0 06/30/28	国債証券	4.0000	2,000	1,977	296,906	2028/06/30
US T N/B 4.125 06/15/26	国債証券	4.1250	4,700	4,661	700,031	2026/06/15
US T N/B 3.75 06/30/30	国債証券	3.7500	5,700	5,531	830,535	2030/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	2,200	2,143	321,828	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,500	2,352	353,183	2026/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	9,270	8,049	1,208,687	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,780	3,304	496,221	2027/07/31
US T N/B 4.0 07/31/30	国債証券	4.0000	2,500	2,459	369,343	2030/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	3,800	3,563	535,067	2025/07/31
US T N/B 2.625 07/31/29	国債証券	2.6250	3,070	2,827	424,508	2029/07/31
US T N/B 4.125 07/31/28	国債証券	4.1250	2,500	2,484	373,061	2028/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	5,100	4,651	698,507	2026/07/31
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	3,820	3,625	544,426	2027/07/31
US T N/B 3.0 07/15/25	国債証券	3.0000	3,200	3,124	469,137	2025/07/15
US T N/B 4.5 07/15/26	国債証券	4.5000	4,100	4,102	615,956	2026/07/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	1,220	1,105	165,966	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,290	1,198	179,897	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,240	957	143,852	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,090	1,684	252,930	2044/08/15

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	1,480	1,492	224,181	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,470	1,287	193,397	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,810	3,522	528,927	2051/08/15
US T N/B 4.125 08/15/53	国債証券	4.1250	1,600	1,512	227,173	2053/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,355	203,495	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	3,550	3,411	512,338	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,640	246,263	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	4,140	2,705	406,314	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	5,540	4,220	633,695	2052/08/15
US T N/B 4.375 08/15/43	国債証券	4.3750	2,000	1,948	292,647	2043/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,270	1,526	229,150	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,810	2,922	438,881	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,955	593,938	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	7,030	6,545	982,844	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	5,030	4,742	712,199	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,777	266,844	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,360	2,938	441,214	2029/08/15
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,482	372,739	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	5,310	3,510	527,153	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	4,060	2,456	368,814	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	6,870	3,546	532,522	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	7,840	6,984	1,048,768	2032/08/15
US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	3.8750	8,000	7,742	1,162,613	2033/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,960	7,241	1,087,383	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	7,740	6,153	923,979	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	2,800	2,596	389,899	2026/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,354	503,781	2025/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,249	488,017	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,680	402,439	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	4,950	4,517	678,384	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,960	444,578	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,935	440,838	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,783	568,138	2027/08/31
US T N/B 4.375 08/15/26	国債証券	4.3750	4,000	3,991	599,431	2026/08/15
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,703	255,861	2025/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,810	3,312	497,388	2027/09/30
US T N/B 4.625 09/30/30	国債証券	4.6250	3,000	3,057	459,067	2030/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,444	216,919	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	4,980	4,354	653,898	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,465	520,399	2025/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	3,220	3,197	480,106	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	5,510	5,036	756,246	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,944	442,183	2025/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	4,550	4,459	669,563	2029/09/30
US T N/B 4.625 09/15/26	国債証券	4.6250	3,500	3,514	527,756	2026/09/15
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	2,270	2,208	331,602	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,410	2,240	336,454	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,134	620,794	2028/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,187	478,590	2027/10/31
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	4,490	4,118	618,411	2026/10/31
US T N/B 4.0 10/31/29	国債証券	4.0000	2,700	2,662	399,730	2029/10/31

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	3,340	3,315	497,919	2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	4,000	3,714	557,809	2025/10/31
US T N/B 4.625 10/15/26	国債証券	4.6250	3,400	3,415	512,877	2026/10/15
US T N/B 4.25 10/15/25	国債証券	4.2500	4,000	3,972	596,451	2025/10/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,350	1,406	211,165	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,200	2,334	350,598	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,960	1,543	231,777	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	1,300	1,261	189,496	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,556	1,197	179,882	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,020	843	126,592	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,460	1,300	195,336	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,250	1,652	248,089	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	5,280	2,917	438,077	2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	5,370	3,146	472,444	2051/11/15
US T N/B 4.0 11/15/52	国債証券	4.0000	4,860	4,492	674,588	2052/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	460	359	53,947	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	1,080	818	122,902	2046/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,000	992	149,086	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,450	2,834	425,581	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	3,690	2,478	372,127	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,120	4,916	738,276	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	5,480	5,213	782,857	2028/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	7,830	7,347	1,103,278	2026/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,038	456,239	2027/11/15
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	3,360	3,259	489,371	2025/11/30
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	3,120	2,895	434,789	2042/11/15
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	4,320	2,717	408,105	2040/11/15
US T N/B 4.75 11/15/43	国債証券	4.7500	500	512	76,927	2043/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	4,250	2,923	438,985	2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,680	252,318	2026/11/30
US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	4.1250	7,600	7,507	1,127,285	2032/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,850	2,497	375,063	2029/11/15
US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	4.5000	2,000	2,033	305,294	2033/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	8,590	6,959	1,044,999	2031/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	9,480	7,624	1,144,902	2030/11/15
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	3,900	3,403	511,082	2027/11/30
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	4,700	4,317	648,244	2026/11/30
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	5,000	4,406	661,701	2028/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	5,190	4,815	723,118	2025/11/30
US T N/B 3.875 11/30/29	国債証券	3.8750	2,800	2,742	411,825	2029/11/30
US T N/B 3.875 11/30/27	国債証券	3.8750	3,300	3,248	487,727	2027/11/30
US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	4.5000	3,570	3,559	534,542	2025/11/15
US T N/B 4.625 11/15/26	国債証券	4.6250	3,900	3,919	588,620	2026/11/15
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	3,000	2,894	434,704	2025/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	2,110	1,962	294,640	2026/12/31
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	3,890	3,566	535,578	2026/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,600	4,022	603,948	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	4,000	3,701	555,861	2025/12/31
US T N/B 3.875 12/31/29	国債証券	3.8750	2,800	2,741	411,628	2029/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	4,020	3,497	525,216	2027/12/31
US T N/B 4.375 12/15/26	国債証券	4.3750	4,800	4,796	720,289	2026/12/15

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

銘	柄	当期					未	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,660	1,529	150,519	2030/05/21		
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	960	762	75,080	2041/05/21		
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	2,130	1,706	167,951	2032/05/21		
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	1,800	1,734	170,694	2034/05/21		
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	820	716	70,462	2039/06/21		
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	2,010	1,689	166,222	2031/06/21		
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	650	563	55,483	2035/06/21		
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	2,520	1,420	139,792	2051/06/21		
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	2,615	2,408	237,000	2026/09/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	450	429	42,287	2028/11/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,430	1,380	135,820	2027/11/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,400	1,319	129,819	2029/11/21		
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	1,670	1,513	148,951	2033/11/21		
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	1,850	1,527	150,297	2032/11/21		
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	2,470	1,969	193,799	2031/11/21		
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,460	1,372	135,065	2025/11/21		
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,670	1,374	135,234	2030/12/21		
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	1,500	1,407	138,513	2034/12/21		
小計	—	—	40,065	35,489	3,492,489	—		
(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 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	800	810	90,501	2027/03/01		
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	460	441	49,339	2046/03/01		
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	840	672	75,082	2050/03/01		
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	660	636	71,104	2042/04/01		
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	340	334	37,399	2028/05/01		
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	780	769	85,999	2025/06/01		
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	590	576	64,404	2026/06/01		
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	640	635	70,970	2029/07/01		
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	190	174	19,487	2039/07/01		
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	840	760	84,946	2031/07/01		
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国債証券	3.0000	125	127	14,224	2072/08/01		
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	890	816	91,260	2036/08/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	620	613	68,510	2030/09/01		
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	580	594	66,424	2033/09/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国債証券	2.8750	200	198	22,223	2027/09/01		
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	510	409	45,725	2051/10/01		
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500	510	485	54,281	2026/11/01		
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	280	267	29,842	2025/11/01		
小計	—	—	9,855	9,323	1,041,728	—		
(ニュージーランド)			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円		
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	800	793	73,529	2027/04/15		
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	450	406	37,662	2033/04/14		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	810	635	58,902	2037/04/15		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	670	650	60,235	2025/04/15		
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	750	693	64,206	2029/04/20		
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	540	355	32,892	2051/05/15		
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	400	247	22,932	2041/05/15		
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	880	706	65,439	2031/05/15		
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	130	123	11,456	2034/05/15		
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	910	739	68,519	2032/05/15		
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	650	540	50,074	2028/05/15		

銘	柄	当期					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	
(ニュージーランド)			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26		国債証券	0.5000	580	526	48,766	2026/05/15
小計		-	-	7,570	6,419	594,617	-
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44		国債証券	3.2500	1,640	1,356	257,233	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45		国債証券	3.5000	1,550	1,324	251,087	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60		国債証券	4.0000	900	816	154,822	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49		国債証券	1.7500	1,130	658	124,799	2049/01/22
UK TREASURY 3.75 01/29/38		国債証券	3.7500	1,650	1,543	292,668	2038/01/29
UK TREASURY 0.875 01/31/46		国債証券	0.8750	1,350	664	125,901	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39		国債証券	1.1250	2,110	1,354	256,764	2039/01/31
UK TREASURY 4.625 01/31/34		国債証券	4.6250	400	416	78,930	2034/01/31
UK TREASURY 1.0 01/31/32		国債証券	1.0000	2,470	1,970	373,512	2032/01/31
UK TREASURY 3.25 01/31/33		国債証券	3.2500	2,500	2,351	445,707	2033/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29		国債証券	0.5000	1,880	1,590	301,513	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28		国債証券	0.1250	1,340	1,152	218,484	2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25		国債証券	0.2500	1,700	1,630	309,123	2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26		国債証券	0.1250	1,750	1,617	306,579	2026/01/30
UK TREASURY 4.125 01/29/27		国債証券	4.1250	2,340	2,334	442,643	2027/01/29
UK TREASURY 5.0 03/07/25		国債証券	5.0000	1,485	1,488	282,244	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36		国債証券	4.2500	1,300	1,302	246,995	2036/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32		国債証券	4.2500	1,770	1,804	342,006	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25		国債証券	0.6250	1,060	1,008	191,181	2025/06/07
UK TREASURY 4.5 06/07/28		国債証券	4.5000	1,750	1,779	337,300	2028/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47		国債証券	1.5000	1,200	671	127,395	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51		国債証券	1.2500	1,730	839	159,095	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52		国債証券	3.7500	970	841	159,613	2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53		国債証券	1.5000	1,210	612	116,163	2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57		国債証券	1.7500	1,260	664	125,977	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65		国債証券	2.5000	1,250	790	149,810	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68		国債証券	3.5000	1,480	1,209	229,224	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26		国債証券	1.5000	1,900	1,785	338,431	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27		国債証券	1.2500	1,100	1,002	190,046	2027/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33		国債証券	0.8750	2,100	1,577	299,050	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31		国債証券	0.2500	2,240	1,707	323,797	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35		国債証券	0.6250	1,650	1,119	212,208	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39		国債証券	4.2500	1,060	1,037	196,777	2039/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25		国債証券	2.0000	1,110	1,069	202,679	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34		国債証券	4.5000	1,200	1,235	234,298	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37		国債証券	1.7500	1,890	1,394	264,361	2037/09/07
UK TREASURY 3.75 10/22/53		国債証券	3.7500	1,800	1,553	294,531	2053/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/54		国債証券	1.6250	1,270	659	124,953	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61		国債証券	0.5000	1,880	553	105,010	2061/10/22
UK TREASURY 4.0 10/22/63		国債証券	4.0000	820	741	140,616	2063/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71		国債証券	1.6250	830	380	72,117	2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73		国債証券	1.1250	740	267	50,729	2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41		国債証券	1.2500	1,750	1,062	201,452	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50		国債証券	0.6250	1,640	653	123,948	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28		国債証券	1.6250	1,030	929	176,235	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29		国債証券	0.8750	1,430	1,211	229,594	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30		国債証券	0.3750	1,390	1,103	209,195	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26		国債証券	0.3750	2,430	2,199	417,048	2026/10/22

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

銘柄	柄	当期					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	
(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 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	4,050	4,004	58,106	2032/06/01	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	8,210	7,852	113,945	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,960	3,622	52,565	2029/11/12	
SWEDEN 1.75 11/11/33	国債証券	1.7500	2,700	2,548	36,979	2033/11/11	
小計	—	—	37,140	35,693	517,914	—	
(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	36,282	33,436	294,374	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	25,080	22,431	197,487	2027/03/04	
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	3,680	3,495	30,777	2025/03/06	
MEXICAN BONDS 03/01/29	国債証券	8.5000	9,500	9,173	80,763	2029/03/01	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	24,159	23,435	206,327	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,148	27,780	244,579	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	19,290	17,202	151,446	2033/05/26	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	28,146	26,588	234,081	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	13,290	11,397	100,340	2053/07/31	
MEXICAN BONDS 09/03/26	国債証券	7.0000	8,000	7,502	66,049	2026/09/03	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	24,707	21,151	186,219	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	19,561	17,001	149,680	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,631	128,813	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,803	51,092	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	10,035	9,020	79,413	2034/11/23	
小計	—	—	273,005	250,053	2,201,447	—	
(中国)			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	15,500	15,832	329,979	2032/02/17	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	国債証券	2.8800	11,200	11,589	241,546	2033/02/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	40,500	40,634	846,893	2025/02/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	19,100	21,625	450,709	2050/03/16	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	11,253	234,531	2029/03/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	3.0300	54,000	55,050	1,147,353	2026/03/11	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	国債証券	2.8000	10,000	10,231	213,231	2030/03/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	15,820	17,880	372,661	2052/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	7,600	9,140	190,494	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	国債証券	3.1900	8,500	9,524	198,515	2053/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	25,100	25,320	527,716	2027/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	18,500	19,263	401,475	2031/05/27	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	9,000	9,195	191,659	2032/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	国債証券	2.6700	14,500	14,741	307,229	2033/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国債証券	3.0100	54,000	55,641	1,159,653	2028/05/13	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	国債証券	3.2900	4,000	4,205	87,647	2029/05/23	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	64,600	65,640	1,368,063	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	国債証券	2.3000	39,500	39,609	825,527	2026/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,500	177,163	2025/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	23,500	23,977	499,730	2027/06/04	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	22,000	22,447	467,837	2029/06/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	18,450	18,952	395,004	2026/06/06	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	国債証券	2.6200	10,000	10,119	210,916	2030/06/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	国債証券	3.8600	5,800	7,059	147,125	2049/07/22	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	国債証券	2.4000	25,000	25,102	523,181	2028/07/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,567	428,669	2027/07/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	21,000	21,379	445,593	2032/08/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	20,000	20,016	417,187	2025/08/25	

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

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

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

銘柄	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…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	3,470	1,878	305,020	2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	3,660	1,938	314,732	2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	940	636	103,318	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	790	306	49,798	2072/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	4,650	4,611	748,628	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,090	4,707	764,175	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	5,780	5,338	866,601	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	3,430	3,317	538,591	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	3,590	3,218	522,455	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	3,560	3,051	495,395	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	4,960	4,712	765,097	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	3,560	3,374	547,800	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,950	1,298	210,748	2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	4,080	3,353	544,449	2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	900	708	115,058	2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国債証券	2.5000	1,200	1,073	174,267	2043/05/25
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	国債証券	3.0000	3,000	3,046	494,567	2033/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	2,790	2,232	362,342	2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	2,450	2,055	333,667	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,490	893	145,019	2044/06/25
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	国債証券	2.5000	4,120	4,090	664,120	2026/09/24
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,170	2,274	369,268	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	3,240	3,247	527,129	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	2,040	2,258	366,661	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,610	3,196	518,890	2032/10/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,740	2,649	430,136	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	4,020	3,757	609,921	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	4,600	4,216	684,425	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	3,670	2,983	484,326	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	4,280	3,582	581,580	2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国債証券	2.0000	3,850	3,622	588,020	2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	3,590	3,090	501,787	2029/11/25
小 計	-	-	141,120	128,977	20,938,250	-
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,310	1,460	237,126	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	840	1,017	165,110	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	2,620	3,139	509,635	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	2,030	2,365	383,970	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,650	1,606	260,751	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	3,860	3,693	599,524	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,430	1,292	209,847	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	2,120	1,970	319,897	2028/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,420	2,264	367,601	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	2,340	1,999	324,656	2031/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	3,050	3,045	494,359	2033/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	2,500	2,086	338,727	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,720	1,502	243,849	2030/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	700	698	113,433	2033/02/15
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,590	1,534	249,117	2025/04/11
BUNDESUBL 2.2 04/13/28	国債証券	2.2000	2,100	2,083	338,203	2028/04/13
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	3,510	3,315	538,291	2026/04/10

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

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

銘柄	当			期		末
	種類	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	1,060	927	150,556	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	2,120	2,014	327,063	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	2,170	2,183	354,505	2030/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,320	1,005	163,245	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	1,150	818	132,867	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	1,480	1,026	166,718	2037/03/01
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国債証券	3.2500	600	545	88,579	2038/03/01
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	国債証券	4.2000	400	412	66,994	2034/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,460	1,299	210,944	2028/03/15
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国債証券	4.0000	1,160	1,171	190,235	2035/04/30
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	1,110	694	112,713	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,550	1,375	223,276	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	2,110	1,766	286,838	2031/04/01
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国債証券	3.4000	1,150	1,158	188,072	2028/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	2,020	1,890	306,906	2026/04/01
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	1,300	1,221	198,368	2027/04/01
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	国債証券	3.8000	1,500	1,519	246,661	2026/04/15
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,260	2,621	425,553	2031/05/01
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,430	1,397	226,943	2025/05/15
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国債証券	4.4000	1,600	1,685	273,614	2033/05/01
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	2,850	2,753	447,077	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,560	1,524	247,437	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	1,590	1,544	250,738	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	1,580	1,282	208,224	2032/06/01
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国債証券	2.8000	1,200	1,169	189,781	2029/06/15
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	国債証券	3.7000	1,400	1,418	230,276	2030/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,790	1,747	283,749	2026/07/15
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,100	979	159,002	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	1,240	1,215	197,396	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	2,360	2,591	420,706	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,890	2,063	335,050	2039/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,700	1,639	266,236	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	2,210	2,173	352,882	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,920	1,554	252,364	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,350	1,156	187,819	2030/08/01
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国債証券	1.2000	1,360	1,318	214,039	2025/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	1,850	1,714	278,404	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	1,520	1,321	214,555	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	1,560	1,658	269,197	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	1,380	1,185	192,407	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	2,180	2,316	376,027	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,650	1,802	292,638	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	1,200	863	140,183	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	1,120	677	110,034	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,330	1,195	194,047	2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	960	632	102,624	2052/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	1,380	1,290	209,522	2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,360	1,128	183,161	2036/09/01
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	国債証券	4.4500	800	816	132,586	2043/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,680	1,556	252,712	2027/09/15
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	国債証券	3.8500	1,500	1,524	247,503	2026/09/15

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

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

■投資信託財産の構成

2024年2月21日現在

項目	当	期	末
	評価額	比	率
公社債	千円		%
コーポレートローン等、その他	256,938,107		98.3
投資信託財産総額	4,534,468		1.7
	261,472,575		100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、259,685,707千円、99.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.16円、1カナダ・ドル=111.02円、1オーストラリア・ドル=98.41円、1シンガポール・ドル=111.73円、1ニュージーランド・ドル=92.63円、1イギリス・ポンド=189.58円、1イスラエル・シケル=40.76円、1デンマーク・クローネ=21.78円、1ノルウェー・クローネ=14.33円、1スウェーデン・クローナ=14.51円、1メキシコ・ペソ=8.803円、1オフショア・人民元=20.841円、1マレーシア・リンギット=31.284円、1ポーランド・ズロチ=37.609円、1ユーロ=162.34円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日)現在

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

(注1) 期首元本額	92,568,430,085円
追加設定元本額	57,122,203,209円
一部解約元本額	37,549,958,225円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I AM外国債券パッシブ・ファンド	6,936,625,396円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,145,444円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	13,898,297円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	33,055,375円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,463,237円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,934,640円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,209,559円
たわらノーロード 先進国債券	20,317,116,345円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	129,335円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,175,860,175円
たわらノーロード バランス (堅実型)	70,372,889円
たわらノーロード バランス (標準型)	393,159,511円
たわらノーロード バランス (積極型)	90,074,981円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	17,547,319円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	1,061,778,662円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	1,874,531,468円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	939,477,666円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	721,685,160円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,181,174円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	12,367,147円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	192,544,517円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	20,620,422円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	38,634,144円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,881,458,772円
One DC 先進国債券インデックスファンド	1,443,766,551円
Oneグローバルバランス	60,758,637円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	734,747,927円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,430,100,443円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,916,905,681円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	415,782,480円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	854,188,656円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	822,838,550円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	23,358,394円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	887,363,869円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	15,215,627円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	159,329,380円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	160,868,965円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	260,318,009円
クルーズコントロール	1,073,014,665円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	854,009,676円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	699,203,724円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,400,751円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	488,705,414円
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	5,190,355円

Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	95,009,306円
D I AMパッシブ資産分散ファンド	989,890,513円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	237,386,300円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	238,317,641円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	95,585,889円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	143,381,639円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	544,565円
インカム重視マルチアセット運用ファンドI I 2021-04 (適格機関投資家限定)	621,159,184円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	543,853,224円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	211,165,647円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	866,888,247円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	634,044,700円
D I AM海替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	4,747,484,094円
D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	1,364,728,567円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,512,206,226円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,272,436,982円
AMO n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	222,937,463円
D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	43,680,338円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	393,718,174円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	322,665,524円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	208,816,275円
D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,704,671円
D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	20,619,600円
D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,524,169円
D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	51,265円
D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,512,264円
D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	33,413,721円
D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,252,683,690円
D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,244,567,605円
D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,359,122,210円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	50,385,127円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	100,205,864円
D I AMアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,142,198,851円
D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	202,876,714円
D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	155,039円
D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	199,846,920円
D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	259,826,276円
D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	336,700,092円
D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	33,520,121円
動的パッケージファンド<DC年金>	48,713,270円
コア資産形成ファンド	24,325,247円
たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	4,593,798,610円
たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	12,277,305,584円
MH AM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	5,666,776,191円
MH AM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	4,945,479,083円
期末元本合計	112,140,675,109円

■損益の状況

当期 自2023年2月22日 至2024年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2024年6月24日）

（計算期間 2023年6月23日～2024年6月24日）

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2008年1月16日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	期中 騰落率	騰落率	期中 騰落率	騰落率			
13期 (2020年6月22日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期 (2021年6月22日)	14,658	5.5	424.77	6.0	100.6	-	337,333
15期 (2022年6月22日)	14,333	△2.2	415.85	△2.1	97.9	-	573,974
16期 (2023年6月22日)	12,469	△13.0	361.76	△13.0	104.3	-	375,850
17期 (2024年6月24日)	11,893	△4.6	345.85	△4.4	104.0	-	101,286
	11,557	△2.8	337.19	△2.5	100.3	-	245,015

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）です（以下同じ）。

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

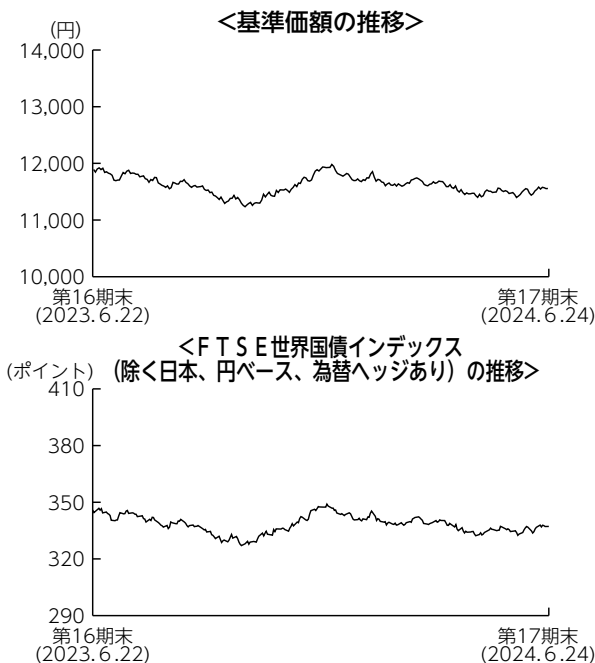
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債 イ ン デ ッ ク ス		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率		(除く日本、 円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2023 年 6 月 22 日	円	%	ポイント	%	%	%
	11,893	-	345.85	-	104.0	-
6 月 末	11,840	△0.4	344.37	△0.4	102.6	-
7 月 末	11,772	△1.0	342.72	△0.9	98.8	-
8 月 末	11,680	△1.8	339.97	△1.7	101.2	-
9 月 末	11,363	△4.5	330.75	△4.4	100.7	-
10 月 末	11,301	△5.0	329.05	△4.9	99.1	-
11 月 末	11,625	△2.3	338.66	△2.1	98.2	-
12 月 末	11,948	0.5	347.97	0.6	95.8	-
2024 年 1 月 末	11,741	△1.3	342.04	△1.1	103.0	-
2 月 末	11,611	△2.4	338.30	△2.2	102.7	-
3 月 末	11,681	△1.8	340.37	△1.6	98.7	-
4 月 末	11,454	△3.7	333.82	△3.5	103.1	-
5 月 末	11,422	△4.0	333.16	△3.7	99.5	-
(期 末) 2024 年 6 月 24 日	11,557	△2.8	337.19	△2.5	100.3	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2023年6月23日から2024年6月24日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は11,557円となり、前期末比で2.8%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは、上昇（価格は下落）しました。ドイツ債の利回りは低下（価格は上昇）しました。米国債は、パウエルF R B（米連邦準備理事会）議長の発言などから利回りが低下する局面もありましたが、インフレ圧力の根強さが意識され利回りは上昇しました。ドイツ債はE C B（欧州中央銀行）による利下げが開始されたことから利回りは低下しました。ドイツ債はプラス要因だったものの、米国債のマイナス要因の方が大きかったことから基準価額は下落しました。

投資環境

米国債の利回りは、上昇しました。ドイツ債の利回りは低下しました。米国債は、パウエルF R B議長の発言などから利回りが低下する局面もあり

ましたが、米労働市場の底堅さが意識されたことや、インフレ圧力の根強さが意識されたことから利回りは上昇しました。ドイツ債はE C Bによる利下げが開始されたことから利回りは低下しました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.5%下落しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) その他費用 (保管費用)	4円	0.033%	(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)	(3)	(0.029)	
合 計	(0)	(0.004)	
期中の平均基準価額は11,611円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)

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 2,830,677	千アメリカ・ドル 2,437,959 (-)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 165,614	千カナダ・ドル 142,389 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 126,070	千オーストラリア・ドル 112,537 (-)
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 33,517	千シンガポール・ドル 28,731 (-)
	ニュージーランド	国 債 証 券	千ニュージーランド・ドル 21,023	千ニュージーランド・ドル 17,298 (-)
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 237,338	千イギリス・ポンド 201,124 (-)
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シケル 67,207	千イスラエル・シケル 55,560 (-)
国	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 110,662	千デンマーク・クローネ 97,440 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 96,961	千ノルウェー・クローネ 82,423 (-)
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 112,293	千スウェーデン・クローナ 99,786 (-)

			買 付 額	売 付 額	
外	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 912,590	千メキシコ・ペソ 800,083 (-)	
	中 国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 3,374,158	千オフショア・人民元 2,578,003 (-)	
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 133,053	千マレーシア・リンギット 114,987 (-)	
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 123,374	千ポーランド・ズロチ 104,515 (-)	
国	ユ ー ロ	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	千ユーロ 30,459	千ユーロ 27,228 (-)
		オ ラ ン ダ	国 債 証 券	82,341	71,905 (-)
		ベ ル ギ ー	国 債 証 券	99,505	87,571 (-)
		フ ラ ン ス	国 債 証 券	445,358	389,308 (-)
		ド イ ツ	国 債 証 券	349,741	304,832 (-)
		ス ペ イ ン	国 債 証 券	270,430	237,003 (-)
		イ タ リ ア	国 債 証 券	407,659	356,709 (-)
		フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	27,907	23,579 (-)
		オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	66,159	58,221 (-)

(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（2023年6月23日から2024年6月24日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

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 803,782	千アメリカ・ドル 728,330	千円 116,445,459	% 47.5	% -	% 20.1	% 19.4	% 8.1	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 45,560	千カナダ・ドル 42,777	千円 4,993,362	2.0	-	1.1	0.5	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 33,370	千オーストラリア・ドル 29,895	千円 3,173,758	1.3	-	0.9	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 9,145	千シンガポール・ドル 8,660	千円 1,021,658	0.4	-	0.2	0.1	0.1	
ニュージーランド	千ニューージーランド・ドル 6,960	千ニューージーランド・ドル 6,082	千円 594,820	0.2	-	0.2	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 75,850	千イギリス・ポンド 63,681	千円 12,874,413	5.3	-	3.7	1.2	0.3	
イスラエル	千イスラエル・シケル 20,220	千イスラエル・シケル 17,545	千円 746,980	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 28,740	千デンマーク・クローネ 27,231	千円 624,139	0.3	-	0.2	0.0	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 28,360	千ノルウェー・クローネ 26,471	千円 400,247	0.2	-	0.1	0.0	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 27,380	千スウェーデン・クローナ 26,395	千円 401,481	0.2	-	0.1	0.1	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 248,798	千メキシコ・ペソ 219,876	千円 1,942,239	0.8	-	0.4	0.3	0.1	
中 国	千オフショア・人民元 1,063,000	千オフショア・人民元 1,106,167	千円 24,254,822	9.9	-	4.3	4.2	1.4	
マレーシア	千マレーシア・リングギット 34,000	千マレーシア・リングギット 34,790	千円 1,179,711	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 35,360	千ポーランド・ズロチ 33,043	千円 1,305,589	0.5	-	0.2	0.3	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	8,105	7,109	1,215,416	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
オランダ	23,080	20,985	3,587,708	1.5	-	0.9	0.5	0.1	
ベルギー	26,770	24,539	4,195,262	1.7	-	1.1	0.4	0.2	
フランス	120,310	109,039	18,641,364	7.6	-	4.3	2.6	0.7	
ドイツ	94,680	88,576	15,143,105	6.2	-	3.4	2.0	0.8	
スペイン	72,150	67,478	11,536,070	4.7	-	2.6	1.6	0.5	
イタリア	106,960	101,928	17,425,671	7.1	-	4.2	2.1	0.8	
フィンランド	8,720	7,644	1,306,951	0.5	-	0.3	0.2	0.1	
オーストラリア	18,510	16,380	2,800,360	1.1	-	0.7	0.4	0.1	
合 計	-	-	千円 245,810,597	100.3	-	49.7	36.6	14.0	

(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			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	外貨建金額	千円	邦貨換算金額	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	780	753	120,468		2026/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	4,900	4,538	725,635		2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	3,600	3,219	514,762		2029/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,070	3,580	572,448		2028/01/31
US T N/B 3.5 01/31/30	国債証券	3.5000	2,500	2,404	384,398		2030/01/31
US T N/B 4.0 01/31/31	国債証券	4.0000	2,000	1,970	314,976		2031/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	1,000	931	148,956		2026/01/31
US T N/B 3.5 01/31/28	国債証券	3.5000	2,900	2,814	450,005		2028/01/31
US T N/B 4.0 01/15/27	国債証券	4.0000	4,630	4,568	730,384		2027/01/15
US T N/B 4.0 01/31/29	国債証券	4.0000	4,600	4,543	726,384		2029/01/31
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	1,600	1,576	252,035		2026/01/15
US T N/B 4.25 01/31/26	国債証券	4.2500	3,700	3,665	586,102		2026/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	2,810	2,869	458,756		2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,000	836	133,812		2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,260	1,039	166,242		2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	2,000	1,440	230,289		2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	300	274	43,864		2039/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	430	443	70,856		2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,500	1,566	250,405		2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,000	882	141,106		2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	2,300	1,784	285,273		2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	3,070	2,007	320,938		2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	300	303	48,563		2038/02/15
US T N/B 3.625 02/15/53	国債証券	3.6250	2,850	2,485	397,312		2053/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	1,000	1,033	165,169		2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,100	2,302	368,100		2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	5,450	3,268	522,569		2051/02/15
US T N/B 4.25 02/15/54	国債証券	4.2500	4,900	4,781	764,438		2054/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	2,300	2,184	349,265		2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,110	1,536	245,604		2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,590	1,245	199,077		2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,200	1,712	273,797		2048/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	3,000	2,789	445,962		2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	3,900	3,685	589,164		2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,900	3,680	588,507		2027/02/15
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	1,000	962	153,928		2026/02/28
US T N/B 4.0 02/15/34	国債証券	4.0000	6,400	6,271	1,002,687		2034/02/15
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	5,500	4,524	723,428		2031/02/15
US T N/B 4.25 02/28/31	国債証券	4.2500	2,400	2,398	383,532		2031/02/28
US T N/B 3.875 02/15/43	国債証券	3.8750	2,200	2,023	323,590		2043/02/15
US T N/B 4.5 02/15/44	国債証券	4.5000	2,500	2,496	399,075		2044/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	4,400	3,073	491,344		2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,500	2,181	348,753		2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	6,480	5,481	876,349		2032/02/15
US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	3.5000	5,400	5,104	816,086		2033/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,006	160,953		2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	4,000	3,450	551,610		2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	4,000	3,735	597,151		2027/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	3,720	3,311	529,400		2028/02/29
US T N/B 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750	2,700	2,424	387,682		2029/02/28
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	3,900	3,630	580,518		2026/02/28

銘柄	当		期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.125 02/15/27	国債証券	4.1250	4,190	4,147	663,172	2027/02/15
US T N/B 4.0 02/28/30	国債証券	4.0000	2,200	2,169	346,920	2030/02/28
US T N/B 4.0 02/29/28	国債証券	4.0000	2,200	2,171	347,174	2028/02/29
US T N/B 4.0 02/15/26	国債証券	4.0000	2,400	2,368	378,675	2026/02/15
US T N/B 4.625 02/28/26	国債証券	4.6250	4,000	3,987	637,521	2026/02/28
US T N/B 4.25 02/28/29	国債証券	4.2500	3,700	3,694	590,747	2029/02/28
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	6,000	5,745	918,548	2026/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	3,000	2,700	431,807	2027/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	3,500	3,123	499,326	2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	6,530	6,089	973,545	2026/03/31
US T N/B 2.375 03/31/29	国債証券	2.3750	2,200	2,019	322,813	2029/03/31
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	3,900	3,700	591,709	2027/03/31
US T N/B 4.125 03/31/31	国債証券	4.1250	2,500	2,481	396,702	2031/03/31
US T N/B 3.625 03/31/30	国債証券	3.6250	1,800	1,741	278,352	2030/03/31
US T N/B 3.625 03/31/28	国債証券	3.6250	3,000	2,922	467,274	2028/03/31
US T N/B 4.625 03/15/26	国債証券	4.6250	8,532	8,506	1,359,939	2026/03/15
US T N/B 4.25 03/15/27	国債証券	4.2500	5,000	4,966	794,107	2027/03/15
US T N/B 4.5 03/31/26	国債証券	4.5000	5,000	4,975	795,512	2026/03/31
US T N/B 4.125 03/31/29	国債証券	4.1250	4,500	4,468	714,457	2029/03/31
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	6,800	6,515	1,041,743	2026/04/30
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	4,000	3,561	569,385	2028/04/30
US T N/B 4.625 04/30/31	国債証券	4.6250	4,000	4,088	653,609	2031/04/30
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	3,400	3,041	486,238	2027/04/30
US T N/B 2.875 04/30/29	国債証券	2.8750	3,150	2,955	472,568	2029/04/30
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	4,862	4,521	722,892	2026/04/30
US T N/B 3.5 04/30/28	国債証券	3.5000	2,800	2,714	434,050	2028/04/30
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	4,000	3,815	610,042	2027/04/30
US T N/B 3.5 04/30/30	国債証券	3.5000	2,200	2,113	337,831	2030/04/30
US T N/B 3.75 04/15/26	国債証券	3.7500	3,650	3,586	573,338	2026/04/15
US T N/B 4.875 04/30/26	国債証券	4.8750	4,500	4,509	720,949	2026/04/30
US T N/B 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	3,700	3,700	591,579	2027/04/15
US T N/B 4.625 04/30/29	国債証券	4.6250	4,000	4,059	648,962	2029/04/30
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	800	802	128,323	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	500	498	79,755	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	1,500	1,226	196,127	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	900	893	142,857	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	1,590	1,258	201,242	2043/05/15
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	3,580	2,418	386,718	2051/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	3,000	2,545	407,019	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	800	634	101,458	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	2,000	1,563	249,968	2047/05/15
US T N/B 2.875 05/15/52	国債証券	2.8750	4,300	3,232	516,875	2052/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,800	1,292	206,715	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,520	2,004	320,539	2048/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,000	1,884	301,320	2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	2,500	1,891	302,382	2049/05/15
US T N/B 3.625 05/15/53	国債証券	3.6250	2,880	2,511	401,557	2053/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	600	614	98,271	2038/05/15
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	2,600	1,919	306,837	2041/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	3,440	3,257	520,736	2028/05/15
US T N/B 4.625 05/15/54	国債証券	4.6250	2,300	2,388	381,887	2054/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	2,820	2,583	413,093	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	3,000	2,829	452,323	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	600	645	103,227	2037/05/15

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	5,422	5,119	818,480		2026/05/15
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	4,100	2,091	334,398		2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,200	2,095	335,042		2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	5,850	4,940	789,851		2031/05/15
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	800	783	125,257		2025/05/31
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	2,650	2,245	359,037		2042/05/15
US T N/B 4.625 05/15/44	国債証券	4.6250	1,000	1,016	162,528		2044/05/15
US T N/B 3.875 05/15/43	国債証券	3.8750	2,200	2,020	323,033		2043/05/15
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	7,400	6,719	1,074,321		2032/05/15
US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	3.3750	7,100	6,638	1,061,429		2033/05/15
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	2,600	2,318	370,717		2027/05/31
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,640	4,122	659,139		2028/05/31
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	5,190	4,214	673,788		2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/34	国債証券	4.3750	4,000	4,039	645,765		2034/05/15
US T N/B 2.625 05/31/27	国債証券	2.6250	3,800	3,607	576,810		2027/05/31
US T N/B 2.75 05/31/29	国債証券	2.7500	2,900	2,702	432,138		2029/05/31
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	4,890	4,534	725,009		2026/05/31
US T N/B 3.625 05/31/28	国債証券	3.6250	2,150	2,093	334,772		2028/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	1,500	1,433	229,202		2025/05/31
US T N/B 3.75 05/31/30	国債証券	3.7500	2,700	2,626	419,973		2030/05/31
US T N/B 4.5 05/15/27	国債証券	4.5000	5,000	5,001	799,618		2027/05/15
US T N/B 3.625 05/15/26	国債証券	3.6250	2,800	2,744	438,736		2026/05/15
US T N/B 4.25 05/31/25	国債証券	4.2500	1,500	1,487	237,825		2025/05/31
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,500	1,465	234,307		2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	2,000	1,892	302,597		2026/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	2,500	2,223	355,522		2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,070	2,722	435,200		2028/06/30
US T N/B 3.25 06/30/27	国債証券	3.2500	2,890	2,792	446,531		2027/06/30
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	4,716	4,375	699,491		2026/06/30
US T N/B 3.25 06/30/29	国債証券	3.2500	3,000	2,860	457,306		2029/06/30
US T N/B 2.875 06/15/25	国債証券	2.8750	2,000	1,957	312,988		2025/06/15
US T N/B 4.0 06/30/28	国債証券	4.0000	2,800	2,764	441,980		2028/06/30
US T N/B 4.125 06/15/26	国債証券	4.1250	2,500	2,472	395,367		2026/06/15
US T N/B 4.625 06/30/25	国債証券	4.6250	1,000	995	159,132		2025/06/30
US T N/B 3.75 06/30/30	国債証券	3.7500	2,500	2,431	388,723		2030/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	1,270	1,240	198,383		2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,000	1,889	302,054		2026/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	4,470	3,913	625,707		2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,100	2,737	437,682		2027/07/31
US T N/B 4.0 07/31/30	国債証券	4.0000	1,500	1,478	236,372		2030/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	1,500	1,424	227,674		2025/07/31
US T N/B 2.625 07/31/29	国債証券	2.6250	3,100	2,866	458,281		2029/07/31
US T N/B 4.125 07/31/28	国債証券	4.1250	3,300	3,273	523,368		2028/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	4,180	3,845	614,834		2026/07/31
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	2,650	2,520	402,919		2027/07/31
US T N/B 4.5 07/15/26	国債証券	4.5000	3,400	3,387	541,585		2026/07/15
US T N/B 4.75 07/31/25	国債証券	4.7500	1,400	1,395	223,150		2025/07/31
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	1,500	1,379	220,503		2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	700	660	105,568		2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,480	1,160	185,480		2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,000	1,629	260,454		2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	530	540	86,434		2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	800	708	113,212		2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	3,800	2,343	374,636		2051/08/15

銘柄	当		期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.125 08/15/53	国債証券	4.1250	3,950	3,769	602,712	2053/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,500	1,161	185,766	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	1,800	1,740	278,228	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,700	2,011	321,564	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	2,790	1,850	295,796	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	2,600	2,006	320,761	2052/08/15
US T N/B 4.375 08/15/43	国債証券	4.3750	2,700	2,651	423,995	2043/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,100	1,432	229,003	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,210	1,716	274,407	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,600	2,433	389,025	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,730	3,491	558,299	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	5,400	5,099	815,260	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,000	973	155,714	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	2,800	2,463	393,786	2029/08/15
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,800	2,409	385,165	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	3,700	2,498	399,381	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	3,260	2,028	324,360	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	3,500	1,842	294,544	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	7,580	6,800	1,087,269	2032/08/15
US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	3.8750	5,400	5,242	838,193	2033/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	6,000	4,898	783,199	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	6,090	4,904	784,184	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,750	1,632	260,958	2026/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	1,500	1,418	226,789	2025/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,770	3,310	529,323	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	2,900	2,563	409,924	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	3,680	3,385	541,266	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	2,700	2,555	408,625	2029/08/31
US T N/B 4.125 08/31/30	国債証券	4.1250	2,500	2,480	396,530	2030/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,000	2,883	460,979	2027/08/31
US T N/B 4.375 08/31/28	国債証券	4.3750	3,500	3,505	560,399	2028/08/31
US T N/B 4.375 08/15/26	国債証券	4.3750	3,700	3,678	588,066	2026/08/15
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	2,000	1,951	312,053	2025/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	2,820	2,475	395,860	2027/09/30
US T N/B 4.625 09/30/30	国債証券	4.6250	2,500	2,547	407,373	2030/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	4,000	3,745	598,800	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	4,250	3,744	598,747	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	1,300	1,225	195,876	2025/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	2,380	2,358	377,006	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	3,310	3,047	487,259	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	2,500	2,455	392,549	2025/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	3,000	2,942	470,459	2029/09/30
US T N/B 5.0 09/30/25	国債証券	5.0000	2,500	2,500	399,731	2025/09/30
US T N/B 4.625 09/30/28	国債証券	4.6250	3,000	3,034	485,120	2028/09/30
US T N/B 4.625 09/15/26	国債証券	4.6250	3,500	3,498	559,339	2026/09/15
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	500	487	77,925	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	1,330	1,242	198,685	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	3,600	3,183	508,916	2028/10/31
US T N/B 4.875 10/31/30	国債証券	4.8750	2,500	2,583	413,064	2030/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,000	2,637	421,624	2027/10/31
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	3,270	3,019	482,780	2026/10/31
US T N/B 4.875 10/31/28	国債証券	4.8750	3,500	3,576	571,755	2028/10/31
US T N/B 4.0 10/31/29	国債証券	4.0000	2,900	2,861	457,476	2029/10/31
US T N/B 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	1,500	1,485	237,576	2027/10/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	価額	償還年月日	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	2,000	1,878	300,362	2025/10/31	
US T N/B 4.625 10/15/26	国債証券	4.6250	4,000	4,000	639,607	2026/10/15	
US T N/B 4.25 10/15/25	国債証券	4.2500	570	564	90,307	2025/10/15	
US T N/B 5.0 10/31/25	国債証券	5.0000	1,000	1,000	159,973	2025/10/31	
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,500	1,194	190,961	2044/11/15	
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	300	295	47,252	2040/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,500	1,171	187,350	2042/11/15	
US T N/B 4.75 11/15/53	国債証券	4.7500	4,830	5,116	818,070	2053/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	580	486	77,857	2041/11/15	
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	2,000	1,800	287,858	2043/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	1,700	1,264	202,148	2047/11/15	
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	4,300	2,419	386,897	2050/11/15	
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	4,400	2,624	419,582	2051/11/15	
US T N/B 4.0 11/15/52	国債証券	4.0000	4,170	3,892	622,283	2052/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	1,000	790	126,336	2045/11/15	
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	1,650	1,266	202,447	2046/11/15	
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	700	703	112,517	2039/11/15	
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	2,350	1,952	312,234	2048/11/15	
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,880	1,961	313,594	2049/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	1,500	1,446	231,295	2025/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	3,710	3,532	564,829	2028/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	3,900	3,673	587,240	2026/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	2,440	2,274	363,599	2027/11/15	
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	1,140	1,108	177,161	2025/11/30	
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	2,000	1,875	299,849	2042/11/15	
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	3,930	2,532	404,879	2040/11/15	
US T N/B 4.75 11/15/43	国債証券	4.7500	2,500	2,578	412,190	2043/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	3,200	2,243	358,750	2041/11/15	
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,600	1,492	238,610	2026/11/30	
US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	4.1250	7,700	7,631	1,220,135	2032/11/15	
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,000	1,762	281,863	2029/11/15	
US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	4.5000	7,800	7,944	1,270,154	2033/11/15	
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	6,000	4,912	785,354	2031/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	6,890	5,602	895,716	2030/11/15	
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	4,300	3,786	605,429	2027/11/30	
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	5,150	4,759	761,017	2026/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	4,340	3,851	615,831	2028/11/30	
US T N/B 4.375 11/30/30	国債証券	4.3750	2,700	2,716	434,281	2030/11/30	
US T N/B 3.875 11/30/29	国債証券	3.8750	2,600	2,549	407,650	2029/11/30	
US T N/B 3.875 11/30/27	国債証券	3.8750	2,900	2,850	455,755	2027/11/30	
US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	4.5000	1,700	1,690	270,224	2025/11/15	
US T N/B 4.375 11/30/28	国債証券	4.3750	4,300	4,312	689,417	2028/11/30	
US T N/B 4.625 11/15/26	国債証券	4.6250	4,010	4,013	641,657	2026/11/15	
US T N/B 4.875 11/30/25	国債証券	4.8750	2,000	1,998	319,572	2025/11/30	
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	1,400	1,354	216,522	2025/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	900	840	134,426	2026/12/31	
US T N/B 3.75 12/31/30	国債証券	3.7500	2,390	2,320	371,067	2030/12/31	
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	3,830	3,533	565,003	2026/12/31	
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	3,300	2,906	464,652	2028/12/31	
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	1,080	1,009	161,413	2025/12/31	
US T N/B 3.875 12/31/29	国債証券	3.8750	2,500	2,451	391,893	2029/12/31	
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	3,360	2,950	471,683	2027/12/31	
US T N/B 4.375 12/15/26	国債証券	4.3750	3,970	3,952	631,859	2026/12/15	
US T N/B 4.0 12/15/25	国債証券	4.0000	1,900	1,875	299,915	2025/12/15	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額	
				千円	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 3.875 12/31/27	国債証券	3.8750	2,800	2,752	440,039	2027/12/31	
US T N/B 4.25 12/31/25	国債証券	4.2500	1,000	990	158,399	2025/12/31	
US T N/B 3.75 12/31/28	国債証券	3.7500	3,700	3,616	578,188	2028/12/31	
小計	-	-	803,782	728,330	116,445,459	-	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 4.5 02/01/26	国債証券	4.5000	2,300	2,317	270,474	2026/02/01	
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,550	1,458	170,267	2026/03/01	
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	1,850	1,739	203,033	2027/03/01	
CANADA 3.5 03/01/34	国債証券	3.5000	400	406	47,399	2034/03/01	
CANADA 3.5 03/01/28	国債証券	3.5000	1,100	1,102	128,643	2028/03/01	
CANADA 4.0 03/01/29	国債証券	4.0000	1,700	1,746	203,877	2029/03/01	
CANADA 3.0 04/01/26	国債証券	3.0000	650	640	74,713	2026/04/01	
CANADA 4.0 05/01/26	国債証券	4.0000	1,920	1,923	224,519	2026/05/01	
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	600	574	67,070	2026/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	550	611	71,358	2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	1,000	1,185	138,331	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	500	585	68,353	2037/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	450	487	56,958	2041/06/01	
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	380	361	42,155	2028/06/01	
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	710	660	77,134	2027/06/01	
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	260	248	28,969	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	2,320	2,064	241,013	2030/06/01	
CANADA 2.75 06/01/33	国債証券	2.7500	1,000	955	111,517	2033/06/01	
CANADA 3.0 06/01/34	国債証券	3.0000	1,650	1,603	187,150	2034/06/01	
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,550	2,264	264,283	2031/06/01	
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	1,300	1,180	137,766	2032/06/01	
CANADA 3.5 08/01/25	国債証券	3.5000	1,000	991	115,785	2025/08/01	
CANADA 4.0 08/01/26	国債証券	4.0000	1,500	1,506	175,812	2026/08/01	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,000	958	111,880	2025/09/01	
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	1,100	1,075	125,542	2027/09/01	
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,010	952	111,150	2026/09/01	
CANADA 3.25 09/01/28	国債証券	3.2500	1,000	994	116,056	2028/09/01	
CANADA 3.5 09/01/29	国債証券	3.5000	300	302	35,272	2029/09/01	
CANADA 4.5 11/01/25	国債証券	4.5000	200	200	23,459	2025/11/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	660	678	79,188	2045/12/01	
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	550	500	58,398	2048/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,520	1,935	225,962	2051/12/01	
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	2,450	1,749	204,166	2053/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	340	305	35,619	2064/12/01	
CANADA 2.75 12/01/55	国債証券	2.7500	900	810	94,581	2055/12/01	
CANADA 3.25 12/01/33	国債証券	3.2500	1,200	1,191	139,098	2033/12/01	
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,770	1,484	173,307	2030/12/01	
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	1,700	1,496	174,718	2031/12/01	
CANADA 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,120	1,052	122,837	2032/12/01	
CANADA 2.25 12/01/29	国債証券	2.2500	500	475	55,529	2029/12/01	
小計	-	-	45,560	42,777	4,993,362	-	
(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	1,030	797	84,709	2047/03/21	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	1,640	1,676	177,953	2027/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	1,280	1,285	136,447	2026/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,250	1,212	128,734	2029/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	1,310	1,340	142,351	2033/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	830	784	83,296	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	1,200	1,128	119,795	2028/05/21	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
(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 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,940	1,788	189,881		2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	650	515	54,763		2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	2,050	1,654	175,618		2032/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	1,800	1,733	184,021		2034/05/21
AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	国債証券	4.7500	470	482	51,197		2054/06/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	930	812	86,273		2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	1,170	988	104,939		2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	1,100	956	101,503		2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	1,280	716	76,092		2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	2,220	2,057	218,393		2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	1,050	1,001	106,276		2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,220	1,175	124,775		2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,090	1,026	108,966		2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	1,200	1,089	115,641		2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	1,800	1,493	158,577		2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	1,970	1,582	168,042		2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	600	568	60,328		2025/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,110	919	97,604		2030/12/21
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	1,180	1,107	117,572		2034/12/21
小計	—	—	33,370	29,895	3,173,758		—
(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 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	800	804	94,942		2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	560	527	62,180		2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	400	313	36,948		2050/03/01
SINGAPORE 3.0 04/01/29	国債証券	3.0000	200	198	23,416		2029/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	560	548	64,669		2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	448	442	52,258		2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	860	839	99,019		2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	310	305	36,066		2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	390	352	41,612		2039/07/01
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	750	677	79,895		2031/07/01
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国債証券	3.0000	427	419	49,466		2072/08/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	420	381	45,063		2036/08/01
SINGAPORE 2.625 08/01/32	国債証券	2.6250	350	336	39,675		2032/08/01
SINGAPORE 2.875 08/01/28	国債証券	2.8750	100	98	11,655		2028/08/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	450	442	52,173		2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	600	609	71,949		2033/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国債証券	2.8750	200	197	23,339		2027/09/01
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	530	410	48,396		2051/10/01
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500	650	619	73,073		2026/11/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	140	134	15,856		2025/11/01
小計	—	—	9,145	8,660	1,021,658		—
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円		
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	550	548	53,639		2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	770	710	69,464		2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	410	330	32,325		2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	430	403	39,415		2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	540	364	35,686		2051/05/15
NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	国債証券	5.0000	220	221	21,614		2054/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	420	268	26,229		2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	500	411	40,222		2031/05/15
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	450	436	42,727		2034/05/15
NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	国債証券	4.5000	280	275	26,971		2035/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	740	616	60,252		2032/05/15

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額	
				邦貨換算金額	外貨換算金額		
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円		
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	740	628	61,504	2028/05/15	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国債証券	0.5000	570	526	51,459	2026/05/15	
NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	国債証券	4.5000	340	340	33,305	2030/05/15	
小計	-	-	6,960	6,082	594,820	-	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	1,050	877	177,316	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,320	1,136	229,770	2045/01/22	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	1,000	911	184,237	2060/01/22	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	530	312	63,164	2049/01/22	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	国債証券	3.7500	1,800	1,697	343,199	2038/01/29	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	810	405	82,065	2046/01/31	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	1,600	1,045	211,453	2039/01/31	
UK TREASURY 4.625 01/31/34	国債証券	4.6250	1,850	1,930	390,228	2034/01/31	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	国債証券	1.0000	1,800	1,453	293,856	2032/01/31	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	国債証券	3.2500	2,250	2,125	429,654	2033/01/31	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	1,850	1,586	320,652	2029/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,180	1,029	208,085	2028/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,000	938	189,688	2026/01/30	
UK TREASURY 4.125 01/29/27	国債証券	4.1250	2,350	2,340	473,208	2027/01/29	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	1,050	1,057	213,695	2036/03/07	
UK TREASURY 3.75 03/07/27	国債証券	3.7500	1,000	985	199,277	2027/03/07	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,400	1,429	288,976	2032/06/07	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	700	674	136,332	2025/06/07	
UK TREASURY 4.5 06/07/28	国債証券	4.5000	1,930	1,959	396,202	2028/06/07	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,500	851	172,157	2047/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	1,330	653	132,184	2051/07/31	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	970	846	171,179	2052/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	国債証券	1.5000	1,490	763	154,382	2053/07/31	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,000	533	107,835	2057/07/22	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	870	554	112,075	2065/07/22	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	1,000	822	166,244	2068/07/22	
UK TREASURY 4.375 07/31/54	国債証券	4.3750	1,000	966	195,457	2054/07/31	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	1,840	1,742	352,202	2026/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	910	837	169,396	2027/07/22	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	2,000	1,521	307,686	2033/07/31	
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,850	1,433	289,763	2031/07/31	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	1,500	1,035	209,274	2035/07/31	
UK TREASURY 4.125 07/22/29	国債証券	4.1250	500	502	101,626	2029/07/22	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	920	906	183,169	2039/09/07	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	670	649	131,350	2025/09/07	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	1,000	1,032	208,760	2034/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,200	898	181,637	2037/09/07	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	国債証券	3.7500	1,920	1,666	336,928	2053/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	1,100	577	116,753	2054/10/22	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	670	203	41,148	2061/10/22	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	国債証券	4.0000	850	770	155,862	2063/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	1,350	625	126,502	2071/10/22	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	国債証券	1.1250	920	339	68,576	2073/10/22	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	1,530	945	191,128	2041/10/22	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	1,350	549	111,019	2050/10/22	
UK TREASURY 4.75 10/22/43	国債証券	4.7500	900	925	187,193	2043/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	800	728	147,268	2028/10/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	900	772	156,103	2029/10/22	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	国債証券	4.0000	800	800	161,788	2031/10/22	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	1,250	1,006	203,542		2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	2,050	1,878	379,762		2026/10/22
UK TREASURY 3.5 10/22/25	国債証券	3.5000	1,350	1,329	268,802		2025/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	900	975	197,167		2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	960	1,002	202,735		2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,420	1,421	287,425		2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,260	1,206	243,823		2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	800	759	153,605		2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	1,000	1,007	203,682		2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,300	1,272	257,249		2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,400	1,466	296,534		2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	1,050	1,000	202,352		2049/12/07
小計	—	—	75,850	63,681	12,874,413		—
(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	1,155	1,210	51,526		2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国債証券	0.5000	2,300	2,159	91,921		2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	国債証券	3.7500	1,050	1,015	43,217		2029/02/28
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,780	1,432	60,980		2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	国債証券	4.0000	620	576	24,539		2035/03/30
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	1,800	1,689	71,916		2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	2,410	1,977	84,201		2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	国債証券	1.3000	1,870	1,456	61,988		2032/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	1,985	1,338	56,965		2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	530	514	21,922		2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	1,800	1,644	70,022		2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27	国債証券	3.7500	1,000	977	41,617		2027/09/30
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	830	864	36,794		2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	国債証券	2.8000	1,090	689	29,365		2052/11/29
小計	—	—	20,220	17,545	746,980		—
(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	4,130	2,235	51,235		2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	6,640	8,209	188,169		2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	4,250	4,186	95,950		2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	3,620	3,392	77,745		2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	3,540	3,214	73,680		2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	3,310	2,791	63,981		2031/11/15
DENMARK 2.25 11/15/33	国債証券	2.2500	3,250	3,201	73,377		2033/11/15
小計	—	—	28,740	27,231	624,139		—
(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	3,600	3,459	52,305		2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	3,350	3,187	48,201		2027/02/17
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,560	2,415	36,516		2028/04/26
NORWAY 3.625 04/13/34	国債証券	3.6250	1,790	1,801	27,246		2034/04/13
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	2,850	2,567	38,817		2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	2,910	2,558	38,688		2030/08/19
NORWAY 3.0 08/15/33	国債証券	3.0000	3,890	3,718	56,226		2033/08/15
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	3,220	2,945	44,530		2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,620	2,233	33,773		2031/09/17
NORWAY 3.5 10/06/42	国債証券	3.5000	1,570	1,583	23,941		2042/10/06
小計	—	—	28,360	26,471	400,247		—
(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	2,740	3,139	47,756		2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	4,480	4,230	64,344		2028/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	4,200	3,650	55,528		2031/05/12

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額	
				邦貨換算金額	千円		
(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 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,600	2,606	39,642	2032/06/01	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	5,100	4,938	75,121	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	4,090	3,820	58,112	2029/11/12	
SWEDEN 1.75 11/11/33	国債証券	1.7500	4,170	4,008	60,975	2033/11/11	
小計	-	-	27,380	26,395	401,481	-	
(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	24,150	22,316	197,128	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	27,200	24,190	213,680	2027/03/04	
MEXICAN BONDS 03/01/29	国債証券	8.5000	8,000	7,495	66,208	2029/03/01	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	19,201	18,016	159,143	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	25,080	22,248	196,527	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 05/24/35	国債証券	8.0000	2,000	1,747	15,439	2035/05/24	
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	18,780	16,061	141,876	2033/05/26	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	24,730	22,958	202,797	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	18,650	15,041	132,862	2053/07/31	
MEXICAN BONDS 09/03/26	国債証券	7.0000	15,000	13,919	122,958	2026/09/03	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	20,220	16,300	143,984	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	18,596	15,153	133,858	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	16,300	14,401	127,208	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	4,700	4,710	41,613	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	6,191	5,315	46,951	2034/11/23	
小計	-	-	248,798	219,876	1,942,239	-	
(中国)		%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円		
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	国債証券	2.3700	5,000	5,061	110,991	2027/01/20	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	国債証券	2.3700	50,000	50,765	1,113,127	2029/01/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	国債証券	2.3500	58,500	58,881	1,291,078	2034/02/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	国債証券	2.8800	15,000	15,737	345,082	2033/02/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27	国債証券	2.0400	79,500	79,859	1,751,065	2027/02/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	3.0300	40,200	41,123	901,712	2026/03/11	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	国債証券	2.2800	15,000	15,101	331,136	2031/03/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	国債証券	2.8000	58,000	60,127	1,318,419	2030/03/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 03/15/26	国債証券	1.9900	50,000	50,225	1,101,278	2026/03/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	7,900	9,168	201,040	2052/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	4,300	5,305	116,327	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	国債証券	3.1900	1,000	1,139	24,978	2053/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	国債証券	2.6200	4,500	4,602	100,922	2028/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	4,400	4,473	98,082	2027/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	国債証券	2.0500	7,000	7,007	153,647	2029/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	18,500	19,546	428,594	2031/05/27	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	2,300	2,387	52,344	2032/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	国債証券	2.6700	18,000	18,545	406,649	2033/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国債証券	3.0100	32,000	33,295	730,070	2028/05/13	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.69 05/17/28	国債証券	3.6900	30,000	32,212	706,329	2028/05/17	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	34,500	35,539	779,265	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	国債証券	2.3000	42,500	42,925	941,232	2026/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	58,000	59,642	1,307,769	2027/06/04	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	6,100	6,302	138,201	2029/06/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	6,700	6,904	151,400	2026/06/06	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	国債証券	3.8600	29,500	36,892	808,931	2049/07/22	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	国債証券	2.4000	15,000	15,226	333,859	2028/07/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	30,500	31,044	680,711	2027/07/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	10,500	10,845	237,813	2032/08/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	国債証券	2.5200	18,500	18,864	413,636	2033/08/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	38,000	38,731	849,261	2026/08/12	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(中国)		%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円		
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	国債証券	2.1800	48,500	48,884	1,071,886	2026/08/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	国債証券	3.8100	23,500	29,314	642,781	2050/09/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	国債証券	2.6000	10,000	10,264	225,060	2032/09/01	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	国債証券	2.6000	18,000	18,467	404,945	2030/09/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 09/25/28	国債証券	2.4800	2,500	2,546	55,842	2028/09/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	国債証券	2.6200	12,000	12,321	270,183	2029/09/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	国債証券	3.0000	19,000	21,049	461,543	2053/10/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	国債証券	3.1200	4,000	4,487	98,391	2052/10/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	10,500	12,589	276,039	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	国債証券	4.0800	4,000	5,162	113,205	2048/10/22	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	国債証券	2.5500	10,000	10,220	224,100	2028/10/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 10/22/25	国債証券	3.0200	11,500	11,711	256,806	2025/10/22	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	7,000	7,339	160,927	2031/11/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	国債証券	2.6700	24,100	24,892	545,808	2033/11/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	国債証券	2.2800	4,500	4,536	99,475	2025/11/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26	国債証券	2.3900	17,000	17,218	377,551	2026/11/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	国債証券	2.5400	15,500	15,863	347,838	2030/12/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	国債証券	2.7900	14,000	14,497	317,884	2029/12/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	16,500	17,311	379,585	2027/12/03	
小計	—	—	1,063,000	1,106,167	24,254,822	—	
(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	870	878	29,776	2027/03/15	
MALAYSIA 4.457 03/31/53	国債証券	4.4570	900	933	31,662	2053/03/31	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	700	754	25,575	2046/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	500	508	17,238	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	2,100	2,184	74,059	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	710	708	24,032	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,200	1,291	43,791	2037/04/07	
MALAYSIA 4.054 04/18/39	国債証券	4.0540	700	702	23,837	2039/04/18	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,300	1,209	41,029	2031/04/15	
MALAYSIA 3.519 04/20/28	国債証券	3.5190	500	498	16,900	2028/04/20	
MALAYSIA 4.504 04/30/29	国債証券	4.5040	520	539	18,301	2029/04/30	
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	1,900	1,897	64,357	2027/05/31	
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	1,500	1,446	49,038	2040/05/22	
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	1,050	1,078	36,560	2035/05/31	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	1,400	1,406	47,684	2028/06/15	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	800	821	27,845	2031/06/30	
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	1,330	1,455	49,342	2038/06/08	
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	1,430	1,395	47,312	2050/06/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	1,180	1,306	44,289	2048/07/06	
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	970	978	33,194	2026/07/15	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	2,000	1,994	67,619	2034/07/05	
MALAYSIA 3.582 07/15/32	国債証券	3.5820	900	883	29,965	2032/07/15	
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	1,630	1,647	55,872	2029/08/15	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	500	503	17,086	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	700	772	26,185	2043/09/30	
MALAYSIA 4.696 10/15/42	国債証券	4.6960	1,600	1,719	58,297	2042/10/15	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,590	1,606	54,466	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	1,300	1,314	44,580	2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	2,220	2,353	79,804	2033/11/07	
小計	—	—	34,000	34,790	1,179,711	—	
(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	2,700	2,724	107,655	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	1,810	1,648	65,143	2028/04/25	

銘柄	当		期			償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額	額	
				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 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	1,900	1,440	56,919	2032/04/25
POLAND 04/25/26	国債証券	0.0000	1,700	1,553	61,378	2026/04/25
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	2,470	2,369	93,608	2027/05/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,690	2,551	100,830	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	900	884	34,954	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	3,250	2,994	118,307	2027/07/25
POLAND 7.5 07/25/28	国債証券	7.5000	2,800	3,005	118,761	2028/07/25
POLAND 4.75 07/25/29	国債証券	4.7500	2,200	2,124	83,928	2029/07/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	3,000	2,622	103,622	2029/10/25
POLAND 6.0 10/25/33	国債証券	6.0000	3,660	3,742	147,867	2033/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,300	1,779	70,311	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	2,980	2,663	105,233	2026/10/25
POLAND 10/25/25	国債証券	0.0000	1,000	938	37,067	2025/10/25
小計	-	-	35,360	33,043	1,305,589	-
(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	630	523	89,423	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	300	275	47,074	2031/03/18
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	240	160	27,393	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	565	400	68,460	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	620	547	93,682	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	730	717	122,714	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	650	607	103,920	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	500	464	79,356	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	510	492	84,152	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	350	301	51,530	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	450	345	59,049	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	650	604	103,348	2027/05/15
IRISH 3.0 10/18/43	国債証券	3.0000	300	294	50,314	2043/10/18
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	430	352	60,269	2031/10/18
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	530	435	74,462	2032/10/18
IRISH 2.6 10/18/34	国債証券	2.6000	250	243	41,671	2034/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	400	342	58,591	2030/10/18
小計	-	-	8,105	7,109	1,215,416	-
(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	1,200	1,343	229,611	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,330	1,312	224,387	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,420	675	115,504	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	1,020	1,119	191,468	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	800	900	153,864	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	820	809	138,370	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	900	612	104,752	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	970	685	117,221	2040/01/15
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	790	661	113,105	2054/01/15
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	国債証券	3.2500	350	369	63,105	2044/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	700	622	106,355	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,540	1,437	245,786	2027/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	国債証券	2.5000	800	794	135,754	2030/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	500	478	81,728	2026/01/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,650	1,575	269,347	2026/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	900	873	149,343	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,310	1,216	207,992	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,000	944	161,475	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	700	622	106,470	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	1,100	940	160,788	2030/07/15

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	880	732	125,305	2031/07/15	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	国債証券	2.5000	1,000	982	167,998	2033/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	700	591	101,086	2032/07/15	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	国債証券	2.5000	700	683	116,883	2034/07/15	
小計	—	—	23,080	20,985	3,587,708	—	
(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	1,360	1,488	254,442	2028/03/28	
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	750	833	142,530	2041/03/28	
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,580	1,618	276,676	2026/03/28	
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	650	697	119,254	2032/03/28	
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,380	1,614	275,956	2035/03/28	
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	900	783	133,890	2033/04/22	
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500	400	374	63,998	2039/04/22	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	600	627	107,196	2045/06/22	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	500	354	60,544	2047/06/22	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	610	424	72,610	2050/06/22	
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	580	359	61,489	2053/06/22	
BELGIUM 3.3 06/22/54	国債証券	3.3000	720	685	117,235	2054/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	450	340	58,202	2057/06/22	
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	530	388	66,380	2066/06/22	
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	520	214	36,685	2071/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,000	961	164,418	2026/06/22	
BELGIUM 3.5 06/22/55	国債証券	3.5000	450	442	75,673	2055/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	850	750	128,320	2031/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	1,000	922	157,710	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	930	594	101,557	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,150	1,049	179,498	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	640	637	109,053	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	700	592	101,369	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	600	585	100,067	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	1,170	1,101	188,352	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	500	407	69,625	2037/06/22	
BELGIUM 3.45 06/22/43	国債証券	3.4500	500	501	85,797	2043/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	900	765	130,953	2030/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/33	国債証券	3.0000	1,300	1,301	222,495	2033/06/22	
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500	1,100	898	153,566	2032/06/22	
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	800	649	110,990	2031/10/22	
BELGIUM 2.85 10/22/34	国債証券	2.8500	500	490	83,883	2034/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	750	683	116,852	2027/10/22	
BELGIUM 2.7 10/22/29	国債証券	2.7000	400	397	67,982	2029/10/22	
小計	—	—	26,770	24,539	4,195,262	—	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	2,900	2,679	458,110	2027/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	3,300	3,133	535,763	2026/02/25	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500	2,730	2,523	431,429	2028/02/25	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	国債証券	2.7500	2,700	2,675	457,460	2029/02/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	2,320	2,335	399,313	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,510	2,842	485,900	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,350	1,447	247,445	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,200	1,300	222,252	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	2,690	2,990	511,205	2029/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,680	1,912	326,993	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	2,500	2,406	411,434	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,650	1,243	212,612	2048/05/25	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(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	1,870	1,227	209,889	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	2,000	1,024	175,072	2052/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	1,950	975	166,738	2053/05/25	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	国債証券	3.0000	1,650	1,466	250,722	2054/05/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/55	国債証券	3.2500	800	743	127,085	2055/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	1,500	951	162,686	2066/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	530	193	33,136	2072/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	3,350	3,270	559,161	2030/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	4,200	3,863	660,481	2028/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	4,200	3,818	652,782	2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	3,980	3,542	605,635	2029/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,350	1,974	337,495	2034/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	3,530	3,362	574,906	2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	2,920	2,759	471,781	2027/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,610	1,038	177,589	2040/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	2,790	2,236	382,393	2036/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	1,550	1,185	202,715	2038/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国債証券	2.5000	1,300	1,119	191,338	2043/05/25	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	国債証券	3.0000	2,100	2,082	356,072	2033/05/25	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	3,150	2,485	425,003	2032/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	2,110	1,712	292,749	2039/06/25	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,320	760	130,075	2044/06/25	
FRANCE OAT 3.0 06/25/49	国債証券	3.0000	800	730	124,852	2049/06/25	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	国債証券	2.5000	4,500	4,444	759,769	2026/09/24	
FRANCE OAT 2.5 09/24/27	国債証券	2.5000	2,500	2,462	420,947	2027/09/24	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	1,070	1,107	189,325	2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	3,790	3,760	642,935	2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,900	2,034	347,735	2038/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	1,710	2,040	348,797	2032/10/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	800	775	132,598	2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,930	2,742	468,817	2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	3,040	2,767	473,198	2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	3,300	2,650	453,090	2031/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	4,180	3,466	592,676	2030/11/25	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国債証券	2.0000	3,600	3,318	567,336	2032/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	3,900	3,337	570,503	2029/11/25	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	国債証券	3.5000	4,000	4,114	703,344	2033/11/25	
小計	-	-	120,310	109,039	18,641,364	-	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,500	1,654	282,773	2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	800	955	163,435	2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,290	1,526	260,963	2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	2,050	2,373	405,781	2037/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	3,100	2,984	510,207	2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,550	1,407	240,685	2029/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,710	1,595	272,795	2028/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,200	2,071	354,147	2027/02/15	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	国債証券	2.2000	2,100	2,062	352,618	2034/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	1,600	1,374	235,016	2031/02/15	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	2,560	2,546	435,311	2033/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	2,080	1,745	298,401	2032/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,600	1,404	240,107	2030/02/15	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	500	497	85,044	2033/02/15	
BUNDESSCHAT 2.5 03/19/26	国債証券	2.5000	2,200	2,186	373,780	2026/03/19	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨	建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BUNDESUBL 2.2 04/13/28	国債証券	2.2000	1,240	1,228	209,965	2028/04/13	
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	2,180	2,074	354,729	2026/04/10	
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	1,290	1,201	205,433	2027/04/16	
BUNDESUBL 2.1 04/12/29	国債証券	2.1000	1,300	1,281	219,096	2029/04/12	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,520	1,166	199,402	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000	1,850	1,514	258,846	2038/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,700	1,267	216,639	2036/05/15	
BUNDESSCHAT 2.8 06/12/25	国債証券	2.8000	600	597	102,186	2025/06/12	
BUNDESSCHAT 2.9 06/18/26	国債証券	2.9000	1,000	1,001	171,284	2026/06/18	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	970	1,078	184,454	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,000	1,086	185,718	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,390	1,674	286,218	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,200	1,307	223,498	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	1,900	1,863	318,626	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,420	1,817	310,724	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,180	1,420	242,805	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,200	2,160	369,371	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	2,360	1,164	199,094	2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	2,120	1,781	304,536	2053/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	2,020	1,539	263,259	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	500	420	71,968	2053/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	830	810	138,548	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,500	2,351	401,941	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	国債証券	2.5000	600	588	100,594	2054/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	2,750	2,599	444,394	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,750	1,603	274,153	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,750	1,553	265,577	2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,920	994	170,004	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000	1,800	1,715	293,277	2032/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	1,500	1,274	217,899	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	760	394	67,412	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	国債証券	2.6000	2,210	2,248	384,339	2033/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,350	2,042	349,105	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	820	712	121,840	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	800	680	116,304	2031/08/15	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	2,000	1,883	321,917	2026/10/09	
BUNDESUBL 2.4 10/19/28	国債証券	2.4000	1,650	1,646	281,567	2028/10/19	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	800	769	131,598	2025/10/10	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	1,960	1,886	322,562	2027/10/15	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	700	673	115,174	2027/10/15	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	500	481	82,240	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,300	1,195	204,448	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	1,950	1,758	300,630	2028/11/15	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	国債証券	2.4000	1,200	1,201	205,381	2030/11/15	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000	1,700	1,674	286,284	2029/11/15	
BUNDESSCHAT 3.1 12/12/25	国債証券	3.1000	800	801	136,973	2025/12/12	
小計	-	-	94,680	88,576	15,143,105	-	
(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	1,800	2,036	348,076	2029/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,080	1,162	198,794	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	2,400	2,219	379,408	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,950	1,752	299,651	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	400	380	65,074	2026/01/31	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,440	2,340	400,081	2027/04/30	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額	千円	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,940	1,900	324,841	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	2,050	1,936	331,080	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,230	1,148	196,377	2029/04/30	
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,350	1,127	192,817	2032/04/30	
SPAIN 3.15 04/30/33	国債証券	3.1500	2,000	1,993	340,870	2033/04/30	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,400	1,217	208,114	2030/04/30	
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,790	1,460	249,711	2031/04/30	
SPAIN 3.25 04/30/34	国債証券	3.2500	1,700	1,695	289,930	2034/04/30	
SPAIN 3.5 05/31/29	国債証券	3.5000	1,000	1,024	175,116	2029/05/31	
SPAIN 2.5 05/31/27	国債証券	2.5000	700	689	117,876	2027/05/31	
SPAIN 2.8 05/31/26	国債証券	2.8000	2,600	2,583	441,677	2026/05/31	
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	800	775	132,541	2025/05/31	
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,600	1,689	288,880	2026/07/30	
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	930	1,064	181,919	2040/07/30	
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,800	2,036	348,179	2041/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	690	625	106,852	2066/07/30	
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	400	405	69,343	2025/07/30	
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,560	1,472	251,703	2030/07/30	
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	2,000	2,374	405,901	2032/07/30	
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,610	1,493	255,400	2033/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	1,100	1,054	180,269	2043/07/30	
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,400	1,316	224,983	2028/07/30	
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,100	948	162,193	2035/07/30	
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	1,460	1,057	180,793	2037/07/30	
SPAIN 3.9 07/30/39	国債証券	3.9000	1,100	1,135	194,064	2039/07/30	
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	600	389	66,571	2042/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,800	1,682	287,633	2027/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	2,200	1,971	336,996	2029/07/30	
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,000	1,087	185,859	2028/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	900	1,079	184,558	2044/10/31	
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,270	1,106	189,235	2046/10/31	
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,200	995	170,214	2048/10/31	
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	1,580	1,057	180,724	2052/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	550	269	46,053	2071/10/31	
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,830	992	169,733	2050/10/31	
SPAIN 4.0 10/31/54	国債証券	4.0000	300	304	51,988	2054/10/31	
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	550	542	92,737	2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,800	1,714	293,142	2027/10/31	
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	2,690	2,586	442,149	2026/10/31	
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,780	1,575	269,309	2029/10/31	
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,300	1,084	185,387	2031/10/31	
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,300	1,244	212,723	2032/10/31	
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	900	630	107,763	2040/10/31	
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	2,000	1,796	307,163	2030/10/31	
SPAIN 3.55 10/31/33	国債証券	3.5500	1,220	1,249	213,597	2033/10/31	
小計	-	-	72,150	67,478	11,536,070	-	
(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	2,200	2,068	353,582	2027/01/15	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	700	700	119,791	2026/01/15	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,820	2,079	355,579	2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	2,250	2,252	385,044	2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,300	1,242	212,386	2028/02/01	
ITALY BTPS 3.5 02/15/31	国債証券	3.5000	1,200	1,192	203,839	2031/02/15	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,500	1,433	244,989	2026/02/01	

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 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	900	787	134,569	2029/02/15
ITALY BTPS 2.95 02/15/27	国債証券	2.9500	1,050	1,039	177,784	2027/02/15
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	国債証券	4.1000	800	823	140,734	2029/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,180	913	156,121	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	960	839	143,588	2048/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	750	540	92,369	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	150	90	15,409	2072/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,500	1,526	260,953	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	1,400	1,215	207,805	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	800	699	119,612	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,100	1,044	178,532	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,940	1,943	332,304	2030/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,030	788	134,725	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	900	643	109,981	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	1,100	766	130,962	2037/03/01
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国債証券	3.2500	1,030	935	159,906	2038/03/01
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	国債証券	4.2000	1,400	1,436	245,662	2034/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,230	1,098	187,843	2028/03/15
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国債証券	4.0000	700	704	120,509	2035/04/30
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	840	523	89,524	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,400	1,244	212,792	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,750	1,470	251,393	2031/04/01
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国債証券	3.4000	1,250	1,252	214,041	2028/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	1,450	1,368	233,910	2026/04/01
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	1,000	941	160,967	2027/04/01
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	国債証券	3.8000	1,700	1,712	292,717	2026/04/15
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,170	2,488	425,443	2031/05/01
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国債証券	4.4000	1,440	1,507	257,703	2033/05/01
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	2,000	1,934	330,705	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	900	883	151,075	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	2,000	1,940	331,696	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	1,350	1,099	187,960	2032/06/01
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国債証券	2.8000	1,000	971	166,087	2029/06/15
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	国債証券	3.7000	1,110	1,119	191,378	2030/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,400	1,366	233,560	2026/07/15
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,300	1,161	198,489	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	460	452	77,359	2025/07/01
ITALY BTPS 3.35 07/01/29	国債証券	3.3500	900	895	153,125	2029/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,930	2,109	360,572	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,860	2,027	346,540	2039/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	900	867	148,236	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,200	1,176	201,116	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,700	1,383	236,440	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,300	1,116	190,888	2030/08/01
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国債証券	1.2000	600	584	99,921	2025/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	1,700	1,586	271,188	2026/08/01
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	国債証券	3.8000	1,400	1,422	243,269	2028/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	980	855	146,263	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	1,400	1,482	253,404	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	1,200	1,024	175,107	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,300	1,369	234,114	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,890	2,054	351,289	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	840	599	102,534	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	1,100	659	112,766	2051/09/01

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	千円	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	780	700	119,812	2033/09/01	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	1,000	654	111,893	2052/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	750	694	118,716	2049/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,200	996	170,317	2036/09/01	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	国債証券	4.4500	500	507	86,796	2043/09/01	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,600	1,486	254,060	2027/09/15	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	国債証券	3.8500	1,820	1,839	314,414	2026/09/15	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	国債証券	4.5000	900	911	155,895	2053/10/01	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	国債証券	4.0000	1,000	1,024	175,063	2031/10/30	
ITALY BTPS 4.05 10/30/37	国債証券	4.0500	1,000	996	170,361	2037/10/30	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	国債証券	4.1500	700	694	118,810	2039/10/01	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	1,500	1,632	279,109	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,870	2,058	351,856	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	1,390	1,513	258,688	2029/11/01	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	400	395	67,588	2025/11/15	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	国債証券	4.3500	1,430	1,489	254,716	2033/11/01	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	国債証券	4.0000	1,000	1,023	174,926	2030/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	500	490	83,861	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,660	1,581	270,385	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,200	1,173	200,555	2028/12/01	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	1,400	1,157	197,970	2031/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,750	1,558	266,441	2030/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,300	1,186	202,867	2032/12/01	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国債証券	3.8500	1,600	1,628	278,350	2029/12/15	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国債証券	2.6500	1,100	1,076	184,031	2027/12/01	
小計	—	—	106,960	101,928	17,425,671	—	
(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	370	168	28,889	2052/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	300	261	44,713	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	320	228	39,053	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	500	478	81,747	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	400	337	57,710	2034/04/15	
FINLAND 2.75 04/15/38	国債証券	2.7500	260	247	42,325	2038/04/15	
FINLAND 2.95 04/15/55	国債証券	2.9500	150	142	24,431	2055/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券	0.5000	190	118	20,275	2043/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	190	134	23,054	2036/04/15	
FINLAND 2.875 04/15/29	国債証券	2.8750	400	400	68,500	2029/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/27	国債証券	1.3750	200	192	32,831	2027/04/15	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	400	399	68,349	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	470	433	74,145	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	500	444	76,016	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	450	437	74,819	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	520	472	80,766	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	350	325	55,661	2027/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	400	253	43,269	2040/09/15	
FINLAND 3.0 09/15/33	国債証券	3.0000	420	420	71,951	2033/09/15	
FINLAND 1.5 09/15/32	国債証券	1.5000	500	448	76,693	2032/09/15	
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	300	246	42,203	2031/09/15	
FINLAND 3.0 09/15/34	国債証券	3.0000	300	299	51,220	2034/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	280	235	40,235	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/26	国債証券	0.0000	550	515	88,085	2026/09/15	
小計	—	—	8,720	7,644	1,306,951	—	
(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	180	202	34,652	2062/01/26	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額	
				千ユーロ	千円		
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	640	465	79,636	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	600	540	92,412	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	950	882	150,852	2028/02/20	
AUSTRIA 2.9 02/20/34	国債証券	2.9000	580	574	98,224	2034/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	880	728	124,544	2031/02/20	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	国債証券	2.9000	1,400	1,393	238,310	2033/02/20	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000	440	379	64,956	2032/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	850	725	124,026	2030/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	850	874	149,574	2026/03/15	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	850	940	160,819	2037/03/15	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	620	353	60,394	2051/03/20	
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	210	92	15,833	2071/04/20	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	900	842	144,044	2027/04/20	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	510	483	82,707	2034/05/23	
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	500	384	65,785	2049/05/23	
AUSTRIA 2.9 05/23/29	国債証券	2.9000	200	201	34,375	2029/05/23	
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	350	156	26,711	2120/06/30	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	520	515	88,118	2044/06/20	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	580	635	108,692	2027/07/15	
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	670	657	112,347	2026/07/15	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	288	49,361	2117/09/20	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,020	970	165,891	2026/10/20	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	300	292	49,991	2025/10/20	
AUSTRIA 3.15 10/20/53	国債証券	3.1500	350	343	58,806	2053/10/20	
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	600	425	72,685	2036/10/20	
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	920	549	94,023	2040/10/20	
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	1,100	975	166,847	2028/10/20	
AUSTRIA 3.45 10/20/30	国債証券	3.4500	400	413	70,756	2030/10/20	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	150	87	14,973	2086/11/02	
小計	—	—	18,510	16,380	2,800,360	—	
合計	—	—	—	—	245,810,597	—	

■投資信託財産の構成

2024年6月24日現在

項目	当期		末
	評価額	比率	
公社債	千円	%	
コール・ローン等、その他	245,810,597	98.7	
投資信託財産総額	3,310,979	1.3	
	249,121,577	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、248,476,163千円、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、2024年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.88円、1カナダ・ドル=116.73円、1オーストラリア・ドル=106.16円、1シンガポール・ドル=117.97円、1ニュージーランド・ドル=97.80円、1イギリス・ポンド=202.17円、1イスラエル・シェケル=42.573円、1デンマーク・クローネ=22.92円、1ノルウェー・クローネ=15.12円、1スウェーデン・クローナ=15.21円、1メキシコ・ペソ=8.833円、1オフショア・人民元=21.926円、1マレーシア・リングギット=33.908円、1ポーランド・ズロチ=39.51円、1ユーロ=170.96円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	489,922,036,408円
コ ー ル ・ ロ ー ド 等	1,227,375,739
公 社 債(評価額)	245,810,597,750
未 収 入 金	240,872,552,173
未 収 利 息	733,415,869
前 払 費 用	1,278,094,877
(B) 負 債	244,906,432,317
未 払 金	244,899,907,317
未 払 解 約 金	6,525,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	245,015,604,091
元 本	212,014,549,028
次 期 繰 越 損 益 金	33,001,055,063
(D) 受 益 権 総 口 数	212,014,549,028口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	11,557円

(注1) 期首元本額 85,162,235,544円
追加設定元本額 733,571,383,611円
一部解約元本額 606,719,070,127円

(注2) 期末における元本の内訳

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	13,731,083,796円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,615,230,628円
たわらノーロード バランス (標準型)	5,031,700,203円
たわらノーロード バランス (積極型)	2,778,705,865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)	49,339,643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)	1,645,112,538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)	1,732,599,283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)	195,178,856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)	173,393円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	2,551,347円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	16,862,255円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	167,750,358円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	8,471,528円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	91,804円
投資のソムリエ	64,059,067,492円
投資のソムリエ<DC年金>	6,807,913,472円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	13,525,217,575円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	41,429,806,015円
ワールドアセットバランス (基本コース)	1,791,410,235円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	5,200,373,091円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	531,865,344円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	277,214,514円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	125,647,393円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	1,493,969,850円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	15,409,752,966円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,794,009,254円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	539,288,750円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	295,380,489円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	187,345,574円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	45,895,640円
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	10,673,926円
外国債券パッシブファンド2 (為替フルヘッジ) (適格機関投資家限定)	18,116,928,359円

先進国債券パッシブファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定) 5,253,304,303円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 1,024,053,434円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF5用) (適格機関投資家専用) 36,581,791円
D I A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) 352,277,290円
D I A世界アセットバランスファンド40 V A (適格機関投資家限定) 30,956,415円
D I A世界アセットバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定) 278,739,539円
D I A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) 577,293,986円
D I A世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定) 844,730,834円
期末元本合計 212,014,549,028円

■損益の状況

当期 自2023年6月23日 至2024年6月24日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	5,934,646,685	円
	受取利息	5,936,851,114	
	その他の収益	60,538	
	支払利息	△2,264,967	
(B)	有価証券売買損益	△16,744,309,500	
	売却益	50,050,846,933	
	売却損	△66,795,156,433	
(C)	その他の費用	△70,896,343	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△10,880,559,158	
(E)	前期繰越損益金	16,124,561,942	
(F)	解約差損益金	△96,522,034,110	
(G)	追加信託差損益金	124,279,086,389	
(H)	計(D+E+F+G)	33,001,055,063	
	次期繰越損益金(H)	33,001,055,063	

(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16期（決算日 2024年4月18日）

（計算期間 2023年4月19日～2024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	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）				
12期(2020年4月20日)	9,723	△20.7	ポイント 225,442.54	% △18.4	% 64.7	% 34.8	% 0.4	百万円 41,166
13期(2021年4月19日)	14,848	52.7	347,921.32	54.3	93.2	6.1	0.7	58,156
14期(2022年4月18日)	14,507	△2.3	343,415.90	△1.3	84.0	15.2	0.6	62,888
15期(2023年4月18日)	14,206	△2.1	339,863.92	△1.0	92.1	7.4	0.7	91,982
16期(2024年4月18日)	16,801	18.3	405,964.98	19.4	91.7	7.4	0.8	92,003

（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）。

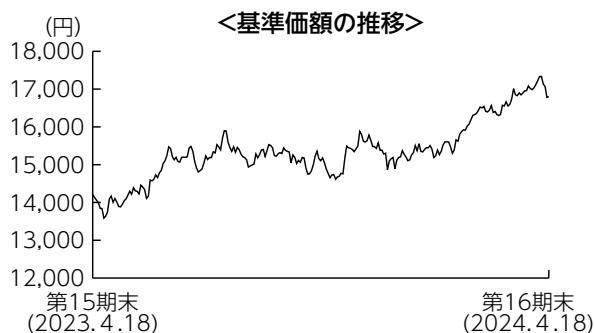
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2023年 4 月18日	円 14,206	% -	ポイント 339,863.92	% -	% 92.1	% 7.4	% 0.7
4 月 末	13,747	△3.2	328,440.62	△3.4	91.0	8.3	0.7
5 月 末	14,340	0.9	342,757.44	0.9	93.8	5.5	0.8
6 月 末	15,194	7.0	363,768.93	7.0	96.0	3.1	0.9
7 月 末	15,690	10.4	375,788.62	10.6	94.1	5.0	0.9
8 月 末	15,401	8.4	370,134.23	8.9	94.1	5.2	0.9
9 月 末	15,064	6.0	362,611.45	6.7	96.9	2.2	0.9
10 月 末	14,695	3.4	354,176.77	4.2	93.9	5.3	0.8
11 月 末	15,432	8.6	372,080.74	9.5	93.0	6.1	0.9
12 月 末	15,506	9.2	374,221.28	10.1	91.2	7.9	0.8
2024年 1 月 末	15,469	8.9	373,407.20	9.9	94.7	4.4	0.9
2 月 末	16,409	15.5	396,672.06	16.7	91.8	7.4	0.8
3 月 末	16,899	19.0	408,467.23	20.2	93.7	5.5	0.9
(期 末) 2024年 4 月18日	16,801	18.3	405,964.98	19.4	91.7	7.4	0.8

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年4月19日から2024年4月18日まで）

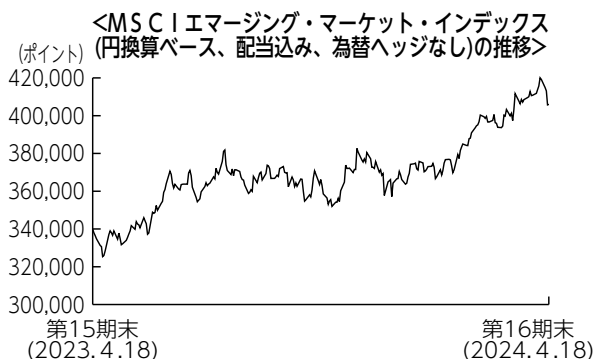


基準価額の推移

当期末の基準価額は16,801円となり、前期末比で18.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークに占める構成比が最大の中国は下落したものの、インドやブラジル、台湾、韓国など多くの株式市場が上昇したことや、為替市場で多くの通貨に対して円安になったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。



投資環境

新興国市場は多くの市場が上昇しました。中国では国内経済の低迷や不動産市場を巡る不透明感が懸念され下落しましたが、2023年10－12月期の実質GDP成長率が市場予想を上回ったインドや利下げによる景気回復が期待されるブラジルが上昇したほか、米ハイテク株高を受けて台湾や韓国なども上昇しました。

為替市場では、米ドルは期前半、日米の金融政策の方向性の違いが意識され円安ドル高が進行しました。2023年11月に米国で早期利下げ観測が浮上し円の下落幅は縮小しましたが、2024年以降は米国の利下げ観測は後退し、改めて円安ドル高となりました。その他の通貨ではトルコリラなど一部を除き、多くの通貨に対して円安となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである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	14.4%
2	半導体・半導体製造装置	8.6
3	素材	8.3
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.8
5	メディア・娯楽	6.6
6	一般消費財・サービス流通・小売り	5.2
7	エネルギー	4.6
8	食品・飲料・タバコ	3.7
9	資本財	3.7
10	自動車・自動車部品	3.1

期末

No.	業種	組入比率
1	銀行	15.7%
2	半導体・半導体製造装置	11.2
3	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.4
4	素材	6.9
5	メディア・娯楽	5.4
6	エネルギー	5.1
7	資本財	4.5
8	一般消費財・サービス流通・小売り	4.5
9	自動車・自動車部品	3.6
10	食品・飲料・タバコ	3.2



(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19.4%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを1.2%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) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	9円 (7) (2) (0) (0)	0.057% (0.043) (0.014) (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)	13 (13) (0) (0)	0.087 (0.087) (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)	34 (24) (10)	0.221 (0.155) (0.066)	(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	56	0.364	
期中の平均基準価額は15,373円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2023年4月19日から2024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 4,141.97 (△237.36)	千アメリカ・ドル 5,661 (-)	百株 7,939.09	千アメリカ・ドル 10,934
	香 港	百株 238,932 (1,736.93)	千香港・ドル 388,003 (△346)	百株 407,896.57	千香港・ドル 541,915
	台 湾	百株 102,289.41 (2,437.15)	千台湾・ドル 1,020,740 (△4,964)	百株 154,676.1	千台湾・ドル 1,488,893
	ト ル コ	百株 6,216.31 (5,292.21)	千トルコ・リラ 36,995 (-)	百株 11,165.9	千トルコ・リラ 57,404
	メ キ シ コ	百株 18,823.65 (2,346)	千メキシコ・ペソ 83,145 (-)	百株 35,274.8	千メキシコ・ペソ 124,160
	フ ィ リ ピ ン	百株 10,716.3 (△157.45)	千フィリピン・ペソ 71,232 (△71)	百株 25,075.94	千フィリピン・ペソ 122,349
	チ リ	百株 175,801.35 (14.57)	千チリ・ペソ 965,084 (-)	百株 75,484.42	千チリ・ペソ 1,438,830
	コ ロ ン ビ ア	百株 71.12 (-)	千コロンビア・ペソ 249,512 (-)	百株 378.07	千コロンビア・ペソ 890,331
	ク ウ ェ ー ト	百株 6,704.76 (1,123.25)	千クウェート・ディナール 498 (-)	百株 10,076.61	千クウェート・ディナール 751

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	カタール	百株 11,005.72 (-)	千カタール・リアル 7,025 (-)	百株 13,553.29	千カタール・リアル 9,773
	サウジアラビア	百株 8,578.79 (1,982.08)	千サウジアラビア・リアル 35,518 (-)	百株 12,083.81	千サウジアラビア・リアル 47,696
	インド	百株 60,950.74 (6,472.94)	千インド・ルピー 3,236,415 (-)	百株 56,153.11	千インド・ルピー 3,945,854
	インドネシア	百株 1,088,076 (5,960)	千インドネシア・ルピア 73,042,490 (-)	百株 481,736	千インドネシア・ルピア 92,702,980
	アラブ首長国連邦	百株 12,141.88 (-)	千アラブ首長国連邦・ディルハム 10,016 (-)	百株 17,633.82	千アラブ首長国連邦・ディルハム 14,874
	ブラジル	百株 22,408 (1,262.62)	千ブラジル・レアル 52,046 (△27)	百株 34,191.25	千ブラジル・レアル 81,907
	チエコ	百株 388.4 (-)	千チエコ・コルナ 6,848 (-)	百株 363.91	千チエコ・コルナ 10,101
	韓国	百株 4,848.79 (85.25)	千韓国・ウォン 38,326,937 (△19,765)	百株 7,634.67	千韓国・ウォン 52,136,375
	中国	百株 62,972.04 (1,799.25)	千オフショア・人民元 78,461 (-)	百株 73,942.67	千オフショア・人民元 99,059
	マレーシア	百株 29,815 (-)	千マレーシア・リンギット 13,672 (-)	百株 44,046	千マレーシア・リンギット 19,990
	南アフリカ	百株 8,333.17 (-)	千南アフリカ・ランド 110,694 (△475)	百株 14,343.29	千南アフリカ・ランド 198,680
	タイ	百株 62,489 (2,641.5)	千タイ・バーツ 133,691 (-)	百株 78,836	千タイ・バーツ 227,722
	ポーランド	百株 1,697.75 (-)	千ポーランド・ズロチ 7,601 (-)	百株 2,503.25	千ポーランド・ズロチ 11,015
ハンガリー	百株 172.4 (-)	千ハンガリー・フォリント 132,641 (-)	百株 339.51	千ハンガリー・フォリント 270,398	
ユーロ 区	百株 3,440.77 (-)	千ユーロ 1,178 (△8)	百株 3,418.85	千ユーロ 1,343	

(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) 投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	— (12.04)	— (28)	12.04 (—)	19 (—)
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	50.8 (—)	9,918 (—)	82.49 (—)	16,519 (—)
GRUPO TELEVISIA SAB	69.3 (—)	1,181 (—)	316.2 (—)	4,158 (—)
CEMEX SAB DE CV	430.7 (—)	5,226 (—)	678.5 (—)	8,792 (—)
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	34.1 (—)	846 (—)	101.2 (—)	2,562 (—)
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	4.6 (—)	695 (—)	14.2 (—)	2,103 (—)
ブラジル	千□	千ブラジル・リアル	千□	千ブラジル・リアル
BANCO SANTANDER BRASIL SA	— (—)	— (—)	8.3 (—)	223 (—)
ENERGISA SA	18.4 (—)	875 (—)	14.6 (—)	707 (—)
KLABIN SA	— (—)	— (—)	18.7 (—)	430 (—)
BANCO BTG PACTUAL SA	36.4 (—)	1,154 (—)	55.9 (—)	1,870 (—)
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	119.486 (—)	1,389 (—)	441.09 (—)	4,953 (—)

(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。

(3) 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 89,599	百万円 90,061	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	78,631,663千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	85,385,717千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.92

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2023年4月19日から2024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	517.04	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	179.59	156.44	243	37,671	金属・鉱業
SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF (※1)	242.1	242.1	0	0	石油・ガス・消耗燃料
CREDICORP LTD	68.17	54	869	134,279	銀行
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR (※1)	423.11	423.11	0	0	無線通信サービス
SOUTHERN COPPER CORP	82.72	68.34	780	120,515	金属・鉱業
GAZPROM PJSC (※2)	9,669.42	9,669.42	0	0	石油・ガス・消耗燃料
LUKOIL PJSC (※2)	338.45	338.45	0	0	石油・ガス・消耗燃料
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	3,060.34	2,195.22	353	54,590	銀行
INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	827	890	181	27,961	石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	864.88	—	—	—	不動産管理・開発
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	574.4	515.68	105	16,264	ソフトウェア
EFG HOLDING S.A.E. -GDR	502.59	628.24	43	6,792	資本市場
SURGUTNEFTEGAZ ADR (※1)	710.84	710.84	0	0	石油・ガス・消耗燃料
X5 RETAIL GROUP NV GDR (※1)	160.03	160.03	0	0	生活必需品流通・小売り
NOVATEK PJSC GDR (※1)	74.13	74.13	0	0	石油・ガス・消耗燃料
NOVOLIPETSK STEEL GDR (※1)	132.6	132.6	0	0	金属・鉱業
MMC NORILSK NICKEL ADR (※1)	539.53	539.53	0	0	金属・鉱業
MAGNIT PJSC (※2)	75.74	75.74	0	0	生活必需品流通・小売り
ROSNEFT OIL CO PJSC (※2)	1,079.51	1,079.51	0	0	石油・ガス・消耗燃料
SEVERSTAL GDR (※1)	186.08	186.08	0	0	金属・鉱業
TATNEFT ADR (※1)	195.09	195.09	0	0	石油・ガス・消耗燃料
VTB BANK PJSC (※2)	3,040,000	3,040,000	0	0	銀行
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	396.53	271.4	416	64,264	大規模小売り
TAL EDUCATION GROUP-ADR	461.95	355.82	413	63,863	各種消費者サービス
VK CO LTD GDR (※1)	98.58	98.58	0	0	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SBERBANK OF RUSSIA PJSC (※2)	8,971.12	8,971.12	0	0	銀行
YANDEX NV (※3)	256.01	256.01	0	0	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PHOSAGRO PJSC GDR (※1)	181.63	181.63	0	0	化学
H WORLD GROUP LTD ADR	181.69	164.09	619	95,653	ホテル・レストラン・レジャー
JOYY INC-ADR	43.68	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	59.96	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ZAI LAB LTD ADR	89.02	—	—	—	バイオテクノロジー
TCS GROUP HOLDING PLC GDR (※1)	99.61	99.61	0	0	銀行
QIFU TECHNOLOGY INC ADR	126.87	100	178	27,555	消費者金融
NIO INC ADR	1,294.54	1,081.22	422	65,299	自動車
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	704.12	598.63	674	104,207	娯楽
AUTOHOME INC ADR	78.01	49.83	120	18,679	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MINISO GROUP HOLDING LTD ADR	83.23	—	—	—	大規模小売り
WEIBO CORP ADR	62.61	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
KANZHUN LTD ADR	169.73	180.55	326	50,504	インタラクティブ・メディアおよびサービス
KE HOLDINGS INC ADR	627.96	521.92	672	103,833	不動産管理・開発
LEGEND BIOTECH CORP ADR	50.58	57.82	282	43,609	バイオテクノロジー
OZON HOLDINGS PLC ADR (※1)	45.37	45.37	0	0	大規模小売り
LUFAX HOLDING LTD ADR	604.38	—	—	—	消費者金融
PDD HOLDINGS INC ADR	482.84	470.54	5,337	824,404	大規模小売り
YUM CHINA HOLDINGS INC	396.96	322.05	1,187	183,455	ホテル・レストラン・レジャー
IQIYI INC ADR	404.57	334.39	139	21,537	娯楽
POLYUS PJSC GDR (※1)	67.87	67.87	0	0	金属・鉱業
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	396.34	341.64	659	101,898	航空貨物・物流サービス
小計	株数 3,076,939.12	株数 3,072,904.64	外貨建金額 14,028	邦貨換算金額 2,166,842	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
JIANGXI COPPER CO LTD	910	880	1,383	27,293	金属・鉱業

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
JIANGSU EXPRESS	1,440	1,020	809	15,978	運送インフラ
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	2,060	—	—	—	旅客航空輸送
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	120	87	931	18,375	飲料
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	1,090	855	1,480	29,217	建設資材
BEIJING ENTERPRISES	415	425	1,009	19,914	ガス
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	3,900	3,200	1,625	32,073	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	4,420	4,760	1,256	24,793	生活必需品流通・小売り
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	1,540	1,790	3,236	63,852	石油・ガス・消耗燃料
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	675	510	1,259	24,853	パーソナルケア用品
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	—	2,340	1,649	32,548	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	8,436	7,276	4,227	83,405	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	3,541.2	3,201.2	3,623	71,496	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	3,008.88	2,613.88	6,051	119,388	不動産管理・開発
CITIC LTD	5,720	4,630	3,180	62,757	コングロメリット
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	1,480	—	—	—	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	6,760	6,100	5,038	99,411	コンピュータ・周辺機器
PETRO CHINA CO LTD	19,920	16,480	12,244	241,586	石油・ガス・消耗燃料
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	1,227.9	1,163.9	725	14,306	保険
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONIC	290	—	—	—	半導体・半導体製造装置
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	23,952	19,672	8,891	175,434	石油・ガス・消耗燃料
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	770	740	685	13,534	ホテル・レストラン・レジャー
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	2,570	2,210	1,726	34,054	ソフトウェア
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	743	641	3,983	78,600	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	3,580	2,860	2,067	40,797	ガス
COSCO SHIPPING PORTS LTD	2,160	940	408	8,067	運送インフラ
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,522	1,112	418	8,249	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	1,160	1,080	1,086	21,436	運送インフラ
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD	3,800	3,100	1,581	31,193	金属・鉱業
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	1,305	—	—	—	運送インフラ
CHINA GAS HOLDINGS LTD	2,878	1,990	1,391	27,444	ガス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	585	545	806	15,914	電子装置・機器・部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	5,690	4,820	4,294	84,732	自動車
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	882	649	1,534	30,283	ガス
BYD CO LTD	785	815	16,609	327,709	自動車
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	2,000	1,600	1,486	29,326	エネルギー設備・サービス
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	4,115.92	—	—	—	商業サービス・用品
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	3,000	—	—	—	情報技術サービス
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	130	100	939	18,526	海上運輸
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	6,497.88	5,617.88	5,612	110,729	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	2,190	2,190	676	13,351	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	1,932	1,532	3,014	59,485	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	2,860	1,900	2,097	41,385	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	7,200	5,840	5,156	101,742	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	5,470	4,190	7,273	143,512	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	2,264	1,944	923	18,218	ヘルスケア機器・用品
WEICHAI POWER CO LTD	1,894.4	1,524.4	2,588	51,069	機械
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	—	1,140	998	19,703	石油・ガス・消耗燃料
TINGYI HOLDING CORP	2,020	1,800	1,492	29,441	食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	580	460	2,366	46,694	飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	2,540	2,060	725	14,306	水道
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	3,160	—	—	—	医薬品
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	1,533.33	1,293.33	4,151	81,910	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	1,000	940	475	9,384	運送インフラ
SINO BIOPHARMACEUTICAL	10,222.5	8,232.5	2,025	39,957	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,980	2,390	3,651	72,052	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	5,942	5,202	156,476	3,087,274	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	6,060	5,250	15,828	312,301	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
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
LI NING CO LTD	2,240	1,935	3,335	65,818	繊維・アパレル・贅沢品
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	2,660	2,680	511	10,099	水道
CHINA POWER INTERNATIONAL	5,430	3,480	1,117	22,039	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	1,960	1,560	567	11,203	旅客航空輸送
ZTE CORP	706.88	632.88	1,007	19,878	通信機器
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	3,210	2,665	8,687	171,412	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	2,852.5	2,212.5	1,911	37,715	海上運輸
BANK OF COMMUNICATIONS	8,052.05	6,862.05	3,568	70,401	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	2,162.5	1,402.5	1,231	24,295	建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	645	515	1,279	25,249	電子装置・機器・部品
BAIDU INC	2,105.5	1,775	16,525	326,043	インタラクティブ・メディアおよびサービス
CHINA CONSTRUCTION BANK	91,335.3	75,225.3	35,957	709,445	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	778	667	4,655	91,856	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,440	2,020	563	11,119	自動車
MINITH GROUP LTD	820	-	-	-	自動車用部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	1,620	-	-	-	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	3,700	3,200	966	19,067	建設資材
BANK OF CHINA LTD	75,262	61,802	20,271	399,947	銀行
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	840	-	-	-	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	3,724.7	3,084.7	9,793	193,234	銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H	54,302.35	51,062.35	20,527	404,998	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	970	950	1,204	23,766	金属・鉱業
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	1,125	-	-	-	電子装置・機器・部品
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	2,856	1,476	538	10,629	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	2,090	1,400	1,162	22,926	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	500	550	1,399	27,617	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	535	376	1,094	21,587	機械
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	12,801.42	-	-	-	不動産管理・開発
CMOC GROUP LIMITED	3,030	3,150	2,321	45,804	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	8,418	6,788	2,918	57,588	銀行
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	671	587	2,198	43,372	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,156	1,022	8,339	164,538	繊維・アパレル・贅沢品
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	350	-	-	-	家庭用品
FOSUN INTERNATIONAL	2,130.28	2,420.28	1,026	20,246	コングロメリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	5,580	-	-	-	不動産管理・開発
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	2,840	3,160	1,251	24,689	繊維・アパレル・贅沢品
KINGSOFT CORP LTD	988	762	1,882	37,134	娯楽
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	19,060	15,820	1,756	34,646	半導体・半導体製造装置
SINOTRUK HONG KONG LTD	-	480	1,080	21,308	機械
CHINA RAILWAY GROUP LTD	3,950	3,510	1,446	28,531	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	1,520	-	-	-	食品
DONGYUE GROUP	1,590	-	-	-	化学
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	710	635	1,568	30,945	通信機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,920	4,230	1,865	36,804	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	2,494	1,960	2,916	57,542	保険
CRRC CORP LTD - H	3,960	3,420	1,590	31,376	機械
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	1,145	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	1,430	920	648	12,796	医薬品
SINOPHARM GROUP CO	1,224	1,040	2,063	40,710	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	1,920	-	-	-	建設資材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	2,905.27	2,145.27	662	13,078	自動車
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	2,090	2,040	2,031	40,088	金属・鉱業
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	3,100	2,280	1,290	25,461	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	613	704	753	14,862	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	1,850	1,416	1,458	28,775	専門小売り
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	990	970	513	10,124	機械
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,710	1,550	1,426	28,134	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	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	883	690	903	17,833	保険
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	6,281.56	5,316.56	1,462	28,846	銀行
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	1,060	—	—	—	建設関連製品
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,270	2,270	513	10,121	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	28,560	21,570	7,312	144,270	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	615	680	874	17,253	専門小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,200	1,690	941	18,572	金融サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	612	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
CITIC SECURITIES CO LTD	1,950	1,290	1,426	28,149	資本市場
HAITONG SECURITIES CO LTD	2,604	2,396	838	16,545	資本市場
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	8,360	6,720	1,693	33,411	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	460	270	311	6,136	医薬品
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	3,480	2,650	1,014	20,024	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	1,760	—	—	—	不動産管理・開発
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	7,140	5,860	2,326	45,900	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	410	—	—	—	食品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	1,140	840	966	19,059	ライフサイエンス・ツール/サービス
EAST BUY HOLDING LTD	425	325	510	10,067	生活必需品流通・小売り
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	2,020	—	—	—	不動産管理・開発
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	561	—	—	—	生活必需品流通・小売り
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	617.5	640	1,162	22,930	金属・鉱業
CHINA TOWER CORP LTD	42,920	36,740	3,306	65,239	各種電気通信サービス
XIAOMI CORP	14,496	12,164	19,802	390,713	コンピュータ・周辺機器
BEIGENE LTD	582	546	4,425	87,311	バイオテクノロジー
WUXI APPTec CO LTD	344.12	241.12	829	16,365	ライフサイエンス・ツール/サービス
MEITUAN	4,712.1	4,002.1	39,040	770,268	ホテル・レストラン・レジャー
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	1,280	1,048	2,310	45,592	ホテル・レストラン・レジャー
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	1,020	1,360	2,238	44,166	ホテル・レストラン・レジャー
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	4,900	3,860	2,084	41,125	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	1,030	985	3,378	66,658	バイオテクノロジー
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	9,970	8,920	561	11,087	資本市場
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	520	—	—	—	専門小売り
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	1,435	—	—	—	建設・土木
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	—	403	945	18,645	自動車
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	1,520	1,330	674	13,304	専門小売り
HANSON PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,280	880	1,388	27,397	医薬品
CHINA FEIHE LTD	3,740	3,410	1,404	27,719	食品
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	14,176.68	12,801.68	87,051	1,717,524	大規模小売り
PHARMARON BEIJING CO LTD	193	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
JD.COM INC	2,063.85	1,851.35	18,282	360,705	大規模小売り
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	1,840	1,400	957	18,893	タバコ
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	76	76	503	9,926	専門小売り
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	690	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
KUAISHOU TECHNOLOGY	1,672	1,862	8,500	167,705	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HAIER SMART HOME CO LTD	2,202	1,978	5,043	99,516	家庭用耐久財
BILIBILI INC	194.2	156.4	1,373	27,093	娯楽
AKESO INC	410	400	1,870	36,895	バイオテクノロジー
NETEASE INC	1,876	1,527	21,545	425,101	娯楽
GDS HOLDINGS LTD	905	—	—	—	情報技術サービス
ZAI LAB LTD	—	705	789	15,578	バイオテクノロジー
NONGFU SPRING CO LTD	1,656	1,570	6,672	131,648	飲料
LI AUTO INC	1,058	906	10,409	205,388	自動車
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	1,047	880.5	2,033	40,129	生活必需品流通・小売り
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	302	304	881	17,393	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	692	632	1,636	32,295	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	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	126	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	1,746.61	1,631.61	623	12,297	不動産管理・開発
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	1,504	1,179	7,934	156,551	各種消費者サービス
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	496	356	1,087	21,457	専門小売り
JD LOGISTICS INC	—	1,481	1,118	22,061	航空貨物・物流サービス
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	—	240	1,104	21,781	パーソナルケア用品
TRIP.COM GROUP LTD	—	434.5	16,641	328,333	ホテル・レストラン・レジャー
XPENG INC	786	862	2,435	48,045	自動車
MINISO GROUP HOLDING LTD	—	286	1,111	21,922	大規模小売り
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	530	420	608	11,998	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD	10,430	8,260	2,147	42,372	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GF SECURITIES CO LTD	1,060	832	611	12,065	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	616	484	1,957	38,626	自動車用部品
HUATAI SECURITIES CO LTD	1,494	806	698	13,787	資本市場
3SBIO INC	1,465	—	—	—	バイオテクノロジー
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	1,825	955	454	8,968	医薬品
CHINA LITERATURE LTD	386	272	701	13,845	メディア
FLAT GLASS GROUP CO LTD	430	250	429	8,474	半導体・半導体製造装置
DALI FOODS GROUP CO LTD	2,615	—	—	—	食品
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	1,450	1,000	410	8,089	不動産管理・開発
BOC AVIATION LTD	236	135	843	16,647	商社・流通業
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	617	612	741	14,634	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	1,240	980	1,254	24,749	自動車
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	1,440	1,228	1,025	20,230	資本市場
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	3,410	3,080	4,102	80,943	ライフサイエンス・ツール/サービス
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	4,360	5,200	878	17,338	娯楽
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	372.4	330.4	773	15,253	化学
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	700	600	802	15,839	不動産管理・開発
小計	株数	株数	金額	金額	
	810,633.78	643,406.14	816,768	16,114,834	
	191銘柄	168銘柄	—	<17.5%>	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	489.06	406.33	16,578	78,789	通信機器
ACER INC	2,573.85	2,139.47	9,638	45,807	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	668.28	571.08	24,470	116,299	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	425.9	372.97	21,259	101,036	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	2,361.05	1,647.78	6,830	32,460	建設資材
TAIWAN BUSINESS BANK	5,515.58	4,983.99	7,974	37,899	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	960	830.53	7,034	33,432	半導体・半導体製造装置
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	—	416.46	12,826	60,961	コンピュータ・周辺機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	700	573.35	9,259	44,007	コンピュータ・周辺機器
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	1,185.01	1,095.25	19,604	93,174	電子装置・機器・部品
QUANTA COMPUTER INC	2,535.29	2,156.97	54,894	260,893	コンピュータ・周辺機器
EVA AIRWAYS CORP	2,550	1,919.77	5,951	28,284	旅客航空輸送
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	657.6	449.75	9,242	43,925	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	4,354.21	3,776.85	6,722	31,950	銀行
CHINA AIRLINES	2,900	2,318.23	4,462	21,208	旅客航空輸送
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	1,781.69	1,606.84	7,712	36,656	自動車用部品
CHINA STEEL CORP	11,182.31	9,646.7	23,586	112,095	金属・鉱業
ADVANTECH CO LTD	386.68	389.79	14,461	68,728	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS INC	3,902.91	3,534.45	12,582	59,800	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,859.04	1,539.77	46,270	219,903	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,340	1,107.88	7,145	33,961	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,672.99	3,005.65	37,119	176,415	各種電気通信サービス
AUO CORP	6,186.49	5,265	9,240	43,914	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,681	1,477.84	15,073	71,640	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP	948.26	746.24	12,723	60,469	海上運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	3,013.39	2,257.68	7,213	34,281	コングロマリット

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	447.68	401.31	6,320	30,039	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE CO LTD	193.22	147.8	7,316	34,770	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	545.64	469.61	29,162	138,599	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	3,939.52	3,128.57	21,211	100,810	化学
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	3,339.38	2,810.26	15,062	71,588	化学
GIANT MANUFACTURING	312.44	-	-	-	レジャー用品
MEDIATEK INC	1,449.75	1,198.81	125,875	598,233	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	7,123.07	6,014.88	39,698	188,669	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	8,260.67	6,780.42	15,222	72,344	銀行
HOTAI MOTOR CO LTD	280.81	235.56	14,274	67,843	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	1,650	1,503.43	12,087	57,447	無線通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,464.4	7,891	23,673	112,508	金融サービス
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	8,249.24	7,306.72	34,999	166,337	保険
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	14,338.46	12,343.86	16,479	78,318	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	12,089.06	11,032.18	29,235	138,943	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	12,017.73	9,831.77	144,035	684,542	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	10,509.83	9,091.73	35,457	168,516	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	95.66	76.04	16,728	79,505	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	9,990.73	9,343.91	16,398	77,935	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	12,453.81	10,480.98	8,510	40,447	保険
INVENTEC CO LTD	2,700.05	1,968.49	10,649	50,612	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,913.35	1,652.21	15,910	75,617	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	10,494.72	8,366.86	18,030	85,692	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	16,741.73	13,870.73	43,692	207,654	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,941.62	8,599.97	23,133	109,946	銀行
NAN YA PLASTICS CORP	4,511.51	3,758.94	20,674	98,256	化学
WISTRON CORP	-	2,102.11	24,069	114,391	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP	2,339.9	1,682.25	5,803	27,582	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	4,625.95	3,684.78	27,783	132,042	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	523.09	437.96	11,934	56,719	生活必需品流通・小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,127.06	873.41	6,140	29,181	石油・ガス・消耗燃料
E INK HOLDINGS INC	839.2	686.2	15,713	74,682	電子装置・機器・部品
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,743.36	1,215.17	4,234	20,126	不動産管理・開発
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	1,161.74	907.18	6,985	33,198	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT CORP	5,712.01	5,481.63	17,897	85,059	建設資材
TAIWAN SEMICONDUCTOR	23,548.79	19,374.36	1,557,698	7,403,118	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	11,311.88	8,998.43	45,262	215,112	半導体・半導体製造装置
WAN HAI LINES LTD	787.47	514.82	2,203	10,472	海上運輸
WALSIN LIHWA CORP	2,461.63	2,216.05	8,941	42,496	電気設備
WINBOND ELECTRONICS CORP	2,580.59	2,476.93	6,452	30,665	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORP	329.04	271.65	16,108	76,558	電子装置・機器・部品
YANG MING MARINE TRANSPORT	1,656.08	1,259.96	5,537	26,317	海上運輸
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,930	1,454.65	4,305	20,463	送迎インフラ
GLOBAL UNICHIP CORP	-	69.04	8,284	39,374	半導体・半導体製造装置
INNOLUX CORPORATION	9,107.42	6,913.96	9,437	44,852	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD	1,652.03	1,191.87	11,012	52,339	電子装置・機器・部品
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	200.79	175.65	3,188	15,151	電子装置・機器・部品
EMEMORY TECHNOLOGY INC	60.64	49.25	11,672	55,473	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	1,918.8	1,588.74	15,315	72,788	コンピュータ・周辺機器
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	-	56.57	16,405	77,967	半導体・半導体製造装置
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	130.87	112.48	12,541	59,604	機械
WIN SEMICONDUCTORS CORP	304.7	-	-	-	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,350.42	1,203.33	20,516	97,508	金融サービス
PARADE TECHNOLOGIES LTD	80	58.51	4,938	23,469	半導体・半導体製造装置
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	629.23	469.6	5,329	25,331	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	9,165.76	7,762.14	19,948	94,808	銀行
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	3,834.37	3,225.7	14,967	71,133	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	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	59.93	49.34	8,042	38,222	電気設備
WIIWYNN CORP	80	77.91	18,620	88,495	コンピュータ・周辺機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	3,129.76	2,447.35	38,178	181,447	半導体・半導体製造装置
SILERGY CORP	303.33	263.96	9,726	46,228	半導体・半導体製造装置
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	2,630.9	2,486.47	5,880	27,947	半導体・半導体製造装置
PHARMAESSENTIA CORP	205.76	175.93	5,401	25,669	バイオテクノロジー
MOMO.COM INC	66	-	-	-	大規模小売り
GLOBALWAFERS CO LTD	200.53	171.28	9,317	44,282	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	151.7	146.58	5,306	25,218	家庭用耐久財
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	3,174,827	15,088,683	
			-	<16.4%>	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
AKBANK TAS	2,866.08	2,245.07	12,583	59,831	銀行
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	738.27	1,088.54	6,280	29,863	航空宇宙・防衛
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	1,257.64	1,076.71	4,319	20,539	金属・鉱業
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	74.1	56.91	6,362	30,251	自動車
HEKTAS TICARET TAS	1,211.18	-	-	-	化学
KOC HOLDING AS	715.98	598.63	12,984	61,736	コングロマリット
SASA POLYESTER SANAYI	469.86	1,052.3	4,196	19,953	化学
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	1,445.86	1,090	5,090	24,202	コングロマリット
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	-	95.53	2,481	11,798	自動車
TURK HAVA YOLLARI	496.83	446.86	13,193	62,731	旅客航空輸送
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,060.83	838.1	6,277	29,847	無線通信サービス
TURKIYE IS BANKASI	3,158.42	6,571.93	8,057	38,309	銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	948.78	798.7	14,895	70,824	石油・ガス・消耗燃料
YAPI VE KREDI BANKASI AS	3,137.27	2,811.9	8,598	40,884	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING AS	923.61	827.71	6,911	32,861	銀行
COCA-COLA ICECEK AS	-	63.4	4,216	20,046	飲料
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	399.99	369.89	14,342	68,194	生活必需品流通・小売り
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	784.29	-	-	-	金属・鉱業
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	34.88	34.31	2,880	13,695	旅客航空輸送
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	133,672	635,571	
			-	<0.7%>	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
ALFA SAB DE CV	2,346	2,629	3,191	29,055	コングロマリット
GRUPO BIMBO SAB DE CV	1,304	1,052	6,960	63,362	食品
GRUMA SAB DE CV	182.7	161.15	5,023	45,734	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	226.6	158.6	2,776	25,275	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV	485	421	5,725	52,124	コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	2,474	2,068	35,457	322,798	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	842.25	870.25	2,919	26,579	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	123.1	154.95	4,728	43,050	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	1,364	1,216	4,583	41,723	家庭用品
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	187.55	139.5	7,188	65,441	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV	2,938.52	2,506.52	25,624	233,274	金属・鉱業
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	2,199	1,532	7,517	68,437	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	447	397	6,656	60,602	飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	4,998	4,192	26,719	243,249	生活必需品流通・小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	348.65	327.25	8,579	78,102	運送インフラ
GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	-	228	3,679	33,498	運送インフラ
OPERADORA DE SITOS MEXICANOS SA DE CV	1,014	1,040	2,057	18,727	各種電気通信サービス
AMERICA MOVIL SAB DE CV	26,406.78	14,816.78	22,669	206,377	無線通信サービス
BANCO DEL BAJIO SA	686	558	3,398	30,936	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	185,457	1,688,351	
			-	<1.8%>	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
AYALA LAND INC	7,555	4,968	13,388	36,150	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	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,581.2	1,513.9	6,070	16,391	コングロマリット
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	2,049.93	1,444.48	17,044	46,022	銀行
AYALA CORP	210.83	214.63	12,738	34,394	コングロマリット
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	963.7	797.6	25,124	67,838	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC	3,182.9	2,049.6	5,984	16,159	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORP	469.6	342.4	7,656	20,672	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,433.05	1,164.55	7,686	20,753	銀行
BDO UNIBANK INC	2,300.62	1,896.82	28,452	76,824	銀行
PLDT INC	89.85	56.9	7,397	19,972	無線通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	10,577.75	8,433.75	23,825	64,330	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	736.1	754.5	7,243	19,557	食品
SM INVESTMENTS CORP	241.33	193.83	18,181	49,091	コングロマリット
MANILA ELECTRIC COMPANY	247.2	244.2	8,791	23,737	電力
ACEN CORP	461.19	-	-	-	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MONDE NISSIN CORP	6,492	-	-	-	食品
小計	株数・金 銘柄数<比率>	株数・金 銘柄数<比率>	189,584	511,896	<0.6%>
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	68,685.1	52,798.08	242,079	38,211	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	57.09	70.27	186,981	29,514	銀行
BANCO DE CHILE	46,141.1	34,257.13	367,236	57,966	銀行
EMPRESAS CMPC SA	1,192.58	849.02	161,313	25,462	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	404.23	299.69	209,783	33,113	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	105.16	-	-	-	飲料
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	11,784.8	11,739.23	84,170	13,285	海上運輸
ENEL AMERICAS SA	21,331.52	16,834.61	152,841	24,125	電力
LATAM AIRLINES GROUP SA	-	138,235.87	170,306	26,882	旅客航空輸送
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	133.94	115.01	519,155	81,946	電気設備
FALABELLA SA	807.36	634.7	156,136	24,645	大規模小売り
CENCOSUD SA	1,169.08	1,162.72	191,499	30,227	生活必需品流通・小売り
ENEL CHILE SA	24,157.02	19,304.15	109,068	17,216	電力
小計	株数・金 銘柄数<比率>	株数・金 銘柄数<比率>	2,550,571	402,597	<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	485.42	311.05	572,332	22,643	電力
BANCOLOMBIA SA	203.22	200.49	686,477	27,159	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	456.92	327.07	1,062,977	42,054	銀行
小計	株数・金 銘柄数<比率>	株数・金 銘柄数<比率>	2,321,787	91,856	<0.1%>
(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	7,714.53	7,352.44	522	262,217	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	1,997	1,523.16	73	37,107	無線通信サービス
GULF BANK KSCP	1,363.55	1,543.4	39	20,079	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	7,175.18	6,316.68	533	268,112	銀行
AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	1,379.27	1,251.43	64	32,310	航空貨物・物流サービス
MABANEE CO KPSC	727.04	490.98	38	19,286	不動産管理・開発
BOUBAYAN BANK KSCP	1,444.41	1,074.29	65	33,079	銀行
小計	株数・金 銘柄数<比率>	株数・金 銘柄数<比率>	1,338	672,192	<0.7%>
(カタール)	百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR NATIONAL BANK	4,414.61	3,646.84	5,196	220,497	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	3,122.67	2,686.21	1,141	48,439	銀行
OOREDOO QSC	860.85	609.2	620	26,339	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	513.75	462.22	686	29,123	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	384.78	374.16	606	25,750	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	866.84	696.58	726	30,826	銀行
INDUSTRIES QATAR QSC	1,384.6	1,122.06	1,374	58,321	コングロマリット

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カタル)	百株	百株	千カタル・リアル	千円	
QATAR ISLAMIC BANK SAQ	1,556.84	1,352.11	2,495	105,905	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	2,494.88	1,901.07	745	31,619	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN	5,542.59	4,791.5	1,212	51,435	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	2,038.13	1,901.41	555	23,557	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	4,516.62	4,291.05	819	34,775	化学
DUKHAN BANK	-	1,315.18	511	21,707	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	16,693	708,299	
	12銘柄	13銘柄	-	<0.8%>	
(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	260.55	215.87	804	33,161	化学
JARIR MARKETING CO	61.27	454.3	662	27,316	専門小売り
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	-	56.9	853	35,198	保険
ETIHAD ETISALAT CO	385.69	311.95	1,600	65,996	無線通信サービス
SAUDI BRITISH BANK	856.85	803.49	3,213	132,543	銀行
AL RAJHI BANK	1,867.14	1,530.72	12,322	508,171	銀行
ARAB NATIONAL BANK	584.12	555.19	1,612	66,512	銀行
BANK ALBILAD	479.8	385.73	1,749	72,140	銀行
BANK AL-JAZIRA	417.43	299.17	633	26,131	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	536.56	475.79	1,736	71,618	銀行
RIYAD BANK	1,246.58	1,155.71	3,253	134,167	銀行
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	525.54	450.08	741	30,589	銀行
SAUDI TELECOM CO	1,439.07	1,574.67	6,023	248,393	各種電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	198.15	183.17	2,124	87,625	化学
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	857.18	695.03	5,692	234,750	化学
SAUDI ELECTRICITY CO	756.74	707.94	1,400	57,748	電力
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	388.56	278.47	643	26,551	化学
SAVOLA GROUP	215.55	209.51	1,078	44,496	食品
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	240.22	-	-	-	化学
ALMARAI CO JSC	239.32	199.78	1,156	47,703	食品
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	39.87	31.21	777	32,048	メディア
EMAAR ECONOMIC CITY	224.94	-	-	-	不動産管理・開発
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	339.39	302.96	978	40,355	化学
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	143.97	101.64	440	18,149	化学
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	759.12	604.76	558	23,019	化学
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	473.34	385.09	528	21,788	不動産管理・開発
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	333.39	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	328.21	360.59	447	18,439	無線通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	65.5	65.1	1,518	62,607	保険
ALINMA BANK	914.69	750.68	3,171	130,797	銀行
SAUDI ARABIAN MINING CO	812.99	1,014.36	5,416	223,383	金属・鉱業
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	50.36	79.75	1,102	45,452	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DALLAH HEALTHCARE CO	41.27	25.53	428	17,688	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO	2,300.08	2,061.98	6,175	254,682	石油・ガス・消耗燃料
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	85.1	69.66	2,197	90,607	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ACWA POWER CO	79.4	75.78	3,193	131,694	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	-	39.81	613	25,316	化学
ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	26.27	16.86	601	24,822	情報技術サービス
NAHDI MEDICAL CO	42.79	32.77	462	19,055	生活必需品流通・小売り
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	52.02	35	910	37,528	資本市場
ELM CO	24.2	19.59	1,782	73,518	情報技術サービス
POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU	-	66.35	444	18,333	総合公益事業
ADES HOLDING CO	-	263.33	523	21,589	エネルギー設備・サービス
THE SAUDI NATIONAL BANK	2,085.06	2,309.07	8,705	359,002	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	88,280	3,640,699	
	40銘柄	41銘柄	-	<4.0%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	2,915.11	2,388.22	700,106	1,302,198	石油・ガス・消耗燃料

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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	886.86	591.89	35,057	65,207	石油・ガス・消耗燃料
ASIAN PAINTS LTD	362.3	306.91	86,855	161,551	化学
BANK OF BARODA	942.2	743.65	18,940	35,229	銀行
EICHER MOTORS LTD	133.32	111.49	48,561	90,324	自動車
GRASIM INDUSTRIES LTD	241.84	214.88	48,196	89,645	建設資材
HDFC BANK LTD	-	2,194.63	331,224	616,077	銀行
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	831.51	737.64	149,836	278,696	自動車
SHREE CEMENT LTD	11.1	6.37	15,850	29,481	建設資材
ICICI BANK LTD	4,955.54	4,064.12	433,661	806,611	銀行
INDUSIND BANK LTD	-	217.21	32,384	60,235	銀行
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	689.31	425.9	19,955	37,117	石油・ガス・消耗燃料
STATE BANK OF INDIA LTD	1,718.79	1,391.71	104,614	194,583	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	282.93	196.95	18,648	34,685	陸上運輸
TATA STEEL LTD	7,003.46	5,841.62	93,495	173,900	金属・鉱業
TATA MOTORS LTD	1,582.84	1,306.79	129,738	241,312	自動車
JSW STEEL LTD	716.65	473.96	40,061	74,514	金属・鉱業
TATA COMMUNICATIONS LTD	-	83.25	15,682	29,168	各種電気通信サービス
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	521.02	456.53	51,845	96,433	食品
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	28.95	20.47	16,177	30,089	金融サービス
TATA POWER CO LTD	1,496.77	1,164.8	50,132	93,247	電力
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	106.84	86.9	41,196	76,625	食品
NESTLE INDIA LTD	31.63	261.23	66,511	123,711	食品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	-	821.26	21,167	39,372	電気設備
GAIL INDIA LTD	2,149.62	1,763.91	36,310	67,536	ガス
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	534.17	858.6	153,912	286,277	銀行
VEDANTA LTD	748.77	679.08	25,682	47,770	金属・鉱業
SUPREME INDUSTRIES LTD	-	44.91	18,391	34,207	化学
AXIS BANK LTD	2,180.25	1,793.47	188,655	350,898	銀行
TITAN COMPANY LTD	337.01	285.58	104,119	193,662	繊維・アパレル・贅沢品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,328.74	2,537.43	71,847	133,636	石油・ガス・消耗燃料
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	102.6	116.12	31,372	58,353	パーソナルケア用品
BHARAT ELECTRONICS LTD	3,517.92	2,942.08	68,682	127,750	航空宇宙・防衛
LUPIN LTD	175.11	176.11	28,379	52,785	医薬品
NMDC LTD	-	815.82	19,616	36,486	金属・鉱業
MPHASIS LTD	88.86	52.63	12,147	22,593	情報技術サービス
ACC LTD	51.68	-	-	-	建設資材
BAJAJ FINANCE LTD	260.02	219.1	152,367	283,403	消費者金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	1,657.1	-	-	-	金融サービス
INFOSYS LTD	3,216.1	2,613.92	369,725	687,690	情報技術サービス
WIPRO LTD	1,290.52	1,054	47,256	87,896	情報技術サービス
TATA ELXSI LTD	34.06	24.5	18,448	34,314	ソフトウェア
MRF LTD	1.65	1.75	22,777	42,365	自動車用部品
INDIAN OIL CORP LTD	2,588.17	2,319.8	39,204	72,920	石油・ガス・消耗燃料
HINDUSTAN UNILEVER LTD	783.39	644.08	143,037	266,049	パーソナルケア用品
TRENT LTD	182.69	148.59	59,260	110,224	専門小売り
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	93.66	82.12	52,020	96,758	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CUMMINS INDIA LTD	-	117.53	36,676	68,219	機械
HCL TECHNOLOGIES LTD	899.89	759.76	112,239	208,765	情報技術サービス
DABUR INDIA LTD	635.91	484.46	24,411	45,406	パーソナルケア用品
HERO MOTOCORP LTD	105.49	90.07	38,936	72,421	自動車
SRF LTD	134.32	114.93	28,942	53,832	化学
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	65.4	51.83	12,190	22,675	自動車用部品
DR REDDYS LABORATORIES LTD	109.56	89.27	54,011	100,461	医薬品
BHARTI AIRTEL LTD	2,128.84	1,750.21	212,904	396,001	無線通信サービス
PUNJAB NATIONAL BANK LTD	-	1,750.51	22,502	41,855	銀行
UNITED SPIRITS LTD	268.7	226.98	26,121	48,586	飲料
UNION BANK OF INDIA LTD	-	1,193.19	17,092	31,791	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		
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	901.88	770.06	118,400	220,225		医薬品
DIVI'S LABORATORIES LTD	121.65	100.63	37,879	70,455		ライフサイエンス・ツール/サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	115.59	112.12	140,180	260,735		自動車
AUROBINDO PHARMA LTD	211.02	192.55	21,394	39,793		医薬品
HAVELLS INDIA LTD	227.29	197.28	29,236	54,380		電気設備
TVS MOTOR COMPANY LTD	193.01	193.42	38,212	71,074		自動車
INDRAPRASTHA GAS LTD	305.76	279.95	12,953	24,093		ガス
JINDAL STEEL & POWER LTD	327.7	272.84	24,604	45,764		金属・鉱業
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	2,104.54	1,685.9	20,947	38,961		自動車用部品
SHRIRAM FINANCE LTD	211.63	217.11	52,122	96,948		消費者金融
PETRONET LNG LTD	652.33	615.07	18,944	35,236		石油・ガス・消耗燃料
CIPLA LTD/INDIA	449.87	428.66	58,949	109,645		医薬品
LARSEN & TOUBRO LTD	656.38	530.51	187,983	349,649		建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	95.68	91.65	86,735	161,328		建設資材
ASHOK LEYLAND LTD	-	1,046.17	18,433	34,286		機械
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	875.62	709.93	274,941	511,391		情報技術サービス
ADANI ENTERPRISES LTD	149.72	136.28	42,334	78,741		商社・流通業
NTPC LTD	3,671.12	3,501.03	125,774	233,940		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
YES BANK LTD	12,307.92	9,770.54	23,400	43,524		銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	531.17	433.08	26,744	49,745		建設資材
BHARAT FORGE LTD	266.09	213.19	25,170	46,816		自動車用部品
SUZLON ENERGY LTD	-	6,473.42	26,217	48,764		電気設備
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,277.64	1,022.74	62,269	115,821		金属・鉱業
ITC LTD	2,851.79	2,358.96	100,468	186,870		タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	151.13	119.91	34,523	64,213		化学
UNITED PHOSPHORUS LTD	492.94	388.55	18,831	35,025		化学
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	98.51	82.01	20,810	38,708		医薬品
SIEMENS INDIA LTD	71.73	65.37	36,161	67,260		コンピュータソフト
INFO EDGE INDIA LTD	65.9	60.37	34,692	64,527		インタラクティブ・メディアおよびサービス
GMR INFRASTRUCTURE LTD	-	1,913.62	15,404	28,652		運送インフラ
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	536.06	439.8	22,766	42,345		電気設備
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	412.11	334.47	39,375	73,238		パーソナルケア用品
TECH MAHINDRA LTD	548.61	440.64	52,691	98,006		情報技術サービス
INDIAN HOTELS CO LTD	787	709.81	41,428	77,056		ホテル・レストラン・レジャー
MARICO LTD	530.87	393.3	19,985	37,173		食品
POWER FINANCE CORP LTD	-	1,204.94	47,781	88,874		金融サービス
PAGE INDUSTRIES LTD	5.89	5.08	18,123	33,709		繊維・アパレル・贅沢品
ABB LTD/INDIA	44.73	38.37	25,496	47,423		電気設備
DLF LTD	548.7	580.79	50,853	94,588		不動産管理・開発
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	2,940.62	3,739.75	102,562	190,766		電力
PERSISTENT SYSTEMS LTD	-	77.78	30,009	55,817		情報技術サービス
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE REC LTD	482.12	427.28	55,732	103,662		運送インフラ
BAJAJ FINSERV LTD	359.61	298.64	48,334	89,902		金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	68.64	56.35	50,259	93,482		自動車
JUBILANT FOODWORKS LTD	405.48	302.66	13,459	25,034		ホテル・レストラン・レジャー
ADANI POWER LTD	774.37	567.27	34,126	63,476		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MUTHOOT FINANCE LTD	115.65	80.95	13,221	24,591		消費者金融
COAL INDIA LTD	1,560.07	1,253.13	56,791	105,632		石油・ガス・消耗燃料
TATA MOTORS LTD	-	335.23	22,054	41,021		自動車
INDUS TOWERS LTD	643.46	-	-	-		各種電気通信サービス
PI INDUSTRIES LTD	74.18	68.56	25,656	47,721		化学
VARUN BEVERAGES LTD	205.55	366.45	51,447	95,692		飲料
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	94.03	87.31	30,747	57,189		自動車用部品
LTIMINDTREE LTD	81.99	73.01	34,043	63,320		情報技術サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	278.84	254.26	46,063	85,677		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	908.35	786.39	47,545	88,433		保険

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			
AU SMALL FINANCE BANK LTD	157.99	115.93	7,111	13,226			銀行
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	-	161	59,926	111,463			航空宇宙・防衛
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	-	74.21	27,672	51,470			資本市場
BANDHAN BANK LTD	589.28	723.75	12,582	23,403			銀行
ADANI TOTAL GAS LTD	279.88	-	-	-			ガス
GODREJ PROPERTIES LTD	126.88	97.9	25,521	47,470			不動産管理・開発
POLYCAB INDIA LTD	-	33.86	17,835	33,174			電気設備
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	395.47	333.61	37,697	70,118			消費者金融
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	238.9	221.15	16,051	29,854			消費者金融
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	267.75	183.62	18,664	34,715			商業サービス・用品
ZOMATO LTD	3,322.58	4,891.43	91,200	169,633			ホテル・レストラン・レジャー
MACROTECH DEVELOPERS LTD	-	178.89	20,737	38,572			不動産管理・開発
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	-	598.52	48,955	91,058			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APL APOLLO TUBES LTD	-	125.92	19,467	36,210			金属・鋳業
SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD	-	326.84	22,140	41,180			自動車用部品
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	-	179.09	7,008	13,036			金融サービス
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	-	2,287.97	82,790	153,989			金融サービス
ASTRAL POLYTECHNIK LTD	-	105.69	21,004	39,068			建設関連製品
BERGER PAINTS INDIA LTD	186.55	226.56	12,034	22,384			化学
ADANI ENERGY SOLUTIONS LTD	252.73	-	-	-			電力
AVENUE SUPERMARTS LTD	151.32	128.52	59,688	111,020			生活必需品流通・小売り
IDFC BANK LTD	-	2,488.08	20,576	38,272			銀行
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	239.26	188.97	31,154	57,947			保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	366.67	248.01	15,091	28,070			保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	96.62	118.95	42,465	78,986			旅客航空輸送
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	417.01	351.81	51,461	95,717			保険
小計	株数 銘柄数<比率>	株数 銘柄数	8,349,430 -	15,529,940 <16.9%>			
(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	9,022	5,470	981,865	9,425			金属・鋳業
BARITO PACIFIC TBK PT	28,850.85	21,783.85	2,167,493	20,807			化学
UNITED TRACTORS TBK PT	1,697.01	1,122.01	2,869,540	27,547			石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	3,570	3,640	2,202,200	21,141			食品
UNILEVER INDONESIA TBK PT	8,225	5,916	1,402,092	13,460			家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	18,907	16,542	8,477,775	81,386			コングロマリット
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	46,469	39,477	12,632,640	121,273			各種電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	7,526	6,206	3,149,545	30,235			食品
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	2,924	1,921	1,824,950	17,519			紙製品・林産品
BANK MANDIRI	34,760	29,266	19,388,725	186,131			銀行
BANK RAKYAT INDONESIA	64,553	53,424	28,314,720	271,821			銀行
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	7,179	12,039	6,320,475	60,676			銀行
KALBE FARMA TBK PT	18,101	19,530	2,841,615	27,279			医薬品
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	2,744.32	2,349.32	1,256,886	12,066			建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	52,483	43,211	41,158,477	395,121			銀行
VALE INDONESIA TBK PT	2,877	-	-	-			金属・鋳業
ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	13,809	13,080	3,597,000	34,531			石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	2,593	1,941	1,970,115	18,913			食品
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	16,979	14,828	4,137,012	39,715			生活必需品流通・小売り
SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	22,186	15,237	1,218,960	11,702			各種電気通信サービス
GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	-	669,872	4,153,206	39,870			大規模小売り
AMMAN MINERAL INTERNASIONAL PT	-	5,284	4,649,920	44,639			金属・鋳業
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	12,324.82	7,940.82	2,255,192	21,649			金属・鋳業
小計	株数 銘柄数<比率>	株数 銘柄数	156,970,405 -	1,506,915 <1.6%>			
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千アラブ首長国連邦・ディルハム	千円			
ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	1,498.1	1,181.72	1,290	54,366			銀行
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	2,790.91	2,436.92	1,389	58,520			銀行

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千円	千円	
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	3,311.06	2,701.55	4,797	202,137	各種電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	2,742.84	2,307.9	1,915	80,702	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	4,173.2	3,509.11	4,519	190,416	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	6,291.31	5,324.92	4,451	187,547	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	3,530.66	2,896.82	1,578	66,513	不動産管理・開発
EMIRATES NBD BANK PJSC	1,792.41	1,513.32	2,549	107,429	銀行
Q HOLDING PJSC	2,229.15	—	—	—	—
MULTIPLY GROUP	3,134.48	3,163.86	819	34,522	—
AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	—	1,884.16	621	26,195	ホテル・レストラン・レジャー
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	3,119.88	2,201.78	772	32,559	専門小売り
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	
	34,614 11銘柄	29,122.06 11銘柄	24,707 —	1,040,910 <1.1%>	
(ブラジル)	百株	百株	千円	千円	
VALE SA	3,657.89	2,676.89	16,626	489,517	金属・鉱業
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	—	835	769	22,642	電力
RAIA DROGASIL SA	1,066	1,020.64	2,541	74,825	生活必需品流通・小売り
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	239.5	204.5	873	25,703	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	1,147	964	3,669	108,052	電力
BANCO DO BRASIL SA	825	1,366	3,820	112,491	銀行
ITAUSA SA	4,900.26	4,401.07	4,203	123,747	銀行
GERDAU SA	1,102.81	927.81	2,088	61,490	金属・鉱業
PETROLEO BRASILEIRO SA	3,503.1	2,894.1	11,909	350,638	石油・ガス・消耗燃料
VIBRA ENERGIA SA	1,166	968	2,356	69,370	専門小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	4,599.12	3,781.12	15,041	442,854	石油・ガス・消耗燃料
CCR SA	1,210.2	799.2	1,013	29,836	運送インフラ
WEG SA	1,582.44	1,333.44	5,096	150,051	電気設備
BANCO BRADESCO SA PREF	5,205.02	4,279.02	5,917	174,237	銀行
BANCO BRADESCO SA	1,395.92	1,265.92	1,552	45,695	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	646.06	482.06	690	20,324	金属・鉱業
SUZANO SA	743.75	627.75	3,817	112,392	紙製品・林産品
CPFL ENERGIA SA	236	169	593	17,465	電力
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4,657.47	3,795.47	12,027	354,131	銀行
ENGIE BRASIL SA	154.87	152.87	619	18,233	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LOCALIZA RENT A CAR	689.89	704.89	3,524	103,768	陸上運輸
LOJAS RENNEN SA	937.2	840.2	1,315	38,739	専門小売り
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	663.04	532.04	1,425	41,965	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA	1,093	879	1,265	37,267	石油・ガス・消耗燃料
TOTVS SA	534	433	1,172	34,536	ソフトウェア
EQUATORIAL ENERGIA SA	941	826	2,572	75,731	電力
JBS SA	714	569	1,274	37,526	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	1,379.62	1,092.62	1,407	41,434	電力
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	317.98	274.98	2,239	65,934	水道
ENEVA SA	711	440	530	15,610	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HYPERA SA	412	298	843	24,830	医薬品
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	5,786.48	4,500.48	5,058	148,936	資本市場
MAGAZINE LUIZA SA	2,715	2,394	363	10,713	大規模小売り
PRIOR SA	709	616	3,001	88,379	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA BRASIL SA	505.28	308.28	1,507	44,393	各種電気通信サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	653	517	1,704	50,186	保険
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	4,686.61	3,559.61	1,260	37,100	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ATACADO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	551	548	614	18,102	生活必需品流通・小売り
AMBEV SA	4,534.95	3,733.95	4,447	130,935	飲料
NATURA & CO HOLDING SA	927	688	1,118	32,916	パーソナルケア用品
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACOES S/A	—	521	801	23,592	保険
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	888	1,089	1,398	41,168	生活必需品流通・小売り
TIM SA	765	613	1,059	31,187	無線通信サービス
LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	3.08	—	—	—	陸上運輸

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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	607	463	1,082	31,857	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
RUMO SA	1,188	1,045	2,207	64,980	陸上運輸
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数 銘柄	138,421	4,075,500	
			-	<4.4%>	
(チェコ)	百株	百株	千チェコ・コルナ	千円	
KOMERCNI BANKA AS	80.62	58.81	5,104	33,307	銀行
CEZ	147.52	119.57	10,522	68,654	電力
MONETA MONEY BANK AS	250.56	324.81	3,306	21,574	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数 銘柄	18,933	123,536	
			-	<0.1%>	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
SKC CO LTD	23.57	17.2	193,156	21,672	化学
CHEIL WORLDWIDE INC	46.13	-	-	-	メディア
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	34.98	29.28	425,731	47,767	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	29.79	23.44	649,288	72,850	保険
DB INSURANCE CO LTD	40.39	36.55	322,005	36,129	保険
COWAY CO LTD	58.33	40.84	231,154	25,935	家庭用耐久財
KT&G CORP	103.26	77.03	684,796	76,834	タバコ
S-1 CORPORATION	15.57	-	-	-	商業サービス・用品
CJ CORP	9.39	-	-	-	コングロマリット
KAKAO CORP	295.75	243.74	1,143,140	128,260	インタラクティブ・メディアおよびサービス
KUM YANG CO LTD	-	25.99	238,328	26,740	化学
HANWHA OCEAN CO LTD	-	58.03	168,287	18,881	機械
SK TELECOM CO LTD	-	37.45	188,373	21,135	無線通信サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	312.28	154.99	112,367	12,607	資本市場
NCSoft CORPORATION	15.42	11.42	191,970	21,539	娯楽
LG UPLUS CORP	177.16	171.31	163,601	18,356	各種電気通信サービス
DOOSAN ENERBILITY	391.12	357.73	512,269	57,476	電気設備
POSCO INTERNATIONAL CORP	-	42.25	177,450	19,909	商社・流通業
LG H&H CO LTD	8.66	7.62	294,132	33,001	パーソナルケア用品
LG CHEM LTD	47.04	38.84	1,458,442	163,637	化学
LG CHEM LTD	7.33	5.99	144,658	16,230	化学
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	436.85	344.6	1,397,353	156,783	銀行
HYUNDAI MERCHANT MARINE	257.38	174.05	255,853	28,706	海上運輸
S-OIL CORP	46.49	32.89	247,661	27,787	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	114.38	91.75	221,117	24,809	化学
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	62.76	51.98	187,128	20,995	資本市場
POSCO FUTURE M CO LTD	25.09	24.67	614,283	68,922	電気設備
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	19	13.12	131,068	14,705	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	27.51	-	-	-	専門小売り
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	43.83	33.14	372,162	41,756	機械
HYUNDAI MOBIS	58.44	48.09	1,127,710	126,529	自動車用部品
SK HYNIX INC	520.44	430.02	7,684,457	862,196	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	69.3	56.95	178,538	20,031	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	20.64	18.64	269,534	30,241	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	135.05	107.45	2,508,957	281,505	自動車
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	26.94	-	-	-	機械
HYUNDAI STEEL CO	78.56	78.56	240,786	27,016	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	280.33	217.85	278,848	31,286	銀行
KIA CORPORATION	250.43	206.05	2,330,425	261,473	自動車
KOREA ZINC CO LTD	8.17	6.76	322,790	36,217	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER CORP	244.75	210.38	415,921	46,666	電力
KOREAN AIR CO LTD	166.09	140.33	282,764	31,726	旅客航空輸送
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	15.44	12.09	140,969	15,816	化学
KT CORP	-	55.36	186,009	20,870	各種電気通信サービス
HLB INC	100.07	94.3	878,876	98,609	ヘルスケア機器・用品
LG ELECTRONICS INC	101.53	83.78	762,398	85,541	家庭用耐久財

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			
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円			
LG CORP	94.86	70.73	538,255	60,392			コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	152.9	92.34	101,481	11,386			資本市場
NAVER CORP	125.28	102.18	1,835,152	205,904			インタラクティブ・メディアおよびサービス
L&F CO LTD	21.69	20.34	285,980	32,087			電気設備
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	37.39	34.43	209,678	23,525			資本市場
KANGWON LAND INC	92.45	72.38	106,470	11,946			ホテル・レストラン・レジャー
POSCO HOLDINGS INC	68.68	56.79	2,106,909	236,395			金属・鉱業
SAMSUNG E&A CO LTD	140.98	122.26	303,204	34,019			建設・土木
COSMOAM&T CO LTD	-	17.3	246,352	27,640			コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG SDI CO LTD	52.32	43.48	1,678,328	188,308			電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	54.94	46.73	689,734	77,388			電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,571.21	3,754.76	29,625,056	3,323,931			コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	547.49	541.1	470,215	52,758			機械
HANWHA AEROSPACE CO LTD	-	28.34	623,480	69,954			航空宇宙・防衛
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	787.43	641.76	4,254,868	477,396			コンピュータ・周辺機器
YUHAN CORP	43.95	47	321,950	36,122			医薬品
HANON SYSTEMS	191.41	130.64	65,581	7,358			自動車部品
GS HOLDINGS CORP	42.59	38.03	161,057	18,070			コングロマリット
LG DISPLAY CO LTD	237.42	235.92	231,673	25,993			電子装置・機器・部品
CELLTRION INC	97.18	121	2,069,100	232,153			バイオテクノロジー
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	-	30.79	419,667	47,086			半導体・半導体製造装置
HANA FINANCIAL GROUP	280.57	231.72	1,211,895	135,974			銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	19.28	16.2	276,858	31,063			航空貨物・物流サービス
CELLTRION PHARM INC	17.64	13.14	115,369	12,944			医薬品
LOTTE SHOPPING CO	10.25	-	-	-			大規模小売り
POSCO DX CO LTD	-	43.64	168,886	18,949			情報技術サービス
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	77.04	65.63	511,914	57,436			保険
AMOREPACIFIC CORP	30.32	22.8	323,988	36,351			パーソナルケア用品
SK INNOVATION CO LTD	51.89	48.55	508,804	57,087			石油・ガス・消耗燃料
ECOPRO CO LTD	-	15.9	822,030	92,231			電気設備
CJ CHEILJEDANG CORP	8.9	7.13	233,507	26,199			食品
STX PAN OCEAN CO LTD	312.93	-	-	-			海上運輸
LG INNOTEK CO LTD	14.36	12.42	228,652	25,654			電子装置・機器・部品
SK INC	36.19	29.45	462,365	51,877			コングロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	370.99	302.64	1,909,658	214,263			銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	74.26	56.45	274,064	30,750			航空宇宙・防衛
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	25.08	-	-	-			電子装置・機器・部品
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	61.86	80.42	587,870	65,959			金融サービス
HANMI PHARM CO LTD	8.1	5.85	174,037	19,527			医薬品
E-MART CO LTD	17.3	-	-	-			生活必需品流通・小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	76.97	55.31	346,793	38,910			自動車部品
HANJIN KAL CORP	-	20.68	118,910	13,341			旅客航空輸送
HD HYUNDAI CO LTD	40.06	39.43	240,917	27,030			石油・ガス・消耗燃料
BGF RETAIL CO LTD	7.15	-	-	-			生活必需品流通・小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	21.29	20.13	183,384	20,575			食品
NETMARBLE CORP	25.97	21.12	115,104	12,914			娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	508.23	485.05	638,810	71,674			銀行
ECOPRO BM CO LTD	45.55	39.06	839,790	94,224			電気設備
SD BIOSENSOR INC	42.88	-	-	-			ヘルスケア機器・用品
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	29.49	22.1	178,347	20,010			医薬品
KRAFTON INC	27.1	23	581,900	65,289			娯楽
ECOPRO MATERIALS CO LTD	-	10.66	111,077	12,462			電気設備
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	15.06	15.45	171,958	19,293			機械
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	27.2	18.78	112,304	12,600			電気設備
SK SQUARE CO LTD	101.44	80.02	630,557	70,748			コングロマリット
SK BIOSCIENCE CO LTD	19.81	23.4	132,678	14,886			バイオテクノロジー
KAKAO GAMES CORP	32.64	-	-	-			娯楽

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			
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円			
HYBE CO LTD	19.2	16.49	361,131	40,518			娯楽
LG ENERGY SOLUTION	33.27	36.71	1,338,079	150,132			電気設備
KAKAOBANK CORP	129.07	132.92	308,374	34,599			銀行
F&F CO LTD / NEW	18.75	—	—	—			繊維・アパレル・贅沢品
KAKAOPAY CORP	22.37	22.37	73,149	8,207			金融サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	36.4	30.71	446,523	50,099			情報技術サービス
SAMSUNG C&T CORP	79.98	63.52	881,657	98,921			コンゴロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	16.61	14.15	1,098,040	123,200			ライフサイエンス・ツール/サービス
PEARL ABYSS CORP	34.27	—	—	—			娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	46	45.42	228,462	25,633			機械
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	90.33	—	—	—			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
小計	株数: 15,049.86 銘柄数: 102	株数: 12,349.23 銘柄数: 99	91,626,818	10,280,529			<11.2%>
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円			
EVE ENERGY CO LTD	130.32	147.32	537	11,466			電気設備
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	58	58	394	8,404			電気設備
LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	227	—	—	—			化学
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	59.4	59.4	185	3,952			電子装置・機器・部品
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	30	30	153	3,282			電子装置・機器・部品
HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	—	150	215	4,595			電子装置・機器・部品
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	51	—	—	—			化学
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD	483	—	—	—			資本市場
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	120	120	91	1,951			半導体・半導体製造装置
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	120.8	51.8	194	4,149			化学
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	122	122	182	3,898			金属・鉱業
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	175	175	318	6,786			航空宇宙・防衛
UNISPLENDOR CORP LTD	212.4	70.4	144	3,085			電子装置・機器・部品
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	105	105	101	2,173			電気設備
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	191	191	302	6,445			紙製品・林産品
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12	12	63	1,349			ライフサイエンス・ツール/サービス
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	162	162	229	4,900			電気設備
HUAGONG TECH CO LTD	—	22	72	1,536			電子装置・機器・部品
CHANGCHUN HIGH-TECH INDUSTRY GROUP CO LTD	21	21	254	5,425			医薬品
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	—	118	246	5,257			機械
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	89	—	—	—			機械
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	81	81	189	4,044			娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	—	136	185	3,963			電子装置・機器・部品
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	139	139	191	4,083			電子装置・機器・部品
YINTAI GOLD CO LTD	239	239	472	10,062			金属・鉱業
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	315	—	—	—			建設資材
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	618	—	—	—			商業サービス・用品
GEM CO LTD	291	291	183	3,920			金属・鉱業
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	26	26	119	2,540			ソフトウェア
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	69	69	98	2,090			バイオテクノロジー
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	186	581	252	5,375			娯楽
INNER MONGOLIA DIAN TON ENERGY CORP LTD	169	169	343	7,331			石油・ガス・消耗燃料
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	98	59	584	12,459			電気設備
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	119.95	155.93	103	2,200			電子装置・機器・部品
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	59.04	59.04	142	3,045			家庭用耐久財
ZHEJIANG NHU CO LTD	273.12	58.12	101	2,157			医薬品
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	296	296	186	3,981			不動産管理・開発
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	133.6	133.6	263	5,610			医薬品
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	66	66	102	2,185			食品
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	51	51	154	3,288			建設関連製品
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	93	93	415	8,868			食品
GOTIION HIGH-TECH CO LTD	104	104	196	4,181			電気設備
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	115	10	36	768			ヘルスケア機器・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	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	333	240	1,032	22,020	食品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	113	89.5	376	8,034	バイオテクノロジー
CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD	57	—	—	—	ソフトウェア
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	180	180	201	4,290	石油・ガス・消耗燃料
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	180	180	189	4,048	コンプロマリット
TIANQI LITHIUM CORP	101	43	205	4,389	化学
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	112	112	102	2,182	コンピュータ・周辺機器
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	29	248	240	5,133	飲料
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	101	101	78	1,679	電子装置・機器・部品
NAVINFO CO LTD	56	—	—	—	ソフトウェア
BY-HEALTH CO LTD	141	141	232	4,953	パーソナルケア用品
DAAN GENE CO LTD	139	—	—	—	バイオテクノロジー
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	21	120	358	7,648	医薬品
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	78	78	148	3,170	バイオテクノロジー
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	717.5	515.5	571	12,176	化学
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	60	60	345	7,357	医薬品
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	61.39	22.39	139	2,976	半導体・半導体製造装置
INSPIR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	35.7	114.7	438	9,352	コンピュータ・周辺機器
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	127	127	150	3,216	コンピュータ・周辺機器
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	367	367	139	2,980	金属・鉱業
FAW JIEFANG GROUP CO LTD	320	—	—	—	機械
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	373.67	397.29	497	10,595	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	108	108	272	5,811	電子装置・機器・部品
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	35.84	35.84	69	1,489	飲料
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	111	5	14	308	医薬品
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	69	69	93	1,997	ヘルスケア機器・用品
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	375	331	249	5,327	機械
DONG-E-E-JIAO CO LTD	49	49	331	7,064	医薬品
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	153	153	165	3,522	通信機器
HUADONG MEDICINE CO LTD	75	62	186	3,971	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	50	50	165	3,537	エネルギー設備・サービス
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	991	—	—	—	金属・鉱業
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	66	159	270	5,769	娯楽
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	98	98	178	3,802	航空宇宙・防衛
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	81	61	1,079	23,004	飲料
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	178	48	296	6,322	機械
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	149.5	149.5	68	1,456	食品
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	223	136.75	149	3,192	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	87.4	87.4	90	1,919	ホテル・レストラン・レジャー
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	74.48	—	—	—	ソフトウェア
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	—	91	372	7,942	娯楽
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	21	36	415	8,848	資本市場
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	364.8	364.8	272	5,801	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	143	143	143	3,054	娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	450.54	311.54	849	18,117	電子装置・機器・部品
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	299	299	487	10,402	化学
SHANXI SECURITIES CO LTD	275	—	—	—	資本市場
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	713	713	503	10,731	メディア
NEW HOPE LIUHE CO LTD	199	199	178	3,801	食品
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	191	191	346	7,382	電子装置・機器・部品
IFLYTEK CO LTD	118	79	371	7,928	ソフトウェア
HESTEEL CO LTD	934	934	206	4,400	金属・鉱業
GOERTEK INC	251	251	382	8,160	電子装置・機器・部品
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	213	213	137	2,933	資本市場
BANK OF NINGBO CO LTD	326	352	779	16,621	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD	396	95	129	2,760	電子装置・機器・部品
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	1,352	544.2	273	5,823	電子装置・機器・部品

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	283	283	153	3,263	資本市場
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	376	376	92	1,971	不動産管理・開発
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	404.88	404.88	693	14,785	自動車
WESTERN SECURITIES CO LTD	227	227	165	3,522	資本市場
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	274	123	331	7,077	食品
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	105.2	105.2	589	12,574	医薬品
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	843.49	779.18	976	20,813	資本市場
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	81	78	748	15,963	飲料
WULIANGYE YIBIN CO LTD	229	186	2,702	57,614	飲料
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	40	589	402	8,576	バイオテクノロジー
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,181	1,374	588	12,536	電子装置・機器・部品
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	459	459	389	8,297	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	187	121	478	10,207	家庭用耐久財
MIDEA GROUP CO LTD	—	162	1,110	23,684	家庭用耐久財
GUOSEN SECURITIES CO LTD	423	423	367	7,827	資本市場
PING AN BANK CO LTD	1,070	972	1,032	22,006	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	291.8	244.8	452	9,638	食品
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	1,463	1,135	506	10,791	資本市場
CHINA VANKE CO LTD	551	551	391	8,339	不動産管理・開発
ZTE CORP	197	165	478	10,197	通信機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	285	285	266	5,680	機械
WEICHAI POWER CO LTD	481	442	817	17,422	機械
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	42	42	158	3,384	医薬品
GF SECURITIES CO LTD	387	153	198	4,233	資本市場
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	211	211	162	3,454	電気設備
BYD CO LTD	104	84	1,789	38,142	自動車
YOUNGYU CO LTD	21	—	—	—	金属・鉱業
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	302	302	159	3,399	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	341	341	179	3,816	電子装置・機器・部品
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	96.6	96.6	222	4,734	化学
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	52.2	52.2	173	3,702	化学
LB GROUP CO LTD	110	110	219	4,673	化学
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	179	428	447	9,534	化学
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	84	—	—	—	化学
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	21	21	75	1,605	半導体・半導体製造装置
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	96	96	189	4,033	化学
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	117	117	200	4,272	化学
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	64	—	—	—	電気設備
RISEN ENERGY CO LTD	—	11	15	331	半導体・半導体製造装置
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	80	—	—	—	医薬品
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	127	127	210	4,494	建設関連製品
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	35	22	683	14,574	半導体・半導体製造装置
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	301	301	195	4,164	化学
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	128	128	264	5,637	半導体・半導体製造装置
HUAFON CHEMICAL CO LTD	342	342	257	5,497	化学
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	573	—	—	—	金属・鉱業
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	55.5	55.5	56	1,200	娯楽
ANHUI GUJJING DISTILLERY CO LTD	16	17	433	9,248	飲料
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	156	156	105	2,258	化学
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	66	66	215	4,596	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	6	6	35	760	家庭用耐久財
NINESTAR CORP	45	11	24	519	コンピュータ・周辺機器
CNPC CAPITAL CO LTD	—	382	220	4,698	銀行
YUNDA HOLDING CO LTD	254.2	254.2	177	3,787	航空貨物・物流サービス
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	16	—	—	—	医薬品
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	169	169	416	8,877	金属・鉱業
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	107	—	—	—	容器・包装

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
ASYMCEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	18.2	18.2	142	3,038	医薬品
JIUGUI LIQUOR CO LTD	18	18	90	1,930	飲料
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	151	151	69	1,483	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SF HOLDING CO LTD	320	244	850	18,127	航空貨物・物流サービス
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	18	—	—	—	建設関連製品
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	236	236	124	2,646	資本市場
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	40	—	—	—	電気設備
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	25	25	163	3,482	半導体・半導体製造装置
GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD	47	—	—	—	電気設備
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC LTD	—	39	278	5,940	電子装置・機器・部品
BANK OF SHANGHAI CO LTD	517.9	974.9	678	14,465	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	389	389	326	6,957	ソフトウェア
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	730	828	440	9,390	保険
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	23	23	78	1,675	家庭用耐久財
CSC FINANCIAL CO LTD	261	289	627	13,375	資本市場
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	121.8	64.61	124	2,656	化学
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	91	91	116	2,488	医薬品
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	332	248	389	8,305	化学
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	31	31	135	2,897	飲料
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	225	225	226	4,825	資本市場
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	103.72	0.46	1	21	生活必需品流通・小売り
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	388	388	251	5,359	金属・鉱業
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	37	37	70	1,493	化学
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	52	—	—	—	食品
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	152.78	152.78	295	6,308	化学
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	30	22	191	4,092	自動車用部品
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	31.5	44.1	153	3,282	通信機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	39	37	161	3,450	化学
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	27	27	88	1,885	電子装置・機器・部品
JUEWEI FOOD CO LTD	31	—	—	—	食品
OPPEIN HOME GROUP INC	21	21	122	2,621	家庭用耐久財
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	91.16	91.16	262	5,604	金属・鉱業
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	95	95	122	2,610	食品
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	30	31	541	11,539	通信機器
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	103	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	47	1	5	119	化学
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	69	69	215	4,586	化学
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	45.4	0.4	3	76	電子装置・機器・部品
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	30	30	394	8,416	自動車用部品
ZHEJIANG WOLWU BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	27	—	—	—	医薬品
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	80.3	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
BGI GENOMICS CO LTD	13	—	—	—	バイオテクノロジー
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	30	48	138	2,946	化学
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	31	31	92	1,974	金属・鉱業
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	32	32	65	1,395	バイオテクノロジー
CAITONG SECURITIES CO LTD	127	127	91	1,960	資本市場
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	24	24	117	2,514	化学
BANK OF CHENGDU CO LTD	213	213	299	6,388	銀行
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	132	—	—	—	金属・鉱業
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	42	1	5	110	自動車用部品
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	19	19	87	1,866	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEBEI YANGYUAN ZHIHUI BEVERAGE CO LTD	—	118	309	6,590	食品
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	561	576	1,296	27,628	電子装置・機器・部品
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	74	58	1,580	33,700	ヘルスケア機器・用品
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	—	608	158	3,382	各種消費者サービス
HUAXI SECURITIES CO LTD	155	—	—	—	資本市場
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	16	16	89	1,900	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	
SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD	—	40.5	206	4,395	化学
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	85	—	—	—	化学
OVCTEK CHINA INC	40.6	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
SG MICRO CORP	31.5	33.95	211	4,504	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	138	202.4	3,966	84,565	電気設備
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	30.16	30.16	228	4,871	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTEC CO LTD	129.72	139.72	602	12,852	ライフサイエンス・ツール/サービス
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	—	514	336	7,166	自動車
FLAT GLASS GROUP CO LTD	103	103	261	5,566	半導体・半導体製造装置
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	921	234	108	2,314	銀行
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	—	825	278	5,944	不動産管理・開発
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	73	73	257	5,482	電子装置・機器・部品
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	25.6	25.6	239	5,100	電子装置・機器・部品
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	297	253	428	9,131	化学
PHARMARON BEIJING CO LTD	49.5	74.25	141	3,007	ライフサイエンス・ツール/サービス
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	6	—	—	—	化学
BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	29	—	—	—	電子装置・機器・部品
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	11	11	330	7,038	電子装置・機器・部品
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	11	11	59	1,265	半導体・半導体製造装置
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	39	—	—	—	商社・流通業
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	18	25.2	93	1,999	金属・鉱業
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	30	30	425	9,071	半導体・半導体製造装置
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	54	54	267	5,698	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	750	534	320	6,841	電子装置・機器・部品
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	27	—	—	—	電気設備
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY INC CO	35	—	—	—	電気設備
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	82	82	175	3,744	通信機器
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	263	287	281	5,995	不動産管理・開発
WILL SEMICONDUCTOR LTD	91.3	50.3	498	10,626	半導体・半導体製造装置
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	23.8	—	—	—	半導体・半導体製造装置
JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD	32.2	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	128	128	117	2,502	電気設備
BANK OF CHANGSHA CO LTD	437	—	—	—	銀行
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	1,143	1,143	341	7,285	銀行
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	707	707	226	4,823	金属・鉱業
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	107	107	236	5,036	電子装置・機器・部品
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	248	248	179	3,827	資本市場
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	22	22	127	2,720	半導体・半導体製造装置
PROYA COSMETICS CO LTD	12.6	—	—	—	パーソナルケア用品
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	29	29	124	2,650	電気設備
CGN POWER CO LTD	—	695	297	6,341	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	—	1,993	1,030	21,965	陸上運輸
GONEO GROUP CO LTD	—	19	208	4,446	電気設備
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	—	32	172	3,683	半導体・半導体製造装置
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	8	8	112	2,406	半導体・半導体製造装置
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO LTD	—	20	343	7,321	通信機器
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	9.6	15.36	175	3,746	半導体・半導体製造装置
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	—	46	170	3,627	医薬品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	1,850	1,176	571	12,184	銀行
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	210	210	210	4,494	資本市場
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	32	136	2,919	情報技術サービス
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	23	23	57	1,231	バイオテクノロジー
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	9	9	79	1,705	半導体・半導体製造装置
HOYMILES POWER ELECTRONICS INC	—	5.96	143	3,055	電気設備
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	—	40	124	2,661	半導体・半導体製造装置
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	435	435	304	6,491	金属・鉱業
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	39	50.7	98	2,097	化学

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	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	14	14	79	1,685	電気設備
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	61	61	184	3,935	食品
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	16	—	—	—	医薬品
SHENZHEN SED INDUSTRY CO LTD	—	76	125	2,678	建設・土木
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD	63	—	—	—	化学
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	60	60	162	3,470	半導体・半導体製造装置
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	22	28.6	140	3,005	金属・鉱業
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	104.8	115.72	179	3,836	半導体・半導体製造装置
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	356	356	223	4,773	資本市場
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	50.55	24.77	173	3,706	バイオテクノロジー
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	29	29	182	3,884	ヘルスケア機器・用品
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	38	53.2	70	1,493	半導体・半導体製造装置
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	26	26	214	4,570	食品
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	75	79	245	5,237	資本市場
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	46	46	241	5,145	機械
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	—	40	488	10,422	ヘルスケア機器・用品
PIOTECH INC	—	5.92	110	2,350	半導体・半導体製造装置
RANGE INTELLIGENT COMPUTING TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	91	279	5,959	情報技術サービス
ASR MICROELECTRONICS CO LTD	—	40	149	3,193	半導体・半導体製造装置
JINKO SOLAR CO LTD	—	402	310	6,624	半導体・半導体製造装置
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	—	28	420	8,959	半導体・半導体製造装置
QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP INC	—	56	161	3,444	ソフトウェア
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	29	40.6	152	3,257	金属・鉱業
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	16	11	325	6,947	バイオテクノロジー
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	22	32	546	11,641	コンピュータ・周辺機器
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	32.47	24.47	707	15,087	ソフトウェア
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	—	190	244	5,212	半導体・半導体製造装置
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	—	8.4	314	6,708	家庭用耐久財
SHANGHAI MEDICILON INC	8	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	—	86	222	4,746	半導体・半導体製造装置
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	1,856	1,856	417	8,902	建設・土木
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	—	168	265	5,655	自動車
PETROCHINA CO LTD	1,221	1,173	1,282	27,331	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	3,737	3,057	1,681	35,843	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	5,112	4,131	1,842	39,277	銀行
BANK OF CHINA LTD	1,960	1,960	913	19,471	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	2,273	1,203	798	17,028	石油・ガス・消耗燃料
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	138	138	380	8,107	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	334	339	1,420	30,280	石油・ガス・消耗燃料
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	1,186	937	3,120	66,517	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	626	518	2,017	43,011	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD	1,299	886	1,433	30,560	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	1,513	1,667	1,223	26,084	銀行
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	2,177	1,334	537	11,460	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD	425	425	645	13,762	自動車
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	72	58	9,668	206,117	飲料
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	2,257	1,943	1,313	28,000	銀行
CITIC SECURITIES CO LTD	703	597	1,080	23,035	資本市場
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	407	402	945	20,156	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	383	383	222	4,743	運送インフラ
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	1,254	1,106	2,873	61,255	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DAQIN RAILWAY CO LTD	826	826	630	13,435	陸上運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,151	2,303	723	15,416	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	2,715	1,683	900	19,195	建設・土木
HAITONG SECURITIES CO LTD	555	555	440	9,382	資本市場
HUAXIA BANK CO LTD	707	707	478	10,203	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	325	296	809	17,264	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	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
BANK OF BEIJING CO LTD	1,664	1,383	795	16,952	銀行
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	1,912	1,248	601	12,823	無線通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	1,081	792	571	12,173	金属・鉱業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	232	232	537	11,459	建設資材
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	283	413	579	12,352	資本市場
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	590	590	592	12,640	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR CO LTD	117	117	299	6,382	自動車
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	544	557	450	9,594	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD	1,417	1,089	858	18,293	機械
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	347.52	266.52	1,183	25,221	医薬品
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	174	174	354	7,567	金属・鉱業
HUATAI SECURITIES CO LTD	495	403	544	11,598	資本市場
CHINA RAILWAY GROUP LTD	1,004	856	623	13,284	建設・土木
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	163	66	192	4,111	保険
HAIER SMART HOME CO LTD	321	257	715	15,258	家庭用耐久財
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	482	279	449	9,581	機械
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	1,013	1,013	528	11,272	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	562	562	409	8,722	銀行
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	174	124	282	6,021	医薬品
GUANGHUI ENERGY CO LTD	264	264	207	4,429	石油・ガス・消耗燃料
GEMDALE CORP	397	-	-	-	不動産管理・開発
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	-	381	441	9,405	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	200	145	1,262	26,917	化学
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	787	787	355	7,583	電気設備
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	1,135	1,035	1,871	39,892	金属・鉱業
FOUNDER SECURITIES CO LTD	-	551	424	9,056	資本市場
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	-	382	608	12,964	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NARI TECHNOLOGY CO LTD	323.44	417.12	1,065	22,719	電気設備
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	298	298	197	4,218	エネルギー設備・サービス
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	111	98	756	16,122	専門小売り
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	309	309	266	5,671	自動車
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	2,225	2,225	362	7,731	金属・鉱業
TSINGTAO BREWERY CO LTD	44	44	343	7,316	飲料
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	250	250	75	1,604	金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	1,020	372	277	5,908	金属・鉱業
AIR CHINA LTD	607	448	321	6,857	旅客航空輸送
TBEA CO LTD	186	241.8	355	7,577	電気設備
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	435	435	306	6,537	建設・土木
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	636	562	193	4,133	建設・土木
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	1,173	445	233	4,970	建設・土木
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	337	212	834	17,793	機械
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	104	116	427	9,107	運送インフラ
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	69	69	209	4,461	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD	149	149	387	8,268	金属・鉱業
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	343	343	129	2,756	資本市場
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	285	58	104	2,229	自動車用部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD	-	252	212	4,539	資本市場
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	-	330	294	6,268	化学
SICHUAN CHUANQING ENERGY CO LTD	237	237	406	8,659	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	114	114	200	4,269	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AEC AVIATION POWER CO LTD	112	93	305	6,522	航空宇宙・防衛
BANK OF NANJING CO LTD	573	573	534	11,384	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	76	158.53	135	2,879	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	896.7	480.7	522	11,139	海上運輸
CMOC GROUP LIMITED	1,197	534	482	10,291	金属・鉱業
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	-	412	547	11,681	金属・鉱業
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	338	338	183	3,919	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	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	90	90	376	8,033	医薬品
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	201.2	201.2	624	13,309	金属・鉱業
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	78	78	156	3,340	電気設備
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	—	277	330	7,050	金属・鉱業
PEOPLE.CN CO LTD	—	70	167	3,578	メディア
BBMG CORP	542	—	—	—	建設資材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	—	845	185	3,945	生活必需品流通・小売り
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	—	2,683	362	7,721	旅客航空輸送
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	140	210	538	11,469	石油・ガス・消耗燃料
YUTONG BUS CO LTD	—	60	144	3,085	機械
SHENERGY CO LTD	—	429	370	7,892	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	306	795	278	5,931	旅客航空輸送
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	150.19	150.19	271	5,779	電気設備
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	580	580	428	9,137	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANXI LUJIAN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	264	164	380	8,104	石油・ガス・消耗燃料
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	102.64	102.64	215	4,601	ソフトウェア
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	162.5	162.5	180	3,852	ソフトウェア
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD	1,275	—	—	—	商社・流通業
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	33	33	68	1,466	金属・鉱業
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	364	451	248	5,297	旅客航空輸送
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	590	590	142	3,043	建設・土木
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	102	102	462	9,852	自動車用部品
XIAMEN C & D INC	189	189	196	4,190	商社・流通業
YOUNGOR FASHION CO LTD	256	256	192	4,109	不動産管理・開発
AVIC HELICOPTER CO LTD	46	46	185	3,956	航空宇宙・防衛
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	168	168	105	2,249	資本市場
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	151	8	15	338	医薬品
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	495	142	120	2,560	大規模小売り
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	149	223.5	227	4,840	石油・ガス・消耗燃料
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	394	394	153	3,275	化学
HISENSE VISUAL TECHNOLOGY CO LTD	—	3	8	173	家庭用耐久財
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	196	196	96	2,059	電気設備
WESTERN MINING CO LTD	233	—	—	—	金属・鉱業
ZHANGZHOU PIENZHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	39	25	568	12,127	医薬品
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	341	341	299	6,375	金属・鉱業
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	74.8	50.8	1,235	26,340	飲料
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	126	126	127	2,723	機械
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	568	568	495	10,558	石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	250	250	154	3,283	専門小売り
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-TECH PARK DEVELOPMENT CO LTD	—	164	298	6,356	不動産管理・開発
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	65	12.5	36	773	ソフトウェア
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	203	203	478	10,200	化学
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	194	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	292	292	105	2,240	金属・鉱業
BEIJING TIANANT BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	—	27	76	1,637	バイオテクノロジー
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	319	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	126	126	168	3,593	電気設備
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	261	23	37	795	石油・ガス・消耗燃料
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	42	42	109	2,340	食品
DALIAN PORT PDA CO LTD	1,732	1,732	247	5,280	運送インフラ
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	339	474.6	372	7,932	建設・土木
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	127	127	267	5,699	化学
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	58.3	58.3	88	1,884	医薬品
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	—	195	201	4,294	運送インフラ
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	118	118	137	2,940	医薬品
SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO	—	224	286	6,098	建設・土木
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	33	26	42	908	電子装置・機器・部品

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
SHANXI COAL INTERNATIONAL ENERGY GROUP CO LTD	—	111	176	3,771	商社・流通業
TONGWEI CO LTD	290	170	407	8,679	半導体・半導体製造装置
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	88.79	106.54	407	8,692	ソフトウェア
JCET GROUP CO LTD	109	109	278	5,946	半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	68	68	128	2,745	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO LTD	25	25	163	3,490	飲料
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	53	53	146	3,116	ホテル・レストラン・レジャー
HUAXIN CEMENT CO LTD	56	—	—	—	建設資材
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	104.9	104.9	295	6,295	化学
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	17	17	159	3,399	電子装置・機器・部品
CHINA JUSHI CO LTD	202.46	202.46	229	4,903	建設資材
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	624	624	147	3,139	化学
NINGBO SHANSHAN CO LTD	132	132	156	3,326	化学
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	45.24	39.24	215	4,590	機械
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	196	—	—	—	建設関連製品
HENG TONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	196	196	257	5,490	通信機器
SAILUN GROUP CO LTD	197	197	323	6,887	自動車用部品
TONGKUN GROUP CO LTD	157	157	218	4,648	化学
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	17	22.1	127	2,718	化学
ANGEL YEAST CO LTD	49	49	145	3,107	食品
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	56	—	—	—	化学
NINGBO SANXING MEDICAL ELECTRIC CO LTD	—	138.04	503	10,723	電気設備
SHEDE SPIRITS CO LTD	—	21	149	3,191	飲料
BTG HOTELS GROUP CO LTD	148	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	42	—	—	—	半導体・半導体製造装置
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	15	15	78	1,680	化学
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9	9	50	1,083	パーソナルケア用品
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	8	15.4	128	2,731	機械
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	26	—	—	—	半導体・半導体製造装置
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	—	10	190	4,070	飲料
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	16	16	87	1,858	バイオテクノロジー
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	10	14	144	3,088	電気設備
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	71	71	284	6,063	半導体・半導体製造装置
TRINA SOLAR CO LTD	111	111	245	5,227	半導体・半導体製造装置
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	1,817	1,518	737	15,727	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ZANGGE MINING CO LTD	116	116	335	7,146	化学
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	290	151	106	2,269	銀行
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	10	—	—	—	電気設備
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	6	8.4	166	3,549	ヘルスケア機器・用品
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	16	—	—	—	半導体・半導体製造装置
3PEAK INC	12	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	48	77.6	364	7,771	電子装置・機器・部品
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	—	78	624	13,309	半導体・半導体製造装置
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	469.68	449.68	836	17,830	半導体・半導体製造装置
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	127	127	252	5,376	金属・鉱業
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	18	18	246	5,261	自動車用部品
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	—	733	488	10,407	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	102	7	30	655	医薬品
HEILAN HOME CO LTD	—	441	405	8,649	専門小売り
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	632.51	401.51	1,086	23,170	石油・ガス・消耗燃料
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	240.16	255.19	951	20,275	食品
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	50	44	248	5,298	飲料
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	70	70	190	4,060	電気設備
DONGXING SECURITIES CO LTD	132	132	105	2,248	資本市場
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	70	70	380	8,110	自動車用部品
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	223	10	11	254	旅客航空輸送
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	407	407	544	11,617	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	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	1,050	1,050	1,008	21,488	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	34	34	131	2,800	飲料
SERES GROUP CO LTD	-	90	851	18,161	自動車
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	53	53	330	7,040	飲料
SKSHU PAINT CO LTD	20	28	84	1,804	化学
BANK OF JIANGSU CO LTD	832	832	672	14,331	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD	454	339	401	8,556	銀行
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	114	114	257	5,497	自動車用部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	14	14	73	1,568	ヘルスケア機器・用品
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	20	-	-	-	医薬品
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	283	41	66	1,421	航空貨物・物流サービス
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	88.5	9.5	31	668	家庭用耐久財
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	304	304	342	7,290	資本市場
SDIC CAPITAL CO LTD	63	423	265	5,663	資本市場
TOPCHOICE MEDICAL CORP	32	32	175	3,743	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ENIN NATURAL GAS CO LTD	213	184	354	7,558	ガス
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	105.8	40.12	100	2,149	半導体・半導体製造装置
TOLY BREAD CO LTD	70.56	-	-	-	食品
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	28.6	40.04	169	3,610	生活必需品流通・小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	29.4	29.4	210	4,490	機械
ZHEJIANG WEIJING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	113.1	113.1	222	4,749	商業サービス・用品
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	493	159	127	2,725	資本市場
SPRING AIRLINES CO LTD	-	66	379	8,084	旅客航空輸送
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	160	160	251	5,351	資本市場
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	45	45	161	3,432	商業サービス・用品
GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	-	1,035	179	3,817	不動産管理・開発
FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	107	107	89	1,904	不動産管理・開発
小計	株数・金 銘柄数比率	464銘柄	464銘柄	176,721	3,767,381 <4.1%>
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
AMMB HOLDINGS BHD	1,652	1,375	566	18,271	銀行
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	6,808	5,243	3,423	110,426	銀行
CELCOMDIGI BHD	2,852	2,727	1,131	36,501	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	559.2	631.2	624	20,134	運送インフラ
RHB BANK BHD	1,463.8	1,037.8	593	19,146	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	600	-	-	-	コンプロマリット
TOP GLOVE CORP BHD	5,007	-	-	-	ヘルスケア機器・用品
GAMUDA BHD	1,498	1,561	805	25,979	建設・土木
GENTING BHD	2,098	1,649	740	23,880	ホテル・レストラン・レジャー
YTL CORP BHD	-	2,630	657	21,206	総合公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	180.56	-	-	-	銀行
HONG LEONG BANK BHD	655.08	490.08	944	30,475	銀行
IOI CORP BHD	2,182.13	2,067.13	822	26,535	食品
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	385	331	750	24,191	食品
MALAYAN BANKING BHD	4,764.75	4,142.75	3,977	128,274	銀行
MISC BHD	1,098.8	1,021.8	797	25,706	海上運輸
NESTLE MALAYSIA BHD	63	60	738	23,803	食品
PPB GROUP BHD	594.6	502.6	781	25,191	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	344	229	499	16,101	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	795	610	1,098	35,414	ガス
GENTING MALAYSIA BHD	2,542	2,401	626	20,212	ホテル・レストラン・レジャー
TELEKOM MALAYSIA BHD	981	953	584	18,842	各種電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	2,500.5	2,137.5	2,462	79,421	電力
QL RESOURCES BHD	1,154.5	870.5	535	17,267	食品
DIALOG GROUP BHD	3,100.44	-	-	-	エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	14,244.5	11,405.5	4,733	152,665	銀行
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	-	1,933	753	24,315	総合公益事業

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	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
SIME DARBY BERHAD	2,340	2,344	639	20,639	コングロマリット
AXIATA GROUP BERHAD	2,353	2,647	688	22,197	無線通信サービス
MAXIS BHD	2,060	1,758	608	19,618	無線通信サービス
INARI AMERTRON BHD	2,347	2,219	694	22,401	半導体・半導体製造装置
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,320	2,174	1,484	47,891	化学
IHH HEALTHCARE BHD	1,777	1,593	970	31,290	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	3,761	2,841	1,494	48,198	金属・鋳業
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,208	1,615	713	23,023	食品
MR DIY GROUP M BHD	2,592	2,451	367	11,858	専門小売り
小計	株数・金 銘柄数<比率>	79,881.86 34銘柄	65,650.86 32銘柄	36,308 -	1,171,087 <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	100	-	-	-	金属・鋳業
BIDVEST GROUP LTD	278.47	207.17	4,820	39,093	コングロマリット
CLICKS GROUP LTD	242.86	191.96	5,337	43,283	生活必需品流通・小売り
DISCOVERY LTD	491.2	426.19	4,648	37,698	保険
GOLD FIELDS LTD	838.89	718.33	24,228	196,493	金属・鋳業
REMGRO LTD	508.32	411.48	4,817	39,070	金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	329.91	-	-	-	専門小売り
HARMONY GOLD MINING CO LTD	608.94	435.21	7,625	61,841	金属・鋳業
EXXARO RESOURCES LTD	247.34	170.72	3,169	25,702	石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	81.51	69.63	13,797	111,895	銀行
MTN GROUP LTD	1,610.39	1,350.77	10,869	88,152	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	394.98	-	-	-	金属・鋳業
FIRSTRAND LTD	4,859.72	3,891.92	23,012	186,634	金融サービス
NASPERS LTD	208.43	143.68	45,998	373,048	大規模小売り
NEDBANK GROUP LTD	445.78	322.6	6,876	55,768	銀行
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	48.23	58.42	58.42	37,887	金属・鋳業
SASOL LTD	542.4	481.38	7,591	61,569	化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD	475.6	397.69	9,034	73,268	生活必需品流通・小売り
MR PRICE GROUP LTD	260.25	-	-	-	専門小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,286.35	1,065.44	17,800	144,360	銀行
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	901.73	677.55	3,845	31,183	大規模小売り
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	385.63	301.67	6,758	54,812	医薬品
ABSA GROUP LTD	811.22	700.74	9,654	78,300	銀行
SANLAM LTD	1,698.04	1,390.73	8,902	72,195	保険
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	811.33	693.63	6,914	56,073	金属・鋳業
KUMBA IRON ORE LTD	70.79	53.86	2,545	20,647	金属・鋳業
OUTSURANCE GROUP LTD	646.4	703.5	2,776	22,513	保険
VODACOM GROUP PTY LTD	595.48	439.38	3,840	31,147	無線通信サービス
NEPI ROCKCASTLE NV	407.69	459.37	5,843	47,391	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	4,792.38	3,914.87	3,973	32,225	保険
REINET INVESTMENTS SCA	125.15	116.2	5,002	40,569	資本市場
PEPKOR HOLDINGS LTD	1,661.42	1,697.35	2,926	23,731	専門小売り
MULTICHOICE GROUP LTD	345.85	-	-	-	メディア
SIBANYE STILLWATER LTD	2,808.77	2,240.39	5,766	46,768	金属・鋳業
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	324.04	241.33	3,460	28,064	金属・鋳業
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	-	321.52	14,831	120,280	金属・鋳業
BID CORP LTD	319.82	260.51	10,822	87,771	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金 銘柄数<比率>	30,565.31 36銘柄	24,555.19 32銘柄	292.163 -	2,369,447 <2.6%>
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
BERLI JUCKER PCL NVDR	947	-	-	-	生活必需品流通・小売り
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	3,085	3,030	4,908	20,616	銀行
CP AXTRA PCL NVDR	-	1,593	4,978	20,908	生活必需品流通・小売り
RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	1,243	-	-	-	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
KASIKORN BANK PCL NVDR	570	454	5,675	23,835	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	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	—	16,672	2,934	12,323	銀行
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	6,721	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	294	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHIN CORP PCL	972	707	4,736	19,894	無線通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	3,922	3,000	5,280	22,176	食品
ADVANCED INFO SERVICE PCL	1,187	941	18,772	78,846	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	5,190.2	3,803.2	3,993	16,772	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	293.5	2,500	17,875	75,075	電子装置・機器・部品
PTT PCL	9,327	7,834	27,223	114,337	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	2,650	—	—	—	食品
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	831	805	3,562	14,960	消費者金融
LAND AND HOUSES PCL NVDR	8,261	6,561	4,789	20,116	不動産管理・開発
SIAM CEMENT PCL NVDR	729.5	650.5	16,327	68,575	建設資材
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	4,084	3,478	22,780	95,679	運送インフラ
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	1,934	1,565	9,742	40,916	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	9,628	9,111	25,283	106,188	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	525	513	11,542	48,478	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,281.1	2,740.1	8,699	36,539	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL NVDR	1,247	890	5,228	21,960	石油・ガス・消耗燃料
CP ALL PCL NVDR	5,488	4,518	24,849	104,365	生活必需品流通・小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL	8,669	6,431	3,955	16,611	陸上運輸
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	1,388.45	1,104.45	18,112	76,074	石油・ガス・消耗燃料
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	1,411.22	1,351.22	3,351	14,074	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,349.08	1,834.08	7,336	30,812	化学
JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR	543	—	—	—	消費者金融
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	1,676	1,380	4,623	19,416	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	6,124	6,299	5,165	21,693	運送インフラ
B GRIMM POWER PCL NVDR	982	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	2,910	2,112	8,870	37,255	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
OSOTSPA PCL NVDR	1,428	—	—	—	飲料
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	8,172	5,271	2,308	9,696	ホテル・レストラン・レジャー
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	1,584.33	1,210.33	4,236	17,791	大規模小売り
SCG PACKAGING PCL NVDR	1,433	978	3,105	13,041	容器・包装
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	690	—	—	—	消費者金融
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	2,953	2,086	3,775	15,857	専門小売り
SCB X PCL NVDR	903	677	7,176	30,140	銀行
TRUE CORP PCL NVDR	8,489.28	8,963.28	7,170	30,116	各種電気通信サービス
CARABAO GROUP PCL NVDR	325	—	—	—	飲料
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	554	587	2,553	10,724	消費者金融
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	744	383	1,905	8,002	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数 銘柄数	株数 銘柄数	312,828	1,313,877	<1.4%>
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
MBANK	13.44	11.96	816	31,013	銀行
BUDIMEX SA	—	10.92	751	28,544	建設・土木
KGHM POLSKA MIEDZ SA	132.82	100.79	1,435	54,490	金属・鉱業
BANK PEKAO SA	171.77	141.31	2,552	96,918	銀行
ORLEN SA	600.93	474.36	3,203	121,619	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA	1.12	0.91	1,380	52,411	繊維・アパレル・贅沢品
SANTANDER BANK POLSKA SA	32.41	28.35	1,568	59,564	銀行
CD PROJEKT RED SA	70.01	46.71	525	19,941	娯楽
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	859.44	696.57	4,035	153,228	銀行
CYFROWY POLSAT SA	200.87	—	—	—	メディア
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	800.42	608.56	365	13,876	電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	585	479.01	2,387	90,639	保険
DINO POLSKA SA	46.92	39.14	1,401	53,198	生活必需品流通・小売り
ALLEGRO.EU SA	345.9	416.96	1,329	50,483	大規模小売り

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	
(ポーランド) PEPCO GROUP NV	百株 165.87	百株 165.87	千ポーランド・ズロチ 311	千円 11,810	大規模小売り
小 計	株 数 4,026.92 銘 柄 数<比 率> 14銘柄	株 数 3,221.42 銘 柄 数 14銘柄	22,065 -	837,742 <0.9%>	
(ハンガリー) RICHTER GEDEON NYRT MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT OTP BANK NYRT	百株 137.96 407.81 222.96	百株 102.84 326.09 172.69	千ハンガリー・フォリント 93,121 98,674 297,199	千円 39,053 41,382 124,639	医薬品 石油・ガス・消耗燃料 銀行
小 計	株 数 768.73 銘 柄 数<比 率> 3銘柄	株 数 601.62 銘 柄 数 3銘柄	488,995 -	205,075 <0.2%>	
(ユーロ圏・ギリシャ) PIRAEUS BANK S.A ALPHA BANK A.E. NATIONAL BANK OF GREECE HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA FF GROUP EUROBANK ERGASIAS SERVICES MYTILINEOS HOLDINGS MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN OPAP SA JUMBO SA PUBLIC POWER CORP TERNA ENERGY SA	百株 - 2,124.73 515.07 208.5 31.3 2,404.41 90.56 46.96 178.33 120.11 214.41 61.02	百株 817.45 1,855.91 605.62 166.76 31.3 2,017.92 77.37 55.06 137.44 83.74 168.75 -	千ユーロ 305 284 426 232 0 363 275 143 221 215 184 -	千円 50,308 46,928 70,313 38,266 0 59,900 45,398 23,672 36,428 35,562 30,383 -	銀行 銀行 銀行 各種電気通信サービス 繊維・アパレル・贅沢品 銀行 コングロマリット 石油・ガス・消耗燃料 ホテル・レストラン・レジャー 専門小売り 電力 独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 5,995.4 銘 柄 数<比 率> 11銘柄	株 数 6,017.32 銘 柄 数 11銘柄	2,653 -	437,162 <0.5%>	
合 計	株 数 5,553,344.58 銘 柄 数<比 率> 1,354銘柄	株 数 5,958,371.91 銘 柄 数 1,332銘柄	-	84,380,932 <91.7%>	

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

(注2) < >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。

(※1) 当該銘柄はロシア株式を原資産とする預託証券です。市場での取引の停止・制限が継続されているため、評価額をゼロとしています。
(ファンド監査人と協議の上、企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」及び社団法人投資信託協会「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」に則り、委託会社が適切と判断した価格を採用しております。)

(※2) 当該銘柄はロシア株式です。市場での取引の停止・制限が継続されているため、評価額をゼロとしています。(ファンド監査人と協議の上、企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」及び社団法人投資信託協会「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」に則り、委託会社が適切と判断した価格を採用しております。)

(※3) 当該銘柄はロシアで事業を展開する会社の株式です。市場での取引の停止・制限が継続されているため、評価額をゼロとしています。
(ファンド監査人と協議の上、企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」及び社団法人投資信託協会「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」に則り、委託会社が適切と判断した価格を採用しております。)

(2) 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	金額	金額
(メキシコ)	千□		千□	千メキシコ・ペソ	千円
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D	186.1		154.41	31,039	282,574
GRUPO TELEVISIA SAB	246.9		-	-	-
CEMEX SAB DE CV	1,453.275		1,205.475	16,780	152,762
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	296.3		229.2	6,112	55,648
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	49.5		39.9	6,210	56,541
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,232.075 5銘柄<0.5%>	1,628.985 4銘柄<0.6%>	60,143 -	547,526 -
(ブラジル)	千□		千□	千ブラジル・レアル	千円
BANCO SANTANDER BRASIL SA	38		29.7	792	23,347
ENERGISA SA	16.1		19.9	909	26,781
KLABIN SA	78.2		59.5	1,449	42,674
BANCO BTG PACTUAL SA	111		91.5	2,995	88,201
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	243.3 4銘柄<0.2%>	200.6 4銘柄<0.2%>	6,147 -	181,005 -
(南アフリカ)	千□		千□	千南アフリカ・ランド	千円
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	321.604		-	-	-
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	321.604 1銘柄<0.0%>	- -銘柄<-%>	- -	- -
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,796.979 10銘柄<0.7%>	1,829.585 8銘柄<0.8%>	- -	728,532 -

(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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期		期末
	買	建	建
外国		百万円	百万円
MINI MSCI EMG MKT		6,842	-

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

■投資信託財産の構成

2024年4月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	84,380,932	91.0
投資信託受益証券、投資証券	728,532	0.8
コール・ローン等、その他	7,596,644	8.2
投資信託財産総額	92,706,109	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、92,184,547千円、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、2024年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=154.46円、1香港・ドル=19.73円、1台湾・ドル=4.752円、1イギリス・ポンド=192.32円、1トルコ・リラ=4.754円、1メキシコ・ペソ=9.103円、1フィリピン・ペソ=2.70円、100チリ・ペソ=15.784円、100コロンビア・ペソ=3.956円、1クウェート・ディナール=502.31円、1カタール・リアル=42.43円、1サウジアラビア・リアル=41.24円、1インド・ルピー=1.86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=42.13円、1ブラジル・レアル=29.442円、1チェコ・コルナ=6.524円、100韓国・ウォン=11.22円、1オフショア・人民元=21.318円、1マレーシア・リンギット=32.253円、1南アフリカ・ランド=8.11円、1タイ・バーツ=4.20円、1ポーランド・ズロチ=37.966円、100ハンガリー・フォリント=41.938円、1ユーロ=164.73円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月18日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	93,019,447,422円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,539,021,875
株 式(評価額)	84,380,932,702
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	672,883,580
投 資 証 券(評価額)	55,648,770
未 収 入 金	315,066,506
未 収 配 当 金	163,877,305
差 入 委 託 証 拠 金	1,892,016,684
(B) 負 債	1,015,806,086
未 払 金	569,120,086
未 払 解 約 金	446,686,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	92,003,641,336
元 本	54,761,986,005
次 期 繰 越 損 益 金	37,241,655,331
(D) 受 益 権 総 口 数	54,761,986,005口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	16,801円

(注1) 期首元本額 64,749,710,350円
 追加設定元本額 32,675,227,035円
 一部解約元本額 42,662,951,380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>
 10,092,188,846円
 たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>
 4,332,203,323円
 M I T O ラップ型ファンド (安定型) 2,597,345円
 M I T O ラップ型ファンド (中立型) 10,877,357円
 M I T O ラップ型ファンド (積極型) 27,524,296円
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 31,030,283円
 グローバル8資産ラップファンド (中立型) 35,760,662円
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 22,467,888円
 たわらノーロード 新興国株式 13,287,751,461円
 たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け> 1,875,988,956円
 たわらノーロード バランス (8資産均等型) 4,740,095,109円
 たわらノーロード バランス (堅実型) 29,723,373円
 たわらノーロード バランス (標準型) 140,600,619円
 たわらノーロード バランス (積極型) 267,189,918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) 491,029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) 103,365,101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) 126,190,831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) 224,234,382円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 11,703円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 9,281,270円
 たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 2,540,142円
 たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 9,825,079円
 たわらノーロード 全世界株式 1,948,996,478円
 O n e D C 新興国株式インデックスファンド 1,240,761,618円

マネックス資産設計ファンド エボリューション 385,770,348円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) 400,914,931円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) 597,969,327円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) 1,176,177,128円
 投資のソムリエ 4,679,807,167円
 グルーズコントロール 238,565,155円
 投資のソムリエ<DC年金> 477,230,061円
 D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 518,294,972円
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 818,140,867円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 2,594,368,576円
 ワールドアセットバランス (基本コース) 488,459,044円
 ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 1,056,982,887円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 101,547,035円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 51,687,588円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 7,391,597円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 96,074,435円
 リスクコントロール世界資産分散ファンド 1,756,435,037円
 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 302,237,195円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 35,469,393円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 56,051,103円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 34,676,533円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) 8,632,083円
 O n e グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け> 22,285,974円
 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 71,456,700円
 リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用) 2,609,447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) 131,375,767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) 89,585,495円
 期末元本合計 54,761,986,005円

■損益の状況

当期 自2023年4月19日 至2024年4月18日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,697,521,902円	
	受取配当金	2,487,727,503	
	受取利息	104,102,749	
	その他の収益	105,856,488	
	支払利息	△164,838	
(B)	有価証券売買損益	13,517,889,164	
	売却益	25,325,622,271	
	売却損	△11,807,733,107	
(C)	先物取引等取引損益	△395,445,347	
	取引益	1,130,970,765	
	取引損	△1,526,416,112	
(D)	その他費用	△204,339,761	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	15,615,625,958	
(F)	前期繰越損益金	27,233,140,175	
(G)	解約差損益金	△22,816,115,767	
(H)	追加信託差損益金	17,209,004,965	
(I)	合計(E+F+G+H)	37,241,655,331	
	次期繰越損益金(I)	37,241,655,331	

(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16期 (決算日 2024年4月18日)

(計算期間 2023年4月19日～2024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	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	%			
12期 (2020年4月20日)	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5	—	百万円 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
15期 (2023年4月18日)	20,300	1.8	93,922.40	1.0	96.8	—	136,262
16期 (2024年4月18日)	23,481	15.7	117,190.62	24.8	98.2	—	112,310

(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)。

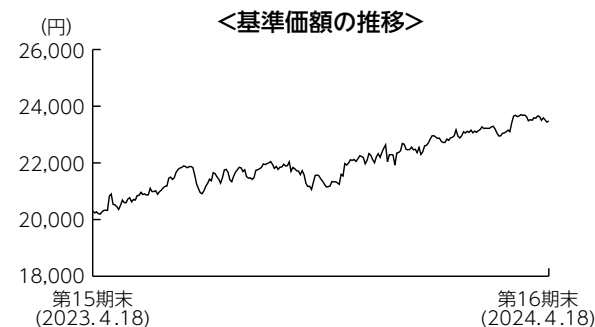
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		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) (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) 2023 年 4 月 18 日	円 20,300	% -	ポイント 93,922.40	% -	% 96.8	% -
4 月 末	20,326	0.1	93,661.07	△0.3	98.6	-
5 月 末	20,908	3.0	96,860.26	3.1	97.9	-
6 月 末	21,872	7.7	102,541.84	9.2	95.9	-
7 月 末	21,475	5.8	101,562.43	8.1	97.5	-
8 月 末	21,963	8.2	103,973.59	10.7	97.6	-
9 月 末	21,586	6.3	102,072.50	8.7	86.8	-
10 月 末	21,245	4.7	100,626.42	7.1	97.7	-
11 月 末	22,216	9.4	105,978.47	12.8	97.7	-
12 月 末	22,482	10.7	107,454.17	14.4	96.0	-
2024 年 1 月 末	22,885	12.7	109,899.73	17.0	97.7	-
2 月 末	23,224	14.4	113,752.19	21.1	97.7	-
3 月 末	23,677	16.6	117,275.84	24.9	97.8	-
(期 末) 2024 年 4 月 18 日	23,481	15.7	117,190.62	24.8	98.2	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2023年4月19日から2024年4月18日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は23,481円となり、前期末比で15.7%上昇しました。

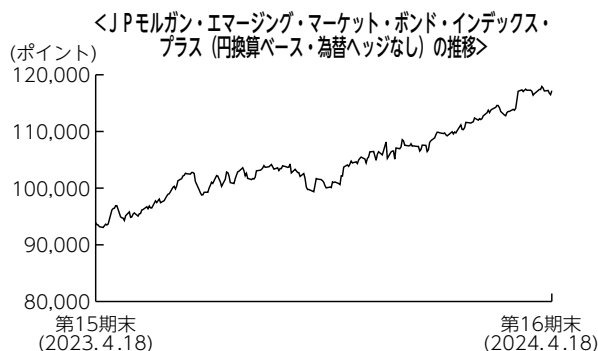
基準価額の主な変動要因

対米国債スプレッド（利回り格差）の縮小や米ドルが対円で上昇したことなどを主因に、基準価額は上昇しました。

投資環境

新興国債券市場は上昇しました。期初から2023年10月末は米金融引き締め長期化観測などから米長期国債が下落し、それに連れて新興国債券も下落したものの、12月末にかけて米経済指標の下振れなどから早期の利下げ観測が強まり、米長期国債の上昇に連れて大きく上昇し、その後は横ばいで推移しました。対米国債スプレッドは縮小しました。米景気の軟着陸期待の高まりなどからリスク選考の改善などに伴い縮小しました。

為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。



期初から2023年10月にかけては、米国が利上げを続ける一方で日銀は緩和を続けたことにより、日米金融政策の違いが意識され、大幅に円安が進みました。その後は米国の早期利下げ観測が強まったことなどに伴い円高となる局面があったものの、日銀が2024年3月の金融政策決定会合にてマイナス金利を解除しつつも緩和的な金融環境を維持する方針を示したことで再び円安基調となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである 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。

【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	3.5%	△3.5%	
	ブラジル	5.1%	4.2%	0.8%
	チリ	6.4%	5.5%	0.9%
	メキシコ	9.2%	7.9%	1.3%
	パナマ	5.7%	4.8%	0.9%
	ペルー	3.8%	2.9%	0.9%
	ベネズエラ	—	0.0%	△0.0%
	エクアドル	—	2.2%	△2.2%
	コロンビア	5.9%	5.0%	0.9%
	ドミニカ共和国	5.8%	4.9%	1.0%
ウルグアイ	2.6%	1.8%	0.7%	
計	44.5%	42.8%	1.6%	
欧州	ハンガリー	4.6%	3.2%	1.4%
	トルコ	—	10.0%	△10.0%
	ウクライナ	—	0.4%	△0.4%
	ルーマニア	2.9%	1.2%	1.7%
計	7.4%	14.8%	△7.4%	
アジア・オセアニア	中国	0.6%	3.4%	△2.8%
	インドネシア	4.4%	3.0%	1.4%
	フィリピン	2.9%	1.6%	1.2%
	スリランカ	—	0.4%	△0.4%
計	7.9%	8.4%	△0.6%	
中近東	カタール	9.7%	8.5%	1.2%
	アラブ首長国連邦	8.7%	7.3%	1.4%
	サウジアラビア	11.4%	10.1%	1.3%
	オマーン	3.3%	2.8%	0.5%
計	33.1%	28.6%	4.5%	
アフリカ	南アフリカ	3.9%	2.1%	1.9%
	エジプト	—	2.8%	△2.8%
	ナイジェリア	—	0.4%	△0.4%
	計	3.9%	5.3%	△1.4%
現金など	3.2%	—	—	
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	—	5.9%	△5.9%
	ブラジル	7.3%	5.8%	1.6%
	チリ	6.7%	5.2%	1.4%
	メキシコ	9.8%	7.6%	2.2%
	パナマ	4.5%	3.5%	1.0%
	ペルー	3.3%	2.6%	0.7%
	ベネズエラ	—	0.0%	△0.0%
	エクアドル	—	3.0%	△3.0%
	コロンビア	4.5%	3.6%	1.0%
	ドミニカ共和国	6.3%	4.9%	1.4%
ウルグアイ	1.1%	0.9%	0.2%	
計	43.6%	42.9%	0.7%	
欧州	ポーランド	7.0%	5.8%	1.2%
	ハンガリー	7.0%	4.1%	2.9%
	トルコ	—	9.6%	△9.6%
	ウクライナ	—	0.7%	△0.7%
	ルーマニア	5.8%	3.2%	2.6%
計	19.8%	23.4%	△3.6%	
アジア・オセアニア	中国	1.2%	3.3%	△2.1%
	インドネシア	3.7%	2.7%	0.9%
	フィリピン	1.2%	0.9%	0.2%
	スリランカ	—	0.6%	△0.6%
計	6.1%	7.6%	△1.5%	
中近東	カタール	3.8%	3.3%	0.5%
	アラブ首長国連邦	7.1%	6.2%	0.9%
	サウジアラビア	10.8%	9.6%	1.2%
	オマーン	2.3%	2.1%	0.3%
計	24.0%	21.1%	2.9%	
アフリカ	南アフリカ	4.8%	2.0%	2.8%
	エジプト	—	2.5%	△2.5%
	ナイジェリア	—	0.5%	△0.5%
	計	4.8%	5.0%	△0.2%
現金など	1.8%	—	—	
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24.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを9.1%下回りました。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債へ投資しなかったことなどが要因です。

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	3円	0.012%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保 管 費 用)	(3)	(0.012)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	3	0.012	
期中の平均基準価額は22,003円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2023年4月19日から2024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 770,013	千アメリカ・ドル 991,781 (1,380)

(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 (2023年4月19日から2024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 829,100	千アメリカ・ドル 714,199	千円 110,315,301	% 98.2	% 20.7	% 81.2	% 13.0	% 4.0
合 計	-	-	110,315,301	98.2	20.7	81.2	13.0	4.0

(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 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	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	国債証券	3.1000	3,000	1,788	276,254	2061/01/22
PANAMA 4.5 01/19/63	国債証券	4.5000	8,000	5,002	772,664	2063/01/19
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	1,000	1,012	156,361	2026/01/29
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	国債証券	3.7500	5,400	3,656	564,768	2055/01/21
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	国債証券	5.8750	6,000	4,851	749,390	2060/01/30
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	国債証券	5.0000	4,000	3,388	523,379	2053/01/18
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	500	600	92,769	2038/01/17
DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41	国債証券	5.3000	3,000	2,435	376,183	2041/01/21
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	2,200	2,181	336,976	2025/01/15
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	1,600	1,564	241,604	2027/01/08
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	1,000	991	153,222	2026/01/08
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	国債証券	5.2500	3,000	2,687	415,118	2050/01/16
PERU 3.0 01/15/34	国債証券	3.0000	9,000	7,109	1,098,158	2034/01/15
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	国債証券	3.5000	4,000	2,785	430,245	2050/01/25
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	国債証券	3.5000	10,200	8,704	1,344,573	2034/01/31
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54	国債証券	5.7500	1,000	941	145,476	2054/01/16
PANAMA 3.16 01/23/30	国債証券	3.1600	8,000	6,592	1,018,267	2030/01/23
BRAZIL 4.75 01/14/50	国債証券	4.7500	7,000	4,964	766,892	2050/01/14
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	国債証券	2.5500	8,200	6,769	1,045,598	2032/01/27
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国債証券	4.5000	6,000	4,512	697,074	2050/01/31
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	1,200	1,005	155,328	2031/01/31
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	国債証券	5.6250	5,000	4,939	762,894	2028/01/17
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	国債証券	4.3750	5,000	4,821	744,662	2031/01/23
ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	7.1250	16,000	16,589	2,562,397	2033/01/17
ROMANIA 6.375 01/30/34	国債証券	6.3750	2,000	1,963	303,204	2034/01/30
PERU 2.783 01/23/31	国債証券	2.7830	9,000	7,522	1,161,962	2031/01/23
COLOMBIA 3.0 01/30/30	国債証券	3.0000	8,000	6,451	996,565	2030/01/30

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	国債証券	6.2500	5,000	5,058	781,316	2031/01/25
PERU 2.392 01/23/26	国債証券	2.3920	2,000	1,892	292,378	2026/01/23
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	国債証券	4.5000	9,000	7,996	1,235,186	2030/01/30
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	国債証券	2.7500	6,200	5,769	891,156	2027/01/31
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	国債証券	4.7500	8,000	7,865	1,214,925	2028/01/18
REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29	国債証券	4.8500	3,000	2,939	454,061	2029/01/22
ROMANIA 5.875 01/30/29	国債証券	5.8750	6,000	5,897	910,866	2029/01/30
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	国債証券	3.4500	2,000	1,236	191,054	2061/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	国債証券	4.4000	3,000	2,179	336,645	2052/02/12
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	国債証券	3.5000	9,000	7,257	1,120,941	2034/02/12
ROMANIA 4.0 02/14/51	国債証券	4.0000	9,000	6,052	934,869	2051/02/14
COLOMBIA 7.5 02/02/34	国債証券	7.5000	8,000	7,900	1,220,298	2034/02/02
PANAMA 6.4 02/14/35	国債証券	6.4000	8,000	7,456	1,151,748	2035/02/14
UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	国債証券	6.3500	7,000	7,007	1,082,357	2035/02/09
ROMANIA 3.0 02/14/31	国債証券	3.0000	3,000	2,467	381,139	2031/02/14
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	国債証券	2.2500	12,000	9,355	1,445,069	2033/02/02
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	国債証券	6.0000	5,200	4,871	752,524	2033/02/22
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	5.5000	12,000	11,396	1,760,315	2029/02/22
ROMANIA 6.625 02/17/28	国債証券	6.6250	9,000	9,149	1,413,267	2028/02/17
REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	国債証券	5.5000	9,000	8,625	1,332,268	2054/03/18
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	4.8170	8,000	7,070	1,092,121	2049/03/14
HUNGARY 5.5 03/26/36	国債証券	5.5000	3,000	2,819	435,522	2036/03/26
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	国債証券	4.3400	7,000	5,887	909,429	2042/03/07
PERU 3.55 03/10/51	国債証券	3.5500	8,000	5,441	840,571	2051/03/10
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	国債証券	4.0000	8,000	7,674	1,185,464	2029/03/14
INDONESIA 3.05 03/12/51	国債証券	3.0500	4,000	2,650	409,322	2051/03/12
INDONESIA 1.85 03/12/31	国債証券	1.8500	3,200	2,547	393,540	2031/03/12
BRAZIL 6.125 03/15/34	国債証券	6.1250	3,000	2,854	440,920	2034/03/15
ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	国債証券	1.7000	7,000	5,654	873,436	2031/03/02
REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	国債証券	4.6250	6,000	5,877	907,770	2029/03/18
PANAMA 4.5 04/01/56	国債証券	4.5000	9,000	5,706	881,456	2056/04/01
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	国債証券	3.7500	4,000	2,390	369,248	2071/04/19
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	国債証券	4.5000	4,000	3,095	478,053	2060/04/22
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	国債証券	3.5000	5,000	3,455	533,813	2053/04/15
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	国債証券	5.0000	7,000	5,628	869,360	2051/04/27
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	国債証券	7.3000	10,000	8,437	1,303,256	2052/04/20
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	国債証券	4.5000	5,000	4,742	732,603	2029/04/22
REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	国債証券	5.5000	8,000	7,662	1,183,565	2053/04/04
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	国債証券	4.7500	5,000	4,608	711,770	2032/04/27
COLOMBIA 3.25 04/22/32	国債証券	3.2500	7,000	5,295	817,999	2032/04/22
COLOMBIA 8.0 04/20/33	国債証券	8.0000	7,000	7,166	1,106,977	2033/04/20
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	1,400	1,354	209,158	2026/04/14
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	4.3750	11,000	10,582	1,634,607	2029/04/16
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	国債証券	4.5000	4,000	3,824	590,709	2030/04/17

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 3.25 04/16/30	国債証券	3.2500	6,000	5,223	806,817	2030/04/16
COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	3.1250	8,000	6,220	960,820	2031/04/15
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	国債証券	4.4000	6,000	4,956	765,596	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	国債証券	3.8750	5,000	3,788	585,114	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	国債証券	3.1250	6,000	5,399	834,080	2030/04/16
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	国債証券	3.7500	2,000	1,876	289,829	2030/04/16
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	国債証券	3.4000	6,000	5,878	907,946	2025/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	国債証券	2.5000	6,000	5,822	899,293	2025/04/16
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	国債証券	3.7710	4,000	2,450	378,437	2061/05/24
UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54	国債証券	6.4000	2,000	1,901	293,685	2054/05/07
UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	国債証券	6.3380	5,000	4,705	726,795	2053/05/04
BRAZIL 7.125 05/13/54	国債証券	7.1250	3,000	2,863	442,248	2054/05/13
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	国債証券	3.1000	9,000	6,405	989,445	2041/05/07
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	国債証券	2.6590	8,000	6,506	1,005,016	2031/05/24
UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	国債証券	4.8750	6,000	5,514	851,750	2033/05/19
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	8,000	7,432	1,147,995	2029/05/30
HUNGARY 6.125 05/22/28	国債証券	6.1250	8,000	8,109	1,252,665	2028/05/22
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	2,000	1,835	283,434	2030/06/22
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	国債証券	6.4000	9,000	8,083	1,248,524	2049/06/05
BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	3.8750	9,000	7,892	1,219,078	2030/06/12
ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	国債証券	1.6250	5,000	4,344	671,051	2028/06/02
BRAZIL 2.875 06/06/25	国債証券	2.8750	4,000	3,864	596,965	2025/06/06
HUNGARY 5.25 06/16/29	国債証券	5.2500	13,000	12,668	1,956,776	2029/06/16
PANAMA 3.87 07/23/60	国債証券	3.8700	4,000	2,244	346,614	2060/07/23
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	国債証券	2.5500	4,000	3,173	490,203	2033/07/27
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	国債証券	3.2000	7,000	4,762	735,583	2046/07/06
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	国債証券	4.8750	9,000	8,625	1,332,347	2033/07/18
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	国債証券	4.0500	5,000	4,682	723,243	2032/07/07
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	国債証券	4.2800	9,000	6,936	1,071,341	2041/08/14
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	国債証券	6.0000	7,000	7,032	1,086,280	2029/08/01
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	国債証券	2.7000	4,000	2,180	336,867	2070/09/02
HUNGARY 3.125 09/21/51	国債証券	3.1250	7,000	4,199	648,604	2051/09/21
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	200	182	28,153	2029/09/18
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	国債証券	4.8750	7,000	6,089	940,602	2032/09/23
PANAMA 2.252 09/29/32	国債証券	2.2520	7,000	4,904	757,509	2032/09/29
REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34	国債証券	5.1250	9,000	8,725	1,347,768	2034/09/18
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	国債証券	3.1250	4,000	2,645	408,546	2049/09/30
UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	国債証券	4.9170	4,000	3,974	613,901	2033/09/25
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	5.7500	15,000	10,592	1,636,132	2049/09/30
HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証券	6.2500	13,000	13,137	2,029,264	2032/09/22
BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	3.7500	14,000	11,846	1,829,761	2031/09/12
HUNGARY 2.125 09/22/31	国債証券	2.1250	13,000	10,064	1,554,574	2031/09/22
ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	国債証券	1.8750	7,000	5,650	872,847	2031/09/15
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	国債証券	2.5000	5,000	4,406	680,669	2029/09/30

銘柄	当 期			評 価 額		末
	種 類	利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
				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	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	国債証券	4.8500	14,000	12,454	1,923,747	2029/09/30
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	国債証券	3.2500	5,000	3,234	499,571	2061/10/19
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	国債証券	5.7500	3,000	3,079	475,685	2034/10/28
INDONESIA 4.2 10/15/50	国債証券	4.2000	8,000	6,357	982,051	2050/10/15
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	国債証券	5.5000	11,000	11,051	1,707,086	2032/10/25
REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	国債証券	4.8750	9,000	8,638	1,334,273	2033/10/04
BRAZIL 6.0 10/20/33	国債証券	6.0000	12,000	11,452	1,768,987	2033/10/20
INDONESIA 3.85 10/15/30	国債証券	3.8500	10,400	9,564	1,477,398	2030/10/15
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	国債証券	1.2000	4,000	3,255	502,832	2030/10/21
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	国債証券	3.2500	9,200	8,151	1,259,055	2030/10/22
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	国債証券	2.9000	4,000	3,853	595,221	2025/10/22
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	国債証券	1.2500	4,000	3,658	565,076	2026/10/26
REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	国債証券	5.7500	6,000	6,121	945,526	2032/11/16
REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	国債証券	5.5000	5,000	5,050	780,158	2027/11/16
PERU 2.78 12/01/60	国債証券	2.7800	4,000	2,130	329,128	2060/12/01
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	国債証券	2.6500	6,000	3,741	577,867	2045/12/10
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	国債証券	1.9500	2,000	1,957	302,375	2024/12/03
合 計	-	-	829,100	714,199	110,315,301	-

■投資信託財産の構成

2024年4月18日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円 110,315,301		% 97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,647,402		2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	112,962,704		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、112,350,092千円、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、2024年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=154.46円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月18日)現在

項	目	当	期	末
(A)	資 産	113,312,304,596	円	
	コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,374,323,241		
	公 社 債(評価額)	110,315,301,340		
	未 収 入 金	350,000,000		
	未 収 利 息	1,056,809,359		
	未 払 費 用	215,870,656		
(B)	負 債	1,002,018,226		
	未 払 金	573,079,226		
	未 払 解 約 金	428,939,000		
(C)	純 資 産 総 額(A-B)	112,310,286,370		
	元 本	47,831,274,931		
	次 期 繰 越 損 益 金	64,479,011,439		
(D)	受 益 権 総 口 数	47,831,274,931	口	
	1万口当たり基準価額(C/D)	23,481	円	

(注1) 期首元本額 67,123,867,342円
追加設定元本額 43,526,714,562円
一部解約元本額 62,819,306,973円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>	56,545,881円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,402,228,783円
たわらノーロード バランス(堅実型)	185,898,554円
たわらノーロード バランス(標準型)	611,432,709円
たわらノーロード バランス(積極型)	288,880,377円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	488,065円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	5,013,325円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	66,432,394円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	7,270,485円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,800,979円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	62,340,964円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10)	271,810,079円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20)	409,557,576円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30)	829,027,400円
投資のソムリエ	12,760,704,368円
クルーズコントロール	175,172,226円
投資のソムリエ<DC年金>	1,299,821,204円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	377,434,623円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,188,460,901円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,769,475,205円
ワールドアセットバランス(基本コース)	332,991,505円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	755,680,455円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	79,148,286円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	40,307,356円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	10,742,825円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	261,787,480円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	641,380,664円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	222,835,935円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	96,645,355円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	43,884,243円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	27,134,290円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,707,467円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	2,067,283円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	19,919,297円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	15,421,084,811円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	194,553,833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)	726,463,768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)	451,003,739円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOF5用)(適格機関投資家専用)	7,063,327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)	93,025,067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)	63,720,320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)	2,556,331,527円
期末元本合計	47,831,274,931円

■損益の状況

当期 自2023年4月19日 至2024年4月18日

項	目	当	期
(A)	配 当 等 収 益	5,614,232,019	円
	受 取 利 息	5,613,461,401	
	そ の 他 収 益 金	1,112,433	
	支 払 利 息	△341,815	
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益	10,007,181,950	
	売 買 益	18,663,475,866	
	売 買 損	△8,656,293,916	
(C)	そ の 他 費 用	△13,081,454	
(D)	当 期 損 益 金(A+B+C)	15,608,332,515	
(E)	前 期 繰 越 損 益 金	69,138,728,177	
(F)	解 約 差 損 益 金	△72,993,928,691	
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金	52,725,879,438	
(H)	合 計(D+E+F+G)	64,479,011,439	
	次 期 繰 越 損 益 金(H)	64,479,011,439	

(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18期（決算日 2024年6月6日）

（計算期間 2023年6月7日～2024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18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	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
	期中 騰落率	騰落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期（2020年6月8日）	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2	41,885
15期（2021年6月7日）	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2	88,531
16期（2022年6月6日）	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	97.6	2.3	199,921
17期（2023年6月6日）	23,686	△2.9	4,437.30	△2.9	97.8	2.2	200,500
18期（2024年6月6日）	23,008	△2.9	4,307.31	△2.9	97.1	2.8	176,077

（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）。

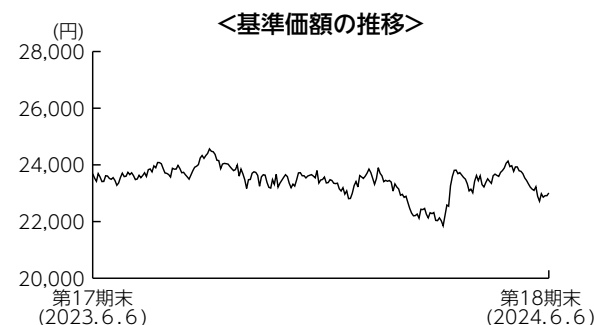
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 率 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 比 率 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) 2023 年 6 月 6 日	円 23,686	% -	ポイント 4,437.30	% -	% 97.8	% 2.2
6 月 末	23,600	△0.4	4,421.28	△0.4	97.8	2.1
7 月 末	23,876	0.8	4,472.88	0.8	97.7	2.2
8 月 末	24,229	2.3	4,539.20	2.3	97.2	2.7
9 月 末	23,852	0.7	4,468.30	0.7	97.0	2.9
10 月 末	23,355	△1.4	4,372.14	△1.5	97.1	2.9
11 月 末	23,801	0.5	4,455.46	0.4	97.2	2.7
12 月 末	23,412	△1.2	4,382.85	△1.2	97.1	2.8
2024 年 1 月 末	23,392	△1.2	4,378.56	△1.3	97.1	2.7
2 月 末	22,258	△6.0	4,166.74	△6.1	97.3	2.7
3 月 末	23,557	△0.5	4,410.17	△0.6	97.2	2.7
4 月 末	23,800	0.5	4,455.74	0.4	97.2	2.7
5 月 末	22,980	△3.0	4,302.09	△3.0	97.2	2.7
(期 末) 2024 年 6 月 6 日	23,008	△2.9	4,307.31	△2.9	97.1	2.8

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年6月7日から2024年6月6日まで）

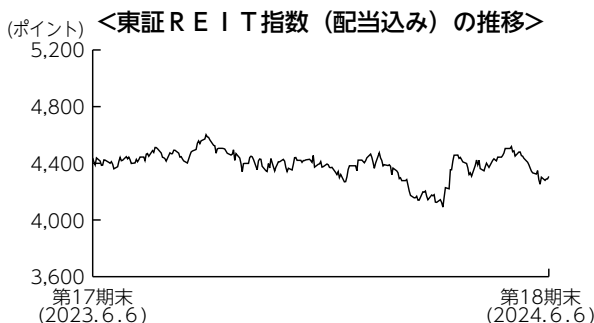


基準価額の推移

当期末の基準価額は23,008円となり、前期末比で2.9%下落しました。

基準価額の主な変動要因

日銀による金融政策の早期正常化観測などを背景に東証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。2024年1月半ばまでは日米の金融政策の先行き不透明感から方向感に欠ける展開が続きました。その後、日銀の金融政策正常化への警戒感から下落しましたが、3月の金融政策決定会合においてマイナス金利解除が決まると先行き不透明感が払拭され、加えて金融緩和的な環境が当面続くとの観測から反発しました。期末にかけては、日銀が金融政策の正常化を早めるとの観測が強まり、軟調に推移しました。

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2.9%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)	0円	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)	(0)	(0.001)	
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は23,451円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2023年6月7日から2024年6月6日まで)

(1) 投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	1.82	215,974	2.101	248,909
	(-)	(-)	(-)	(-)
サンケイリアルエステート投資法人	2.866	261,292	3.31	299,730
	(-)	(-)	(-)	(-)
S O S I L A物流リート投資法人	4.492	549,146	5.155	627,392
	(-)	(-)	(-)	(-)
東海道リート投資法人	1.678	210,433	1.831	227,205
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本アコモデーションファンド投資法人	3.081	1,929,478	3.559	2,215,658
	(-)	(-)	(-)	(-)
森ヒルズリート投資法人	10.515	1,480,261	12.142	1,693,861
	(-)	(-)	(-)	(-)
産業ファンド投資法人	19.279	2,617,554	16.329	2,225,882
	(-)	(-)	(-)	(-)
アドバンス・レジデンス投資法人	9.196	3,051,767	10.901	3,601,098
	(-)	(-)	(-)	(-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2.89	657,189	16.463	3,519,258
	(-)	(-)	(-)	(-)
アクティブピア・プロパティーズ投資法人	4.631	1,862,059	5.419	2,171,683
	(-)	(-)	(-)	(-)
G L P投資法人	30.123	4,081,394	35.003	4,676,432
	(-)	(-)	(-)	(-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4.602	1,491,072	5.032	1,613,794
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本プロロジスリート投資法人	15.626	4,310,532	17.979	4,878,631
	(-)	(-)	(-)	(-)
星野リゾート・リート投資法人	2.245	1,315,222	1.883	1,119,686
	(-)	(-)	(-)	(-)
Oneリート投資法人	1.557	405,199	1.798	465,279
	(-)	(-)	(-)	(-)
イオンリート投資法人	12.369	1,780,060	12.612	1,799,162
	(-)	(-)	(-)	(-)
ヒューリックリート投資法人	8.359	1,291,991	9.654	1,491,758
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本リート投資法人	2.905	1,005,465	3.355	1,160,649
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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		26.852		2,158,993		31.012		2,508,612
		(-)		(-)		(-)		(-)
トーセイ・リート投資法人		1.871		259,702		2.371		327,950
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス商業リート投資法人		1.704		491,759		9.75		2,652,150
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		2.207		313,314		2.548		358,481
		(-)		(-)		(-)		(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人		2.657		298,187		2.802		311,461
		(-)		(-)		(-)		(-)
野村不動産マスターファンド投資法人		28.903		4,727,220		33.38		5,404,280
		(-)		(-)		(-)		(-)
いちごホテルリート投資法人		1.478		162,524		1.707		187,696
		(-)		(-)		(-)		(-)
ラサールロジポート投資法人		12.375		1,860,122		13.144		1,950,287
		(-)		(-)		(-)		(-)
スターアジア不動産投資法人		18.561		1,062,613		15.279		887,851
		(-)		(-)		(-)		(-)
マリモ地方創生リート投資法人		1.406		177,552		1.594		201,606
		(-)		(-)		(-)		(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		4.074		1,914,082		4.263		1,968,867
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ホテル&レジデンシャル投資法人		1.359		93,573		1.728		116,580
		(-)		(-)		(-)		(-)
投資法人みらい		14.575		663,663		13.561		620,717
		(-)		(-)		(-)		(-)
三菱地所物流リート投資法人		3.116		1,189,632		3.561		1,357,297
		(-)		(-)		(-)		(-)
CREロジスティクスファンド投資法人		3.886		622,019		4.445		708,229
		(-)		(-)		(-)		(-)
ザイマックス・リート投資法人		1.453		170,595		1.678		195,775
		(-)		(-)		(-)		(-)
タカラレーベン不動産投資法人		5.304		520,584		4.907		485,949
		(-)		(-)		(-)		(-)
アドバンス・ロジスティクス投資法人		3.959		499,714		4.523		568,458
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ビルファンド投資法人		10.424		6,292,531		12.039		7,189,709
		(-)		(-)		(-)		(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人		9.209		5,236,328		10.599		5,957,540
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本都市ファンド投資法人		42.515		4,137,198		53.819		5,196,002
		(-)		(-)		(-)		(-)
オリックス不動産投資法人		17.806		3,070,729		20.564		3,548,381
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プライムリアルティ投資法人		6.113		2,156,108		7.06		2,474,634
		(-)		(-)		(-)		(-)
NTT都市開発リート投資法人		9.364		1,214,627		9.795		1,268,538
		(-)		(-)		(-)		(-)
東急リアル・エステート投資法人		5.992		1,054,823		6.921		1,213,089
		(-)		(-)		(-)		(-)
グローバル・ワン不動産投資法人		6.638		744,935		7.614		851,266
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ユナイテッド・アーバン投資法人	19.993 (-)	3,005,653 (-)	23.089 (-)	3,443,613 (-)
森トラストリート投資法人	18.408 (-)	1,344,609 (-)	19.85 (-)	1,440,247 (-)
インヴィンシブル投資法人	50.923 (-)	3,073,858 (-)	49.476 (-)	3,003,666 (-)
フロンティア不動産投資法人	3.315 (-)	1,492,992 (-)	3.829 (-)	1,722,127 (-)
平和不動産リート投資法人	7.538 (-)	1,063,901 (-)	7.308 (-)	1,026,115 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	5.64 (-)	1,617,816 (-)	7.189 (-)	2,054,307 (-)
福岡リート投資法人	4.616 (-)	762,262 (-)	5.332 (-)	873,951 (-)
KDX不動産投資法人	31.031 (24.335)	7,788,795 (-)	17.614 (-)	3,381,983 (-)
いちごオフィスリート投資法人	7.328 (-)	623,720 (-)	8.462 (-)	720,480 (-)
大和証券オフィス投資法人	1.867 (3.676)	1,200,170 (-)	2.283 (-)	1,361,843 (-)
阪急阪神リート投資法人	4.709 (-)	665,980 (-)	4.905 (-)	686,661 (-)
スターツプロシード投資法人	1.551 (-)	325,486 (-)	1.791 (-)	375,512 (-)
大和ハウスリート投資法人	13.465 (-)	3,557,715 (-)	15.552 (-)	4,085,667 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	31.902 (-)	2,301,345 (-)	34.265 (-)	2,511,266 (-)
大和証券リビング投資法人	14.334 (-)	1,555,762 (-)	14.764 (-)	1,598,601 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	7.704 (-)	989,812 (-)	9.801 (-)	1,265,802 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 20,724	百万円 19,938	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2023年6月7日から2024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 100,979	百万円 13,310	% 13.2	百万円 112,099	百万円 13,897	% 12.4
不動産投信指数先物取引	20,724	5,118	24.7	19,938	9,265	46.5

(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 4,180

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	2,468千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	885千円
(B) / (A)	35.9%

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

■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			3.762		3.481	418,068	0.2
サンケイリアルエステート投資法人			5.929		5.485	467,322	0.3
S O S I L A物流リート投資法人			9.206		8.543	1,002,948	0.6
東海道リート投資法人			3.078		2.925	359,190	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人			6.391		5.913	3,843,450	2.2
森ヒルズリート投資法人			21.763		20.136	2,625,734	1.5
産業ファンド投資法人			28.239		31.189	3,907,981	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人			18.505		16.8	5,510,400	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人			13.573		—	—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人			9.771		8.983	3,373,116	1.9
G L P 投資法人			62.397		57.517	7,644,009	4.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人			8.85		8.42	2,723,870	1.5
日本プロロジスリート投資法人			32.182		29.829	7,433,386	4.2
星野リゾート・リート投資法人			3.237		3.599	1,885,876	1.1
One リート投資法人			3.228		2.987	761,386	0.4
イオンリート投資法人			21.247		21.004	2,810,335	1.6
ヒューリックリート投資法人			17.316		16.021	2,351,882	1.3
日本リート投資法人			6.012		5.562	1,888,299	1.1
積水ハウス・リート投資法人			55.614		51.454	4,121,465	2.3
トーセイ・リート投資法人			4.106		3.606	498,349	0.3
ケネディクス商業リート投資法人			8.046		—	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人			4.563		4.222	545,904	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人			4.811		4.666	492,263	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人			59.85		55.373	7,818,667	4.4
いちごホテルリート投資法人			3.066		2.837	313,488	0.2
ラサールロジポート投資法人			22.657		21.888	3,307,276	1.9
スターアジア不動産投資法人			23.108		26.39	1,593,956	0.9
マリモ地方創生リート投資法人			2.827		2.639	342,278	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人			7.311		7.122	3,155,046	1.8
日本ホテル&レジデンシャル投資法人			2.987		2.618	195,041	0.1
投資法人みらい			22.485		23.499	1,058,629	0.6
三菱地所物流リート投資法人			6.358		5.913	2,288,331	1.3
C R E ロジスティクスファンド投資法人			7.93		7.371	1,068,795	0.6
ザイマックス・リート投資法人			3.002		2.777	331,851	0.2
タカラレーベン不動産投資法人			8.724		9.121	902,066	0.5
アドバンス・ロジスティクス投資法人			8.067		7.503	907,863	0.5
日本ビルファンド投資法人			21.591		19.976	11,725,912	6.7

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	%	
ジャパンリアルエステイト投資法人	18,979	17,589	9,163,869	5.2	
日本都市ファンド投資法人	93,381	82,077	7,444,383	4.2	
オリックス不動産投資法人	36,876	34,118	5,455,468	3.1	
日本プライムリアルティ投資法人	12,657	11,71	3,881,865	2.2	
NTT都市開発リート投資法人	17,791	17.36	2,046,744	1.2	
東急リアル・エステート投資法人	12,409	11.48	1,796,620	1.0	
グローバル・ワン不動産投資法人	13.62	12,644	1,284,630	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人	41.4	38,304	5,431,507	3.1	
森トラストリート投資法人	34,447	33,005	2,323,552	1.3	
インヴィンシブル投資法人	81.46	82,907	5,662,548	3.2	
フロンティア不動産投資法人	6,867	6,353	2,877,909	1.6	
平和不動産リート投資法人	13.04	13.27	1,762,256	1.0	
日本ロジスティクスファンド投資法人	12,479	10.93	2,992,634	1.7	
福岡リート投資法人	9,572	8,856	1,416,074	0.8	
KDX不動産投資法人	10,769	48,521	7,399,452	4.2	
いちごオフィスリート投資法人	15,165	14,031	1,149,138	0.7	
大和証券オフィス投資法人	3,834	7,094	1,992,704	1.1	
阪急阪神リート投資法人	8.36	8,164	1,091,526	0.6	
スターツプロシード投資法人	3,208	2,968	606,065	0.3	
大和ハウスリート投資法人	27,898	25,811	6,540,507	3.7	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	59,684	57,321	4,522,626	2.6	
大和証券リビング投資法人	25,646	25,216	2,624,985	1.5	
ジャパンエクセレント投資法人	16,978	14,881	1,827,386	1.0	
合 計	□ 数 ・ 金 額	1,128,309	1,091,979	170,968,898	-
	銘 柄 数 < 比 率 >	60銘柄 < 97.8% >	58銘柄 < 97.1% >	-	97.1

(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、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、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、アドバンス・ロジスティクス投資法人、KDX不動産投資法人、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、トーセイ・リート投資法人、福岡リート投資法人、S O S I L A 物流リート投資法人、日本都市ファンド投資法人、森トラストリート投資法人、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、投資法人みらい、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、ジャパンリアルエステイト投資法人、東海道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 4,979		百万円 -

■投資信託財産の構成

2024年6月6日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
投 資 証 券	千円 170,968,898		% 96.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,029,246		3.9
投 資 信 託 財 産 総 額	177,998,145		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	177,998,145,093円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	4,452,172,984
投 資 証 券(評価額)	170,968,898,350
未 収 入 金	1,077,568,704
未 収 配 当 金	1,319,496,712
差 入 委 託 証 拠 金	180,008,343
(B) 負 債	1,920,896,895
未 払 払 金	226,286,895
未 払 払 解 約 金	1,694,610,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	176,077,248,198
元 本	76,529,156,421
次 期 繰 越 損 益 金	99,548,091,777
(D) 受 益 権 総 口 数	76,529,156,421口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	23,008円

(注1) 期首元本額	84,649,761,469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) 20-04 (適格機関投資家限定)	213,663,893円
追加設定元本額	43,457,370,268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)	67,645,374円
一部解約元本額	51,577,975,316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)	89,471,283円
(注2) 期末における元本の内訳		インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	40,737,084円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	274,804円	固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル連日本政府保証償活用型) (適格機関投資家限定)	187,394,813円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	1,143,704円	低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	81,150,070円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	2,907,813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・シグナルヘッジ付き) 21-03 (適格機関投資家限定)	213,274,938円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	3,263,162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)	104,578,140円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	3,763,743円	マルチアセット・インカム戦略ファンドI(2021-04 (適格機関投資家限定)	172,266,444円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	2,003,505円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き) 2021-05 (適格機関投資家限定)	26,270,997円
たわらノーロード 国内リート	5,959,788,163円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き) 2021-07 (適格機関投資家限定)	43,694,307円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,691,467,158円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き) 2021-08 (適格機関投資家限定)	30,480,697円
たわらノーロード バランス(堅実型)	47,220,839円	低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	81,099,581円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,082,290,459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)	46,826,287円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,367,082,467円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き) 2021-09 (適格機関投資家限定)	30,344,037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	マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き) 2021-12 (適格機関投資家限定)	43,911,261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)	363,532,982円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2022-10 (適格機関投資家限定)	174,653,236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)	1,004,444,746円	予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	124,680,497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)	714,849,012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・シグナルヘッジ付き) 24-04 (適格機関投資家限定)	111,255,376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)	854,144,072円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2024-05 (適格機関投資家限定)	175,975,490円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	4,118,390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)	3,087,015,147円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	82,954,597円	投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	53,275,042円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	14,531,791円	AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)	24,607,627円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	26,594,772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)	319,808,903円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,646,122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)	111,939,256円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	473,314,451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)	1,961,878円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,539,059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)	112,498,130円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	152,407,293円	MHAM J - R E I T インデックスファンド<DC年金>	7,051,073,596円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	236,914,240円	MHAM J - R E I T インデックスファンド(毎月決算型)	31,672,270,859円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	528,218,240円	MHAM J - R E I T インデックスファンド(年1回決算型)	2,630,987,832円
投資のソムリエ	3,343,920,338円	たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>	5,218,394,727円
投資のソムリエ<DC年金>	354,825,931円	期末元本合計	76,529,156,421円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	225,908,401円		
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	714,661,133円		
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,188,732,008円		
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	60,679,736円		
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	31,642,088円		
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,628,675円		
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	74,459,869円		
リスクコントロール世界資産分散ファンド	110,119,108円		
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	134,261,239円		
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	27,251,818円		
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	33,832,205円		
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	20,798,045円		
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2065)	5,257,990円		
On eグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	55,791,387円		
Jリートインデックスファンド(DC)	80,982,635円		
MHAM J - R E I Tインデックスファンド(隔月決算型)	14,068,198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)	67,677,043円		

■損益の状況

当期 自2023年6月7日 至2024年6月6日

項	目	当	期
(A)	配当等収当益	8,115,346,474	円
	受取配当金	8,115,874,480	
	受取利息	576,101	
	その他の収益	6	
	支払利息	△1,104,113	
(B)	有価証券売買損益	△13,925,966,692	
	売却益	2,997,248,845	
	売却損	△16,923,215,537	
(C)	先物取引等取引損益	△188,895,920	
	取引益	297,573,890	
	取引損	△486,469,810	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△5,999,516,138	
(E)	前期繰越損益金	115,851,031,341	
(F)	解約差損益金	△69,011,497,158	
(G)	追加信託差損益金	58,708,073,732	
(H)	計(D+E+F+G)	99,548,091,777	
	次期繰越損益金(H)	99,548,091,777	

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2024年6月24日）

（対象期間 2023年6月23日～2024年6月24日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	不動産 投信指数 先物比率	純資産額
	円	期 騰 落 率	ポイント	期 中 騰 落 率			
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	—	百万円 34,753
14期(2021年6月22日)	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4	—	78,959
15期(2022年6月22日)	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3	—	56,003
16期(2023年6月22日)	17,096	2.5	177,832.19	2.9	99.4	—	81,199
17期(2024年6月24日)	20,700	21.1	216,675.29	21.8	99.0	1.0	87,881

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) S & P 先進国 REIT インデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスが委託会社に付与されています。S & P[®]、S&P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®]およびCDX[®]は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones[®]は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、委託会社により一定の目的でサブライセンスされています。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REIT インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

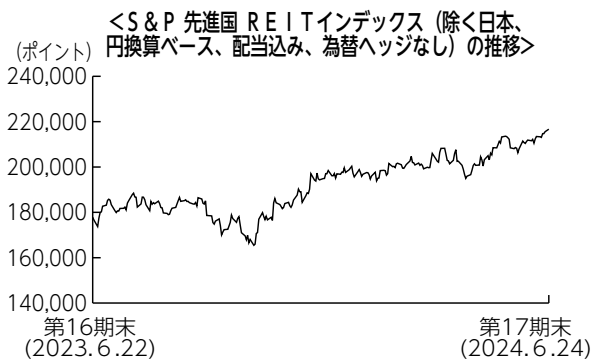
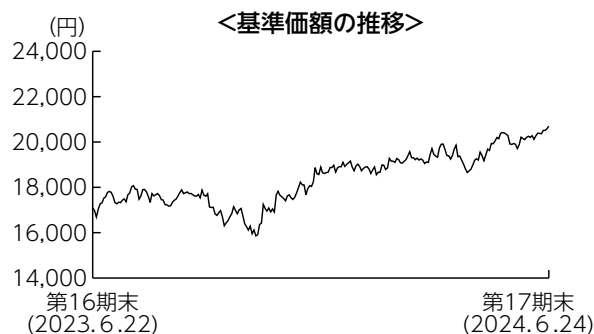
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2023年6月23日から2024年6月24日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は20,700円となり、前期末比で21.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で21.8%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.8%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券)	2円 (0) (0) (2)	0.013% (0.000) (0.002) (0.011)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券)	4 (0) (4)	0.024 (0.002) (0.022)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	8 (7) (1)	0.046 (0.038) (0.008)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	15	0.083	
期中の平均基準価額は18,397円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)

(1) 投資信託受益証券、投資証券

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

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
CAMDEN PROPERTY TRUST	30.337	2,942	35.142	3,339
	(-)	(-)	(-)	(-)
VERIS RESIDENTIAL INC	25.854	413	27.396	438
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	26.952	20,491	30.643	22,767
	(-)	(-)	(-)	(-)
NNN REIT INC	49.099	1,892	57.324	2,138
	(-)	(-)	(-)	(-)
CTO REALTY GROUTH INC	-	-	1.936	33
	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	35.373	732	42.016	852
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	-	-	-	-
	(△14.046)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	37.223	464	46.279	564
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	12.207	221	12.873	215
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18.669	4,210	21.491	4,749
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	101.285	6,084	114.785	6,785
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19.889	1,875	23.003	2,129
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	36.575	1,700	42.101	1,970
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	163.634	2,990	192.551	3,410
	(68.793)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	30.158	571	35.968	667
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.711	485	29.203	582
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	34.114	248	41.344	307
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	191.286	16,821	173.196	14,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	13.221	2,224	13.918	2,300
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	181.693	3,331	211.022	3,816
	(22.741)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	33.041	1,051	37.091	1,184
	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	12.892	419	14.463	456
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	42.905	89	54.866	131
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	29.058	114	45.368	192
	(-)	(-)	(-)	(-)

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

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

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

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

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

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

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

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,515.1 (-)	2,845 (△10)	1,699.9 (-)	3,109 (-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,078.6 (-)	2,935 (△21)	1,142.7 (-)	3,029 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	490.3 (-)	578 (△5)	597.5 (-)	686 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,060.7 (-)	1,656 (△46)	1,154.3 (-)	1,782 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	330.7 (-)	164 (-)	415.3 (-)	195 (-)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	640.9 (-)	609 (△17)	639.4 (-)	582 (-)
KEPPEL REIT	713.6 (-)	599 (-)	694.3 (-)	592 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	379.1 (-)	818 (-)	387.4 (-)	828 (-)
ESR LOGOS REIT	1,470.2 (-)	427 (△9)	1,976.2 (-)	561 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	158 (-)	155 (△3)	275.3 (-)	274 (-)
CAPITALAND CHINA TRUST	179.7 (-)	148 (△23)	278.4 (-)	225 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (△1)	538.1 (-)	115 (-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	267.8 (-)	340 (△5)	223.3 (-)	283 (-)
PARKWAY LIFE REIT	121.8 (-)	440 (△5)	131.9 (-)	465 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	563.2 (-)	1,259 (△1)	623.2 (-)	1,379 (-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	592.1 (-)	833 (△11)	673.9 (-)	907 (-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	184.8 (-)	115 (-)	201.7 (-)	121 (-)
PARAGON REIT	361.8 (-)	313 (-)	368.5 (-)	309 (-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	53.6 (-)	37 (△0.47114)	71.2 (-)	43 (-)
QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	135.2 (-)	44 (△0.70461)	1,174.355 (-)	240 (-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	448.9 (-)	257 (-)	579.5 (-)	312 (-)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	80.3 (-)	47 (△5)	307 (-)	164 (-)
KEPPEL DC REIT	319.8 (-)	618 (△10)	376.9 (-)	696 (-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	657.9 (-)	736 (△15)	783.9 (-)	827 (-)

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

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

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買		建		売		建	
	新規買付額	決 済 額	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 不動産投信指数先物取引	百万円 1,922		百万円 1,032		百万円 -		百万円 -	

(注) 金額は受渡代金です。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国投資信託受益証券、投資証券

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

銘 柄	期 首(前期末)	当 期			末
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
BRANDYWINE REALTY TRUST	81.948	65.638	297	47,643	0.1
IRON MOUNTAIN INC	131.248	118.409	10,521	1,682,229	1.9
THE MACERICH COMPANY	95.956	87.151	1,278	204,407	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	78.222	75.334	4,846	774,936	0.9
ACADIA REALTY TRUST	44.351	42.601	739	118,171	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	318.701	284.799	5,220	834,632	0.9
MID AMERICA	52.249	47.191	6,652	1,063,528	1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13.525	—	—	—	—
NATIONAL HEALTH INVS INC	19.429	17.553	1,171	187,325	0.2
CENTERSPACE	6.622	6.258	419	67,125	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8.132	5.83	138	22,183	0.0
GETTY REALTY CORP	20.182	19.838	524	83,796	0.1
RPT REALTY	40.594	—	—	—	—
REALTY INCOME CORP	302.637	351.747	18,695	2,989,013	3.4
REGENCY CENTERS CORP	68.717	66.651	4,141	662,173	0.8
UDR INC	138.65	122.38	4,983	796,732	0.9
COPT DEFENCE PROPERTIES	50.428	46.331	1,141	182,444	0.2
SAUL CENTERS INC	5.447	4.875	176	28,261	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	147.007	131.66	19,243	3,076,638	3.5
LIFE STORAGE INC	38.018	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	71.125	63.885	18,593	2,972,765	3.4
SUN COMMUNITIES INC	55.989	50.345	5,916	945,937	1.1
TANGER INC	46.487	44.528	1,182	189,013	0.2
UMH PROPERTIES INC	26.109	26.733	414	66,290	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16.72	15.124	209	33,562	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6.151	4.814	185	29,678	0.0
VENTAS INC	179.26	163.523	8,244	1,318,183	1.5
VORNADO REALTY TRUST	71.874	64.543	1,665	266,336	0.3
ELME COMMUNITIES	40.732	36.795	555	88,771	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	99.789	88.708	1,944	310,883	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	60.583	85.525	13,592	2,173,167	2.5
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	53.55	46.375	74	11,863	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	94.114	82.956	840	134,354	0.2
CUBESMART	100.353	91.225	4,130	660,411	0.8
DIGITAL REALTY TRUST INC	131.006	131.081	19,445	3,109,005	3.5
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	91.448	85.756	715	114,346	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	266.517	242.489	1,163	186,091	0.2
DOUGLAS EMMETT INC	76.09	67.612	905	144,743	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	55.617	52.599	643	102,932	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	58.595	52.568	378	60,512	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	50.883	41.424	241	38,677	0.0
TERRENO REALTY CORP	32.893	39.063	2,264	361,982	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	23.022	19.557	421	67,319	0.1
RLJ LODGING TRUST	70.804	62.698	601	96,231	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	121.186	107.852	2,734	437,119	0.5

銘	柄	期 首(前期末)	当		期		末
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	
(アメリカ)		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		55.166	48.508	672	107,568		0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST		23.664	23.664	53	8,550		0.0
CHATHAM LODGING TRUST		22.868	19.711	162	26,030		0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC		103.588	93.511	1,369	218,875		0.2
WHITESTONE REIT		19.598	18.939	251	40,150		0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC		61.059	52.743	257	41,235		0.0
STAG INDUSTRIAL INC		79.986	73.55	2,608	416,980		0.5
WP CAREY INC		96.284	88.393	4,872	778,970		0.9
ALEXANDER & BALDWIN INC		33.832	30.467	499	79,788		0.1
GLADSTONE LAND CORP		15.596	13.328	175	28,085		0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		169.898	152.91	2,454	392,378		0.4
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		25.104	24.192	2,410	385,311		0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC		29.672	25.65	281	45,028		0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		63.531	—	—	—		—
PHYSICIANS REALTY TRUST		106.824	—	—	—		—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC		90.045	87.811	3,909	625,026		0.7
AMERICAN HOMES 4 RENT		140.789	129.991	4,725	755,460		0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC		101.147	90.754	1,642	262,626		0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES		12.848	11.565	1,245	199,194		0.2
JBG SMITH PROPERTIES		43.096	34.53	506	80,988		0.1
THE NECESSITY RETAIL REIT INC		63.796	—	—	—		—
INVITATION HOMES INC		260.485	232.585	8,238	1,317,117		1.5
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC		62.501	51.841	471	75,341		0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		17.079	15.197	320	51,315		0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS		66.693	70.815	1,901	303,993		0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES		26.881	26.881	92	14,741		0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN		118.272	109.672	4,866	777,999		0.9
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		136.117	121.708	2,744	438,793		0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC		22.683	22.683	62	9,936		0.0
POSTAL REALTY TRUST INC		7.309	7.238	95	15,228		0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC		6.752	4.384	67	10,759		0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP		29.365	28.156	690	110,468		0.1
FARMLAND PARTNERS INC		23.717	16.653	192	30,831		0.0
CITY OFFICE REIT INC		17.231	17.231	86	13,774		0.0
ORION OFFICE REIT INC		28.112	20.368	69	11,104		0.0
NETSTREIT CORP		28.118	28.72	485	77,600		0.1
CARETRUST REIT INC		44.457	57.387	1,428	228,458		0.3
PEAKSTONE REALTY TRUST		—	13.637	148	23,699		0.0
INDUS REALTY TRUST INC		2.103	—	—	—		—
PHILLIPS EDISON & CO INC		52.693	49.443	1,603	256,436		0.3
BLUEROCK HOMES TRUST INC		1.188	—	—	—		—
APARTMENT INCOME REIT CORP		67.666	58.614	2,285	365,383		0.4
BROADSTONE NET LEASE INC		83.884	75.796	1,192	190,620		0.2
STAR HOLDINGS		5.322	—	—	—		—
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC		11.835	10.705	239	38,269		0.0

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

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(カナダ)	千□	千円	千□	千カナダ・ドル	千円	%
SLATE GROCERY REIT	12.066	12,169	12.169	133	15,540	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT	14.455	14,455	14.455	95	11,136	0.0
PRIMARIS REIT	21.998	20,442	20.442	268	31,306	0.0
SLATE OFFICE REIT	17.818	—	—	—	—	—
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT	8.337	—	—	—	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	24.983	23,694	23.694	396	46,271	0.1
小計	□数・金額	792,546	649,799	10,057	1,173,982	—
	銘柄数<比率>	30銘柄<1.7%>	26銘柄<1.3%>	—	—	1.3
(オーストラリア)	千□	千円	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%
BWP TRUST	209.056	222,212	222.212	806	85,631	0.1
MIRVAC GROUP	1,776.143	1,620,072	1,620.072	3,175	337,094	0.4
CROMWELL PROPERTY GROUP	632.521	520.52	520.52	216	22,932	0.0
CHARTER HALL RETAIL REIT	230.204	204,746	204.746	685	72,815	0.1
GPT GROUP	853.243	774,713	774.713	3,191	338,843	0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP	302.227	341,038	341.038	601	63,901	0.1
ABACUS GROUP	195.539	168,642	168.642	198	21,125	0.0
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	160.446	137,586	137.586	335	35,638	0.0
STOCKLAND	1,071.893	964,954	964.954	4,284	454,831	0.5
INGENIA COMMUNITIES GROUP	162.299	157,084	157.084	761	80,878	0.1
DEXUS	479.312	441,787	441.787	2,893	307,195	0.3
GOODMAN GROUP	769.687	704,819	704.819	25,288	2,684,670	3.1
VICINITY CENTRES	1,758.932	1,588,997	1,588.997	2,995	317,976	0.4
CHARTER HALL GROUP	212.89	194,616	194.616	2,382	252,883	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	126.146	101.9	101.9	241	25,637	0.0
REGION RE LTD	515.147	466,538	466.538	1,045	110,941	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	240.142	213.14	213.14	667	70,822	0.1
ARENA REIT	165.205	147.24	147.24	584	62,055	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	299.469	265,944	265.944	922	97,967	0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT	91.184	93,159	93.159	281	29,867	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	538.807	509,415	509.415	1,186	126,005	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85.857	85,857	85.857	297	31,627	0.0
GDI PROPERTY GROUP	222.442	222,442	222.442	133	14,168	0.0
RURAL FUNDS GROUP	173.97	148,357	148.357	307	32,601	0.0
SCENTRE GROUP	2,339.436	2,106,223	2,106.223	6,718	713,273	0.8
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	140.343	—	—	—	—	—
HMC CAPITAL LTD	109.034	97,142	97.142	720	76,519	0.1
HOMECO DAILY NEEDS REIT	709.912	745.38	745.38	913	96,933	0.1
HEALTHCO REIT	182.619	202,023	202.023	232	24,663	0.0
ABACUS STORAGE KING	—	224,215	224.215	266	28,325	0.0
CENTURIA OFFICE REIT	210.931	185,985	185.985	223	23,693	0.0
WAYPOINT REIT LTD	300.308	266,477	266.477	620	65,913	0.1
小計	□数・金額	15,265,344	14,123,223	63,182	6,707,435	—
	銘柄数<比率>	31銘柄<6.8%>	31銘柄<7.6%>	—	—	7.6
(香港)	千□	千円	千□	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT	1,145.32	1,047.12	1,047.12	33,350	683,357	0.8

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期			期末	
		□数	外貨建金額	邦貨換算金額		比率
(ユーロ…ベルギー) XIOR STUDENT HOUSING NV	千口 10.247	千口 14	千ユーロ 403	千円 68,931	% 0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	151.445 8銘柄<1.0%>	146.583 7銘柄<1.0%>	5,223 -	893,013 -	- 1.0
(ユーロ…フランス) GECINA SA ICADE ALTAREA KLEPIERRE COVIVIO MERCIALYS CARMILA SA UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	千口 24.437 14.462 2.083 86.815 20.812 35.663 26.256 48.183	千口 20.75 12,549 1,894 78,795 20,325 37.38 22,407 41,142	千ユーロ 1,886 305 168 2,029 929 397 364 3,023	千円 322,460 52,304 28,818 347,007 158,935 67,930 62,363 516,831	% 0.4 0.1 0.0 0.4 0.2 0.1 0.1 0.6	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	258.711 8銘柄<1.7%>	235.242 8銘柄<1.8%>	9,105 -	1,556,652 -	- 1.8
(ユーロ…ドイツ) HAMBORNER REIT AG ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千口 32.393 3.939	千口 28.721 -	千ユーロ 188 -	千円 32,161 -	% 0.0 -	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	36.332 2銘柄<0.0%>	28.721 1銘柄<0.0%>	188 -	32,161 -	- 0.0
(ユーロ…スペイン) INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	千口 133.768 26.318 148.852	千口 115,299 19,464 134.73	千ユーロ 637 134 1,420	千円 109,004 22,960 242,772	% 0.1 0.0 0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	308.938 3銘柄<0.4%>	269.493 3銘柄<0.4%>	2,191 -	374,737 -	- 0.4
(ユーロ…イタリア) IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	千口 20.555	千口 20.555	千ユーロ 35	千円 6,149	% 0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	20.555 1銘柄<0.0%>	20.555 1銘柄<0.0%>	35 -	6,149 -	- 0.0
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	71,937.959 324銘柄<99.4%>	63,422.659 302銘柄<99.0%>	- -	86,986,336 -	- 99.0

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

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

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

■投資信託財産の構成

2024年6月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券、投資証券	86,986,336 千円	98.4 %
コール・ローン等、その他	1,451,023	1.6
投資信託財産総額	88,437,359	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、87,853,241千円、99.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.88円、1カナダ・ドル=116.73円、1オーストラリア・ドル=106.16円、1香港・ドル=20.49円、1シンガポール・ドル=117.97円、1ニュージーランド・ドル=97.80円、1イギリス・ポンド=202.17円、1イスラエル・シケル=42.573円、100韓国・ウォン=11.51円、1ユーロ=170.96円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月24日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	474,013,891円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,452,619,453円
ワールドアセットバランス (基本コース)	246,980,107円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	680,485,328円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	63,029,259円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	32,850,694円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,386,291円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	86,191,058円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,215,386,591円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	156,783,516円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	38,983,095円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	35,002,071円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	22,084,482円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	5,403,231円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	68,809,621円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	270,424,593円
D I A M外国リートインデックスファンド<DC年金>	383,275,072円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	217,802円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	647,540円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	125,270円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	867,926円
インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定)	711,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	501,108円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	5,202円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	62,054,960円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	895,492円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	572,716円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用)	2,122,603円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	40,047,574円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	101,133,689円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	16,902,701円
期末元本合計	42,455,688,196円

■損益の状況

当期 自2023年6月23日 至2024年6月24日

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

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

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

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

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■先物取引等の指図範囲の規定を追加しました。

(2024年4月12日)