

グローバル3倍3分法ファンド (隔月分配型)

運用報告書 (全体版)

第34期 (決算日 2024年5月21日) 第35期 (決算日 2024年7月22日) 第36期 (決算日 2024年9月24日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型)」は、2024年9月24日に第36期の決算を行ないましたので、第34期から第36期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

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	2018年10月4日から原則無期限です。
運用方針	主として、日本を含む世界各国の株式、不動産投信および債券などを実質的な投資対象とする投資信託証券(投資信託または外国投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。)の一部、またはすべてに投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券、短期社債など、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	第1計算期から第2計算期までは収益分配を行ないません。第3計算期以降、毎決算時、原則として分配対象額のかなから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。

<944440>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号: 0120-25-1404
午前9時~午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近15期の運用実績

決算期	基準価額			T O P I X (東証株価指数) 配 当 込 込 込		MSCI-KOKUSAIインデックス (税引後配当込み、 円ヘッジなし・円ベース)		MSCI エマージング・ マーケット・インデックス (税引後配当込み、 円ヘッジなし・円ベース)		S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、 ヘッジなし・円ベース)	
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率
	円	円	%		%		%		%		%
22期(2022年5月23日)	10,882	108	△7.4	3,058.56	△0.9	146.99	△6.0	120.85	△0.8	133.78	△5.4
23期(2022年7月21日)	10,869	109	0.9	3,156.42	3.2	159.36	8.4	126.21	4.4	141.92	6.1
24期(2022年9月21日)	9,920	102	△7.8	3,109.51	△1.5	160.32	0.6	126.34	0.1	138.04	△2.7
25期(2022年11月21日)	9,802	98	△0.2	3,227.07	3.8	163.36	1.9	123.17	△2.5	134.54	△2.5
26期(2023年1月23日)	9,443	94	△2.7	3,189.24	△1.2	154.31	△5.5	125.19	1.6	129.40	△3.8
27期(2023年3月22日)	9,259	93	△1.0	3,219.53	0.9	158.01	2.4	118.23	△5.6	123.17	△4.8
28期(2023年5月22日)	9,488	96	3.5	3,611.02	12.2	172.53	9.2	126.64	7.1	129.73	5.3
29期(2023年7月21日)	9,674	98	3.0	3,761.11	4.2	187.83	8.9	135.53	7.0	141.55	9.1
30期(2023年9月21日)	9,434	95	△1.5	3,964.18	5.4	192.89	2.7	137.49	1.4	141.32	△0.2
31期(2023年11月21日)	9,325	94	△0.2	3,973.10	0.2	197.98	2.6	139.54	1.5	139.18	△1.5
32期(2024年1月22日)	9,928	99	7.5	4,277.71	7.7	209.54	5.8	137.94	△1.2	150.56	8.2
33期(2024年3月21日)	10,381	102	5.6	4,702.41	9.9	229.89	9.7	149.69	8.5	154.06	2.3
34期(2024年5月21日)	10,436	106	1.6	4,684.41	△0.4	244.48	6.3	166.62	11.3	161.73	5.0
35期(2024年7月22日)	10,606	108	2.7	4,809.01	2.7	251.97	3.1	167.29	0.4	172.04	6.4
36期(2024年9月24日)	10,618	106	1.1	4,520.16	△6.0	239.68	△4.9	156.24	△6.6	173.40	0.8

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) MSCI-KOKUSAIインデックスは、MSCI Inc. が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。また、設定時を100として2024年9月24日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

(注) MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。また、設定時を100として2024年9月24日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

(注) S&P先進国REIT指数(除く日本)は、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シー社(S&P社)が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。なお、設定時を100として2024年9月24日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○最近15期の運用実績

決 算 期	東 証 R E I T 指 数 (配 当 込) (参考指数)		FTSE世界国債インデックス (含む日本、円ヘッジ、円ベース) (参考指数)		債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
22期(2022年5月23日)	4,511.75	%	100.15	△3.2	—	98.9	百万円 89,124
23期(2022年7月21日)	4,543.29	0.7	98.87	△1.3	—	99.0	87,217
24期(2022年9月21日)	4,632.47	2.0	95.28	△3.6	—	98.9	78,576
25期(2022年11月21日)	4,547.04	△1.8	94.25	△1.1	—	98.8	77,357
26期(2023年1月23日)	4,237.39	△6.8	94.39	0.1	—	98.8	75,710
27期(2023年3月22日)	4,165.50	△1.7	94.19	△0.2	—	98.8	74,644
28期(2023年5月22日)	4,424.44	6.2	92.89	△1.4	—	98.8	76,432
29期(2023年7月21日)	4,449.76	0.6	92.36	△0.6	—	99.0	78,379
30期(2023年9月21日)	4,485.67	0.8	89.63	△3.0	—	99.0	76,243
31期(2023年11月21日)	4,406.76	△1.8	90.15	0.6	—	99.0	74,216
32期(2024年1月22日)	4,474.19	1.5	91.39	1.4	—	98.8	76,035
33期(2024年3月21日)	4,416.57	△1.3	90.77	△0.7	—	99.0	78,032
34期(2024年5月21日)	4,390.25	△0.6	89.73	△1.1	0.1	99.5	75,619
35期(2024年7月22日)	4,276.48	△2.6	90.00	0.3	0.1	99.2	73,854
36期(2024年9月24日)	4,376.43	2.3	92.06	2.3	0.1	99.0	72,663

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) FTSE世界国債インデックス（含む日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を含む世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関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。また、設定時を100として2024年9月24日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準価額		T O P I X (東証株価指数) 配 当 込 込 込		MSCI-KOKUSAIインデックス (税引後配当込み、 円ヘッジなし・円ベース)		MSCI エマージング・ マーケット・インデックス (税引後配当込み、 円ヘッジなし・円ベース)		S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、 ヘッジなし・円ベース)	
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)
第34期	(期首)	円	%		%		%		%		%
	2024年3月21日	10,381	—	4,702.41	—	229.89	—	149.69	—	154.06	—
	3月末	10,583	1.9	4,699.20	△0.1	232.46	1.1	151.65	1.3	157.93	2.5
	4月末	10,161	△2.1	4,656.27	△1.0	235.48	2.4	159.08	6.3	155.04	0.6
第35期	(期末)										
	2024年5月21日	10,542	1.6	4,684.41	△0.4	244.48	6.3	166.62	11.3	161.73	5.0
	(期首)										
	2024年5月21日	10,436	—	4,684.41	—	244.48	—	166.62	—	161.73	—
第35期	5月末	9,998	△4.2	4,710.15	0.5	241.02	△1.4	160.36	△3.8	157.60	△2.6
	6月末	10,603	1.6	4,778.56	2.0	255.74	4.6	169.15	1.5	165.13	2.1
	(期末)										
	2024年7月22日	10,714	2.7	4,809.01	2.7	251.97	3.1	167.29	0.4	172.04	6.4
第36期	(期首)										
	2024年7月22日	10,606	—	4,809.01	—	251.97	—	167.29	—	172.04	—
	7月末	10,409	△1.9	4,752.72	△1.2	241.35	△4.2	159.26	△4.8	167.49	△2.6
	8月末	10,546	△0.6	4,615.06	△4.0	237.15	△5.9	154.91	△7.4	166.68	△3.1
第36期	(期末)										
	2024年9月24日	10,724	1.1	4,520.16	△6.0	239.68	△4.9	156.24	△6.6	173.40	0.8

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

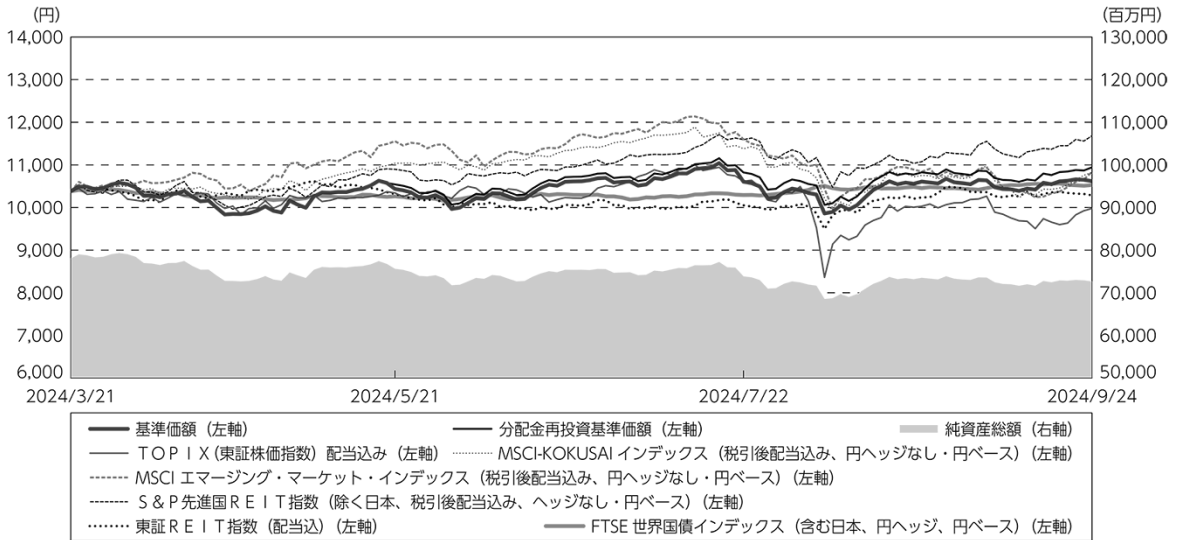
決算期	年 月 日	東証REIT指数 (配当込) (参考指数)		FTSE世界国債インデックス (含む日本、円ヘッジ、円ベース) (参考指数)		債 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
第34期	(期首) 2024年3月21日	4,416.57	—	90.77	—	—	99.0
	3月末	4,410.17	△0.1	91.05	0.3	—	99.3
	4月末	4,455.74	0.9	89.06	△1.9	0.1	99.6
	(期末) 2024年5月21日	4,390.25	△0.6	89.73	△1.1	0.1	99.5
第35期	(期首) 2024年5月21日	4,390.25	—	89.73	—	0.1	99.5
	5月末	4,302.09	△2.0	89.16	△0.6	0.1	98.9
	6月末	4,277.59	△2.6	89.49	△0.3	0.1	99.2
	(期末) 2024年7月22日	4,276.48	△2.6	90.00	0.3	0.1	99.2
第36期	(期首) 2024年7月22日	4,276.48	—	90.00	—	0.1	99.2
	7月末	4,290.75	0.3	90.72	0.8	0.1	99.3
	8月末	4,411.38	3.2	91.21	1.3	0.1	99.3
	(期末) 2024年9月24日	4,376.43	2.3	92.06	2.3	0.1	99.0

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

○運用経過

（2024年3月22日～2024年9月24日）

作成期間中の基準価額等の推移



第34期首：10,381円

第36期末：10,618円（既払分配金（税込み）：320円）

騰落率：5.4%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額、TOPIX（東証株価指数）配当込み、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、S & P 先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）、東証REIT指数（配当込）およびFTSE世界国債インデックス（含む日本、円ヘッジ、円ベース）は、作成期首（2024年3月21日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) TOPIX（東証株価指数）配当込み、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、S & P 先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）、東証REIT指数（配当込）およびFTSE世界国債インデックス（含む日本、円ヘッジ、円ベース）は当ファンドの参考指数です。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、日本を含む世界各国の株式、不動産投信（REIT）および債券などを実質的な投資対象とする投資信託証券の一部、またはすべてに投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・海外のREIT市場が上昇したことから、海外REIT資産を保有したことがプラス要因となりました。
- ・海外の債券利回りが総じて低下（債券価格は上昇）したことから、海外債券先物資産を保有したことがプラス要因となりました。

<値下がり要因>

- ・国内株式市場が下落したことから、国内株式先物資産を保有したことがマイナス要因となりました。
- ・投資先通貨が円に対して総じて下落したこと。

投資環境

（市況）

国内株式市場では、期間の初めと比べて、東証株価指数（TOPIX）および日経平均株価指数はともに下落しました。インフレの鈍化を示す米国の経済指標の発表を受けて米国連邦準備制度理事会（FRB）による利下げが期待されたことや、米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったことなどが支援材料となったものの、中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、日銀が金融政策決定会合において利上げを決定したことを受けて円高／アメリカドル安が進み、輸出関連企業の業績への期待が後退したこと、米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったことなどから、国内市場の株価は下落しました。

海外株式市場では、期間の初めと比べて、欧米諸国などの株価は総じて上昇しました。中東情勢が緊迫化したことや、フランス議会下院選挙において左派連合が極右政党を抑えて最大勢力となりフランス政治の不透明感が続いたこと、米国の雇用統計の内容を受けて米国景気の悪化が懸念されたことなどが株価の重しとなったものの、生成AI（人工知能）の活用の広がりからAI関連の大手ハイテク企業などへの業績期待が高まったこと、米国の労働市場における需給のひっ迫が薄れたこと、米国の消費者物価指数（CPI）が市場予想を下回りインフレ鈍化の傾向を示したこと、欧州中央銀行（ECB）が政策金利を引き下げたこと、FRBの金融政策が緩和に転じたことなどが支援材料となり、欧米諸国などの株価は総じて上昇しました。

新興国株式市場では、期間の初めと比べて、新興国各国の株価はまちまちの動きとなりました。中国景気に対する先行き懸念や、欧米の早期利下げ観測が後退する場面で欧米の長期金利が上昇したこと、中東情勢が緊迫化したことなどが株価の重しとなったものの、中国政府が低迷する不動産市場への支援策を発表したことや、インドの総選挙で与党連合が過半数の議席を獲得し政権を維持したこと、中国人民銀行が事実上の政策金利である最優遇貸出金利を引き下げたこと、欧米の金融政策が緩和に転じたことなどが支援材料となりました。

国内のREIT市場では、東証REIT指数（配当込）は期間の初めと比べて下落しました。都心部オフィスの空室率が低下したことに加え平均賃料が上昇したことなどがREIT価格の支援材料となったものの、日銀がマイナス金利政策の解除を決定したことや、日銀が追加利上げや国債買い入れの減額を決定し金融政策の正常化を進めたこと、国内長期金利が上昇したことなどがREIT価格の重しとなり、東証REIT指数（配当込）は下落しました。

海外のREIT市場では、S&P先進国REIT指数（除く日本）は期間の初めと比べて上昇しました。期間の初めから2024年5月下旬にかけては、米国経済の底堅さを示す経済指標の発表を受けてFRBによる政策金利の早期引き下げ観測が後退し欧米の長期金利が総じて上昇したことや、イスラム組織ハマスとイスラエルとの間の軍事衝突による中東情勢の緊迫化を受けた地政学的リスクが警戒されたこと、一部IT企業の企業決算が市場予想を下回ったことを背景に株式市場が下落したことなどから、同指数は下落しました。6月

上旬から期間末にかけては、今期の米国大統領選挙に向けた候補者討論会で共和党が優勢になったとの見方から米国の財政拡大に伴う景気刺激策は米国経済を下支えると期待されたことや、生成AI関連の大手ハイテク企業への業績期待などから米国の株式市場が上昇したことが好感されたこと、米国の雇用統計の内容が悪化を示し、米国景気の減速懸念などを背景にFRBが利下げに踏み切ったことを受けて欧米主要国の長期金利の低下により相対的に分配金利回りの高いREITの投資魅力が高まり、同指数は上昇しました。

国内債券市場では、10年国債利回りは期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。期間の初めから2024年7月上旬にかけては、円安／アメリカドル高が進行するなか日銀による国債購入の減額や追加利上げが意識されたことや、日銀が発表した全国企業短期経済観測調査（短観）で大企業製造業の景況感が改善したことや毎月勤労統計調査で高い賃金上昇率の実現が確認され日銀の追加利上げ観測が強まったことなどから、10年国債利回りは上昇しました。7月中旬から期間末にかけては、日銀が金融政策決定会合において利上げを決定したことが国債利回りの上昇要因となったものの、米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念などから国内株式市場が下落し投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、FRB議長が講演で利下げに踏み切る考えを示し、FRBによる早期の利下げ観測が意識されたことなどから、10年国債利回りは低下しました。

海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて低下しました。期間の初めから2024年5月下旬にかけては、中東情勢の緊迫化を受けて地政学的リスクが警戒されたことや、スウェーデンの中央銀行などが政策金利を引き下げたことなどが利回りの低下要因となったものの、ECB高官の発言などを受けてECBの利下げに近いが利下げペースが緩やかになるとの見方が広がったことや、FRB議長が米国連邦公開市場委員会（FOMC）後の記者会見で金融緩和に慎重な考えを示したことを受けてFRBによる早期利下げ観測が後退したことなどから、投資対象国の10年国債利回りは総じて上昇しました。6月上旬から期間末にかけては、フランスなど欧州政治を巡る先行き不透明感などが利回りの上昇要因となったものの、ECBに続き、イングランド銀行（BOE）、カナダの中央銀行が利下げを実施したことや、米国の雇用統計の内容が悪化を示し、米国景気の減速懸念などを背景にFRBが利下げに踏み切ったことを受けて、投資対象国の10年国債利回りは総じて低下しました。

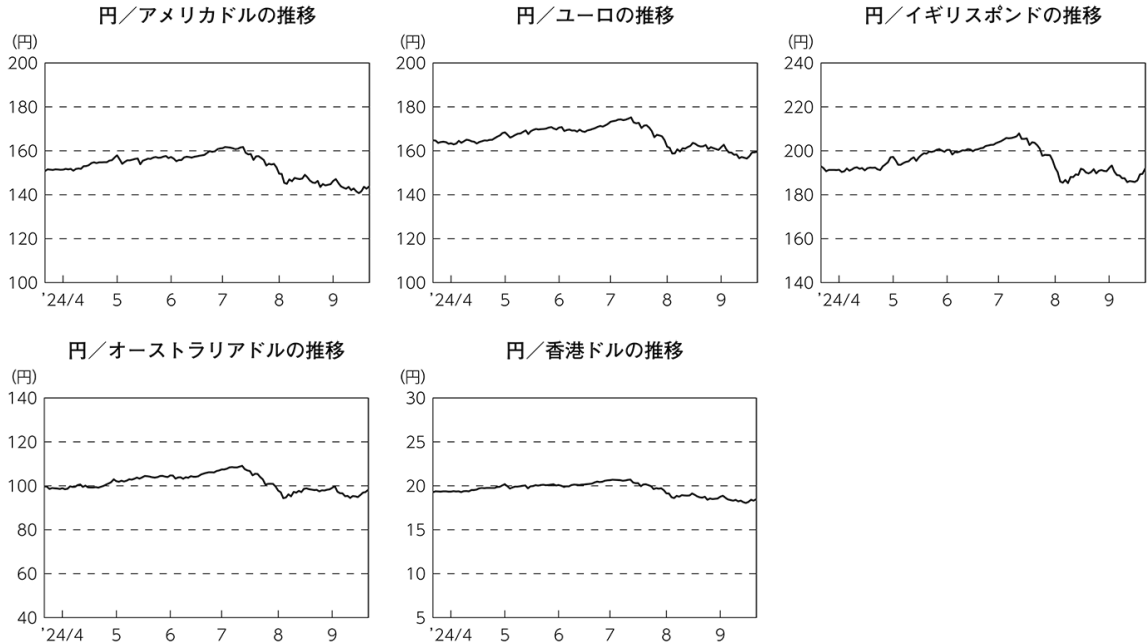
（国内短期金利市況）

無担保コール翌日物金利は、期間の初めの0.07%近辺から、日銀が2024年7月の金融政策決定会合において政策金利を引き上げたことなどから、0.23%近辺で期間末を迎えました。

国庫短期証券（TB）3ヵ月物金利は、期間の初めの-0.01%近辺から、日銀による利上げなどを受けて、0.05%近辺で期間末を迎えました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、収益性を追求するため、「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」受益証券を高位に組み入れ、「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を抑制しました。

（グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け））

主として、株式やREITに投資を行なう4つの受益証券に投資を行なうとともに、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利に投資を行なうことで、実質的に日本を含む世界各国の株式、REITおよび債券に分散投資を行ない、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないました。現物の組入総額と先物取引の買建総額の組入合計額が純資産総額の3倍相当額となるように投資を行ないました。

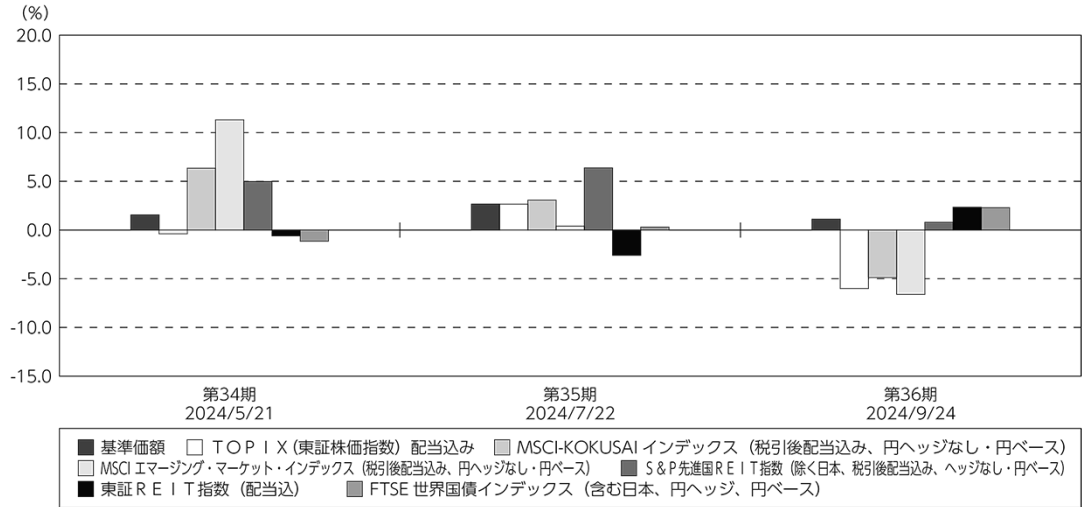
（マネー・オープン・マザーファンド）

運用の基本方針に従い、国庫短期証券の購入や現先取引、コールローンや金銭信託などを通じて、元本の安全性を重視した運用を行ないました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。
 グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率です。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

(注) TOPIX（東証株価指数）配当込み、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、S & P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）、東証REIT指数（配当込）およびFTSE世界国債インデックス（含む日本、円ヘッジ、円ベース）は当ファンドの参考指数です。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、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

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第34期	第35期	第36期
	2024年3月22日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年9月24日
当期分配金	106	108	106
（対基準価額比率）	1.006%	1.008%	0.988%
当期の収益	0	0	0
当期の収益以外	105	107	105
翌期繰越分配対象額	1,621	1,513	1,407

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、原則として「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」受益証券を高位に組み入れ、「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を抑制する方針です。

（グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け））

引き続き、主として、株式やREITに投資を行なう4つの受益証券に投資を行なうとともに、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利に投資を行なうことで、実質的に日本を含む世界各国の株式、REITおよび債券に分散投資を行ない、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。現物の組入総額と先物取引の買建総額の組入合計額が純資産総額の3倍相当額となるように投資を行ないます。各資産への配分については、市況環境および投資対象資産のリスク水準などを勘案して決定する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

（マネー・オープン・マザーファンド）

引き続き、安定した収益の確保をめざして安定運用を行なう方針です。主な投資対象は、わが国の国債および格付の高い公社債とし、それらの現先取引なども活用する方針です。また、コールローンや金銭信託などに投資することもあります。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくごお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2024年3月22日～2024年9月24日）

項 目	第34期～第36期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 21	% 0.203	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	（ 8 ）	（ 0.079 ）	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	（ 12 ）	（ 0.113 ）	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	（ 1 ）	（ 0.011 ）	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.007	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	（ 0 ）	（ 0.002 ）	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 費 用 等 ）	（ 1 ）	（ 0.005 ）	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用、運用において利用する指数の 標章使用料など
合 計	22	0.210	
作成期間の平均基準価額は、10,383円です。			

(注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

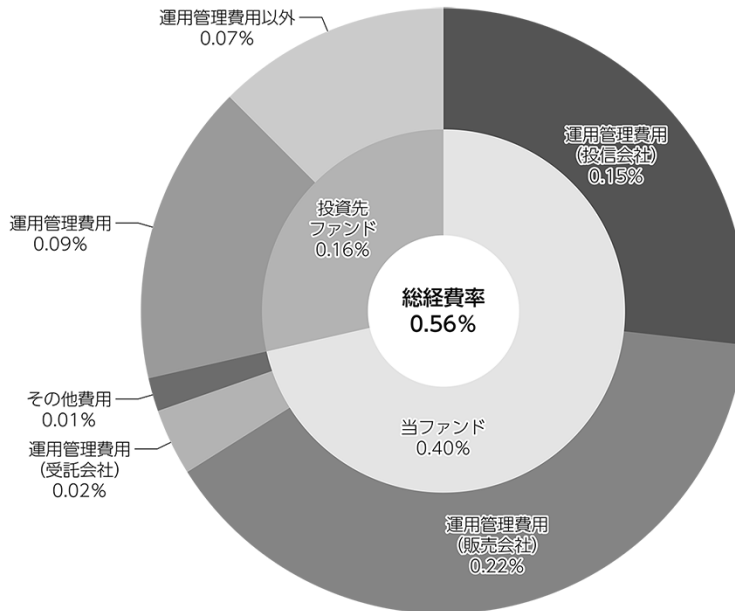
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(注) この他にファンドが投資対象とする投資先においても信託報酬等が発生する場合があります。

（参考情報）

○総経費率

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（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除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.56%です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	0.56
①当ファンドの費用の比率	0.40
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.09
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.07

(注) 当ファンドの費用は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) 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) 「その他費用」には保管費用が含まれる場合があります。なお、「その他費用」の内訳は「1万口当たりの費用明細」にてご確認いただけますが、期中の費用の総額と年率換算した値は一致しないことがあります。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

（2024年3月22日～2024年9月24日）

投資信託証券

銘柄		第34期～第36期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	千口 —	千円 —	千口 6,325,335	千円 9,344,103

（注）金額は受け渡し代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		第34期～第36期			
		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	マネー・オープン・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 818	千円 830

○利害関係人との取引状況等

（2024年3月22日～2024年9月24日）

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2024年3月22日～2024年9月24日）

区分	第34期～第36期					
	買付			売付		
	買付額 A	うち自己取引 状況B	$\frac{B}{A}$	売付額 C	うち自己取引 状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 —	百万円 —	% —	百万円 9,344	百万円 9,344	% 100.0

（注）委託会社に支払われた売買委託手数料は0円です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2024年3月22日～2024年9月24日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年9月24日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第33期末	第36期末		
		口数	口数	評価額	比率
		千口	千口	千円	%
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）		53,279,702	46,954,367	71,924,700	99.0
合	計	53,279,702	46,954,367	71,924,700	99.0

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

親投資信託残高

銘	柄	第33期末	第36期末	
		口数	口数	評価額
		千口	千口	千円
マネー・オープン・マザーファンド		68,175	67,356	68,414

(注) 親投資信託の2024年9月24日現在の受益権総口数は、282,697千口です。

○投資信託財産の構成

(2024年9月24日現在)

項	目	第36期末	
		評価額	比率
		千円	%
投資信託受益証券		71,924,700	97.4
マネー・オープン・マザーファンド		68,414	0.1
コール・ローン等、その他		1,827,986	2.5
投資信託財産総額		73,821,100	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第34期末	第35期末	第36期末
	2024年5月21日現在	2024年7月22日現在	2024年9月24日現在
	円	円	円
(A) 資産	77,109,548,569	75,085,125,411	73,821,100,739
コール・ローン等	696,183,094	563,218,526	860,929,426
投資信託受益証券(評価額)	75,224,014,622	73,261,616,246	71,924,700,300
マネー・オープン・マザーファンド(評価額)	69,218,097	69,224,915	68,414,316
未収入金	1,120,131,241	1,191,064,458	967,051,175
未収利息	1,515	1,266	5,522
(B) 負債	1,489,714,004	1,230,645,240	1,157,403,949
未払収益分配金	768,064,100	752,043,596	725,428,555
未払解約金	666,159,037	421,816,936	374,157,594
未払信託報酬	50,044,018	50,097,505	50,008,459
その他未払費用	5,446,849	6,687,203	7,809,341
(C) 純資産総額(A-B)	75,619,834,565	73,854,480,171	72,663,696,790
元本	72,458,877,403	69,633,666,349	68,436,656,138
次期繰越損益金	3,160,957,162	4,220,813,822	4,227,040,652
(D) 受益権総口数	72,458,877,403口	69,633,666,349口	68,436,656,138口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,436円	10,606円	10,618円

(注) 当ファンドの第34期首元本額は75,167,891,167円、第34～36期中追加設定元本額は3,150,014,741円、第34～36期中一部解約元本額は9,881,249,770円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第34期1.0436円、第35期1.0606円、第36期1.0618円です。

○損益の状況

項 目	第34期	第35期	第36期
	2024年3月22日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年9月24日
	円	円	円
(A) 配当等収益	98,448	104,311	244,959
受取利息	98,448	104,311	244,959
(B) 有価証券売買損益	1,233,637,879	1,985,310,529	869,138,284
売買益	1,287,645,902	2,076,708,983	896,735,128
売買損	△ 54,008,023	△ 91,398,454	△ 27,596,844
(C) 信託報酬等	△ 51,838,489	△ 51,893,885	△ 51,687,212
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,181,897,838	1,933,520,955	817,696,031
(E) 前期繰越損益金	△ 7,284,058,117	△ 5,767,866,126	△ 3,708,145,440
(F) 追加信託差損益金	10,031,181,541	8,807,202,589	7,842,918,616
(配当等相当額)	(12,517,729,058)	(11,291,635,393)	(10,358,515,049)
(売買損益相当額)	(△ 2,486,547,517)	(△ 2,484,432,804)	(△ 2,515,596,433)
(G) 計(D+E+F)	3,929,021,262	4,972,857,418	4,952,469,207
(H) 収益分配金	△ 768,064,100	△ 752,043,596	△ 725,428,555
次期繰越損益金(G+H)	3,160,957,162	4,220,813,822	4,227,040,652
追加信託差損益金	9,263,217,034	8,055,262,194	7,117,729,916
(配当等相当額)	(11,749,764,561)	(10,539,695,005)	(9,633,326,362)
(売買損益相当額)	(△ 2,486,547,527)	(△ 2,484,432,811)	(△ 2,515,596,446)
繰越損益金	△ 6,102,259,872	△ 3,834,448,372	△ 2,890,689,264

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 分配金の計算過程(2024年3月22日～2024年9月24日)は以下の通りです。

項 目	2024年3月22日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年9月24日
a. 配当等収益(経費控除後)	99,593円	103,201円	239,855円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	12,517,729,068円	11,291,635,400円	10,358,515,062円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円	0円	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	12,517,828,661円	11,291,738,601円	10,358,754,917円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	1,727円	1,621円	1,513円
g. 分配金	768,064,100円	752,043,596円	725,428,555円
h. 分配金(1万円当たり)	106円	108円	106円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○分配金のお知らせ

	第34期	第35期	第36期
1 万口当たり分配金（税込み）	106円	108円	106円

○お知らせ

約款変更について

2024年3月22日から2024年9月24日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

グローバル3倍3分法ファンド (適格機関投資家向け)

運用報告書 (全体版)

第67期 (決算日 2024年4月22日) 第69期 (決算日 2024年6月21日) 第71期 (決算日 2024年8月21日)
第68期 (決算日 2024年5月21日) 第70期 (決算日 2024年7月22日) 第72期 (決算日 2024年9月24日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)」は、2024年9月24日に第72期の決算を行いましたので、第67期から第72期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

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(私募)	
信託期間	2018年10月5日から原則無期限です。	
運用方針	主として、投資信託の受益証券に投資を行なうとともに、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利に投資を行なうことで、実質的に日本を含む世界各国の株式、不動産投信および債券に投資し、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要運用対象	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	投資信託の受益証券のほか、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利などを主要投資対象とします。
	海外株式インデックスMSCI-KOORUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド	新興国の株式を主要投資対象とします。
	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託を主要投資対象とします。
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託を主要投資対象とします。
組入制限	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	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。
	海外株式インデックスMSCI-KOORUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	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割合には、制限を設けません。
	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド	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割合には、制限を設けません。
	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。外貨建資産への投資は行ないません。
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。	

<944459>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX (東証株価指数) 配当込み		MSCI-KOKUSAIインデックス (税引後配当込み、 円ヘッジなし・円ベース)		MSCI エマージング・ マーケット・インデックス (税引後配当込み、 円ヘッジなし・円ベース)		S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、 ヘッジなし・円ベース)	
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率
43期(2022年4月21日)	円 14,591	円 0	% 0.0	3,112.36	% 0.8	168.96	% 6.8	131.67	% 5.2	161.50	% 12.6
44期(2022年5月23日)	13,514	0	△ 7.4	3,058.56	△1.7	148.72	△12.0	124.11	△ 5.7	135.75	△15.9
45期(2022年6月21日)	12,182	0	△ 9.9	2,999.49	△1.9	148.28	△ 0.3	127.38	2.6	133.59	△ 1.6
46期(2022年7月21日)	13,644	0	12.0	3,156.42	5.2	161.23	8.7	129.62	1.8	144.01	7.8
47期(2022年8月22日)	14,024	0	2.8	3,224.73	2.2	168.84	4.7	130.84	0.9	150.35	4.4
48期(2022年9月21日)	12,577	0	△10.3	3,109.51	△3.6	162.21	△ 3.9	129.76	△ 0.8	140.07	△ 6.8
49期(2022年10月21日)	11,333	0	△ 9.9	3,078.70	△1.0	161.65	△ 0.3	124.12	△ 4.3	131.90	△ 5.8
50期(2022年11月21日)	12,555	0	10.8	3,227.07	4.8	165.29	2.3	126.50	1.9	136.52	3.5
51期(2022年12月21日)	11,365	0	△ 9.5	3,098.65	△4.0	150.97	△ 8.7	120.05	△ 5.1	124.07	△ 9.1
52期(2023年1月23日)	12,217	0	7.5	3,189.24	2.9	156.12	3.4	128.57	7.1	131.31	5.8
53期(2023年2月21日)	12,092	0	△ 1.0	3,274.90	2.7	165.99	6.3	129.62	0.8	138.94	5.8
54期(2023年3月22日)	12,105	0	0.1	3,219.53	△1.7	159.87	△ 3.7	121.42	△ 6.3	124.98	△10.0
55期(2023年4月21日)	12,299	0	1.6	3,377.11	4.9	168.83	5.6	128.16	5.6	130.35	4.3
56期(2023年5月22日)	12,543	0	2.0	3,611.02	6.9	174.56	3.4	130.06	1.5	131.64	1.0
57期(2023年6月21日)	12,871	0	2.6	3,810.90	5.5	185.85	6.5	139.24	7.1	138.73	5.4
58期(2023年7月21日)	12,931	0	0.5	3,761.11	△1.3	190.04	2.3	139.19	△ 0.0	143.63	3.5
59期(2023年8月21日)	12,176	0	△ 5.8	3,727.03	△0.9	188.86	△ 0.6	137.05	△ 1.5	139.28	△ 3.0
60期(2023年9月21日)	12,745	0	4.7	3,964.18	6.4	195.17	3.3	141.20	3.0	143.40	3.0
61期(2023年10月23日)	11,446	0	△10.2	3,756.35	△5.2	187.85	△ 3.8	136.07	△ 3.6	131.25	△ 8.5
62期(2023年11月21日)	12,727	0	11.2	3,973.10	5.8	200.31	6.6	143.31	5.3	141.23	7.6
63期(2023年12月21日)	13,683	0	7.5	3,904.50	△1.7	201.93	0.8	140.73	△ 1.8	150.51	6.6
64期(2024年1月22日)	13,706	0	0.2	4,277.71	9.6	212.00	5.0	141.66	0.7	152.77	1.5
65期(2024年2月21日)	13,812	0	0.8	4,416.48	3.2	221.58	4.5	150.73	6.4	154.09	0.9
66期(2024年3月21日)	14,495	0	4.9	4,702.41	6.5	232.59	5.0	153.74	2.0	156.33	1.5
67期(2024年4月22日)	13,779	0	△ 4.9	4,519.02	△3.9	228.23	△ 1.9	153.85	0.1	151.29	△ 3.2
68期(2024年5月21日)	14,731	0	6.9	4,684.41	3.7	247.36	8.4	171.12	11.2	164.11	8.5
69期(2024年6月21日)	14,994	0	1.8	4,628.96	△1.2	255.59	3.3	173.59	1.4	165.53	0.9
70期(2024年7月22日)	15,136	0	0.9	4,809.01	3.9	254.94	△ 0.3	171.81	△ 1.0	174.57	5.5
71期(2024年8月21日)	15,071	0	△ 0.4	4,532.67	△5.7	240.19	△ 5.8	161.27	△ 6.1	166.20	△ 4.8
72期(2024年9月24日)	15,318	0	1.6	4,520.16	△0.3	242.50	1.0	160.46	△ 0.5	175.95	5.9

(注) MSCI-KOKUSAIインデックスは、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、設定時を100として2024年9月24日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

(注) MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、設定時を100として2024年9月24日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

(注) S&P先進国REIT指数(除く日本)は、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シー社(S&P社)が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。なお、設定時を100として2024年9月24日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○最近30期の運用実績

決算期	東証REIT指数 (配当込) (参考指数)		FTSE世界国債インデックス (含む日本、円ヘッジ、円ベース) (参考指数)		株式組入比率	株式先物比率	債券先物比率	投資信託証券比率	純資産総額
	期騰落	中率	期騰落	中率					
		%		%	%	%	%	%	百万円
43期(2022年4月21日)	4,496.52	0.7	100.83	△2.7	38.5	21.9	200.9	41.0	283,688
44期(2022年5月23日)	4,511.75	0.3	100.33	△0.5	37.1	22.0	201.3	38.6	259,336
45期(2022年6月21日)	4,359.79	△3.4	96.59	△3.7	37.6	21.1	204.3	40.4	232,349
46期(2022年7月21日)	4,543.29	4.2	99.05	2.5	37.9	22.4	197.7	40.3	258,799
47期(2022年8月22日)	4,645.23	2.2	98.41	△0.6	39.2	22.3	201.1	40.9	264,794
48期(2022年9月21日)	4,632.47	△0.3	95.45	△3.0	38.7	22.4	205.1	40.9	235,309
49期(2022年10月21日)	4,298.48	△7.2	91.87	△3.8	38.0	21.1	200.6	38.9	212,367
50期(2022年11月21日)	4,547.04	5.8	94.42	2.8	37.8	22.0	200.1	39.6	235,204
51期(2022年12月21日)	4,342.68	△4.5	93.84	△0.6	39.4	22.6	208.8	42.0	215,904
52期(2023年1月23日)	4,237.39	△2.4	94.56	0.8	37.1	21.3	198.5	39.1	233,933
53期(2023年2月21日)	4,267.00	0.7	92.40	△2.3	38.3	21.9	205.5	40.5	232,365
54期(2023年3月22日)	4,165.50	△2.4	94.36	2.1	37.7	21.2	200.5	39.4	233,138
55期(2023年4月21日)	4,316.45	3.6	93.49	△0.9	39.4	22.3	201.5	40.2	236,904
56期(2023年5月22日)	4,424.44	2.5	93.06	△0.5	39.6	22.2	202.4	41.0	241,570
57期(2023年6月21日)	4,411.85	△0.3	93.01	△0.0	39.2	21.7	199.0	39.5	248,395
58期(2023年7月21日)	4,449.76	0.9	92.52	△0.5	37.5	21.5	198.0	39.9	248,980
59期(2023年8月21日)	4,401.81	△1.1	90.29	△2.4	39.0	21.4	201.3	41.3	234,506
60期(2023年9月21日)	4,485.67	1.9	89.79	△0.6	38.5	21.9	201.5	39.9	244,499
61期(2023年10月23日)	4,347.22	△3.1	88.26	△1.7	39.7	21.5	206.3	40.6	219,121
62期(2023年11月21日)	4,406.76	1.4	90.31	2.3	38.5	20.8	198.1	39.3	241,219
63期(2023年12月21日)	4,299.57	△2.4	93.09	3.1	37.3	20.3	199.1	39.1	253,103
64期(2024年1月22日)	4,474.19	4.1	91.55	△1.7	39.3	21.4	198.0	40.2	246,668
65期(2024年2月21日)	4,167.64	△6.9	90.66	△1.0	40.5	22.2	200.9	38.9	246,407
66期(2024年3月21日)	4,416.57	6.0	90.93	0.3	38.8	21.3	197.7	39.1	253,829
67期(2024年4月22日)	4,421.43	0.1	89.67	△1.4	38.7	20.9	205.0	40.8	237,296
68期(2024年5月21日)	4,390.25	△0.7	89.89	0.2	39.2	20.7	200.4	39.3	249,656
69期(2024年6月21日)	4,270.94	△2.7	90.17	0.3	39.1	20.8	197.8	39.1	249,486
70期(2024年7月22日)	4,276.48	0.1	90.16	△0.0	37.7	22.0	202.5	40.6	243,181
71期(2024年8月21日)	4,341.98	1.5	91.83	1.9	37.6	22.7	194.8	40.5	239,972
72期(2024年9月24日)	4,376.43	0.8	92.22	0.4	37.6	21.7	199.8	41.5	241,255

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) FTSE世界国債インデックス（含む日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を含む世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関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。また、設定時を100として2024年9月24日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準価額		TOPIX (東証株価指数) 配 当 込 み		MSCI-KOKUSAIインデックス (税引後配当込み、 円ヘッジなし・円ベース)		MSCI エマージング・ マーケット・インデックス (税引後配当込み、 円ヘッジなし・円ベース)		S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、 ヘッジなし・円ベース)	
		騰落率	(参考指数)	騰落率	(参考指数)	騰落率	(参考指数)	騰落率	(参考指数)	騰落率	(参考指数)
第67期	(期首) 2024年3月21日	円	%		%		%		%		%
	2024年3月21日	14,495	—	4,702.41	—	232.59	—	153.74	—	156.33	—
	3月末	14,781	2.0	4,699.20	△0.1	235.19	1.1	155.74	1.3	160.26	2.5
第68期	(期末) 2024年4月22日		△4.9		△3.9		△1.9		0.1		△3.2
	2024年4月22日	13,779	—	4,519.02	—	228.23	—	153.85	—	151.29	—
	4月末	14,193	3.0	4,656.27	3.0	238.25	4.4	163.38	6.2	157.33	4.0
第69期	(期末) 2024年5月21日		6.9		3.7		8.4		11.2		8.5
	2024年5月21日	14,731	—	4,684.41	—	247.36	—	171.12	—	164.11	—
	5月末	14,110	△4.2	4,710.15	0.5	243.86	△1.4	164.69	△3.8	159.91	△2.6
第70期	(期末) 2024年6月21日		1.8		△1.2		3.3		1.4		0.9
	2024年6月21日	14,994	—	4,628.96	—	255.59	—	173.59	—	165.53	—
	6月末	14,977	△0.1	4,778.56	3.2	258.75	1.2	173.71	0.1	167.56	1.2
第71期	(期末) 2024年7月22日		0.9		3.9		△0.3		△1.0		5.5
	2024年7月22日	15,136	—	4,809.01	—	254.94	—	171.81	—	174.57	—
	7月末	14,855	△1.9	4,752.72	△1.2	244.19	△4.2	163.56	△4.8	169.96	△2.6
第72期	(期末) 2024年8月21日		△0.4		△5.7		△5.8		△6.1		△4.8
	2024年8月21日	15,071	—	4,532.67	—	240.19	—	161.27	—	166.20	—
	8月末	15,057	△0.1	4,615.06	1.8	239.94	△0.1	159.10	△1.3	169.13	1.8
第72期	(期末) 2024年9月24日		1.6		△0.3		1.0		△0.5		5.9
	2024年9月24日	15,318	—	4,520.16	—	242.50	—	160.46	—	175.95	—

(注) 騰落率は期首比です。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	東証REIT指数 (配当込) (参考指数)		FTSE世界国債インデックス (含む日本、円ヘッジ、円ベース) (参考指数)		株式 組入比率	株式 先物比率	債券 先物比率	投資信託 比率	証券 比率
		騰落率	騰落率							
第67期	(期首) 2024年3月21日	4,416.57	—	90.93	—	38.8	21.3	197.7	39.1	—
	3月末	4,410.17	△0.1	91.21	0.3	38.4	21.1	195.0	38.9	—
	(期末) 2024年4月22日	4,421.43	0.1	89.67	△1.4	38.7	20.9	205.0	40.8	—
第68期	(期首) 2024年4月22日	4,421.43	—	89.67	—	38.7	20.9	205.0	40.8	—
	4月末	4,455.74	0.8	89.22	△0.5	39.5	20.8	199.9	39.6	—
	(期末) 2024年5月21日	4,390.25	△0.7	89.89	0.2	39.2	20.7	200.4	39.3	—
第69期	(期首) 2024年5月21日	4,390.25	—	89.89	—	39.2	20.7	200.4	39.3	—
	5月末	4,302.09	△2.0	89.32	△0.6	39.9	22.4	206.0	40.6	—
	(期末) 2024年6月21日	4,270.94	△2.7	90.17	0.3	39.1	20.8	197.8	39.1	—
第70期	(期首) 2024年6月21日	4,270.94	—	90.17	—	39.1	20.8	197.8	39.1	—
	6月末	4,277.59	0.2	89.65	△0.6	39.7	21.9	200.9	39.9	—
	(期末) 2024年7月22日	4,276.48	0.1	90.16	△0.0	37.7	22.0	202.5	40.6	—
第71期	(期首) 2024年7月22日	4,276.48	—	90.16	—	37.7	22.0	202.5	40.6	—
	7月末	4,290.75	0.3	90.88	0.8	36.6	22.3	198.4	40.8	—
	(期末) 2024年8月21日	4,341.98	1.5	91.83	1.9	37.6	22.7	194.8	40.5	—
第72期	(期首) 2024年8月21日	4,341.98	—	91.83	—	37.6	22.7	194.8	40.5	—
	8月末	4,411.38	1.6	91.37	△0.5	37.3	22.1	196.8	41.1	—
	(期末) 2024年9月24日	4,376.43	0.8	92.22	0.4	37.6	21.7	199.8	41.5	—

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

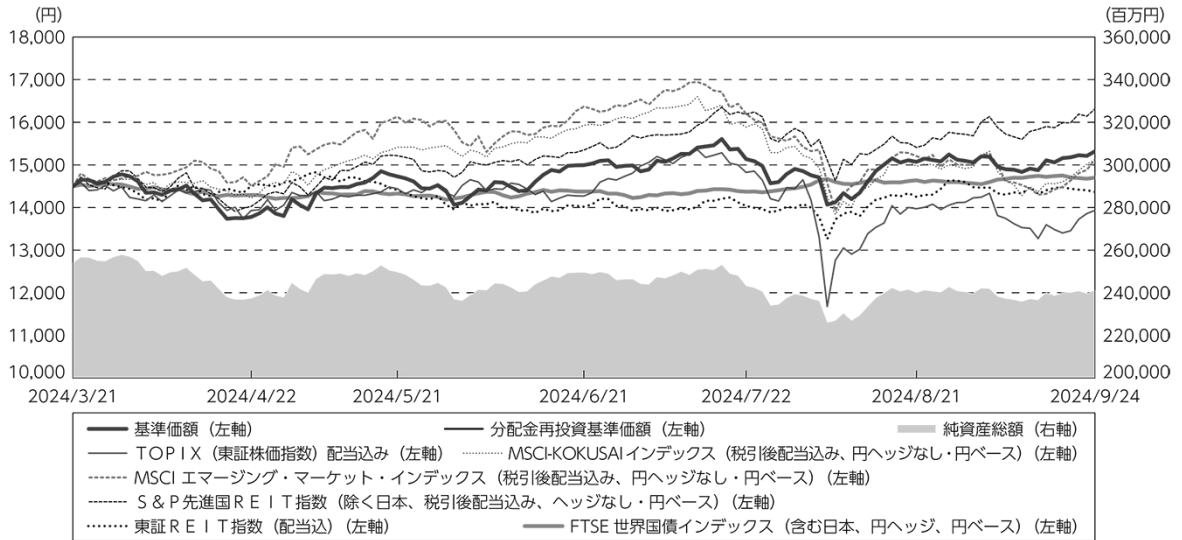
(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

（2024年3月22日～2024年9月24日）

作成期間中の基準価額等の推移



第67期首：14,495円

第72期末：15,318円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：5.7%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額、TOPIX（東証株価指数）配当込み、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、S & P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）、東証REIT指数（配当込）およびFTSE世界国債インデックス（含む日本、円ヘッジ、円ベース）は、作成期首（2024年3月21日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) TOPIX（東証株価指数）配当込み、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、S & P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）、東証REIT指数（配当込）およびFTSE世界国債インデックス（含む日本、円ヘッジ、円ベース）は当ファンドの参考指数です。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、株式や不動産投信（REIT）に投資を行なう4つの受益証券に投資を行なうとともに、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利に投資を行なうことで、実質的に日本を含む世界各国の株式、REITおよび債券に分散投資を行ない、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。現物の組入総額と先物取引の買建総額の組入合計額が純資産総額の3倍相当額となるように投資を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・海外のREIT市場が上昇したことから、海外REIT資産を保有したことがプラス要因となりました。
- ・海外の債券利回りが総じて低下（債券価格は上昇）したことから、海外債券先物資産を保有したことがプラス要因となりました。

<値下がり要因>

- ・国内株式市場が下落したことから、国内株式先物資産を保有したことがマイナス要因となりました。
- ・投資先通貨が円に対して総じて下落したこと。

投資環境

(市況)

国内株式市場では、期間の初めと比べて、東証株価指数（TOPIX）および日経平均株価指数はともに下落しました。インフレの鈍化を示す米国の経済指標の発表を受けて米国連邦準備制度理事会（FRB）による利下げが期待されたことや、米国の大手半導体企業の好決算などを背景として半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったことなどが支援材料となったものの、中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、日銀が金融政策決定会合において利上げを決定したことを受けて円高／アメリカドル安が進み、輸出関連企業の業績への期待が後退したこと、米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念が強まったことなどから、国内市場の株価は下落しました。

海外株式市場では、期間の初めと比べて、欧米諸国などの株価は総じて上昇しました。中東情勢が緊迫化したことや、フランス議会下院選挙において左派連合が極右政党を抑えて最大勢力となりフランス政治の不透明感が続いたこと、米国の雇用統計の内容を受けて米国景気の悪化が懸念されたことなどが株価の重しとなったものの、生成AI（人工知能）の活用の広がりからAI関連の大手ハイテク企業などへの業績期待が高まったこと、米国の労働市場における需給のひっ迫が薄れたこと、米国の消費者物価指数（CPI）が市場予想を下回りインフレ鈍化の傾向を示したこと、欧州中央銀行（ECB）が政策金利を引き下げたこと、FRBの金融政策が緩和に転じたことなどが支援材料となり、欧米諸国などの株価は総じて上昇しました。

新興国株式市場では、期間の初めと比べて、新興国各国の株価はまちまちの動きとなりました。中国景気に対する先行き懸念や、欧米の早期利下げ観測が後退する場面で欧米の長期金利が上昇したこと、中東情勢が緊迫化したことなどが株価の重しとなったものの、中国政府が低迷する不動産市場への支援策を発表したことや、インドの総選挙で与党連合が過半数の議席を獲得し政権を維持したこと、中国人民銀行が事実上の政策金利である最優遇貸出金利を引き下げたこと、欧米の金融政策が緩和に転じたことなどが支援材料となりました。

国内のREIT市場では、東証REIT指数（配当込）は期間の初めと比べて下落しました。都心部オフィスの空室率が低下したことに加え平均賃料が上昇したことなどがREIT価格の支援材料となったものの、

日銀がマイナス金利政策の解除を決定したことや、日銀が追加利上げや国債買入れの減額を決定し金融政策の正常化を進めたこと、国内長期金利が上昇したことなどがREIT価格の重しとなり、東証REIT指数（配当込）は下落しました。

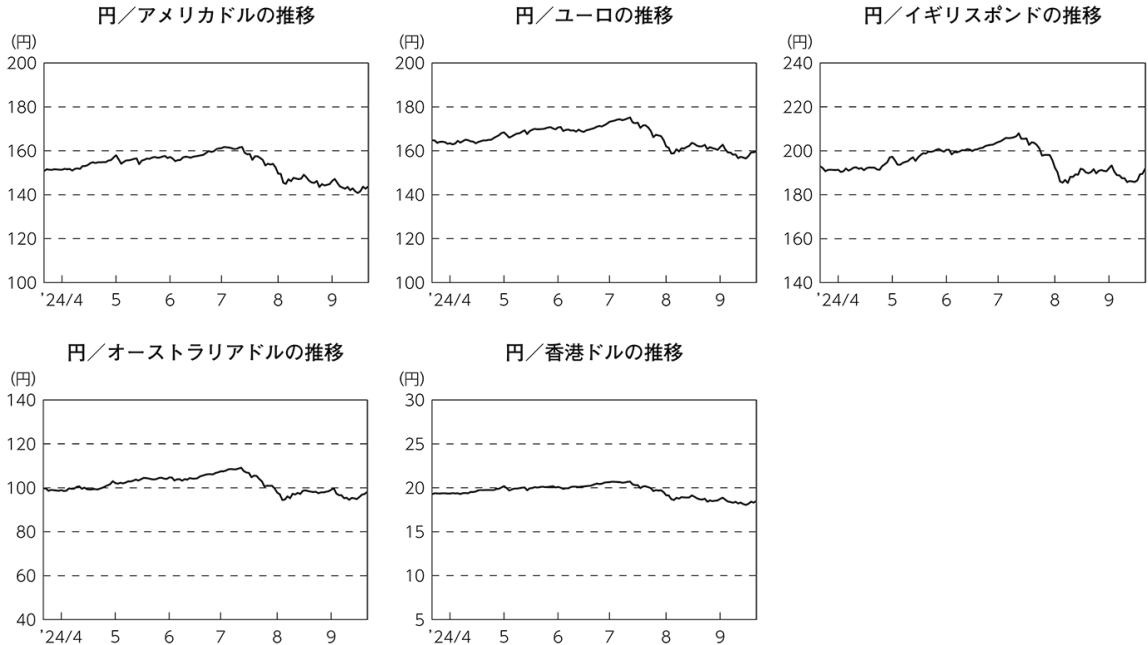
海外のREIT市場では、S&P先進国REIT指数（除く日本）は期間の初めと比べて上昇しました。期間の初めから2024年5月下旬にかけては、米国経済の底堅さを示す経済指標の発表を受けてFRBによる政策金利の早期引き下げ観測が後退し欧米の長期金利が総じて上昇したことや、イスラム組織ハマスとイスラエルとの間の軍事衝突による中東情勢の緊迫化を受けた地政学的リスクが警戒されたこと、一部IT企業の企業決算が市場予想を下回ったことを背景に株式市場が下落したことなどから、同指数は下落しました。6月上旬から期間末にかけては、今期の米国大統領選挙に向けた候補者討論会で共和党が優勢になったとの見方から米国の財政拡大に伴う景気刺激策は米国経済を下支えすると期待されたことや、生成AI関連の大手ハイテク企業への業績期待などから米国の株式市場が上昇したことが好感されたこと、米国の雇用統計の内容が悪化を示し、米国景気の減速懸念などを背景にFRBが利下げに踏み切ったことを受けて欧米主要国の長期金利の低下により相対的に分配金利回りの高いREITの投資魅力が高まり、同指数は上昇しました。

国内債券市場では、10年国債利回りは期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。期間の初めから2024年7月上旬にかけては、円安／アメリカドル高が進行するなか日銀による国債購入の減額や追加利上げが意識されたことや、日銀が発表した全国企業短期経済観測調査（短観）で大企業製造業の景況感が改善したことや毎月勤労統計調査で高い賃金上昇率の実現が確認され日銀の追加利上げ観測が強まったことなどから、10年国債利回りは上昇しました。7月中旬から期間末にかけては、日銀が金融政策決定会合において利上げを決定したことが国債利回りの上昇要因となったものの、米国の製造業の景況感や雇用に関する経済指標が市場予想を下回り、米国景気の減速懸念などから国内株式市場が下落し投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、FRB議長が講演で利下げに踏み切る考えを示し、FRBによる早期の利下げ観測が意識されたことなどから、10年国債利回りは低下しました。

海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて低下しました。期間の初めから2024年5月下旬にかけては、中東情勢の緊迫化を受けて地政学的リスクが警戒されたことや、スウェーデンの中央銀行などが政策金利を引き下げたことなどが利回りの低下要因となったものの、ECB高官の発言などを受けてECBの利下げに近い利下げペースが緩やかになるとの見方が広がったことや、FRB議長が米国連邦公開市場委員会（FOMC）後の記者会見で金融緩和に慎重な考えを示したことを受けてFRBによる早期利下げ観測が後退したことなどから、投資対象国の10年国債利回りは総じて上昇しました。6月上旬から期間末にかけては、フランスなど欧州政治を巡る先行き不透明感などが利回りの上昇要因となったものの、ECBに続き、イングランド銀行（BOE）、カナダの中央銀行が利下げを実施したことや、米国の雇用統計の内容が悪化を示し、米国景気の減速懸念などを背景にFRBが利下げに踏み切ったことを受けて、投資対象国の10年国債利回りは総じて低下しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



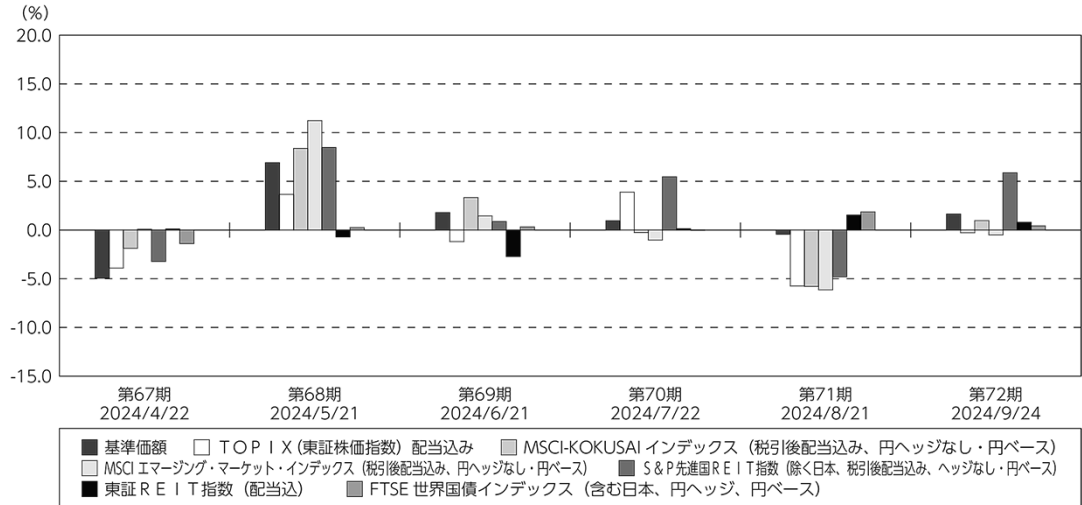
当ファンドのポートフォリオ

主として、株式やREITに投資を行なう4つの受益証券に投資を行なうとともに、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利に投資を行なうことで、実質的に日本を含む世界各国の株式、REITおよび債券に分散投資を行ない、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないました。現物の組入総額と先物取引の買建総額の組入合計額が純資産総額の3倍相当額となるように投資を行ないました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。
 グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率です。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

(注) TOPIX（東証株価指数）配当込み、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）、S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）、東証REIT指数（配当込）およびFTSE世界国債インデックス（含む日本、円ヘッジ、円ベース）は当ファンドの参考指数です。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、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

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期
	2024年3月22日～ 2024年4月22日	2024年4月23日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年6月21日	2024年6月22日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年8月21日	2024年8月22日～ 2024年9月24日
当期分配金	—	—	—	—	—	—
（対基準価額比率）	—%	—%	—%	—%	—%	—%
当期の収益	—	—	—	—	—	—
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	6,910	6,941	6,979	7,023	7,053	7,101

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、主として、株式やREITに投資を行なう4つの受益証券に投資を行なうとともに、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利に投資を行なうことで、実質的に日本を含む世界各国の株式、REITおよび債券に分散投資を行ない、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。現物の組入総額と先物取引の買建総額の組入合計額が純資産総額の3倍相当額となるように投資を行ないます。各資産への配分については、市況環境および投資対象資産のリスク水準などを勘案して決定する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2024年3月22日～2024年9月24日）

項 目	第67期～第72期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	7	0.045	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	（ 5 ）	（ 0.034 ）	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	（ ー ）	（ ー ）	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	（ 2 ）	（ 0.011 ）	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	3	0.023	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	（ 0 ）	（ 0.001 ）	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	（ 0 ）	（ 0.001 ）	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	（ 3 ）	（ 0.021 ）	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.003	(c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 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 ）	（ 0.002 ）	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	（ 0 ）	（ 0.000 ）	
(d) そ の 他 費 用	6	0.039	(d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	（ 2 ）	（ 0.016 ）	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	（ 0 ）	（ 0.001 ）	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 費 用 等 ）	（ 2 ）	（ 0.013 ）	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用など
（ そ の 他 ）	（ 1 ）	（ 0.009 ）	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	16	0.110	
作成期間の平均基準価額は、14,662円です。			

(注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2024年3月22日～2024年9月24日）

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		第67期～第72期			
		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 102,330	百万円 103,487	百万円 —	百万円 —
	債券先物取引	202,165	207,737	—	—
外 国	債券先物取引	779,264	790,534	—	—

（注）金額は受け渡し代金。

（注）外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第67期～第72期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	520,310	3,213,642	1,363,713	8,851,850
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	771,103	1,879,410	620,756	1,577,032
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	—	—	1,480,104	4,982,296
海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	1,660,726	4,603,265	3,389,308	9,721,697

○株式売買比率

（2024年3月22日～2024年9月24日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第67期～第72期	
	海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI（ヘッジなし） マザーファンド	海外新興国株式インデックス MSCIエマージング（ヘッジなし） マザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	24,062,051千円	12,776,615千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	400,370,911千円	117,010,782千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.06	0.10

（注）(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

（注）外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2024年3月22日～2024年9月24日)

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2024年3月22日～2024年9月24日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2024年3月22日～2024年9月24日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年9月24日現在)

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			第72期末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX先物	百万円 48,626	百万円 —
	債券先物取引	長期国債先物	95,047	—
外国	債券先物取引	AUSTRI0Y	97,122	—
		BUND10Y	96,416	—
		GILT10Y	96,971	—
		TNOTE10Y	96,520	—

(注) 邦貨換算金額は、第72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。

親投資信託残高

銘	柄	第66期末		第72期末	
		口	数	口	数
			千口		千円
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド		8,281,596		7,438,193	48,026,925
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド		19,487,539		19,637,886	49,169,341
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド		15,349,636		13,869,531	50,983,012
海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド		18,734,603		17,006,021	47,460,404

(注) 各親投資信託の2024年9月24日現在の受益権総口数は、以下の通りです。

・ 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	65,384,327千口	・ 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	15,930,330千口
・ 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	24,730,772千口	・ 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	44,356,515千口

○投資信託財産の構成

(2024年9月24日現在)

項	目	第72期末	
		評 価 額	比 率
		千円	%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド		48,026,925	19.8
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド		49,169,341	20.2
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド		50,983,012	21.0
海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド		47,460,404	19.5
コール・ローン等、その他		47,482,703	19.5
投資信託財産総額		243,122,385	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（417,678,304千円）の投資信託財産総額（422,410,975千円）に対する比率は98.9%です。

(注) 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（58,534,761千円）の投資信託財産総額（58,563,275千円）に対する比率は100.0%です。

(注) 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（123,698,360千円）の投資信託財産総額（123,790,741千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 当作成期末における外貨建純資産（11,679,084千円）の投資信託財産総額（243,122,385千円）に対する比率は4.8%です。

(注) 外貨建資産は、当作成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。1アメリカドル=143.74円、1カナダドル=106.23円、1メキシコペソ=7.396円、1ブラジルレアル=25.9467円、1チリペソ=0.155793円、1コロンビアペソ=0.034551円、1ユーロ=159.62円、1イギリスポンド=191.86円、1スイスフラン=169.64円、1スウェーデンクローナ=14.10円、1ノルウェークローネ=13.68円、1デンマーククローネ=21.40円、1トルコリラ=4.2126円、1チェココルナ=6.3496円、1ハンガリーフォリント=0.404268円、1ポーランドズロチ=37.364円、1オーストラリアドル=98.13円、1ニュージーランドドル=89.98円、1香港ドル=18.46円、1シンガポールドル=111.33円、1マレーシアリンギット=34.2159円、1タイバーツ=4.36円、1フィリピンペソ=2.5688円、1インドネシアルピア=0.0095円、1韓国ウォン=0.1077円、1新台湾ドル=4.4815円、1インドルピー=1.73円、1サウジアラビアリヤル=38.37円、1イスラエルシェケル=37.9033円、1カタールリアル=39.50円、1クウェートディナール=472.05円、1エジプトポンド=2.9536円、1南アフリカランド=8.28円、1アラブディルハム=39.20円、1香港・オフショア人民元=20.3569円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第67期末	第68期末	第69期末	第70期末	第71期末	第72期末
	2024年4月22日現在	2024年5月21日現在	2024年6月21日現在	2024年7月22日現在	2024年8月21日現在	2024年9月24日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	244,889,317,847	255,420,650,107	249,981,255,934	245,360,800,091	240,943,399,289	243,107,247,432
コール・ローン等	25,205,814,645	29,762,538,747	31,406,544,784	28,026,283,991	25,288,094,607	25,107,176,727
新興成長(インテグリス)REIT(米国) (ハッジなし) マチーフンド(詳細欄)	47,796,287,009	50,389,974,108	50,533,253,109	48,073,883,929	47,601,461,311	48,026,925,963
日本リート(インテグリス)-REIT(マチーフンド(詳細欄))	49,282,039,734	47,380,153,006	47,989,104,092	48,051,945,330	48,784,438,510	49,169,341,092
新興成長(インテグリス)REIT(米国) (ハッジなし) マチーフンド(詳細欄)	47,653,118,082	50,471,165,830	49,468,926,382	50,550,282,824	48,131,436,465	50,983,012,219
新興成長(インテグリス)REIT(米国) (ハッジなし) マチーフンド(詳細欄)	47,441,427,160	51,225,579,044	51,394,936,907	48,016,454,022	47,744,404,620	47,460,404,065
未収入金	—	119,891,132	5,552,648,151	5,311,229,403	12,049,122,354	3,823,711,049
未収利息	56,260	64,800	70,729	63,039	164,594	161,050
差入委託証拠金	27,510,574,957	26,071,283,440	13,635,771,780	17,330,657,553	11,344,276,828	18,536,515,267
(B) 負債	7,592,674,682	5,764,230,024	494,428,011	2,179,226,548	971,366,161	1,851,434,921
未払金	7,549,817,052	4,600,297,608	446,143,250	—	—	813,165,055
未払解約金	—	1,120,131,241	—	2,127,138,197	917,685,647	967,051,174
未払信託報酬	19,196,793	17,043,142	18,144,526	18,515,574	17,002,123	19,568,406
その他未払費用	23,660,837	26,758,033	30,140,235	33,572,777	36,678,391	51,650,286
(C) 純資産総額(A-B)	237,296,643,165	249,656,420,083	249,486,827,923	243,181,573,543	239,972,033,128	241,255,812,511
元本	172,216,338,641	169,471,246,753	166,388,778,153	160,667,454,443	159,222,793,991	157,495,848,935
次期繰越損益金	65,080,304,524	80,185,173,330	83,098,049,770	82,514,119,100	80,749,239,137	83,759,963,576
(D) 受益権総口数	172,216,338,641口	169,471,246,753口	166,388,778,153口	160,667,454,443口	159,222,793,991口	157,495,848,935口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,779円	14,731円	14,994円	15,136円	15,071円	15,318円

(注) 当ファンドの第67期首元本額は175,113,484,807円、第67～72期中追加設定元本額は206,372,969円、第67～72期中一部解約元本額は17,824,008,841円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第67期1.3779円、第68期1.4731円、第69期1.4994円、第70期1.5136円、第71期1.5071円、第72期1.5318円です。

○損益の状況

項 目	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期
	2024年3月22日～ 2024年4月22日	2024年4月23日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年6月21日	2024年6月22日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年8月21日	2024年8月22日～ 2024年9月24日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	46,725,059	36,487,966	44,453,650	40,551,014	46,180,465	41,558,247
受取利息	1,699,054	1,659,277	1,765,510	1,506,374	3,808,143	5,288,658
その他収益金	45,026,005	34,828,689	42,688,140	39,044,640	42,372,322	36,269,589
(B) 有価証券売買損益	△ 2,570,215,290	13,062,976,714	1,563,905,360	2,106,592,279	△ 8,078,043,596	3,215,309,950
売買益	235,566,778	13,587,178,988	3,002,140,564	2,872,326,246	777,843,637	3,692,896,250
売買損	△ 2,805,782,068	△ 524,202,274	△ 1,438,235,204	△ 765,733,967	△ 8,855,887,233	△ 477,586,300
(C) 先物取引等取引損益	△ 9,782,766,568	3,063,114,364	2,784,943,950	148,695,341	7,032,054,105	664,595,618
取引益	64,694,905	3,781,418,268	6,513,073,952	1,974,043,670	10,029,359,515	4,473,377,458
取引損	△ 9,847,461,473	△ 718,303,904	△ 3,728,130,002	△ 1,825,348,329	△ 2,997,305,410	△ 3,808,781,840
(D) 信託報酬等	△ 23,689,120	△ 20,620,248	△ 21,952,799	△ 22,401,721	△ 20,570,616	△ 34,965,341
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△12,329,945,919	16,141,958,796	4,371,350,161	2,273,436,913	△ 1,020,379,642	3,886,498,474
(F) 前期繰越損益金	35,166,717,097	22,465,740,088	37,905,470,380	40,823,111,136	42,696,443,112	41,217,843,041
(G) 追加信託差損益金	42,243,533,346	41,577,474,446	40,821,229,229	39,417,571,051	39,073,175,667	38,656,622,061
(配当等相当額)	(42,033,162,815)	(41,386,848,620)	(40,634,141,286)	(39,236,916,221)	(38,905,648,916)	(38,494,629,210)
(売買損益相当額)	(210,370,531)	(190,625,826)	(187,087,943)	(180,654,830)	(167,526,751)	(160,992,851)
(H) 計(E+F+G)	65,080,304,524	80,185,173,330	83,098,049,770	82,514,119,100	80,749,239,137	83,759,963,576
(I) 収益分配金	0	0	0	0	0	0
次期繰越損益金(H+I)	65,080,304,524	80,185,173,330	83,098,049,770	82,514,119,100	80,749,239,137	83,759,963,576
追加信託差損益金	42,243,533,346	41,577,474,446	40,821,229,229	39,417,571,051	39,073,175,667	38,656,622,061
(配当等相当額)	(42,033,212,810)	(41,386,920,554)	(40,634,141,286)	(39,236,916,221)	(38,905,705,883)	(38,494,693,206)
(売買損益相当額)	(210,320,536)	(190,553,892)	(187,087,943)	(180,654,830)	(167,469,784)	(160,928,855)
分配準備積立金	76,969,313,074	76,257,846,731	75,491,472,489	73,613,294,432	73,409,067,277	73,355,863,499
繰越損益金	△54,132,541,896	△37,650,147,847	△33,214,651,948	△30,516,746,383	△31,733,003,807	△28,251,521,984

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
(注) 損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注) 分配金の計算過程（2024年3月22日～2024年9月24日）は以下の通りです。

項 目	2024年3月22日～ 2024年4月22日	2024年4月23日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年6月21日	2024年6月22日～ 2024年7月22日	2024年7月23日～ 2024年8月21日	2024年8月22日～ 2024年9月24日
a. 配当等収益(経費控除後)	457,868,904円	539,061,061円	620,666,042円	717,633,598円	479,192,837円	753,915,021円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	42,033,212,810円	41,386,920,554円	40,634,141,286円	39,236,916,221円	38,905,705,883円	38,494,693,206円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	76,511,444,170円	75,718,785,670円	74,870,806,447円	72,895,660,834円	72,929,874,440円	72,601,948,478円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	119,002,525,884円	117,644,767,285円	116,125,613,775円	112,850,210,653円	112,314,773,160円	111,850,556,705円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,910円	6,941円	6,979円	7,023円	7,053円	7,101円
g. 分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

○分配金のお知らせ

	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期
1万口当たり分配金（税込み）	0円	0円	0円	0円	0円	0円

○お知らせ

約款変更について

2024年3月22日から2024年9月24日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第24期（決算日 2023年10月26日）
（2022年10月27日～2023年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2000年5月17日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
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割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、「MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数等先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	期騰落	中率	期騰落	中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
20期(2019年10月28日)	26,268	9.9	250.26	9.6	95.7	2.0	2.8	185,690
21期(2020年10月26日)	28,388	8.1	269.16	7.6	96.4	1.3	2.3	231,675
22期(2021年10月26日)	41,177	45.1	389.33	44.6	96.5	1.3	2.3	254,055
23期(2022年10月26日)	44,171	7.3	415.95	6.8	96.2	1.9	2.2	258,049
24期(2023年10月26日)	49,637	12.4	466.22	12.1	97.1	1.0	1.9	300,888

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 「MSCI-KOKUSAIインデックス」は、「MSCI Inc.」が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。同指数の（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2023年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率
	騰落	率	騰落	率			
(期首) 2022年10月26日	円	%		%	%	%	%
10月末	44,171	—	415.95	—	96.2	1.9	2.2
11月末	44,648	1.1	420.20	1.0	95.9	2.0	2.2
12月末	43,324	△ 1.9	407.98	△ 1.9	96.0	1.7	2.3
2023年1月末	40,668	△ 7.9	382.74	△ 8.0	95.5	2.3	2.2
2月末	42,201	△ 4.5	397.39	△ 4.5	95.8	2.0	2.3
3月末	43,694	△ 1.1	410.88	△ 1.2	96.3	1.7	2.2
4月末	43,473	△ 1.6	408.73	△ 1.7	95.9	2.0	2.1
5月末	44,667	1.1	419.66	0.9	96.6	1.3	2.1
6月末	46,762	5.9	439.36	5.6	95.8	1.6	2.0
7月末	50,451	14.2	474.05	14.0	96.6	1.3	2.0
8月末	51,222	16.0	481.24	15.7	96.6	1.5	2.0
9月末	52,120	18.0	489.41	17.7	96.3	1.6	2.0
(期末) 2023年10月26日	50,871	15.2	477.47	14.8	96.3	1.9	1.9
	49,637	12.4	466.22	12.1	97.1	1.0	1.9

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

（2022年10月27日～2023年10月26日）

基準価額の推移

期間の初め44,171円の基準価額は、期間末に49,637円となり、騰落率は+12.4%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

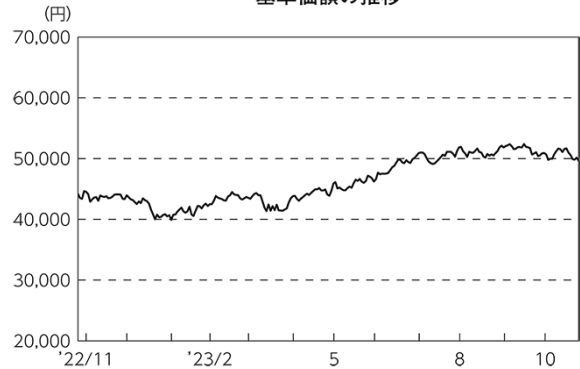
<値上がり要因>

- ・米国の消費者物価指数（CPI）などのインフレ指標が市場予想を下回り、米国連邦準備制度理事会（FRB）の利上げペース鈍化への期待が強まったこと。
- ・交渉難航が懸念された米国政府の債務上限問題を巡る政府と野党の協議が最終的に基本合意し、米国債務上限停止法案が成立したこと。
- ・公表された米国の2023年4－6月期の企業業績が概ね良好な内容となったこと。
- ・円安／アメリカドル高、円安／ユーロ高、円安／イギリスポンド高となったこと。

<値下がり要因>

- ・インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行が利上げを継続したこと。
- ・米国の地方銀行の経営破綻やスイスの大手金融グループの経営悪化から金融システムに対する不安が高まったこと。
- ・米国の金融引き締めが長期化するとの見方が改めて広がり、欧米の長期金利が上昇したこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2022/10/26	2023/09/15	2023/01/04	2023/10/26
44,171円	52,389円	39,934円	49,637円

MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）（指数化）の推移



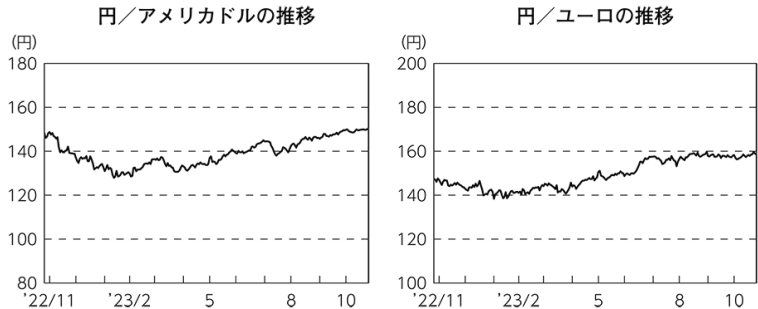
（海外株式市況）

海外株式市場では、期間の初めと比べて欧米各国の株価は概して上昇しました。

期間の初めから、2023年7月下旬にかけては、インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行が利上げを継続したこと、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの大手金融グループの経営悪化から金融システムに対する不安が高まったことなどが株価の重しとなったものの、米国のCPIなどのインフレ指標が市場予想を下回り、FRBの利上げペース鈍化への期待が強まったことや、ユーロ圏のCPIが市場予想を下回りインフレ圧力の緩和が見られたこと、交渉難航が懸念された米国政府の債務上限問題を巡る政府と野党の協議が最終的に基本合意し、米国債務上限停止法案が成立したこと、公表された米国の2023年4－6月期の企業業績が概ね良好な内容となったことなどを背景に、欧米各国の株価は総じて上昇しました。8月上旬から期間末にかけては、米国連邦公開市場委員会（FOMC）の結果を受けて、米国の金融引き締めが長期化するとの見方が改めて広がり、欧米の長期金利が上昇したことや、イスラエルとイスラム組織ハマスの戦闘激化による地政学的リスクの高まりなどが重しとなり、欧米各国の株価は総じて下落しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。



ポートフォリオ

ベンチマークが採用している国の株式の中からリスクコントロールモデルを使用して構築したポートフォリオで、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

なお、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、12.4%の値上がりとなり、ベンチマークである「MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）」の上昇率12.1%を概ね0.3%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・現物株式の組入れに基づく要因が寄与したこと。

<マイナス要因>

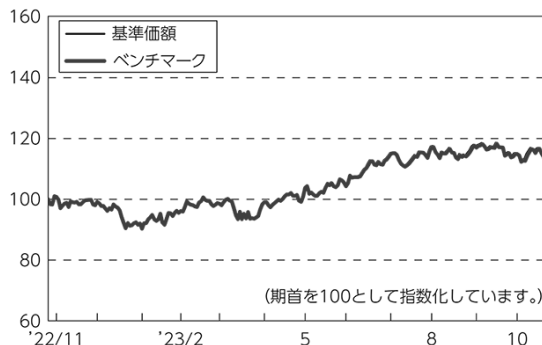
- ・株式先物の組入れに基づく要因が影響したこと。
- ・海外カस्टディ・フィーや売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

○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て、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○1万口当たりの費用明細

(2022年10月27日～2023年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	1 (1) (0) (0)	0.003 (0.002) (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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0)	0.004 (0.004) (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)	9 (9) (0)	0.020 (0.020) (0.000)	(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、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	12	0.027	
期中の平均基準価額は、46,175円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2022年10月27日～2023年10月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 18,006 (1,159)	千アメリカドル 166,737 (1,302)	百株 8,701 (762)	千アメリカドル 74,600 (6,451)
	カナダ	1,382 (256)	千カナダドル 8,728 (616)	543 (187)	千カナダドル 1,928 (1,297)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	853 (-)	4,773 (△ 135)	232	1,396
	イタリア	1,059 (-)	506 (△ 0.624)	629	882
	フランス	1,067 (-)	6,833 (△ 25)	955	4,136
	オランダ	902 (533)	3,888 (404)	614	1,496
	スペイン	969 (4,955)	1,101 (△ 310)	5,576 (110)	995 (124)
	ベルギー	10	78	56	55
	オーストリア	15	38	-	-
	ルクセンブルク	36	67	359	35
	フィンランド	477 (196)	727 (81)	211 (-)	143 (81)
	アイルランド	1,388	877	404 (300)	161 (1,074)
	ポルトガル	218	129	-	-
	スイス	- (-)	- (△ 12)	-	-
国	イギリス	9,460 (300)	千イギリスポンド 7,268 (935)	4,389 (-)	千イギリスポンド 4,075 (177)
	スイス	1,066 (1,376)	千スイスフラン 6,653 (1,115)	2,804 (166)	千スイスフラン 3,726 (1,229)
	スウェーデン	1,776 (194)	千スウェーデンクローナ 23,241 (602)	1,894 (81)	千スウェーデンクローナ 20,380 (458)
	ノルウェー	155 (-)	千ノルウェークローネ 3,828 (△ 14)	12	千ノルウェークローネ 398

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	デンマーク	百株 135 (1,311)	千デンマーククローネ 11,708 (54,016)	百株 81 (655)	千デンマーククローネ 5,587 (54,016)
	オーストラリア	4,344	千オーストラリアドル 6,934	2,463	千オーストラリアドル 3,220
	ニュージーランド	311	千ニュージーランドドル 397	—	千ニュージーランドドル —
	香港	1,976	千香港ドル 8,069	2,202	千香港ドル 4,003
	シンガポール	14,033 (10,191)	千シンガポールドル 1,299 (0.059)	8,089 (7)	千シンガポールドル 357 (13)
	イスラエル	461	千イスラエルシケル 858	1,072	千イスラエルシケル 1,011

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、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。

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,220	158	—	—
PROLOGIS INC	4,480	532	1,700	211
AMERICAN TOWER CORP	2,250	463	790	154
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	930	30	—	—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3,290	61	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,870	305	1,300	231
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,110	115	—	—
CROWN CASTLE INC	4,110	486	3,820	433
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,750	277	1,690	178
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	2,110	129	—	—
EQUINIX INC	560	391	200	148
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,840	561	—	—
GAMING AND LEISURE PROPRTIE	1,970	98	—	—
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,810	75	—	—
WELLTOWER INC	7,140	530	3,530	262
INVITATION HOMES INC	10,700	367	7,810	263
IRON MOUNTAIN INC	6,270	367	3,800	202
KIMCO REALTY CORP	1,930	39	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	—	23,470	193
PUBLIC STORAGE	540	154	140	40
REALTY INCOME CORP	5,980	364	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	145	41	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,280	153	—	—
VENTAS INC	2,130	96	—	—
VICI PROPERTIES INC	5,760	181	2,250	74
VORNADO REALTY TRUST	—	—	6,851	173
WEYERHAEUSER CO	4,850	139	2,610	81
WP CAREY INC	1,300	95	—	—
小計	82,325	6,218	59,961	2,649
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
KLEPIERRE	—	—	—	—
	(—)	(△ 7)	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	830	43	—	—
小計	830	43	—	—
	(—)	(△ 7)	—	—
ベルギー				
WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,570	67	—	—
小計	2,570	67	—	—
ユーロ計	3,400	110	—	—
	(—)	(△ 7)	—	—
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND COMPANY PLC	—	—	30,601	99
小計	—	—	30,601	99
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
GOODMAN GROUP	11,500	218	4,440	84
MIRVAC GROUP	24,800	51	—	—
STOCKLAND	68,900	308	48,800	212
小計	105,200	577	53,240	297

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	9,500	530	(-)	(96)
	LINK REIT(N)	(17,360)	(863)	-	-
	LINK REIT-RTS	(17,360)	(96)	(17,360)	(96)
	LINK REIT-RTS(N)	(17,360)	(96)	(17,360)	(96)
	小計	9,500 (52,080)	530 (1,055)	- (34,720)	- (288)
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	(-)	(△ 1)	(-)	(1)
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	-	-	5,986	6
	CAPITALAND ASCOTT TRUST(N)	(5,986)	(5)	-	-
国	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	(-)	(△0.733)	-	-
	KEPPEL REIT(N)	(13,712)	(8)	-	-
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	(-)	(△0.901)	-	-
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	(-)	(△ 5)	-	-
	小計	(19,698)	(4)	5,986 (-)	6 (1)

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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 39,130	百万円 41,527	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2022年10月27日～2023年10月26日)

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	44,895,252千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	269,517,980千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年10月27日～2023年10月26日)

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2022年10月27日～2023年10月26日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2023年10月26日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
3M CO	207	215	1,925	289,438	資本財
ABBVIE INC	657	703	10,212	1,534,756	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBOTT LABORATORIES	653	695	6,506	977,794	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	236	253	7,407	1,113,145	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	158	166	3,598	540,725	保険
ADVANCE AUTO PARTS INC	21	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
AES CORP	251	279	410	61,678	公益事業
AECOM	—	49	375	56,469	資本財
AERCAP HOLDINGS NV	48	69	409	61,485	資本財
AFLAC INC	229	234	1,833	275,487	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	112	127	1,318	198,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	82	91	2,501	375,983	素材
ALLSTATE CORP	102	105	1,316	197,786	保険
ALTRIA GROUP INC	677	710	3,042	457,193	食品・飲料・タバコ
ALLIANT ENERGY CORP	88	121	601	90,455	公益事業
ALBEMARLE CORP	43	47	642	96,595	素材
ALLEGION PLC	33	33	322	48,446	資本財
ALLY FINANCIAL INC	122	122	286	43,116	金融サービス
ALCOA CORP	67	—	—	—	素材
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	—	102	223	33,643	生活必需品流通・小売り
AMPHENOL CORP-CL A	220	233	1,860	279,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	41	42	1,297	195,013	金融サービス
AMEREN CORPORATION	95	101	780	117,245	公益事業
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	295	303	1,849	277,992	保険
AMERICAN EXPRESS CO	238	253	3,633	545,977	金融サービス
AMETEK INC	85	90	1,261	189,585	資本財
AMERICAN ELECTRIC POWER	189	203	1,533	230,443	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	67	77	897	134,896	公益事業
CENCORA INC	57	70	1,326	199,344	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	26	26	288	43,356	保険
AMCOR PLC	546	656	561	84,387	素材
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	194	—	—	—	メディア・娯楽
U-HAUL HOLDING CO	—	33	164	24,715	運輸
AON PLC	79	80	2,581	387,994	保険
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	150	158	1,286	193,278	金融サービス
ESSENTIAL UTILITIES INC	91	112	370	55,626	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	210	221	1,573	236,429	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	25	25	276	41,604	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	79	86	1,989	299,022	保険
ARAMARK	88	88	233	35,110	消費者サービス
HOWMET AEROSPACE INC	137	179	775	116,568	資本財
ARISTA NETWORKS INC	87	104	1,939	291,401	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARES MANAGEMENT CORP-A	—	71	724	108,814	金融サービス
ASSURANT INC	19	19	292	43,887	保険
AT&T INC	2,670	2,872	4,363	655,736	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	47	53	575	86,461	公益事業
AUTOZONE INC	7	7	1,758	264,324	一般消費財・サービス流通・小売り
AVERY DENNISON CORP	30	30	511	76,901	素材
AVANTOR INC	227	271	524	78,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EQUITABLE HOLDINGS INC	144	144	377	56,733	金融サービス
BALL CORP	117	125	568	85,396	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BANK OF AMERICA CORP	2,703	2,878	7,355	1,105,432	銀行
BAXTER INTERNATIONAL INC	187	194	625	93,948	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	286	306	1,281	192,525	金融サービス
BAKER HUGHES CO	371	406	1,381	207,645	エネルギー
TRUIST FINANCIAL CORP	497	532	1,488	223,621	銀行
BECTON DICKINSON AND CO	106	113	2,910	437,341	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	73	78	528	79,370	一般消費財・サービス流通・小売り
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	480	518	17,459	2,623,865	金融サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	8	9	275	41,412	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BILL HOLDINGS INC	36	39	361	54,264	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	56	60	3,667	551,121	金融サービス
BLACK KNIGHT INC	58	-	-	-	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC	262	284	2,615	393,096	金融サービス
BORGWARNER INC	91	91	347	52,259	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	532	577	2,884	433,531	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	209	229	4,081	613,298	資本財
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	50	50	605	90,980	商業・専門サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	793	835	4,730	710,831	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	44	44	747	112,402	商業・専門サービス
BROWN & BROWN INC	90	90	627	94,284	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	116	127	714	107,410	食品・飲料・タバコ
BUNGE LTD	55	58	597	89,784	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	25	25	310	46,651	一般消費財・サービス流通・小売り
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	-	52	556	83,644	資本財
CARMAX INC	59	59	360	54,114	一般消費財・サービス流通・小売り
CARDINAL HEALTH INC	103	103	963	144,843	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	198	205	5,039	757,393	資本財
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	146	154	1,373	206,372	金融サービス
CARNIVAL CORP	350	387	437	65,691	消費者サービス
COTERRA ENERGY INC	301	324	916	137,708	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	78	78	322	48,464	食品・飲料・タバコ
CARLISLE COS INC	19	22	533	80,187	資本財
CATALENT INC	65	65	257	38,634	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CABLE ONE INC	2	-	-	-	メディア・娯楽
CARRIER GLOBAL CORP	316	330	1,556	233,904	資本財
CBRE GROUP INC - A	120	125	825	124,123	不動産管理・開発
CENTENE CORP	218	223	1,536	230,955	ヘルスケア機器・サービス
CELANESE CORP	40	40	461	69,418	素材
CENTERPOINT ENERGY INC	222	239	658	98,924	公益事業
LUMEN TECHNOLOGIES INC	343	-	-	-	電気通信サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	52	52	344	51,703	商業・専門サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	78	78	632	95,049	素材
CHURCH & DWIGHT CO INC	90	103	950	142,915	家庭用品・パーソナル用品
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	10	10	1,961	294,787	消費者サービス
CHEVRON CORP	696	723	11,283	1,695,697	エネルギー
CHARLES RIVER LABORATORIES	19	19	329	49,568	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEWY INC - CLASS A	34	48	81	12,321	一般消費財・サービス流通・小売り
CITIGROUP INC	719	784	3,029	455,289	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	176	193	453	68,107	銀行
CIGNA GROUP/THE	118	117	3,573	537,062	ヘルスケア機器・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	191	211	334	50,314	素材
CLOROX COMPANY	46	52	642	96,523	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC-CLASS A	97	107	606	91,175	ソフトウェア・サービス
CLARIVATE PLC	108	142	92	13,898	商業・専門サービス
CMS ENERGY CORP	105	110	603	90,746	公益事業
COLGATE-PALMOLIVE CO	294	304	2,234	335,815	家庭用品・パーソナル用品
CONOCOPHILLIPS	482	481	5,794	870,850	エネルギー
CONAGRA BRANDS INC	180	206	572	86,074	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
COCA-COLA CO/THE	1,538	1,648	9,251	1,390,314	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	128	142	188,929	188,929	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	61	65	1,535	230,705	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	298	335	897	134,893	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	77	77	453	68,105	食品・飲料・タバコ
CORTEVA INC	272	281	1,370	205,884	素材
CROWN HOLDINGS INC	45	45	361	54,381	素材
CSX CORP	805	816	2,417	363,287	運輸
CUMMINS INC	51	55	1,209	181,814	資本財
CVS HEALTH CORP	489	516	3,539	531,906	ヘルスケア機器・サービス
DAVITA INC	21	21	165	24,899	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	45	48	690	103,707	消費者サービス
DANAHER CORP	257	280	5,399	811,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DARLING INGREDIENTS INC	—	58	238	35,867	食品・飲料・タバコ
DEVON ENERGY CORPORATION	235	252	1,208	181,642	エネルギー
DEERE & CO	108	110	4,126	620,106	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	101	110	731	109,884	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	55	57	179	26,929	運輸
APTIV PLC	101	110	990	148,810	自動車・自動車部品
DECKERS OUTDOOR CORP	—	9	487	73,257	耐久消費財・アパレル
DICK'S SPORTING GOODS INC	—	22	243	36,583	一般消費財・サービス流通・小売り
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	104	107	866	130,210	金融サービス
DOMINO'S PIZZA INC	13	13	481	72,303	消費者サービス
DOMINION ENERGY INC	302	333	1,351	203,064	公益事業
DOLLAR GENERAL CORP	84	87	1,042	156,648	生活必需品流通・小売り
DOVER CORP	53	53	695	104,584	資本財
DUPONT DE NEMOURS INC	191	191	1,372	206,299	素材
DOW INC	273	280	1,332	200,219	素材
DOORDASH INC - A	69	100	724	108,839	消費者サービス
DR HORTON INC	124	128	1,298	195,080	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	71	83	814	122,427	公益事業
DUKE ENERGY CORP	287	307	2,714	407,960	公益事業
DYNATRACE INC	75	98	439	65,989	ソフトウェア・サービス
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	48	48	332	49,949	素材
EATON CORP PLC	149	159	3,122	469,309	資本財
ECOLAB INC	95	102	1,618	243,218	素材
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	231	241	1,648	247,715	ヘルスケア機器・サービス
EDISON INTERNATIONAL	144	163	1,033	155,333	公益事業
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	165	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	220	224	1,997	300,227	資本財
ENTERGY CORP	75	79	737	110,820	公益事業
EOG RESOURCES INC	218	234	3,045	457,605	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	21	22	489	73,509	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	45	50	824	123,949	商業・専門サービス
EQT CORP	126	126	531	79,944	エネルギー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	85	92	1,237	186,025	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST GROUP LTD	14	14	582	87,573	保険
EVERGY INC	87	87	426	64,080	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,571	1,615	17,539	2,635,845	エネルギー
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	14	15	674	101,355	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	9	9	800	120,276	ソフトウェア・サービス
FEDEX CORP	92	94	2,222	333,961	運輸
FERGUSON PLC	—	84	1,284	193,032	資本財
FIRST REPUBLIC BANK/CA	67	—	—	—	銀行
FISERV INC	—	248	2,839	426,759	金融サービス
FIRSTENERGY CORP	202	232	833	125,187	公益事業
FIRST HORIZON CORP	—	198	205	30,915	銀行
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	226	241	1,182	177,641	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	26	28	664	99,930	金融サービス
FMC CORP	48	48	269	40,564	素材
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	95	110	413	62,174	保険
FORD MOTOR COMPANY	1,479	1,592	1,837	276,098	自動車・自動車部品
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	50	50	278	41,914	資本財
FORTIVE CORP	126	148	959	144,203	資本財
NEXTERA ENERGY INC	734	809	4,572	687,184	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC	103	117	261	39,323	金融サービス
FREEPORT-MCMORAN INC	535	563	1,906	286,505	素材
INGERSOLL-RAND INC	151	163	973	146,280	資本財
GENERAL MOTORS CORP	518	527	1,530	230,035	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	53	57	738	110,996	一般消費財・サービス流通・小売り
GENERAL ELECTRIC CO	407	433	4,817	724,043	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	88	93	2,277	342,312	資本財
GENERAL MILLS INC	225	230	1,513	227,497	食品・飲料・タバコ
GENERAC HOLDINGS INC	24	24	207	31,212	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	105	109	1,160	174,407	金融サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	127	133	3,970	596,619	金融サービス
GODADDY INC-CLASS A	60	60	438	65,933	ソフトウェア・サービス
WW GRAINGER INC	16	18	1,251	188,026	資本財
GRACO INC	—	63	440	66,189	資本財
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	123	123	890	133,770	保険
HALLIBURTON CO	338	376	1,518	228,210	エネルギー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	72	77	1,361	204,679	資本財
HCA HEALTHCARE INC	88	81	1,845	277,371	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	53	59	1,156	173,742	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	102	108	1,678	252,219	エネルギー
HP INC	393	344	897	134,937	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	482	501	758	114,000	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEICO CORP	18	18	288	43,402	資本財
HEICO CORP-CLASS A	24	31	400	60,217	資本財
HF SINCLAIR CORP	—	59	319	48,034	エネルギー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	104	106	1,605	241,272	消費者サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	254	267	4,766	716,348	資本財
HOME DEPOT INC	383	401	11,266	1,693,159	一般消費財・サービス流通・小売り
HORMEL FOODS CORP	115	115	369	55,510	食品・飲料・タバコ
HUBBELL INC	—	23	649	97,583	資本財
HUMANA INC	47	50	2,642	397,130	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	15	15	329	49,448	資本財
HUBSPOT INC	17	18	776	116,622	ソフトウェア・サービス
HYATT HOTELS CORP - CL A	—	16	170	25,590	消費者サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	336	363	4,981	748,659	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	28	28	538	80,934	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	114	121	2,751	413,448	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	96	106	705	106,040	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	150	150	418	62,818	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	206	227	2,427	364,735	金融サービス
INVESCO LTD	135	135	170	25,593	金融サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	127	136	452	68,039	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	86	90	1,671	251,260	資本財
JABIL INC	—	49	607	91,322	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACOBS SOLUTIONS INC	48	48	648	97,391	商業・専門サービス
JM SMUCKER CO/THE	41	41	469	70,548	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	982	965	14,626	2,198,093	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	1,095	1,168	16,409	2,466,087	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	119	134	336	50,603	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KEYCORP	346	361	354	53,232	銀行

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
KELLANOVA	93	110	565	84,991	食品・飲料・タバコ
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	67	71	862	129,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KENVUE INC	—	600	1,183	177,901	家庭用品・パーソナル用品
KIMBERLY-CLARK CORP	125	136	1,622	243,888	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	754	814	1,368	205,615	エネルギー
KKR & CO INC -A	210	247	1,359	204,369	金融サービス
KROGER CO	259	268	1,190	178,910	生活必需品流通・小売り
LAS VEGAS SANDS CORP	129	143	679	102,071	消費者サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	34	34	675	101,455	ヘルスケア機器・サービス
LAMB WESTON HOLDING INC	—	61	546	82,080	食品・飲料・タバコ
LENNAR CORP-CL A	94	100	1,034	155,513	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	13	469	70,621	資本財
LEAR CORP	22	22	296	44,628	自動車・自動車部品
ELI LILLY & CO	301	322	18,924	2,843,970	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	64	64	498	74,964	メディア・娯楽
LINCOLN NATIONAL CORP	64	—	—	—	保険
BATH & BODY WORKS INC	92	92	260	39,173	一般消費財・サービス流通・小売り
LINDE PLC	187	—	—	—	素材
LINDE PLC	—	195	7,138	1,072,729	素材
LOCKHEED MARTIN CORP	89	91	4,099	616,005	資本財
LOWE'S COS INC	239	234	4,371	656,967	一般消費財・サービス流通・小売り
LOEWS CORP	71	71	455	68,505	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	97	105	943	141,754	素材
M & T BANK CORP	67	69	771	116,001	銀行
MARATHON OIL CORP	266	283	798	119,930	エネルギー
MASTERCARD INC - A	324	338	13,082	1,966,021	金融サービス
MARSH & MCLENNAN COS	187	199	3,762	565,370	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	23	27	1,116	167,731	素材
MASCO CORP	84	98	476	71,533	資本財
MARKEL GROUP INC	5	5	774	116,415	保険
MARATHON PETROLEUM CORP	202	176	2,606	391,767	エネルギー
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	92	104	670	100,813	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	276	292	7,547	1,134,258	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	129	131	4,603	691,780	金融サービス
MCKESSON CORP	54	54	2,463	370,269	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	257	263	1,552	233,341	保険
MERCK & CO. INC.	942	1,011	10,486	1,575,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC	497	535	3,821	574,355	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8	8	867	130,440	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM RESORTS INTERNATIONAL	129	129	446	67,134	消費者サービス
MICRON TECHNOLOGY INC	417	441	2,936	441,288	半導体・半導体製造装置
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	66	75	436	65,617	食品・飲料・タバコ
MOHAWK INDUSTRIES INC	18	18	146	22,072	耐久消費財・アパレル
MOSAIC CO/THE	135	135	453	68,081	素材
MORGAN STANLEY	490	504	3,598	540,823	金融サービス
MOODY'S CORP	61	65	2,043	307,069	金融サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	62	66	1,854	278,644	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOLINA HEALTHCARE INC	21	26	893	134,241	ヘルスケア機器・サービス
MSCI INC	30	31	1,522	228,850	金融サービス
NEWMONT CORP	295	458	1,686	253,410	素材
NEWELL BRANDS INC	146	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NIKE INC -CL B	474	492	5,097	765,987	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	156	156	395	59,373	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	55	57	2,795	420,059	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	88	89	1,656	248,911	運輸
EVERSOURCE ENERGY	126	143	775	116,600	公益事業
NRG ENERGY INC	87	87	366	55,067	公益事業
NUCOR CORP	99	99	1,440	216,413	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	351	283	1,793	269,567	エネルギー
OMNICOM GROUP	78	74	556	83,587	メディア・娯楽
ONEOK INC	168	224	1,487	223,481	エネルギー
ORACLE CORP	598	651	6,606	992,815	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	156	171	1,292	194,214	資本財
OVINTIV INC	—	94	458	68,837	エネルギー
OWENS CORNING	—	35	392	59,004	資本財
P G & E CORP	558	732	1,184	178,048	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	47	52	1,934	290,790	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	35	532	80,097	素材
PAYCOM SOFTWARE INC	19	19	482	72,512	商業・専門サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	610	728	1,134	170,560	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	516	552	8,963	1,347,035	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	59	69	396	59,654	資本財
REVVITY INC	47	49	489	73,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	2,091	2,260	6,947	1,044,061	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	579	623	5,614	843,820	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	178	188	2,088	313,785	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	85	91	2,238	336,373	エネルギー
PINTEREST INC- CLASS A	209	221	564	84,889	メディア・娯楽
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	154	162	1,802	270,939	銀行
PPL CORP	269	303	739	111,153	公益事業
PPG INDUSTRIES INC	87	93	1,141	171,496	素材
PROCTER & GAMBLE CO	895	944	14,217	2,136,680	家庭用品・パーソナル用品
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	95	95	636	95,682	保険
PROGRESSIVE CORP	218	233	3,651	548,683	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	139	149	1,336	200,812	保険
PULTE GROUP INC	88	88	628	94,455	耐久消費財・アパレル
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	187	198	1,205	181,089	公益事業
QUANTA SERVICES INC	53	57	960	144,357	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	43	43	550	82,700	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	70	74	1,347	202,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	70	84	777	116,887	金融サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	351	358	503	75,736	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	81	89	1,316	197,830	商業・専門サービス
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	—	22	546	82,089	素材
RESMED INC	53	58	819	123,096	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	29	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	43	46	1,216	182,742	資本財
ROBERT HALF INC	39	44	324	48,806	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	39	42	2,021	303,728	ソフトウェア・サービス
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	87	93	769	115,627	消費者サービス
WESTROCK CO	99	99	345	51,984	素材
ROLLINS INC	82	82	283	42,640	商業・専門サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	126	191	594	89,408	メディア・娯楽
RPM INTERNATIONAL INC	49	49	445	66,980	素材
SALESFORCE INC	370	390	7,690	1,155,722	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	49	49	452	68,068	商業・専門サービス
SCHLUMBERGER LTD	523	569	3,222	484,332	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	539	605	2,989	449,188	金融サービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	56	64	221	33,227	資本財
SEALED AIR CORP	57	57	177	26,604	素材
SEMPRA	117	248	1,744	262,194	公益事業
SERVICENOW INC	74	81	4,307	647,350	ソフトウェア・サービス
SEA LTD-ADR	133	144	636	95,615	メディア・娯楽
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	91	96	2,296	345,172	素材
SMITH (A. O.) CORP	50	50	327	49,179	資本財
SNAP-ON INC	19	19	494	74,260	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SNAP INC - A	404	453	416	62,562	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	83	104	1,493	224,484	ソフトウェア・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	54	54	129	19,399	運輸
SOUTHERN CO	394	434	2,896	435,291	公益事業
BLOCK INC	194	214	894	134,484	金融サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	58	58	448	67,402	資本財
STRYKER CORP	127	136	3,547	533,089	ヘルスケア機器・サービス
STATE STREET CORP	137	129	828	124,562	金融サービス
STERIS PLC	37	42	903	135,720	ヘルスケア機器・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	56	61	303	45,628	運輸
SYSCO CORP	192	199	1,314	197,548	生活必需品流通・小売り
SYNCHRONY FINANCIAL	190	190	526	79,133	金融サービス
TARGET CORP	173	179	1,984	298,196	生活必需品流通・小売り
TARGA RESOURCES CORP	81	81	698	104,919	エネルギー
TEXTRON INC	79	79	591	88,906	資本財
TERADYNE INC	61	61	544	81,776	半導体・半導体製造装置
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	435	435	357	53,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELADOC HEALTH INC	66	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	17	20	754	113,314	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	17	18	337	50,700	ヘルスケア機器・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2	2	455	68,446	エネルギー
THE WALT DISNEY CO.	677	734	5,917	889,218	メディア・娯楽
COOPER COS INC/THE	17	20	638	95,926	ヘルスケア機器・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	145	154	6,677	1,003,425	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TJX COMPANIES INC	436	458	4,078	612,975	一般消費財・サービス流通・小売り
GLOBE LIFE INC	35	35	401	60,373	保険
TORO CO	—	38	312	46,971	資本財
TOAST INC-CLASS A	—	127	211	31,755	金融サービス
TRAVELERS COS INC/THE	88	88	1,464	220,052	保険
TRANSDIGM GROUP INC	19	21	1,783	268,077	資本財
TRANSUNION	72	79	367	55,162	商業・専門サービス
TWITTER INC	240	—	—	—	メディア・娯楽
TWILIO INC - A	64	72	369	55,602	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	15	18	670	100,830	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	109	109	494	74,359	食品・飲料・タバコ
TE CONNECTIVITY LTD	119	129	1,513	227,472	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	258	274	1,321	198,667	資本財
UBER TECHNOLOGIES INC	543	725	3,072	461,734	運輸
UGI CORP	77	—	—	—	公益事業
UIPATH INC - CLASS A	—	179	272	40,886	ソフトウェア・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	274	291	4,282	643,584	運輸
RTX CORP	555	587	4,607	692,348	資本財
UNION PACIFIC CORP	234	244	5,012	753,309	運輸
UNITEDHEALTH GROUP INC	350	371	19,715	2,962,899	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	24	19	234	35,262	ヘルスケア機器・サービス
UNITED RENTALS INC	26	28	1,119	168,255	資本財
UNITY SOFTWARE INC	67	96	247	37,255	ソフトウェア・サービス
US BANCORP	526	597	1,870	281,105	銀行
VF CORP	121	121	218	32,828	耐久消費財・アパレル
VALERO ENERGY CORP	152	146	1,862	279,905	エネルギー
VAIL RESORTS INC	15	15	318	47,925	消費者サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,566	1,681	5,665	851,468	電気通信サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	52	57	1,127	169,482	ヘルスケア機器・サービス
VERALTO CORP	—	93	661	99,393	商業・専門サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	614	647	15,338	2,305,126	金融サービス
VISTRA CORP	147	147	482	72,513	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	76	95	1,410	212,043	ソフトウェア・サービス
VULCAN MATERIALS CO	49	55	1,131	170,018	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WALMART INC	565	591	9,629	1,447,077	生活必需品流通・小売り
WATERS CORP	22	23	564	84,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WASTE MANAGEMENT INC	155	165	2,709	407,176	商業・専門サービス
WABTEC CORP	64	71	741	111,499	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	95	106	1,457	219,013	商業・専門サービス
WAYFAIR INC- CLASS A	28	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
WATSCO INC	—	12	422	63,453	資本財
WESTLAKE CORP	13	13	153	23,133	素材
WESTERN UNION CO	145	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WELLS FARGO & CO	1,412	1,482	5,786	869,608	銀行
ELEVANCE HEALTH INC	90	94	4,246	638,218	ヘルスケア機器・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	27	29	1,059	159,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEBSTER FINANCIAL CORP	63	63	235	35,381	銀行
WHIRLPOOL CORP	20	20	261	39,244	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	449	473	1,630	245,074	エネルギー
WEC ENERGY GROUP INC	117	122	1,005	151,174	公益事業
WORKDAY INC-CLASS A	73	79	1,655	248,804	ソフトウェア・サービス
WOLFSPEED INC	—	50	155	23,345	半導体・半導体製造装置
WR BERKLEY CORP	80	80	542	81,539	保険
XCEL ENERGY INC	203	221	1,318	198,172	公益事業
XYLEM INC	66	94	830	124,869	資本財
YUM! BRANDS INC	105	113	1,370	206,005	消費者サービス
ZENDESK INC	47	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	76	84	871	131,017	ヘルスケア機器・サービス
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	29	—	—	—	運輸
ZOETIS INC	175	185	3,031	455,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHENIERE ENERGY INC	86	95	1,595	239,775	エネルギー
NVR INC	1	1	795	119,598	耐久消費財・アパレル
ABIOMED INC	16	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	289	—	—	—	メディア・娯楽
ADOBE INC	176	181	9,481	1,424,898	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	601	643	6,176	928,237	半導体・半導体製造装置
AFFIRM HOLDINGS INC	66	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ATRBNB INC-CLASS A	140	163	1,936	290,985	消費者サービス
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	60	60	618	92,974	ソフトウェア・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	45	50	803	120,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	28	30	776	116,661	ヘルスケア機器・サービス
AMAZON.COM INC	3,415	3,697	44,883	6,745,160	一般消費財・サービス流通・小売り
AMGEN INC	199	212	5,778	868,352	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERCO	3	—	—	—	運輸
ANALOG DEVICES INC	194	200	3,211	482,594	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	32	35	951	143,014	ソフトウェア・サービス
APA CORP	127	127	523	78,597	エネルギー
APPLE INC	6,037	6,297	107,757	16,193,835	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	323	337	4,389	659,579	半導体・半導体製造装置
APPLOVIN CORP-CLASS A	39	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	140	145	1,213	182,368	保険
ASPEN TECHNOLOGY INC	—	13	229	34,554	ソフトウェア・サービス
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	—	60	1,075	161,567	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	157	165	3,607	542,064	商業・専門サービス
AUTODESK INC	81	87	1,745	262,363	ソフトウェア・サービス
AXON ENTERPRISE INC	—	25	527	79,346	資本財
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	75	75	368	55,335	ソフトウェア・サービス
BIOGEN INC	55	56	1,392	209,225	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	71	83	685	102,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	150	165	14,044	2,110,590	半導体・半導体製造装置
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	49	49	407	61,293	運輸
CADENCE DESIGN SYS INC	102	105	2,441	366,981	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CARLYLE GROUP INC/THE	76	76	210	31,684	金融サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	79	79	307	46,160	消費者サービス
PARAMOUNT GLOBAL	228	228	249	37,522	メディア・娯楽
CDW CORP/DE	50	58	1,171	176,028	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECH	38	38	513	77,097	ソフトウェア・サービス
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	37	324	48,831	エネルギー
CHARTER COMMUNICATION-A	43	39	1,663	250,000	メディア・娯楽
CINTAS CORP	34	35	1,801	270,717	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,548	1,624	8,514	1,279,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	56	58	578	86,941	保険
CME GROUP INC	134	145	3,106	466,814	金融サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,663	1,665	7,121	1,070,213	メディア・娯楽
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	192	203	1,302	195,691	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION ENERGY	122	131	1,475	221,694	公益事業
COSTCO WHOLESALE CORP	165	176	9,715	1,459,973	生活必需品流通・小売り
COPART INC	78	351	1,533	230,403	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	149	168	1,191	179,026	不動産管理・開発
COGNEX CORP	64	64	226	34,073	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COUPA SOFTWARE INC	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	42	69	536	80,662	金融サービス
CONFLUENT INC-CLASS A	—	68	182	27,483	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	74	89	1,576	236,941	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	16	16	261	39,346	ソフトウェア・サービス
DATADOG INC-CLASS A	82	99	808	121,509	ソフトウェア・サービス
DEXCOM INC	146	155	1,307	196,479	ヘルスケア機器・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	82	82	261	39,304	ヘルスケア機器・サービス
DISH NETWORK CORP-A	92	—	—	—	メディア・娯楽
DIAMONDBACK ENERGY INC	63	65	1,077	161,852	エネルギー
DOLLAR TREE INC	84	89	973	146,250	生活必需品流通・小売り
DOCUSIGN INC	74	83	327	49,250	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	291	397	1,155	173,613	食品・飲料・タバコ
DROPBOX INC-CLASS A	116	116	306	46,102	ソフトウェア・サービス
EBAY INC	207	218	860	129,323	一般消費財・サービス流通・小売り
PAYPAL HOLDINGS INC	407	422	2,176	327,058	金融サービス
ELECTRONIC ARTS INC	104	108	1,362	204,688	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	50	54	513	77,133	半導体・半導体製造装置
ENTEGRIS INC	50	56	490	73,720	半導体・半導体製造装置
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9	9	276	41,579	保険
ETSY INC	48	48	302	45,415	一般消費財・サービス流通・小売り
EXPEDIA GROUP INC	56	60	578	86,995	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	61	64	704	105,816	運輸
EXELON CORP	367	397	1,548	232,713	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	65	73	455	68,458	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
F5 INC	23	23	361	54,364	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
META PLATFORMS INC-CLASS A	855	885	26,526	3,986,383	メディア・娯楽
FASTENAL CO	216	227	1,301	195,543	資本財
FISERV INC	229	—	—	—	金融サービス
FIRST SOLAR INC	—	42	644	96,899	半導体・半導体製造装置
FIFTH THIRD BANCORP	255	264	609	91,573	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	4	4	585	88,026	銀行
FORTINET INC	255	269	1,508	226,685	ソフトウェア・サービス
FOX CORP- CLASS B	54	54	152	22,860	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS A	114	130	395	59,479	メディア・娯楽
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	25	25	140	21,061	金融サービス
GARMIN LTD	58	58	596	89,672	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	30	30	1,011	152,017	ソフトウェア・サービス
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	—	167	1,077	161,947	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	467	499	3,915	588,480	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GLOBAL-E ONLINE LTD	—	30	102	15,391	一般消費財・サービス流通・小売り
ALPHABET INC-CL A	2,244	2,380	29,897	4,493,025	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	2,103	2,115	26,797	4,027,058	メディア・娯楽
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	381	770	246	37,028	運輸
HASBRO INC	47	51	284	42,685	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	52	52	357	53,774	ヘルスケア機器・サービス
HOLOGIC INC	92	98	656	98,694	ヘルスケア機器・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	79	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	31	31	533	80,238	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	537	537	508	76,451	銀行
IAC INC	30	—	—	—	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	31	33	1,386	208,378	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	59	62	714	107,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	100	112	5,429	815,981	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	1,524	1,674	5,496	826,057	半導体・半導体製造装置
INTUITIVE SURGICAL INC	133	140	3,741	562,328	ヘルスケア機器・サービス
INCYTE CORP	71	76	416	62,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSULET CORP	26	27	383	57,604	ヘルスケア機器・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	24	24	318	47,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	26	32	454	68,267	金融サービス
KLA CORP	55	54	2,496	375,191	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	519	542	3,561	535,262	食品・飲料・タバコ
KRAFT HEINZ CO/THE	271	329	1,055	158,663	食品・飲料・タバコ
LAM RESEARCH CORP	51	54	3,151	473,562	半導体・半導体製造装置
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	—	51	354	53,278	半導体・半導体製造装置
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	111	103	173	26,033	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	54	—	—	—	電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND-C	48	48	423	63,578	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	33	—	—	—	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW C	57	57	140	21,039	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	71	77	508	76,370	メディア・娯楽
LKQ CORP	102	102	481	72,344	一般消費財・サービス流通・小売り
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	30	31	688	103,487	金融サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	43	47	1,868	280,791	耐久消費財・アパレル
LCUID GROUP INC	165	363	151	22,785	自動車・自動車部品
LYFT INC-A	105	—	—	—	運輸
MASIMO CORP	20	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	104	106	2,011	302,230	消費者サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	14	15	330	49,705	金融サービス
MATCH GROUP INC	98	109	381	57,296	メディア・娯楽
MARVELL TECHNOLOGY INC	320	336	1,598	240,199	半導体・半導体製造装置
MANHATTAN ASSOCIATES INC	—	23	453	68,180	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	234	219	3,093	464,843	電気通信サービス
MERCADOLIBRE INC	16	17	2,131	320,375	一般消費財・サービス流通・小売り
MICROSOFT CORP	2,650	2,828	96,346	14,478,913	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	207	220	1,572	236,294	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	148	318	1,596	239,929	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	25	28	928	139,566	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	125	128	988	148,519	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	17	18	727	109,329	半導体・半導体製造装置
MONDAY.COM LTD	—	9	126	18,948	ソフトウェア・サービス
NASDAQ INC	129	117	580	87,203	金融サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	36	36	392	59,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	822	82	597	89,817	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	165	178	7,320	1,100,087	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS A	147	147	303	45,551	メディア・娯楽
DRAFTKINGS INC-CL A	—	158	432	64,940	消費者サービス
NORTHERN TRUST CORP	73	76	484	72,875	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NORDSON CORP	18	23	494	74,255	資本財
NOVOCURE LTD	34	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NVIDIA CORP	933	988	41,311	6,208,228	半導体・半導体製造装置
XPX SEMICONDUCTORS NV	98	104	1,838	276,221	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24	24	2,117	318,188	一般消費財・サービス流通・小売り
OKTA INC	56	63	427	64,236	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	36	39	1,467	220,512	運輸
ON SEMICONDUCTOR CORP	161	173	1,407	211,491	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	129	207	1,750	263,031	資本財
PAYCHEX INC	120	130	1,466	220,392	商業・専門サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	110	122	2,987	448,985	ソフトウェア・サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	17	307	46,170	商業・専門サービス
PLUG POWER INC	192	—	—	—	資本財
POOL CORP	15	15	491	73,842	一般消費財・サービス流通・小売り
BOOKING HOLDINGS INC	15	14	4,213	633,242	消費者サービス
PTC INC	41	41	573	86,253	ソフトウェア・サービス
QORVO INC	38	42	365	54,925	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	418	448	4,694	705,467	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	40	43	3,435	516,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REPLIGEN CORP	—	22	279	42,070	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	107	272	463	69,596	自動車・自動車部品
ROSS STORES INC	131	137	1,590	238,954	一般消費財・サービス流通・小売り
ROKU INC	47	47	274	41,319	メディア・娯楽
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	130	143	391	58,790	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROBINHOOD MARKETS INC - A	—	178	160	24,168	金融サービス
SEI INVESTMENTS COMPANY	41	43	238	35,766	金融サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	53	56	1,217	182,968	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	77	77	522	78,593	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIGNATURE BANK	302	302	132	19,840	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	23	—	—	—	銀行
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	59	64	570	85,718	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	20	23	187	28,132	半導体・半導体製造装置
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	61	61	902	135,648	ソフトウェア・サービス
STEEL DYNAMICS INC	84	84	418	62,828	商業・専門サービス
STARBUCKS CORP	71	60	600	90,173	素材
SUPER MICRO COMPUTER INC	428	461	4,335	651,562	消費者サービス
SVB FINANCIAL GROUP	—	17	454	68,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEN DIGITAL INC	21	—	—	—	銀行
SYNOPSYS INC	222	243	402	60,415	ソフトウェア・サービス
T ROWE PRICE GROUP INC	57	60	2,768	416,108	ソフトウェア・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	81	86	810	121,854	金融サービス
TESLA INC	59	72	992	149,135	メディア・娯楽
TEXAS INSTRUMENTS INC	985	1,142	24,276	3,648,260	自動車・自動車部品
BIO-TECHNE CORP	344	364	5,171	777,152	半導体・半導体製造装置
TRIMBLE INC	14	67	412	61,977	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	95	95	449	67,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	42	45	897	134,839	一般消費財・サービス流通・小売り
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	42	42	350	52,633	金融サービス
ULTA BEAUTY INC	165	175	1,254	188,484	メディア・娯楽
UNITED THERAPEUTICS CORP	19	21	793	119,285	一般消費財・サービス流通・小売り
VERISIGN INC	—	19	426	64,101	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	36	36	761	114,494	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	95	103	3,750	563,580	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIATRIS INC	58	58	1,325	199,186	商業・専門サービス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	458	458	410	61,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WARNER BROS DISCOVERY INC	270	307	667	100,243	生活必需品流通・小売り
WESTERN DIGITAL CORP	867	948	923	138,750	メディア・娯楽
	118	116	492	74,088	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	当 期		額	
			株数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
WIX.COM LTD	22	22	186	28,014	ソフトウェア・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	41	41	872	131,058	保険	
WYNN RESORTS LTD	41	41	371	55,869	消費者サービス	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	19	20	412	62,026	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZILLOW GROUP INC - C	63	63	243	36,558	不動産管理・開発	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	85	96	581	87,338	ソフトウェア・サービス	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	98	98	154	23,246	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	31	36	572	85,978	ソフトウェア・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	405	405	125	18,867	不動産管理・開発	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	57	65	264	39,740	資本財	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	39	39	639	96,169	金融サービス	
小 計	株数・金額	127,008	136,710	1,449,589	217,844,291	
	銘柄数<比率>	598	604		<72.4%>	
(カナダ)			千カナダドル			
AGNICO EAGLE MINES LTD	168	214	1,448	157,606	素材	
AIR CANADA	71	71	116	12,660	運輸	
ALTAGAS LTD	111	111	281	30,633	公益事業	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	270	270	187	20,452	公益事業	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	310	308	2,277	247,890	生活必需品流通・小売り	
ARC RESOURCES LTD	255	255	564	61,410	エネルギー	
BARRICK GOLD CORP	667	696	1,592	173,290	素材	
BANK OF MONTREAL	252	276	2,894	315,051	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	444	475	2,660	289,570	銀行	
BCE INC	30	30	153	16,722	電気通信サービス	
BROOKFIELD CORP	528	572	2,351	255,953	金融サービス	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	54	54	179	19,566	公益事業	
BRP INC/CA- SUB VOTING	-	15	147	16,091	耐久消費財・アパレル	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	-	138	569	62,005	金融サービス	
CAE INC	123	123	351	38,206	資本財	
CAMECO CORP	149	163	885	96,382	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	337	377	1,818	197,928	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	427	440	3,906	425,167	エネルギー	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	218	224	3,288	357,913	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	19	22	306	33,360	一般消費財・サービス流通・小売り	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	45	45	131	14,307	公益事業	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	57	57	316	34,467	素材	
CENOVUS ENERGY INC	498	572	1,563	170,169	エネルギー	
CGI INC	80	80	1,060	115,434	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	8	2,252	245,178	ソフトウェア・サービス	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	348	375	3,612	393,138	運輸	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	-	37	367	40,018	ソフトウェア・サービス	
DOLLARAMA INC	103	129	1,247	135,800	一般消費財・サービス流通・小売り	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	-	138	260	28,339	金融サービス	
EMPIRE CO LTD 'A'	69	69	264	28,757	生活必需品流通・小売り	
EMERA INC	104	104	478	52,091	公益事業	
ENBRIDGE INC	759	810	3,608	392,673	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9	9	1,010	109,987	保険	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	226	226	650	70,794	素材	
FIRSTSERVICE CORP	15	15	285	31,036	不動産管理・開発	
FORTIS INC	171	190	1,038	112,978	公益事業	
FRANCO-NEVADA CORP	71	81	1,540	167,687	素材	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	74	74	300	32,749	商業・専門サービス	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	70	70	275	29,972	耐久消費財・アパレル	
GREAT-WEST LIFE CO INC	89	113	426	46,461	保険	
HYDRO ONE LTD	132	132	463	50,494	公益事業	
IA FINANCIAL CORP INC	40	40	323	35,159	保険	
IGM FINANCIAL INC	33	33	102	11,142	金融サービス	
IMPERIAL OIL LTD	89	89	721	78,503	エネルギー	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			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		
INTACT FINANCIAL CORP	65	72	1,399	152,299	保険	
IVANHOE MINES LTD-CL A	245	245	251	27,421	素材	
KEYERA CORP	84	84	273	29,747	エネルギー	
KINROSS GOLD CORP	460	460	337	36,765	素材	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	43	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
LOBLAW COMPANIES LTD	55	63	707	76,948	生活必需品流通・小売り	
LUNDIN MINING CORP	250	250	215	23,489	素材	
MANULIFE FINANCIAL CORP	719	719	1,717	186,912	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	106	106	734	79,946	自動車・自動車部品	
METRO INC	87	95	672	73,134	生活必需品流通・小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	126	137	1,172	127,554	銀行	
NORTHLAND POWER INC	86	86	179	19,523	公益事業	
NUTRIEN LTD	204	209	1,616	175,958	素材	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	22	22	43	4,728	金融サービス	
ONEX CORPORATION	27	27	210	22,869	金融サービス	
OPEN TEXT CORP	96	111	511	55,617	ソフトウェア・サービス	
PAN AMERICAN SILVER CORP	76	128	266	28,956	素材	
PARKLAND CORP	61	61	254	27,725	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	204	235	994	108,242	エネルギー	
POWER CORP OF CANADA	204	204	667	72,612	保険	
QUEBECOR INC -CL B	61	61	168	18,326	電気通信サービス	
BLACKBERRY LTD	222	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	109	109	1,020	111,109	消費者サービス	
RB GLOBAL INC	40	75	655	71,349	商業・専門サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	138	138	721	78,520	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	527	549	5,993	652,251	銀行	
SAPUTO INC	96	96	259	28,236	食品・飲料・タバコ	
SHOPIFY INC - CLASS-A	423	477	3,196	347,873	ソフトウェア・サービス	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	174	—	—	—	メディア・娯楽	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	168	191	1,148	125,018	素材	
STANTEC INC	—	41	343	37,423	資本財	
SUN LIFE FINANCIAL INC	215	247	1,554	169,156	保険	
SUNCOR ENERGY INC	534	534	2,449	266,611	エネルギー	
TELUS CORP	126	126	282	30,701	電気通信サービス	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	179	179	871	94,876	素材	
TFI INTERNATIONAL INC	32	32	481	52,401	運輸	
THOMSON REUTERS CORP	65	63	1,059	115,306	商業・専門サービス	
TMX GROUP LTD	21	108	317	34,585	金融サービス	
TOURMALINE OIL CORP	112	120	862	93,897	エネルギー	
TORONTO-DOMINION BANK	680	731	5,629	612,604	銀行	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	32	32	338	36,809	資本財	
TC ENERGY CORP	366	416	1,974	214,874	エネルギー	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	24	24	218	23,778	素材	
WESTON (GEORGE) LTD	28	28	411	44,833	生活必需品流通・小売り	
WSP GLOBAL INC	45	45	823	89,575	資本財	
小 計	株数・金額	15,196	16,104	91,296	9,935,782	
	銘柄数<比率>	84	86	—	<3.3%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG	64	65	1,126	178,843	耐久消費財・アパレル	
ALLIANZ SE-REG	151	162	3,573	567,145	保険	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	123	133	1,220	193,674	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	22	22	186	29,671	自動車・自動車部品	
BASF SE	334	370	1,503	238,600	素材	
BAYER AG-REG	367	390	1,602	254,394	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEIERSDORF AG	38	43	544	86,337	家庭用品・パーソナル用品	
BECHTLE AG	30	30	126	20,024	ソフトウェア・サービス	
BRENNTAG SE	56	68	468	74,324	資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	16	16	121	19,260	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
COMMERZBANK AG	404	404	407	64,649	銀行	
CONTINENTAL AG	43	43	261	41,531	自動車・自動車部品	
COVESTRO AG	74	74	361	57,328	素材	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	299	342	2,099	333,161	自動車・自動車部品	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	167	181	544	86,468	資本財	
DEUTSCHE BOERSE AG	70	76	1,184	187,913	金融サービス	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	757	809	831	132,014	金融サービス	
DEUTSCHE POST AG-REG	367	398	1,464	232,446	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,199	1,287	2,637	418,646	電気通信サービス	
VONOVIA SE	271	271	548	87,022	不動産管理・開発	
DELIVERY HERO SE	66	66	155	24,734	消費者サービス	
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	35	43	378	60,140	自動車・自動車部品	
E.ON SE	826	909	1,010	160,301	公益事業	
EVONIK INDUSTRIES AG	82	82	131	20,858	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	76	76	242	38,420	ヘルスケア機器・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	156	156	392	62,220	ヘルスケア機器・サービス	
GEA GROUP AG	60	60	193	30,734	資本財	
HANNOVER RUECK SE-REG	22	22	480	76,324	保険	
HEIDELBERG MATERIALS AG	57	57	387	61,528	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	67	67	461	73,285	家庭用品・パーソナル用品	
HENKEL AG & CO KGAA	34	45	268	42,680	家庭用品・パーソナル用品	
HELLOFRESH SE	60	60	147	23,446	生活必需品流通・小売り	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	475	517	1,489	236,353	半導体・半導体製造装置	
KION GROUP AG	28	—	—	—	資本財	
KNORR-BREMSE AG	29	29	159	25,367	資本財	
LEG IMMOBILIEN SE	24	30	165	26,205	不動産管理・開発	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	238	238	161	25,607	運輸	
MERCK KGAA	48	51	744	118,182	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MTU AERO ENGINES AG	20	20	360	57,190	資本財	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	51	56	2,151	341,513	保険	
NEMETSCHEK SE	23	23	160	25,546	ソフトウェア・サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	56	56	244	38,863	自動車・自動車部品	
PUMA SE	42	42	230	36,606	耐久消費財・アパレル	
QIAGEN N.V.	83	103	363	57,743	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RATIONAL AG	2	2	125	19,856	資本財	
RHEINMETALL AG	17	17	461	73,222	資本財	
RWE AG	236	258	912	144,771	公益事業	
SAP SE	388	419	5,245	832,421	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	9	12	276	43,822	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCOUT24 SE	29	29	173	27,497	メディア・娯楽	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	106	106	508	80,764	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS AG-REG	284	305	3,881	616,062	資本財	
SIEMENS ENERGY AG	158	213	227	36,072	資本財	
SYMRISE AG	49	57	544	86,484	素材	
TALANX AG	—	25	151	24,082	保険	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	464	464	73	11,663	電気通信サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	40	—	—	—	電気通信サービス	
VOLKSWAGEN AG	11	11	126	20,111	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG-PFD	67	80	813	129,143	自動車・自動車部品	
ZALANDO SE	82	82	180	28,576	一般消費財・サービス流通・小売り	
小 計	株 数	金 額	9,478	10,100	45,002	7,141,870
	銘柄 数 < 比率 >		59	58	—	< 2.4% >
(ユーロ…イタリア)						
AMPLIFON SPA	48	48	131	20,918	ヘルスケア機器・サービス	
ATLANTIA SPA	187	—	—	—	運輸	
DIASORIN ITALIA SPA	9	9	76	12,217	ヘルスケア機器・サービス	
ENEL SPA	3,009	3,097	1,781	282,741	公益事業	
ENI SPA	924	894	1,379	218,961	エネルギー	

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…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円			
FINCOBANK SPA	235	235	257	40,869	銀行		
ASSICURAZIONI GENERALI	422	422	776	123,233	保険		
INTESA SANPAOLO	6,137	6,580	1,550	246,059	銀行		
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	151	151	155	24,664	電気通信サービス		
MEDIOBANCA SPA	205	195	214	34,107	銀行		
MONCLER SPA	80	80	430	68,320	耐久消費財・アパレル		
NEXI SPA	212	212	115	18,397	金融サービス		
POSTE ITALIANE SPA	195	195	177	28,247	保険		
PRYSMIAN SPA	95	95	323	51,367	資本財		
RECORDATI SPA	37	37	163	25,958	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SNAM SPA	724	911	400	63,511	公益事業		
TELECOM ITALIA SPA	4,005	4,005	95	15,191	電気通信サービス		
TERNA SPA	536	536	389	61,872	公益事業		
UNICREDIT SPA	793	732	1,647	261,520	銀行		
小 計	株 数	金 額	18,012	18,442	10,070	1,598,160	
	銘柄 数 < 比率 >		19	18	—	< 0.5% >	
(ユーロ…フランス)							
ACCOR SA	60	60	182	28,919	消費者サービス		
ADP	10	10	112	17,869	運輸		
AIR LIQUIDE SA	195	208	3,274	519,606	素材		
ALSTOM	116	116	138	22,009	資本財		
AMUNDI SA	21	21	106	16,912	金融サービス		
ARKEMA	22	22	185	29,387	素材		
AXA SA	695	757	2,089	331,682	保険		
BIOMERIEUX	16	16	148	23,516	ヘルスケア機器・サービス		
BNP PARIBAS	411	442	2,485	394,451	銀行		
BOLLORE SE	335	335	172	27,377	メディア・娯楽		
BOUYGUES SA	84	84	264	41,983	資本財		
BUREAU VERITAS SA	109	109	247	39,200	商業・専門サービス		
CAP GEMINI SA	61	65	1,074	170,493	ソフトウェア・サービス		
CARREFOUR SA	226	226	353	56,086	生活必需品流通・小売り		
CREDIT AGRICOLE SA	440	496	559	88,759	銀行		
DANONE	236	257	1,415	224,610	食品・飲料・タバコ		
DASSAULT SYSTEMES SE	246	274	1,034	164,238	ソフトウェア・サービス		
DASSAULT AVIATION SA	9	9	170	27,109	資本財		
EDENRED	96	96	490	77,818	金融サービス		
EIFFAGE	32	32	268	42,654	資本財		
EDF	213	—	—	—	公益事業		
ESSILORLUXOTTICA	107	115	1,939	307,800	ヘルスケア機器・サービス		
EURAZEO SE	14	14	76	12,094	金融サービス		
ORANGE S. A.	743	728	791	125,684	電気通信サービス		
ENGIE	683	718	1,067	169,430	公益事業		
GETLINK	173	173	251	39,901	運輸		
HERMES INTERNATIONAL	11	12	2,259	358,595	耐久消費財・アパレル		
IPSEN	13	16	191	30,368	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	103	110	7,527	1,194,557	耐久消費財・アパレル		
L'OREAL	90	96	3,852	611,420	家庭用品・パーソナル用品		
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	39	39	118	18,827	消費者サービス		
LEGRAND SA	100	111	901	143,082	資本財		
MICHELIN (CGDE)	252	247	673	106,960	自動車・自動車部品		
PERNOD-RICARD SA	77	82	1,407	223,422	食品・飲料・タバコ		
KERING	27	30	1,182	187,687	耐久消費財・アパレル		
PUBLICIS GROUPE	86	93	677	107,444	メディア・娯楽		
RENAULT SA	68	82	268	42,594	自動車・自動車部品		
REMY COINTREAU	8	8	100	15,894	食品・飲料・タバコ		
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	10	10	179	28,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SAFRAN SA	127	130	1,942	308,214	資本財		
SANOFI	421	456	4,615	732,432	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株数	価 値			
		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		
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	184	191	953	151,318	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	200	219	3,068	486,904	資本財	
SEB SA	9	9	85	13,580	耐久消費財・アパレル	
SODEXO	32	32	315	50,030	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	298	309	646	102,544	銀行	
TELEPERFORMANCE	22	22	243	38,641	商業・専門サービス	
THALES SA	40	40	570	90,511	資本財	
TOTALENERGIES SE	926	904	5,623	892,518	エネルギー	
UBISOFT ENTERTAINMENT	35	—	—	—	メディア・娯楽	
VALEO SA	74	74	91	14,466	自動車・自動車部品	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	247	255	648	102,951	公益事業	
VINCI SA	198	206	2,075	329,406	資本財	
VIVENDI SE	260	260	219	34,811	メディア・娯楽	
WENDEL	10	10	71	11,331	金融サービス	
WORLDDLINE SA	89	89	84	13,374	金融サービス	
小 計	株数	金額				
	銘柄数 < 比率 >					
	56	9,433	9,546	59,495	9,441,945	
(ユーロ…オランダ)						
ABN AMRO BANK NV-CVA	151	151	192	30,562	銀行	
ADYEN NV	8	8	558	88,707	金融サービス	
AEGON LTD	696	—	—	—	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	384	400	1,114	176,915	生活必需品流通・小売り	
AKZO NOBEL	69	69	426	67,617	素材	
ARGENX SE	19	23	1,033	164,003	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ASM INTERNATIONAL NV	17	19	742	117,797	半導体・半導体製造装置	
ASML HOLDING NV	151	161	9,067	1,439,034	半導体・半導体製造装置	
ASR NEDERLAND NV	—	58	202	32,193	保険	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	—	28	253	40,208	半導体・半導体製造装置	
CNH INDUSTRIAL NV	395	395	418	66,339	資本財	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	198	198	219	34,841	食品・飲料・タバコ	
AIRBUS GROUP SE	218	235	2,950	468,275	資本財	
EURONEXT NV	34	34	227	36,070	金融サービス	
EXOR NV	41	41	338	53,659	金融サービス	
FERRARI NV	44	50	1,427	226,608	自動車・自動車部品	
FERROVIAL SE	—	178	492	78,103	資本財	
STELLANTIS NV	832	907	1,614	256,168	自動車・自動車部品	
HEINEKEN NV	96	113	970	153,947	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	36	48	355	56,359	食品・飲料・タバコ	
IMCD NV	21	21	236	37,563	資本財	
ING GROEP NV-CVA	1,469	1,469	1,769	280,783	銀行	
JDE PEET'S NV	40	62	164	26,033	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	63	—	—	—	素材	
KONINKLIJKE KPN NV	1,240	1,229	388	61,602	電気通信サービス	
NN GROUP NV	102	102	302	48,080	保険	
OCI NV	35	48	107	17,068	素材	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	325	367	639	101,471	ヘルスケア機器・サービス	
PROSUS NV	307	627	1,655	262,787	一般消費財・サービス流通・小売り	
RANDSTAD NV	46	46	227	36,176	商業・専門サービス	
STMICROELECTRONICS NV	—	272	1,012	160,744	半導体・半導体製造装置	
JUST EAT TAKEAWAY	64	—	—	—	消費者サービス	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	277	314	801	127,214	メディア・娯楽	
WOLTERS KLUWER	96	100	1,208	191,749	商業・専門サービス	
小 計	株数	金額				
	銘柄数 < 比率 >					
	30	7,488	7,790	31,119	4,938,690	
(ユーロ…スペイン)						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	80	78	256	40,634	資本財	
ACCIONA SA	8	8	96	15,253	公益事業	
AENA SA	28	28	388	61,624	運輸	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AMADEUS IT GROUP SA	170	183	991	157,372	消費者サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,505	2,417	1,796	285,072	銀行
BANCO SANTANDER SA	6,315	6,623	2,292	363,824	銀行
CELLNEX TELECOM SA	197	216	583	92,604	電気通信サービス
CAIXABANK S.A	1,630	1,630	592	93,981	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	110	111	163	25,963	公益事業
ENDESA SA	120	120	216	34,316	公益事業
ENAGAS SA	86	86	138	22,026	公益事業
FERROVIAL SA	184	—	—	—	資本財
NATURGY ENERGY GROUP SA	62	45	121	19,204	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	88	—	—	—	資本財
GRIFOLS SA	120	120	121	19,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA	2,204	2,445	2,574	408,606	公益事業
INDITEX	401	439	1,497	237,599	一般消費財・サービス流通・小売り
REDEIA CORP SA	155	155	236	37,471	公益事業
REPSOL SA	548	548	792	125,780	エネルギー
TELEFONICA SA	1,956	1,956	699	110,959	電気通信サービス
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	銘柄 数 < 比 率 >	銘柄 数 < 比 率 >	—	< 0.7% >	
(ユーロ…ベルギー)					
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	324	332	1,697	269,408	食品・飲料・タバコ
PROXIMUS	56	—	—	—	電気通信サービス
ELIA GROUP SA/NV	13	13	122	19,486	公益事業
AGEAS	59	59	213	33,957	保険
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	34	34	237	37,690	金融サービス
KBC GROEP NV	97	97	499	79,341	銀行
D' IETEREN GROUP	8	10	144	22,995	一般消費財・サービス流通・小売り
SOLVAY SA	28	28	269	42,817	素材
SOFINA	6	6	114	18,159	金融サービス
UCB SA	49	49	355	56,371	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE	79	79	176	28,082	素材
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	銘柄 数 < 比 率 >	銘柄 数 < 比 率 >	—	< 0.2% >	
(ユーロ…オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	114	130	426	67,639	銀行
VERBUND AG	27	27	230	36,552	公益事業
OMV AG	54	54	223	35,517	エネルギー
VOESTALPINE AG	42	42	97	15,441	素材
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	銘柄 数 < 比 率 >	銘柄 数 < 比 率 >	—	< 0.1% >	
(ユーロ…ルクセンブルク)					
AROUNDTOWN SA	359	—	—	—	不動産管理・開発
ARCELORMITTAL	191	205	429	68,167	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	50	50	230	36,657	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA	156	178	274	43,564	エネルギー
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	銘柄 数 < 比 率 >	銘柄 数 < 比 率 >	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フィンランド)					
ELISA OYJ	54	60	241	38,310	電気通信サービス
FORTUM OYJ	167	167	183	29,142	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	109	109	165	26,261	生活必需品流通・小売り
KONE OYJ-B	122	136	537	85,341	資本財
METSO CORPORATION	—	242	214	34,019	資本財
NESTE OYJ	155	163	478	75,957	エネルギー
NOKIA OYJ	2,038	2,133	650	103,262	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ORION OYJ-CLASS B	36	45	163	25,945	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ-A SHS	177	196	745	118,247	保険
STORA ENSO OYJ-R SHS	197	253	279	44,279	素材

銘柄	株数	当 期		業 種 等
		株数	価 値	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円
UPM-KYMMENE OYJ	195	210	672	106,775
WARTSILA OYJ ABP	181	181	175	27,911
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,438	3,900	4,508
		11	12	—
				<0.2%>
(ユーロ…アイルランド)				
ATB GROUP PLC	—	510	205	32,536
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	447	384	61,016
CRH PLC	284	—	—	—
KERRY GROUP PLC-A	59	64	487	77,320
KINGSPAN GROUP PLC	59	59	366	58,089
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	63	68	1,012	160,632
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	90	90	270	42,871
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	556	1,240	2,725
		5	6	—
				<0.1%>
(ユーロ…ポルトガル)				
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,058	1,261	479	76,104
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	187	187	269	42,726
JERONIMO MARTINS	90	105	211	33,546
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,336	1,554	960
		3	3	—
				<0.1%>
(ユーロ…スイス)				
DSM-FIRMENICH AG	—	75	576	91,421
STMICROELECTRONICS NV	252	—	—	—
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	252	75	576
		1	1	—
				<0.0%>
(ユーロ…バミューダ)				
AEGON LTD	—	696	313	49,694
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	—	696	313
		—	1	—
				<0.0%>
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	68,728	71,963	174,073
		223	219	—
				<9.2%>
(イギリス)			千ギリスポンド	
3I GROUP PLC	368	406	811	147,439
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	131	131	258	46,902
ADMIRAL GROUP PLC	67	67	168	30,548
ANGLO AMERICAN PLC	466	540	1,122	203,975
ANTOFAGASTA PLC	143	143	192	35,063
ASTRAZENECA PLC	577	617	6,512	1,183,427
ASHTED GROUP PLC	161	177	837	152,190
AUTO TRADER GROUP PLC	364	364	221	40,331
AVEVA GROUP PLC	45	—	—	—
AVIVA PLC	1,016	945	373	67,900
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	801	846	2,085	378,994
BAE SYSTEMS PLC ORD	1,173	1,242	1,360	247,319
BARCLAYS PLC	6,134	6,397	852	154,875
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	407	407	163	29,687
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	45	45	178	32,465
BP PLC	7,209	7,036	3,762	683,704
BT GROUP PLC	2,677	2,677	298	54,324
BUNZL PLC	128	128	367	66,788
BURBERRY GROUP PLC	155	155	266	48,473
CENTRICA PLC	—	2,092	329	59,836
COCA-COLA HBC AG-CDI	76	76	165	30,142
COMPASS GROUP PLC	666	722	1,478	268,691
CRH PLC	—	300	1,340	243,518
CRODA INTERNATIONAL PLC	50	61	253	46,135
DCC PLC	38	38	169	30,723
DIAGEO PLC	850	904	2,844	516,923

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	
ENDEAVOUR MINING PLC	—	64	111	20,249	素材
EXPERIAN PLC	339	374	907	164,914	商業・専門サービス
GLENCORE PLC	3,676	4,178	1,837	333,910	素材
GSK PLC	1,513	1,632	2,421	440,029	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENTAIN PLC	214	248	230	41,814	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	130	130	90	16,391	金融サービス
HALMA PLC	146	146	268	48,864	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALEON PLC	1,946	2,182	730	132,684	家庭用品・パーソナル用品
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	57	57	112	20,475	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	7,492	7,890	4,853	881,980	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	331	387	673	122,410	食品・飲料・タバコ
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	64	74	442	80,393	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	60	60	240	43,674	商業・専門サービス
INFORMA PLC	565	565	399	72,547	メディア・娯楽
JD SPORTS FASHION PLC	973	973	122	22,325	一般消費財・サービス流通・小売り
JOHNSON MATTHEY PLC	73	73	106	19,291	素材
KINGFISHER PLC	781	781	157	28,639	一般消費財・サービス流通・小売り
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,256	2,256	466	84,757	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	25,535	26,499	1,098	199,649	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	124	162	1,347	244,878	金融サービス
M&G PLC	995	995	191	34,777	金融サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,629	504	235	42,789	資本財
MONDI PLC	183	183	234	42,528	素材
NATIONAL GRID PLC	1,349	1,405	1,372	249,340	公益事業
NEXT PLC	46	56	388	70,685	一般消費財・サービス流通・小売り
NMC HEALTH PLC	80	80	0	0	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	226	226	104	18,950	生活必需品流通・小売り
PERSIMMON PLC	124	124	119	21,710	耐久消費財・アパレル
PEARSON PLC	260	260	240	43,711	消費者サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	302	302	134	24,434	保険
PRUDENTIAL PLC	1,017	1,107	921	167,492	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	265	286	1,624	295,148	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	715	764	2,187	397,438	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	859	1,153	524	95,249	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	420	447	2,306	419,131	素材
NATWEST GROUP PLC	1,929	2,040	421	76,601	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,210	3,530	716	130,230	資本財
SAINSBURY (J) PLC	706	706	178	32,369	生活必需品流通・小売り
SAGE GROUP PLC/THE	388	388	374	68,095	ソフトウェア・サービス
SCHRODERS PLC	302	303	109	19,899	金融サービス
SSE PLC	398	436	702	127,597	公益事業
SEVERN TRENT PLC	90	90	232	42,188	公益事業
SHELL PLC-NEW	2,780	2,709	7,363	1,338,148	エネルギー
SMITHS GROUP PLC	136	136	212	38,525	資本財
SMITH & NEPHEW PLC	315	339	311	56,549	ヘルスケア機器・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	28	28	232	42,318	資本財
ST JAMES'S PLACE PLC	205	205	125	22,798	金融サービス
ABRDN PLC	885	885	134	24,457	金融サービス
STANDARD CHARTERED PLC	954	954	681	123,805	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	1,240	1,240	132	23,992	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	2,778	2,880	784	142,537	生活必需品流通・小売り
UNILEVER PLC	953	1,007	4,044	734,963	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	261	261	272	49,596	公益事業
VODAFONE GROUP PLC	9,965	9,965	736	133,824	電気通信サービス
WHITBREAD PLC	69	81	267	48,574	消費者サービス
WISE PLC - A	—	214	143	26,055	金融サービス
FERGUSON PLC	79	—	—	—	資本財

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	価 値		
(イギリス)	百株	百株	千円		
WPP PLC	411	411	284	51,663	メディア・娯楽
小 計	106,610	111,982	72,080	13,098,450	
	銘柄数 < 比率 >	80	82	—	< 4.4% >
(スイス)			千スイスフラン		
ABB LTD-REG	612	612	1,825	305,781	資本財
ADECCO GROUP AG-REG	55	68	229	38,471	商業・専門サービス
ALCON INC	186	195	1,263	211,599	ヘルスケア機器・サービス
BALOISE HOLDING AG - REG	17	17	223	37,384	保険
CLARIANT AG-REG	79	79	98	16,510	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	987	—	—	—	金融サービス
DUFREY AG-REG	—	34	108	18,100	一般消費財・サービス流通・小売り
GEBERIT AG-REG	13	14	620	103,898	資本財
GIVAUDAN-REG	3	3	1,078	180,531	素材
HOLCIM LTD	206	222	1,239	207,545	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	84	84	449	75,351	金融サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	19	21	519	86,955	運輸
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.05	499	83,562	食品・飲料・タバコ
LONZA GROUP AG-REG	27	29	936	156,825	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA-REG	1,051	1,071	10,561	1,768,646	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG-REG	806	822	7,058	1,181,948	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG	8	9	859	143,962	金融サービス
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	195	205	2,199	368,380	耐久消費財・アパレル
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	261	282	6,699	1,121,918	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SANDOZ GROUP AG	—	164	423	70,966	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	13	14	268	44,958	資本財
SGS SA-REG	2	59	443	74,290	商業・専門サービス
SIKA AG-REG	55	56	1,203	201,471	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	20	20	435	72,916	ヘルスケア機器・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	11	12	730	122,354	保険
SWISSCOM AG-REG	9	10	546	91,569	電気通信サービス
SWISS RE AG	113	122	1,200	201,017	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	11	11	258	43,236	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG-REG	1,301	1,325	2,841	475,763	金融サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	56	60	2,563	429,215	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	175	29,323	食品・飲料・タバコ
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	15	152	25,539	銀行
BACHEM HOLDING AG	14	14	89	15,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BKW AG	—	8	129	21,732	公益事業
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	162	27,128	素材
HELVETIA HOLDING AG-REG	—	13	158	26,503	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.4	0.4	400	67,050	食品・飲料・タバコ
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	66	66	464	77,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR	10	12	324	54,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	10	10	186	31,303	資本財
SIG GROUP AG	109	109	212	35,520	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	40	43	491	82,290	ヘルスケア機器・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	27	34	284	47,683	不動産管理・開発
TEMENOS AG	22	22	146	24,481	ソフトウェア・サービス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	18	19	85	14,237	耐久消費財・アパレル
VAT GROUP AG	10	10	329	55,189	資本財
小 計	6,547	6,018	51,178	8,570,298	
	銘柄数 < 比率 >	41	45	—	< 2.8% >
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
ALFA LAVAL AB	107	107	3,764	50,671	資本財
ASSA ABLOY AB-B	374	429	10,013	134,783	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,029	1,113	15,962	214,851	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	534	568	7,088	95,415	資本財
BEIJER REF AB	—	154	1,569	21,127	資本財

銘柄	株数	当期		業種等			
		株数	期末				
			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			
BOLIDEN AB	102	102	2,868	38,614	素材		
ELECTROLUX AB-B	80	—	—	—	耐久消費財・アパレル		
EMBRACER GROUP AB	239	—	—	—	メディア・娯楽		
EPIROC AB-A	249	315	6,071	81,722	資本財		
EPIROC AB-B	154	154	2,515	33,855	資本財		
EQT AB	106	144	2,916	39,249	金融サービス		
ERICSSON LM-B SHS	1,076	1,149	5,693	76,634	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	236	236	5,629	75,778	家庭用品・パーソナル用品		
EVOLUTION AB	67	71	7,522	101,255	消費者サービス		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	232	232	1,015	13,664	不動産管理・開発		
GETINGE AB-B SHS	76	94	1,867	25,136	ヘルスケア機器・サービス		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	278	278	4,149	55,850	一般消費財・サービス流通・小売り		
HEXAGON AB-B SHS	719	809	7,656	103,060	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
HOLMEN AB-B SHARES	35	35	1,440	19,382	素材		
HUSQVARNA AB-B SHS	150	150	1,068	14,387	資本財		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	59	59	1,672	22,513	金融サービス		
INVESTOR AB-B SHS	693	693	14,008	188,557	金融サービス		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	49	49	1,400	18,850	金融サービス		
INVESTOR AB-A SHS	191	—	—	—	金融サービス		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	68	68	1,261	16,978	資本財		
INDUTRADE AB	101	101	1,908	25,684	資本財		
KINNEVIK AB - B	82	—	—	—	金融サービス		
LIFCO AB-B SHS	84	84	1,633	21,991	資本財		
LUNDBERGS AB-B SHS	22	35	1,602	21,575	金融サービス		
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	564	630	3,971	53,456	資本財		
NORDEA BANK ABP	1,260	1,311	15,408	207,391	銀行		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	624	624	7,703	103,685	銀行		
SANDVIK AB	389	408	7,673	103,278	資本財		
SAAB AB-B	—	27	1,594	21,455	資本財		
SAGAX AB-B	79	79	1,507	20,292	不動産管理・開発		
SECURITAS AB-B SHS	94	177	1,617	21,768	商業・専門サービス		
SECURITAS AB-B SHS(N)	83	—	—	—	商業・専門サービス		
SKANSKA AB-B SHS	143	143	2,294	30,883	資本財		
SKF AB-B SHARES-B	140	140	2,471	33,267	資本財		
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	226	226	3,372	45,394	素材		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	534	601	5,773	77,717	銀行		
SWEDBANK AB - A SHARES	345	345	6,619	89,102	銀行		
SWEDISH MATCH AB	567	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
SWEDISH ORPHAN BLOVITRUM AB	71	81	1,756	23,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
TELE2 AB-B SHS	232	232	1,819	24,485	電気通信サービス		
TELIA CO AB	942	1,185	2,825	38,034	電気通信サービス		
VOLVO AB-B SHS-B	566	584	12,761	171,764	資本財		
VOLVO AB-A SHS	71	95	2,119	28,528	資本財		
VOLVO CAR AB-B	204	204	862	11,606	自動車・自動車部品		
小計	株数	金額	14,348	14,343	194,454	2,617,352	
銘柄数 < 比率 >	47	43	—	—	< 0.9% >		
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ				
ADEVINTA ASA	114	114	1,087	14,562	メディア・娯楽		
AKER BP ASA	121	121	3,759	50,339	エネルギー		
DNB BANK ASA	358	358	7,169	95,992	銀行		
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	74	74	1,213	16,242	保険		
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	39	1,863	24,951	資本財		
MOWI ASA	163	163	2,894	38,762	食品・飲料・タバコ		
NORSK HYDRO A S	506	506	3,036	40,659	素材		
ORKLA ASA	259	322	2,620	35,090	食品・飲料・タバコ		
SALMAR ASA	21	35	1,819	24,361	食品・飲料・タバコ		
EQUINOR ASA	364	390	14,437	193,313	エネルギー		
TELENOR ASA	239	239	2,772	37,129	電気通信サービス		

銘柄	株数	期 末		業 種 等
		期首(前期末)	当 期	
		株 数	評 価	
		株 数	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
YARA INTERNATIONAL ASA	66	66	2,402	32,169
小 計	株数・金額	2,288	45,076	603,575
	銘柄数<比率>	11	—	<0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ	
AP MOELLER - MAERSK A/S - B	1	1	2,252	47,882
AP MOELLER - MAERSK A/S - A	1	1	1,302	27,700
CARLSBERG AS-B	36	39	3,398	72,253
CHR HANSEN HOLDING A/S	38	38	1,625	34,557
COLOPLAST-B	44	50	3,668	78,002
DANSKE BANK A/S	266	266	4,143	88,081
ORSTED A/S	70	75	2,517	53,511
DSV A/S	69	78	7,691	163,514
GENMAB A/S	24	25	5,252	111,676
GN STORE NORD A/S	49	—	—	—
NOVO NORDISK A/S-B	617	1,311	90,808	1,930,583
NOVOZYMES A/S-B SHARES	72	81	2,268	48,222
PANDORA A/S	33	33	2,692	57,239
ROCKWOOL A/S-B SHS	3	3	482	10,266
TRYG A/S	139	139	1,913	40,690
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	382	414	6,127	130,269
DEMANT A/S	36	36	961	20,437
小 計	株数・金額	1,888	2,597	137,106
	銘柄数<比率>	17	16	<1.0%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,103	1,207	3,001	283,345
APA GROUP	458	458	369	34,900
ARISTOCRAT LEISURE LTD	220	235	949	89,623
ASX LTD	71	71	395	37,287
BHP GROUP LTD	1,892	2,035	9,104	859,365
BLUESCOPE STEEL LTD	183	183	338	31,955
BRAMBLES LTD	547	547	783	73,965
AMPOL LTD	87	87	289	27,283
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	639	671	6,533	616,729
COCHLEAR LTD	25	29	720	68,006
COMPUTERSHARE LTD	209	209	526	49,717
COLES GROUP LTD	492	579	865	81,739
CSL LTD	179	192	4,534	428,057
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	21	—	—	—
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	504	504	251	23,720
EVOLUTION MINING LTD	690	—	—	—
FORTESCUE METALS GROUP LTD	640	659	1,451	137,002
IDP EDUCATION LTD	72	101	214	20,215
IGO LTD	—	243	263	24,886
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	951	951	538	50,820
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	169	169	663	62,590
LOTTERY CORP LTD/THE	855	855	382	36,097
MACQUARIE GROUP LTD	136	146	2,387	225,324
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,084	1,084	378	35,719
MINERAL RESOURCES LTD	62	73	439	41,518
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,194	1,241	3,516	331,956
NEWCREST MINING LTD	323	—	—	—
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	421	421	510	48,186
ORIGIN ENERGY LTD	683	683	621	58,683
ORICA LIMITED	176	176	260	24,591
PILBARA MINERALS LTD	—	1,145	444	41,944
QANTAS AIRWAYS LTD	350	350	169	15,970
QBE INSURANCE GROUP LTD	552	552	849	80,201
AURIZON HOLDINGS LTD	735	735	253	23,888

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		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	71	71	351	33,203	ヘルスケア機器・サービス	
REA GROUP LTD	18	18	278	26,318	メディア・娯楽	
REECE LTD	102	102	179	16,906	資本財	
RIO TINTO LTD	140	148	1,727	163,062	素材	
SANTOS LTD	1,216	1,216	945	89,226	エネルギー	
SEEK LTD	128	128	273	25,855	メディア・娯楽	
SONIC HEALTHCARE LTD	176	176	508	47,957	ヘルスケア機器・サービス	
SOUTH32 LTD	1,698	2,077	675	63,742	素材	
SUNCORP GROUP LTD	442	440	594	56,113	保険	
TELSTRA GROUP LTD	—	1,642	635	60,011	電気通信サービス	
TELSTRA GROUP LTD	1,449	—	—	—	電気通信サービス	
TRANSURBAN GROUP	1,136	1,299	1,554	146,753	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	279	279	333	31,476	食品・飲料・タバコ	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	83	83	285	26,908	金融サービス	
WESTPAC BANKING CORP	1,313	1,406	2,925	276,141	銀行	
WESFARMERS LTD	409	478	2,431	229,555	一般消費財・サービス流通・小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	59	59	354	33,499	ソフトウェア・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	439	491	1,749	165,135	生活必需品流通・小売り	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	712	759	2,649	250,110	エネルギー	
XERO LTD	49	59	646	61,010	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 < 比 率 >	25,662 51	27,543 50	61,111 —	5,768,282 < 1.9% >
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	471	471	357	31,023	運輸	
EBOS GROUP LTD	—	56	196	17,106	ヘルスケア機器・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	231	231	476	41,401	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	459	578	280	24,395	公益事業	
MERCURY NZ LTD	204	341	200	17,392	公益事業	
SPARK NEW ZEALAND LTD	765	765	381	33,169	電気通信サービス	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 < 比 率 >	2,132 5	2,444 6	1,893 —	164,488 < 0.1% >
(香港)			千香港ドル			
AIA GROUP LTD	4,491	4,603	30,846	592,554	保険	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,345	1,480	3,048	58,567	銀行	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	679	679	992	19,069	食品・飲料・タバコ	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	250	250	910	17,481	公益事業	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	977	1,032	4,050	77,818	資本財	
CK ASSET HOLDINGS LTD	730	805	3,132	60,183	不動産管理・開発	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	570	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
CLP HOLDINGS LTD	595	630	3,543	68,075	公益事業	
ESR GROUP LTD	758	758	804	15,463	不動産管理・開発	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	810	910	3,999	76,829	消費者サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	780	780	801	15,403	不動産管理・開発	
HANG SENG BANK LTD	291	291	2,589	49,751	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	579	579	1,184	22,746	不動産管理・開発	
HKT TRUST AND HKT LTD	1,500	1,500	1,215	23,340	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS	495	580	2,160	41,503	公益事業	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	950	—	—	—	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	4,032	4,562	2,495	47,940	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	446	483	13,437	258,125	金融サービス	
MTR CORP	575	625	1,862	35,778	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	616	616	876	16,845	不動産管理・開発	
SANDS CHINA LTD	966	966	2,057	39,526	消費者サービス	
SINO LAND CO	1,230	1,230	1,071	20,588	不動産管理・開発	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	520	520	619	11,907	運輸	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	524	604	4,808	92,364	不動産管理・開発	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	175	175	857	16,471	不動産管理・開発	
SWIRE PROPERTIES LTD	416	416	614	11,795	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	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	525	525	3,693	70,949	資本財
WH GROUP LTD	2,998	2,998	1,301	25,002	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	638	638	1,764	33,887	不動産管理・開発
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	710	710	638	12,261	資本財
小 計	株 数	株 数	95,379	1,832,233	
	銘柄 数 < 比率 >	銘柄 数 < 比率 >	—	< 0.6% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,050	1,050	316	34,610	不動産管理・開発
CITY DEVELOPMENTS LTD	173	173	107	11,802	不動産管理・開発
DBS GROUP HOLDINGS LTD	673	711	2,360	258,456	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	2,111	2,111	180	19,765	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD	533	685	425	46,624	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,240	1,342	1,723	188,755	銀行
SEATRUM LTD	—	14,881	169	18,578	資本財
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	—	302	138	15,180	公益事業
SINGAPORE AIRLINES LTD	539	539	333	36,478	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	252	425	402	44,121	金融サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,047	3,544	843	92,389	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	633	633	238	26,064	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	418	499	1,383	151,477	銀行
UOL GROUP LTD	155	155	89	9,757	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	99	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD	739	739	255	27,942	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数	株 数	8,967	982,005	
	銘柄 数 < 比率 >	銘柄 数 < 比率 >	—	< 0.3% >	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
AZRIELI GROUP LTD	17	17	307	11,352	不動産管理・開発
BANK LEUMI LE-ISRAEL	625	625	1,562	57,725	銀行
BANK HAPOALIM BM	411	504	1,434	53,007	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	687	—	—	—	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	10	10	770	28,463	資本財
ICL GROUP LTD	260	260	516	19,078	素材
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	483	483	827	30,591	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	49	69	810	29,932	銀行
NICE LTD	24	24	1,565	57,837	ソフトウェア・サービス
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	37	—	—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数	株 数	7,793	287,988	
	銘柄 数 < 比率 >	銘柄 数 < 比率 >	—	< 0.1% >	
合 計	株 数	株 数	—	292,245,103	
	銘柄 数 < 比率 >	銘柄 数 < 比率 >	—	< 97.1% >	

(注) 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) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,690	6,910	635	95,525	0.0	
PROLOGIS INC	34,365	37,145	3,667	551,181	0.2	
AMERICAN TOWER CORP	17,089	18,549	3,003	451,386	0.2	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	11,180	12,110	395	59,510	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,557	18,847	284	42,683	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,220	5,790	956	143,726	0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	5,717	5,717	298	44,813	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,700	4,810	440	66,133	0.0	
CROWN CASTLE INC	16,040	16,330	1,424	214,142	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	10,635	11,695	1,367	205,560	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	6,550	422	63,420	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	13,340	15,450	861	129,441	0.0	
EQUINIX INC	3,368	3,728	2,543	382,220	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	2,480	521	78,362	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,960	8,800	907	136,319	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,370	11,340	511	76,875	0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	20,375	334	50,216	0.0	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,000	14,810	214	32,227	0.0	
WELLTOWER INC	16,750	20,360	1,683	252,945	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	27,179	423	63,717	0.0	
INVITATION HOMES INC	22,810	25,700	779	117,101	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	10,895	13,365	780	117,235	0.0	
KIMCO REALTY CORP	21,830	23,760	389	58,487	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,470	—	—	—	—	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	4,300	547	82,313	0.0	
PUBLIC STORAGE	5,919	6,319	1,503	225,999	0.1	
REALTY INCOME CORP	22,221	28,201	1,389	208,850	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	6,005	6,005	347	52,178	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,030	4,175	817	122,792	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	12,114	13,394	1,406	211,309	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	4,640	4,640	477	71,800	0.0	
UDR INC	12,100	12,100	411	61,807	0.0	
VENTAS INC	14,895	17,025	703	105,717	0.0	
VICI PROPERTIES INC	35,610	39,120	1,078	162,023	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	6,851	—	—	—	—	
WEYERHAEUSER CO	27,758	29,998	858	128,976	0.0	
WP CAREY INC	7,310	8,610	452	67,943	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	483,323	505,687	32,838	4,934,949	
	銘柄 数 < 比 率 >	37	35	—	< 1.6% >	
(カナダ)				千カナダドル		
CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	2,800	116	12,646	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,800	2,800	116	12,646	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
COVIVIO	1,925	1,925	71	11,376	0.0	
GECINA SA	1,950	1,950	173	27,573	0.0	
KLEPIERRE	8,402	8,402	185	29,414	0.0	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,160	—	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	4,990	212	33,687	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	16,437	17,267	643	102,052
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.0% >
(ユーロ…ベルギー)					
WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,160	7,730	175	27,798	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	5,160	7,730	175	27,798
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	21,597	24,997	818	129,850
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.0% >
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND COMPANY PLC	30,601	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	26,624	148	27,064	0.0
SEGRO PLC	45,033	45,033	308	56,089	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	102,258	71,657	457	83,153
	銘柄 数 < 比 率 >	3	2	—	< 0.0% >
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES	154,902	154,902	266	25,148	0.0
DEXUS/AU	42,067	42,067	281	26,603	0.0
GOODMAN GROUP	63,582	70,642	1,464	138,225	0.0
GPT GROUP	71,335	71,335	258	24,441	0.0
LENLEASE GROUP	23,367	23,367	147	13,917	0.0
MIRVAC GROUP	135,075	159,875	310	29,351	0.0
SCENTRE GROUP	198,271	198,271	481	45,476	0.0
STOCKLAND	82,300	102,400	373	35,279	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	770,899	822,859	3,585	338,444
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	< 0.1% >
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	77,300	104,160	3,739	71,832	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	77,300	104,160	3,739	71,832
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	138,243	346	37,998	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	209,556	356	39,012	0.0
KEPPEL REIT(N)	—	13,712	10	1,186	0.0
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	106,000	106,000	137	15,090	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	144,556	212	23,270	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	598,355	612,067	1,064	116,558
	銘柄 数 < 比 率 >	4	5	—	< 0.0% >
合 計	口 数 ・ 金 額	2,056,532	2,144,227	—	5,687,435
	銘柄 数 < 比 率 >	59	57	—	< 1.9% >

(注) 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) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引		百万円	百万円
		DJSTX5	491	—
		SP EMINI	2,530	—

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2023年10月26日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
	千円	%
株式	292,245,103	96.5
投資証券	5,687,435	1.9
コール・ローン等、その他	4,915,984	1.6
投資信託財産総額	302,848,522	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（298,846,128千円）の投資信託財産総額（302,848,522千円）に対する比率は98.7%です。

(注) 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。1アメリカドル=150.28円、1カナダドル=108.83円、1ユーロ=158.70円、1イギリスポンド=181.72円、1スイスフラン=167.46円、1スウェーデンクローナ=13.46円、1ノルウェークローネ=13.39円、1デンマーククローネ=21.26円、1オーストラリアドル=94.39円、1ニュージーランドドル=86.89円、1香港ドル=19.21円、1シンガポールドル=109.51円、1イスラエルシェケル=36.9505円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	305,331,567,564	
コール・ローン等	4,147,078,572	
株式(評価額)	292,245,103,382	
投資証券(評価額)	5,687,435,505	
未収入金	2,623,471,915	
未収配当金	214,263,884	
差入委託証拠金	414,214,306	
(B) 負債	4,443,283,441	
未払金	2,566,255,389	
未払解約金	1,877,026,677	
未払利息	1,375	
(C) 純資産総額(A-B)	300,888,284,123	
元本	60,617,205,489	
次期繰越損益金	240,271,078,634	
(D) 受益権総口数	60,617,205,489口	
1万口当たり基準価額(C/D)	49,637円	

(注) 当ファンドの期首元本額は58,419,890,528円、期中追加設定元本額は10,020,807,446円、期中一部解約元本額は7,823,492,485円です。

(注) 2023年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	33,033,504,086円
・グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	8,685,455,095円
・インデックスファンド先進国株式(適格機関投資家向け)	5,869,865,622円
・インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,205,726,915円
・日興五大陸株式ファンド	3,477,499,117円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,338,394,962円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	1,254,888,146円
・DCインデックスバランス(株式80)	811,294,314円
・DCインデックスバランス(株式60)	674,344,956円
・DCインデックスバランス(株式40)	313,862,875円
・Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス(全世界株式)	300,017,123円
・インデックスファンドMSCIオール・カンントリー(全世界株式)	233,610,327円
・DCインデックスバランス(株式20)	113,435,960円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	75,144,450円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	73,782,515円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	73,311,676円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	46,137,440円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	15,811,296円
・インデックスファンド海外先進国株式(適格機関投資家向け)	13,258,596円
・Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	7,448,649円
・Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	263,039円
・Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	148,330円

(注) 1口当たり純資産額は4,9637円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

○損益の状況（2022年10月27日～2023年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	5,585,318,199	
受取配当金	5,537,318,611	
受取利息	59,800	
その他収益金	48,859,809	
支払利息	△ 920,021	
(B) 有価証券売買損益	27,644,050,037	
売買益	45,676,623,662	
売買損	△ 18,032,573,625	
(C) 先物取引等取引損益	465,462,880	
取引益	962,836,644	
取引損	△ 497,373,764	
(D) 保管費用等	△ 56,022,234	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	33,638,808,882	
(F) 前期繰越損益金	199,629,511,096	
(G) 追加信託差損益金	35,603,058,528	
(H) 解約差損益金	△ 28,600,299,872	
(I) 計(E+F+G+H)	240,271,078,634	
次期繰越損益金(I)	240,271,078,634	

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

(注) 損益の状況の中で(H)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。

〇お知らせ

約款変更について

2022年10月27日から2023年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、2023年4月26日付けにて運用目標とするベンチマークを「MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）」から「MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）」に変更いたしました。

当ファンドに関して、実際の運用においては保有資産から配当を受け取るため、当ファンドの基準価額は「配当込み」の値動きとなる一方で、運用目標とするベンチマークを構成する指数については、一般に広く認知されている指数が配当を含まないものであったことなどを理由として、「配当抜き」の値動きとなる指数を採用して参りました。こうしたことが要因の一つとなって、当ファンドの基準価額とベンチマークの値動きに乖離が生じておりました。このたび、当該乖離を是正することが受益者にとってより適切な投資判断につながるとの考えから、運用実態に則して当ファンドのベンチマークを「配当込み」の指数へ変更いたしました。

なお、投資する海外資産から配当を受け取る際に税金が控除されることから、運用実態に則して「税引後配当込み」の指数へ変更いたしました。（付表）

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2024年5月16日）
（2023年5月17日～2024年5月16日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2006年5月17日から原則無期限です。
運用方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	新興国の株式を主要投資対象とします。
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割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として、新興国の株式に投資し、「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数等先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<936561>

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○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 (税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	期騰落	中率	期騰落	中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
14期(2020年5月18日)	15,171	△11.2	148.32	△10.9	91.2	8.7	0.1	133,915
15期(2021年5月17日)	22,962	51.4	224.29	51.2	96.8	3.1	0.1	111,602
16期(2022年5月16日)	21,388	△6.9	208.69	△7.0	93.0	6.9	0.1	95,921
17期(2023年5月16日)	22,397	4.7	219.50	5.2	95.2	7.0	0.1	98,878
18期(2024年5月16日)	28,923	29.1	283.01	28.9	96.8	3.1	0.1	124,141

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」は、「MSCI Inc.」が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。(税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの税引後配当込み指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2024年5月16日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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 (税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率
	騰落	率	騰落	率			
(期首) 2023年5月16日	円	%		%	%	%	%
2023年5月16日	22,397	—	219.50	—	95.2	7.0	0.1
5月末	22,862	2.1	224.16	2.1	91.5	6.7	0.1
6月末	24,228	8.2	237.72	8.3	94.7	5.4	0.1
7月末	25,009	11.7	245.38	11.8	94.3	5.7	0.1
8月末	24,629	10.0	241.61	10.1	93.7	6.3	0.1
9月末	24,124	7.7	236.60	7.8	94.1	5.9	0.1
10月末	23,539	5.1	231.08	5.3	97.2	2.9	0.1
11月末	24,726	10.4	242.72	10.6	94.7	5.3	0.1
12月末	24,840	10.9	244.03	11.2	94.3	5.7	0.1
2024年1月末	24,801	10.7	243.47	10.9	94.1	5.9	0.1
2月末	26,329	17.6	258.60	17.8	94.7	5.4	0.1
3月末	27,108	21.0	266.18	21.3	96.4	3.6	0.1
4月末	28,423	26.9	279.23	27.2	96.0	3.0	0.1
(期末) 2024年5月16日	28,923	29.1	283.01	28.9	96.8	3.1	0.1

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

（2023年5月17日～2024年5月16日）

基準価額の推移

期間の初め22,397円の基準価額は、期間末に28,923円となり、騰落率は+29.1%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

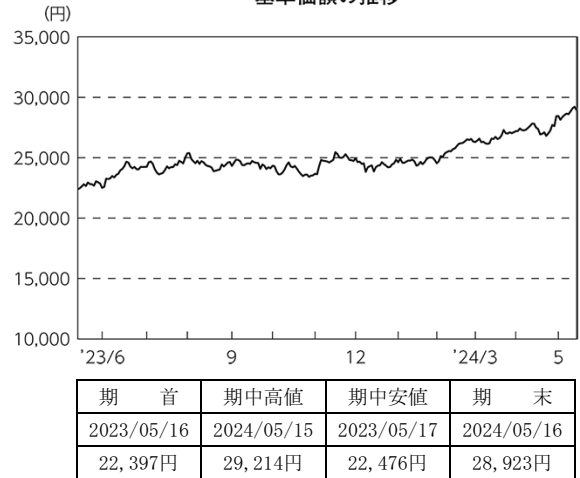
<値上がり要因>

- ・ 中国人民銀行が景気下振れリスクの抑制のため最優遇貸出金利を引き下げたこと。
- ・ 米国連邦公開市場委員会（FOMC）において米国連邦準備制度理事会（FRB）が2024年に利下げに転じるとの見方を示したこと。
- ・ 中国人民銀行が住宅ローン金利の基準となる5年物ローンプライムレート（LPR）を大幅に引き下げたこと。

<値下がり要因>

- ・ 中国の貿易統計で輸出・輸入がともに低迷していることなどから中国景気の先行き不安が強まったことや中国の不動産市況の悪化が警戒されたこと。
- ・ 中東情勢の緊迫化を受けて地政学的リスクが高まったこと。

基準価額の推移

MSCI エマージング・マーケット・インデックス
（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）（指数化）の推移

（新興国株式市況）

新興国株式市場では、期間の初めと比べて、新興国各国の株価は概して上昇しました。

期間の初めから2023年7月下旬にかけては、世界的なインフレ懸念を背景に複数の新興国および欧米の主要中央銀行の利上げの継続が警戒されたことなどが株価の重しとなったものの、中国人民銀行が景気下振れリスクの抑制のため最優遇貸出金利を引き下げたことや、中国共産党の中央政治局会議で景気刺激策を追加する方針が示されたことなどが支援材料となり、新興国各国の株価は総じて上昇しました。8月上旬から10月下旬にかけては、中国の貿易統計で輸出・輸入がともに低迷していることなどから中国景気の先行き不安が強まったことや、中国の不動産市況の悪化が警戒されたこと、中東情勢の緊迫化を受けた地政学的リスクの高まりが警戒され、世界経済の先行き懸念が高まったことなどが株価の重しとなり、新興国各国の株価は総じて下落しました。11月上旬から期間末にかけては、中国景気に対する先行き懸念や、欧米の早期利下げ観測が後退する局面で欧米の長期金利が上昇したこと、イランがイスラエルを攻撃し中東情勢が緊迫化したことなどが株価の重しとなったものの、中国の主要都市で住宅購入の規制緩和が発表されたことや、一部の新興国の政策金利の引き下げ、FOMCにおいてFRBが2024年に利下げに転じるとの見方を示したこと、中国人民銀行が住宅ローン金利の基準となる5年物LPRを大幅に引き下げたことなどが支援材料となり、新興国各国の株価は総じて上昇しました。

（為替市況）

新興国通貨は、期間の初めと比べて、対円で総じて上昇しました。FRBの金融引き締めによる新興国からの資金流出懸念などが新興国通貨の重しとなったものの、米国の利上げサイクル終了への期待が強まったことや、欧米の長期金利が低下したことなどが新興国通貨の支援材料となったこと、日銀による金融緩和と政策の継続が円売りの要因となり、新興国通貨は対円で総じて上昇しました。

ポートフォリオ

ベンチマークが採用している国の株式の中からリスクコントロールモデルを使用して構築したポートフォリオで運用を行ない、期間を通じて株式組入比率を高位に維持しました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替えなどに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ないました。

なお、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高位の外貨エクスポージャーを維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、29.1%の値上がりとなり、ベンチマークである「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）」の上昇率28.9%を概ね0.2%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・現物株式の組入れに基づく要因。
- ・株式先物証拠金金利の受取り。

<マイナス要因>

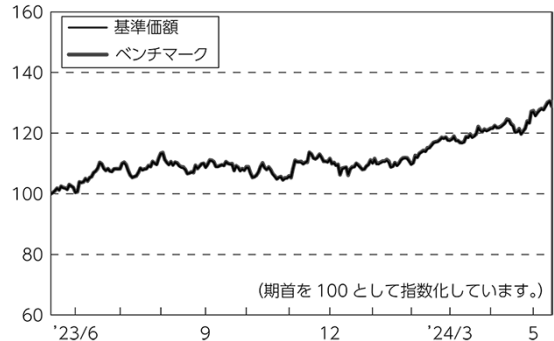
- ・株式先物の組入れに基づく要因。
- ・海外カストディ・フィーや売買手数料などの諸費用。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークである「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）」に連動する投資成果をめざし、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行わず、高位の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○1万口当たりの費用明細

(2023年5月17日～2024年5月16日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 6 (4) (0) (3)	% 0.025 (0.014) (0.000) (0.010)	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	5 (5) (0)	0.021 (0.021) (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)	43 (31) (12)	0.170 (0.124) (0.047)	(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、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	54	0.216	
期中の平均基準価額は、25,051円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2023年5月17日～2024年5月16日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 5,544 (△ 404)	千アメリカドル 4,950 (△ 1)	百株 5,701 (1,217)	千アメリカドル 5,601 (2,510)
	メキシコ	6,259 (5,030)	千メキシコペソ 27,877 (2,973)	19,231 (-)	千メキシコペソ 40,020 (58)
	ブラジル	4,198 (2,445)	千ブラジルレアル 8,112 (230)	5,240 (106)	千ブラジルレアル 10,009 (110)
	チリ	185,966 (17)	千チリペソ 275,682 (1,248)	3,690 (-)	千チリペソ 111,785 (1,248)
	コロンビア	-	千コロンビアペソ -	34	千コロンビアペソ 101,790
	ユーロ ギリシャ	1,702 (-)	千ユーロ 695 (△ 9)	408	千ユーロ 289
	トルコ	1,849 (7,385)	千トルコリラ 14,429 (-)	2,832	千トルコリラ 10,186
	チェコ	-	千チェココルナ -	9	千チェココルナ 859
	ハンガリー	97	千ハンガリーフォリント 47,176	37	千ハンガリーフォリント 53,021
	ポーランド	368	千ポーランドズロチ 2,848	623	千ポーランドズロチ 2,746
	香港	77,209 (3,860)	千香港ドル 143,622 (19,683)	136,038 (505)	千香港ドル 142,809 (173)
	マレーシア	14,006	千マレーシアリンギット 5,856	17,462	千マレーシアリンギット 5,516
	タイ	28,175	千タイバーツ 28,979	27,837	千タイバーツ 61,728
	フィリピン	2,526 (805)	千フィリピンペソ 22,157 (2,091)	12,816 (846)	千フィリピンペソ 43,179 (2,091)
	インドネシア	915,648 (7,852)	千インドネシアルピア 32,339,927 (-)	33,373	千インドネシアルピア 20,638,465

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	韓国	百株 1,811 (223)	千韓国ウォン 14,898,628 (243,192)	百株 2,280 (93)	千韓国ウォン 13,141,039 (109,539)
	台湾	31,090 (3,665)	千新台湾ドル 324,297 (△ 3,728)	39,176 (842)	千新台湾ドル 371,146 (358)
	インド	44,153 (6,969)	千インドルピー 1,566,977 (161,256)	11,487 (369)	千インドルピー 913,108 (161,256)
	サウジアラビア	3,016 (1,750)	千サウジアラビリアル 14,752 ()	3,587	千サウジアラビリアル 12,234
	カタール	3,749	千カタールリアル 2,465	1,352	千カタールリアル 1,541
	クウェート	2,049 (1,826)	千クウェートディナール 142 (0.646)	3,657 (179)	千クウェートディナール 229 (0.646)
	エジプト	—	千エジプトポンド —	4,007	千エジプトポンド 16,590
	南アフリカ	2,507 ()	千南アフリカランド 28,936 (△ 526)	5,149	千南アフリカランド 63,728
	アラブ首長国連邦	6,313	千アラブディルハム 3,643	6,369	千アラブディルハム 3,825
	中国オフショア	31,125 (1,278)	千香港・オフショア人民元 32,251 ()	15,211	千香港・オフショア人民元 14,521

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、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。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	メキシコ		千メキシコペソ		千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	—	—	17,600	445
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1XXX	—	—	—	—
	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	71,100	5,293	(180,500)	(2,915)
	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA(N)	—	—	—	—
	小計	(1,638)	(—)	—	—
		71,100	5,293	17,600	445
		(1,638)	(—)	(180,500)	(2,915)
国	香港		千香港ドル		千香港ドル
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	—	—	9,870	15
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN(N)	—	—	—	—
		(9,870)	(17)	—	—
	小計	—	—	9,870	15
	(9,870)	(17)	—	—	
		—	—	9,870	15
		(9,870)	(17)	—	—
	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	49,530	602	379,360	4,019
	小計	49,530	602	379,360	4,019

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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 39,560	百万円 43,762	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2023年5月17日～2024年5月16日)

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	24,157,012千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	104,651,781千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.23

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

（2023年5月17日～2024年5月16日）

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2023年5月17日～2024年5月16日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2024年5月16日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMBEV SA-ADR	528	341	81	12,545	食品・飲料・タバコ
AMERICA MOVIL SAB DE CV-ADR	147	—	—	—	電気通信サービス
AUTOHOME INC-ADR	77	77	226	34,884	メディア・娯楽
BANCO DE CHILE-ADR	49	22	54	8,365	銀行
BANCO BRADESCO-ADR	531	364	94	14,512	銀行
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	69	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CENTRAIS ELETRICAS BR-SP ADR	894	826	612	94,348	公益事業
CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	122	98	77	11,933	素材
COCA-COLA FEMSA SAB-SP ADR	18	16	165	25,496	食品・飲料・タバコ
COSAN SA -ADR	30	30	33	5,149	エネルギー
CREDICORP LTD	73	69	1,201	185,020	銀行
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	63	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ENEL CHILE SA-ADR	123	123	39	6,096	公益事業
FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	22	16	200	30,929	食品・飲料・タバコ
GERDAU SA -SPON ADR	189	138	53	8,236	素材
GRUPO AEROPORTUARIO PAC-ADR	3	5	95	14,684	運輸
GRUPO AEROPORTUARIO SUR-ADR	1	—	—	—	運輸
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR-ADR	519	367	238	36,659	銀行
KE HOLDINGS INC-ADR	713	721	1,309	201,615	不動産管理・開発
LUFAX HOLDING LTD-ADR	692	—	—	—	金融サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	227	227	393	60,551	素材
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	91	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	608	608	0	0	電気通信サービス
NTO INC - ADR	1,476	1,430	762	117,372	自動車・自動車部品
PETROLEO BRASILEIRO S. A. -ADR	192	91	141	21,797	エネルギー
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	251	195	289	44,547	エネルギー
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	59	54	261	40,261	資本財
BANCO SANTANDER BRASIL-ADS	119	119	64	9,983	銀行
CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	42	42	64	9,924	公益事業
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	23	25	49	7,693	銀行
SENDAS DISTRIBUIDORA-ADR	89	141	184	28,426	生活必需品流通・小売り
SOUTHERN COPPER CORP(US)	95	89	1,101	169,597	素材
SOUTHERN COPPER CORP(US)(N)	—	0.93	11	1,759	素材
SUZANO SA - SPON ADR	92	93	92	14,163	素材
TAL EDUCATION GROUP- ADR	475	475	623	95,935	消費者サービス
GRUPO TELEVISIA SA-SPONS ADR	115	—	—	—	メディア・娯楽
TELEFONICA BRASIL-ADR	192	56	50	7,826	電気通信サービス
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	745	819	1,258	193,772	メディア・娯楽
TIM SA-ADR	55	63	104	16,128	電気通信サービス
VALE SA-SP ADR	239	61	77	11,890	素材
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	453	364	605	93,139	一般消費財・サービス流通・小売り
YUM CHINA HOLDINGS INC	451	435	1,689	260,020	消費者サービス
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	458	440	942	145,046	運輸
QIFU TECHNOLOGY INC-ADR	119	119	248	38,231	金融サービス
H WORLD GROUP LTD-ADR	207	228	927	142,777	消費者サービス
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	588	—	—	—	消費者サービス

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価	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		
IQIYI INC-ADR	448	448	231	35,586		メディア・娯楽
KANZHUN LTD-ADR	186	246	533	82,115		メディア・娯楽
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	62	81	370	57,058		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OZON HOLDINGS PLC - ADR	64	64	0	0		一般消費財・サービス流通・小売り
PDD HOLDINGS INC-ADR	542	619	8,756	1,347,954		一般消費財・サービス流通・小売り
WEIBO CORP-SPON-ADR	77	—	—	—		メディア・娯楽
YANDEX NV-A	350	350	0.003	0.538		メディア・娯楽
JOYY INC-ADR	47	—	—	—		メディア・娯楽
ZAI LAB LTD-ADR	100	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	—	2,922	449	69,271		銀行
GAZPROM PAO-SPON ADR	6,493	6,493	0	0		エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON-ADR	26	26	0	0		エネルギー
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	438	—	—	—		生活必需品流通・小売り
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	185	185	0	0		素材
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	102	102	0	0		エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	1,263	1,263	0	0		エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S	263	263	0	0		素材
SURGUTNEFTGAS-SP ADR	1,747	1,747	0	0		エネルギー
TATNEFT-SPONSORED-ADR	274	274	0.002	0.421		エネルギー
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	154	154	0.001	0.237		生活必需品流通・小売り
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	1,296	1,296	241	37,148		エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	1,346	—	—	—		不動産管理・開発
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	452	542	113	17,499		ソフトウェア・サービス
LUKOIL PJSC	433	433	0.004	0.666		エネルギー
VK IPJSC -GDR	152	152	0	0		メディア・娯楽
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	720	720	0	0		素材
PHOSAGRO PJSC REG S-GDR	176	176	0.001	0.27		素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	78	78	0	0		素材
SBERBANK PJSC-SPONSORED ADR	517	517	0	0		銀行
TCS GROUP HOLDING -REG S-GDR	134	134	0	0		銀行
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	5,763	5,763	0.057	8		銀行
VTB BANK PJSC	3,364,600	3,364,600	33	5,179		銀行
(アメリカ…非上場)						
PHOSAGRO PJSC REG S-GDR (FUKA)	1	1	0	0.001		素材
小計	株数・金額	3,400,836	3,399,056	25,160	3,873,149	
	銘柄数<比率>	77	66	—	<3.1%>	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	3,225	3,225	4,131	38,123		資本財
AMERICA MOVIL SAB DE CV	26,606	19,907	33,165	306,058		電気通信サービス
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	440	528	8,922	82,334		食品・飲料・タバコ
BANCO DEL BAJIO SA	808	808	5,194	47,936		銀行
CEMEX SAB-CPO	14,756	14,756	19,448	179,472		素材
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	401	401	6,734	62,145		食品・飲料・タバコ
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,831	1,831	37,302	344,235		食品・飲料・タバコ
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	2,756	2,698	47,306	436,552		銀行
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	358	345	11,014	101,643		運輸
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	2,262	1,841	9,118	84,146		銀行
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	496	563	8,450	77,983		資本財
GRUPO MEXICO SA-SER B	3,397	3,260	33,906	312,891		素材
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,424	1,402	9,906	91,418		食品・飲料・タバコ
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	186	186	10,839	100,028		運輸

銘柄	株数	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	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコペソ	千円		
GRUMA S. A. B. -B	217	196	6,388	58,958	食品・飲料・タバコ	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	—	293	5,346	49,339	運輸	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	153	198	5,051	46,611	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,644	1,644	6,008	55,443	家庭用品・パーソナル用品	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	1,016	1,016	3,003	27,713	素材	
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	—	1,452	2,919	26,945	電気通信サービス	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	236	210	3,935	36,313	運輸	
GRUPO TELEVISIA SAB	2,249	—	—	—	メディア・娯楽	
WALMART DE MEXICO -SER V	5,617	5,375	36,404	335,947	生活必需品流通・小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	70,083 21	62,140 22	314,500 —	2,902,242 <2.3%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル			
AMBEV SA	4,461	4,461	5,491	164,476	食品・飲料・タバコ	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	675	675	717	21,490	生活必需品流通・小売り	
BANCO BRADESCO S. A.	1,471	1,352	1,613	48,323	銀行	
BANCO DO BRASIL S. A.	929	1,790	4,949	148,238	銀行	
BANCO BRADESCO SA-PRF	5,309	5,309	7,056	211,356	銀行	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	241	241	677	20,296	銀行	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	1,336	1,172	4,154	124,439	金融サービス	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	774	739	2,530	75,786	保険	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	6,546	5,807	6,684	200,205	金融サービス	
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	—	582	928	27,820	保険	
CCR SA	1,298	1,102	1,407	42,156	運輸	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,464	1,904	1,995	59,776	公益事業	
CIA SIDERURGICA NACIONAL	648	648	847	25,386	素材	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PRF-B	—	975	941	28,209	公益事業	
COSAN SA	1,112	1,112	1,599	47,893	エネルギー	
CPFL ENERGIA SA	233	233	793	23,755	公益事業	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	427	427	1,630	48,828	公益事業	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	287	287	1,212	36,317	公益事業	
ENERGISA SA-UNITS	210	238	1,139	34,123	公益事業	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,057	1,072	3,383	101,345	公益事業	
EQUATORIAL ENERGIA SA-RTS	14	16	3	113	公益事業	
GERDAU SA-PREF	1,065	1,278	2,538	76,034	素材	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	5,877	5,361	2,359	70,658	ヘルスケア機器・サービス	
HYPERMARCAS SA	446	446	1,354	40,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	4,647	4,647	15,484	463,771	銀行	
ITAUSA SA-PRF	5,671	5,776	5,932	177,685	銀行	
JBS SA	878	805	2,188	65,556	食品・飲料・タバコ	
KLABIN SA - UNIT	811	892	1,928	57,767	素材	
LOJAS RENNEN S. A.	986	986	1,470	44,030	一般消費財・サービス流通・小売り	
LOCALIZA RENT A CAR SA	817	942	4,512	135,165	運輸	
LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	3	—	—	—	運輸	
MAGAZINE LUIZA SA	2,927	2,927	471	14,114	一般消費財・サービス流通・小売り	
ENEVA SA	845	729	919	27,554	公益事業	
NATURA &CO HOLDING SA	945	945	1,557	46,660	家庭用品・パーソナル用品	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	3,561	3,561	14,253	426,908	エネルギー	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	4,649	4,649	17,854	534,760	エネルギー	
VBRA ENERGIA SA	1,202	1,202	2,859	85,646	一般消費財・サービス流通・小売り	
PRIO SA	757	881	4,140	124,018	エネルギー	
RAIA DROGASIL SA	1,179	1,319	3,569	106,914	生活必需品流通・小売り	

銘柄	株数	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	596	596	1,835	54,962	ヘルスケア機器・サービス	
RUMO SA	1,455	1,344	2,753	82,481	運輸	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	314	314	2,492	74,645	公益事業	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	779	779	1,045	31,311	生活必需品流通・小売り	
SUZANO SA	715	715	3,615	108,302	素材	
TELEFONICA BRASIL S. A.	363	363	1,667	49,952	電気通信サービス	
TIM SA	567	567	971	29,092	電気通信サービス	
TOTVS SA	530	627	1,787	53,539	ソフトウェア・サービス	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	210	210	925	27,715	公益事業	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	774	774	1,947	58,316	エネルギー	
VALE SA	3,862	3,481	22,431	671,861	素材	
WEG SA	1,779	1,742	6,904	206,802	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	77,715	79,013	181,533	5,437,128	
	銘柄 数 < 比 率 >	49	50	—	< 4.4% >	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO DE CHILE	42,380	42,380	472,963	80,395	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSTON	58	77	211,195	35,899	銀行	
BANCO SANTANDER CHILE SA	63,729	60,205	273,089	46,420	銀行	
CENCOSUD SA	1,431	1,301	234,139	39,799	生活必需品流通・小売り	
EMPRESAS CMPC SA	1,090	1,090	207,645	35,295	素材	
EMPRESAS COPEC SA	391	391	287,776	48,916	エネルギー	
ENEL AMERICAS SA	22,776	22,776	208,971	35,521	公益事業	
ENEL CHILE SA	24,873	24,873	147,948	25,148	公益事業	
LATAM AIRLINES GROUP SA	—	185,800	245,627	41,752	運輸	
S. A. C. I. FALABELLA	765	893	244,235	41,515	一般消費財・サービス流通・小売り	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	94	94	411,660	69,974	資本財	
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	18,750	18,750	139,406	23,696	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額	176,339	358,633	3,084,660	524,336	
	銘柄 数 < 比 率 >	11	12	—	< 0.4% >	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA	442	442	829,379	33,370	公益事業	
BANCOLOMBIA SA-PRF	472	472	1,604,800	64,569	銀行	
BANCOLOMBIA SA	287	253	899,215	36,179	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,201	1,167	3,333,394	134,119	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.1% >	
(ユーロ…ギリシャ)				千ユーロ		
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	2,463	2,274	373	62,549	銀行	
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	—	1,105	429	71,960	銀行	
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	2,582	2,815	579	97,088	銀行	
JUMBO SA	126	126	353	59,341	一般消費財・サービス流通・小売り	
MOTOR OIL (HELLAS) SA	58	74	206	34,682	エネルギー	
MYTILINEOS S. A.	106	106	409	68,656	資本財	
NATIONAL BANK OF GREECE	534	758	645	108,158	銀行	
OPAP SA	201	201	313	52,502	消費者サービス	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	225	202	284	47,755	電気通信サービス	
PUBLIC POWER CORP	213	213	248	41,713	公益事業	
TERNA ENERGY SA	71	—	—	—	公益事業	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	6,582	7,876	3,843	644,409	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	< 0.5% >	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	3,364	3,364	19,247	92,124	銀行	

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(トルコ)	百株	百株	千ドルコリラ	千円		
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	766	1,532	9,184	43,959	資本財	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	507	461	21,660	103,676	生活必需品流通・小売り	
COCA-COLA ICECEK AS	—	73	5,339	25,558	食品・飲料・タバコ	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,516	1,516	6,812	32,609	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	74	74	8,896	42,583	自動車・自動車部品	
HACI OMER SABANCI HOLDING	957	957	9,483	45,393	銀行	
HEKTAS TICARET T.A.S	1,443	—	—	—	素材	
KOC HOLDING AS	736	736	17,721	84,819	資本財	
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	912	—	—	—	素材	
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	43	43	876	4,197	運輸	
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS(N)	—	169	3,409	16,318	運輸	
SASA POLYESTER SANAYI	538	1,597	7,491	35,858	素材	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	—	120	3,291	15,752	自動車・自動車部品	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	1,526	1,526	7,881	37,725	資本財	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,167	1,167	9,667	46,272	電気通信サービス	
TURK HAVA YOLLARI AO	570	570	17,413	83,347	運輸	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	983	977	17,741	84,918	エネルギー	
TURKIYE IS BANKASI-C	3,834	9,585	13,227	63,312	銀行	
YAPI VE KREDI BANKASI	2,740	3,610	11,544	55,257	銀行	
小計	株数・金額	21,681	28,083	190,892	913,685	
	銘柄数<比率>	17	18	—	<0.7%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
CEZ AS	175	166	15,452	104,770	公益事業	
KOMERCNI BANKA AS	81	81	6,499	44,068	銀行	
MONETA MONEY BANK AS	390	390	3,779	25,623	銀行	
小計	株数・金額	647	638	25,730	174,461	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT	162	150	142,336	61,906	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	412	492	149,485	65,015	エネルギー	
OTP BANK PLC	236	227	415,598	180,755	銀行	
小計	株数・金額	811	871	707,419	307,677	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.2%>	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
ALLEGRO. EU SA	401	579	2,217	87,230	一般消費財・サービス流通・小売り	
BANK PEKAO SA	190	190	3,203	126,032	銀行	
SANTANDER BANK POLSKA SA	34	36	1,843	72,518	銀行	
MBANK SA	16	16	1,064	41,873	銀行	
BUDIMEX	—	12	940	36,981	資本財	
CD PROJEKT SA	66	66	928	36,535	メディア・娯楽	
CYFROWY POLSAT SA	250	—	—	—	メディア・娯楽	
DINO POLSKA SA	54	50	1,985	78,123	生活必需品流通・小売り	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	142	159	2,444	96,188	素材	
LPP SA	1	1	2,029	79,832	耐久消費財・アパレル	
PEPCO GROUP NV	179	179	372	14,670	一般消費財・サービス流通・小売り	
PKO BANK POLSKI SA	978	928	5,346	210,327	銀行	
ORLEN SA	697	603	4,172	164,172	エネルギー	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	866	866	629	24,757	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	640	574	3,097	121,854	保険	
小計	株数・金額	4,519	4,265	30,275	1,191,101	
	銘柄数<比率>	14	14	—	<1.0%>	

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	
3SBIO INC	1,495	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	745	745	1,985	39,152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	29,820	27,190	10,005	197,316	銀行
ATR CHINA LTD-H	1,740	1,740	704	13,896	運輸
AKESO INC - B	540	530	2,607	51,421	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	4,550	4,150	2,303	45,420	素材
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	15,858	16,884	139,546	2,751,852	一般消費財・サービス流通・小売り
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,300	1,318	11,829	233,268	耐久消費財・アパレル
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,325	1,220	2,379	46,913	素材
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2,480	2,480	972	19,170	資本財
BANK OF CHINA LTD - H	84,740	81,820	30,191	595,377	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	8,672	8,372	5,015	98,897	銀行
BAIDU INC-CLASS A	2,381	2,333	25,477	502,415	メディア・娯楽
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	5,040	5,040	1,219	24,052	公益事業
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	2,040	—	—	—	運輸
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	64	90	614	12,121	一般消費財・サービス流通・小売り
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	565	565	1,582	31,197	公益事業
BEIGENE LTD	658	748	7,401	145,967	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BILIBILI INC-CLASS Z	195	195	2,345	46,262	メディア・娯楽
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	3,740	4,460	2,091	41,249	耐久消費財・アパレル
BOC AVIATION LTD	215	215	1,335	26,329	資本財
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	—	3,100	2,021	39,858	自動車・自動車部品
BYD CO LTD-H	885	1,065	23,749	468,340	自動車・自動車部品
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	665	820	2,775	54,736	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	730	730	1,327	26,171	不動産管理・開発
CGN POWER CO LTD-H	10,780	12,280	3,585	70,711	公益事業
CMOC GROUP LTD-H	3,510	3,510	2,927	57,727	素材
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	2,140	2,140	2,052	40,470	資本財
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3,920	3,920	1,266	24,968	素材
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	3,965	—	—	—	商業・専門サービス
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	102,119	98,619	54,832	1,081,292	銀行
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	2,170	2,090	4,556	89,848	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	26,953	24,973	12,611	248,696	エネルギー
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	1,770	1,685	6,360	125,436	食品・飲料・タバコ
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	7,950	8,010	9,323	183,862	保険
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,390	1,250	1,462	28,840	運輸
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	4,013	4,098	6,196	122,194	不動産管理・開発
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	2,900	2,900	1,128	22,246	資本財
CHINA COSCO HOLDINGS-H	3,333	3,333	4,186	82,565	運輸
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,920	1,920	1,674	33,016	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	9,961	9,461	6,367	125,570	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES LAND LTD	3,357	3,377	10,403	205,157	不動産管理・開発
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,980	—	—	—	運輸
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	3,595	3,460	12,300	242,561	エネルギー
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	3,790	3,750	2,433	47,993	公益事業
CRRC CORP LTD - H	4,010	4,010	1,976	38,985	資本財
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,547	1,547	1,298	25,601	保険
CHINA MENGNIU DAIRY CO	3,490	3,350	5,634	111,116	食品・飲料・タバコ
CHINA COAL ENERGY CO - H	2,160	2,160	1,844	36,376	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK - H	4,126	3,821	14,177	279,585	銀行
CHINA CITIC BANK - H	9,290	9,290	4,533	89,401	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA MINSHENG BANKING-H	7,276	6,626	1,954	38,548	銀行
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,760	3,760	1,635	32,254	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	—	1,240	1,339	26,409	エネルギー
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	2,664	2,664	5,200	102,546	保険
CHINA GAS HOLDINGS LTD	3,188	2,878	2,256	44,495	公益事業
CHINA RESOURCES CEMENT	2,460	—	—	—	素材
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	960	960	2,620	51,682	公益事業
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	1,540	1,540	1,148	22,655	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	9,010	9,010	684	13,503	金融サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	2,450	2,450	2,891	57,010	素材
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	900	900	0	0	食品・飲料・タバコ
CHINA VANKE CO LTD-H	2,429	2,095	1,035	20,411	不動産管理・開発
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	3,500	1,820	458	9,044	銀行
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	3,160	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA POWER INTERNATIONAL	5,380	5,380	1,877	37,026	公益事業
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	3,775	4,400	2,006	39,566	金融サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	1,690	—	—	—	資本財
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	1,350	1,350	708	13,976	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	1,935	1,935	1,205	23,772	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	2,168	2,168	2,311	45,574	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA LITERATURE LTD	394	394	1,229	24,241	メディア・娯楽
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	1,772	1,772	1,938	38,228	金融サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	49,740	46,060	4,559	89,922	電気通信サービス
CHINA FEIHE LTD	3,790	3,790	1,713	33,781	食品・飲料・タバコ
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	1,130	—	—	—	資本財
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	740	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	774	720	2,174	42,879	不動産管理・開発
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	3,040	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,991	1,786	2,344	46,227	金融サービス
CITIC LTD	6,290	5,770	4,766	93,985	資本財
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	5,500	6,420	2,054	40,512	生活必需品流通・小売り
KUNLUN ENERGY CO LTD	3,980	3,980	3,287	64,829	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	2,100	1,060	562	11,099	運輸
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	12,537	—	—	—	不動産管理・開発
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	2,260	2,260	1,326	26,160	不動産管理・開発
DALI FOODS GROUP CO LTD	1,920	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	3,120	3,120	932	18,396	自動車・自動車部品
DONGYUE GROUP	1,610	—	—	—	素材
FAR EAST HORIZON LTD	1,650	2,460	1,537	30,319	金融サービス
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	570	570	981	19,355	半導体・半導体製造装置
FOSUN INTERNATIONAL LTD	2,410	2,410	1,205	23,762	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	7,020	—	—	—	不動産管理・開発
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	784	588	2,898	57,165	自動車・自動車部品
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	345	429	1,125	22,195	素材
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	21,260	24,870	3,531	69,641	半導体・半導体製造装置
GDS HOLDINGS LTD-CL A	868	—	—	—	ソフトウェア・サービス
GENSCRIPT BIOTECH CORP	1,220	1,220	1,515	29,880	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	6,550	6,270	6,407	126,364	自動車・自動車部品
GF SECURITIES CO LTD-H	1,174	1,010	830	16,371	金融サービス
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	—	282	1,498	29,556	家庭用品・パーソナル用品
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	3,695	2,735	3,889	76,694	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	830	—	—	—	不動産管理・開発
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	1,660	—	—	—	不動産管理・開発
GUANGDONG INVEST	3,160	3,160	1,478	29,163	公益事業
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,592	1,892	1,008	19,886	不動産管理・開発
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	3,328	3,908	1,317	25,974	自動車・自動車部品
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	2,372	2,372	932	18,382	金融サービス
HANERGY THIN FILM POWER GROU	2,400	2,400	0	0	半導体・半導体製造装置
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	690	690	1,814	35,785	資本財
HAIDLIAO INTERNATIONAL HOLDI	1,180	1,680	3,376	66,590	消費者サービス
HANSHO PHARMACEUTICAL GROUP	1,420	1,420	2,538	50,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	108	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	2,468	2,368	7,376	145,461	耐久消費財・アパレル
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	6,440	6,440	1,358	26,796	メディア・娯楽
HENGAN INTL GROUP CO LTD	645	845	2,425	47,823	家庭用品・パーソナル用品
HUANENG POWER INTL INC-H	5,460	4,040	2,149	42,383	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,270	1,270	1,240	24,468	金融サービス
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	600	600	1,053	20,776	半導体・半導体製造装置
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	374	374	1,387	27,362	ヘルスケア機器・サービス
IND & COMM BK OF CHINA - H	60,205	66,995	29,947	590,556	銀行
INNOVENT BIOLOGICS INC	1,120	1,310	5,167	101,911	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JD.COM INC - CL A	2,326	2,422	31,270	616,663	一般消費財・サービス流通・小売り
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	1,208	1,167	3,518	69,384	生活必需品流通・小売り
JD LOGISTICS INC	—	1,964	1,857	36,638	運輸
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	1,580	1,580	1,339	26,421	運輸
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	1,190	1,190	2,130	42,005	素材
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	740	—	—	—	消費者サービス
KINGSOFT CORP LTD	972	972	2,600	51,273	メディア・娯楽
KINGBOARD HOLDINGS LTD	705	705	1,388	27,388	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	1,050	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	2,710	3,000	2,748	54,190	ソフトウェア・サービス
EAST BUY HOLDING LTD	455	455	837	16,509	生活必需品流通・小売り
KUAI SHOU TECHNOLOGY	1,922	2,523	14,507	286,082	メディア・娯楽
LENOVO GROUP LTD	7,660	8,200	8,396	165,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LI NING CO LTD	2,515	2,525	5,454	107,552	耐久消費財・アパレル
LI AUTO INC-CLASS A	1,223	1,220	12,505	246,598	自動車・自動車部品
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	2,030	2,030	2,525	49,799	不動産管理・開発
MEITUAN-CLASS B	5,315	5,257	64,093	1,263,917	消費者サービス
MINTH GROUP LTD	740	—	—	—	自動車・自動車部品
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	615	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MINISO GROUP HOLDING LTD	—	420	2,072	40,873	一般消費財・サービス流通・小売り
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	810	810	1,370	27,026	保険
NETEASE INC	2,126	2,007	31,521	621,607	メディア・娯楽
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	1,636	1,589	11,091	218,718	消費者サービス
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,830	—	—	—	素材
NONGFU SPRING CO LTD-H	1,852	2,048	9,431	185,980	食品・飲料・タバコ
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	135	135	1,873	36,951	運輸
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	8,670	8,670	2,418	47,701	保険
PETROCHINA CO LTD-H	22,510	21,450	16,173	318,937	エネルギー
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	220	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	7,240	7,240	7,500	147,912	保険
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	6,735	6,805	27,322	538,791	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		
PING AN HEALTHCARE AND TECH	482	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	7,980	7,980	3,503	69,083	銀行	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	552	552	2,039	40,221	一般消費財・サービス流通・小売り	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	1,260	1,260	816	16,100	資本財	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	826	826	1,029	20,295	ヘルスケア機器・サービス	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	892	863	7,305	144,060	耐久消費財・アパレル	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	2,636	2,636	1,415	27,914	ヘルスケア機器・サービス	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	425	425	569	11,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	1,580	—	—	—	運輸	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	772	772	1,433	28,273	素材	
SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	370	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
SINOPHARM GROUP CO-H	1,548	1,380	3,111	61,366	ヘルスケア機器・サービス	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	11,697	11,027	3,374	66,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SINOTRUK HONG KONG LTD	—	670	1,413	27,878	資本財	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	1,840	1,840	1,293	25,508	食品・飲料・タバコ	
SUNNY OPTICAL TECH	780	780	3,338	65,833	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TENCENT HOLDINGS LTD	6,654	6,866	262,162	5,169,853	メディア・娯楽	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,020	2,020	2,072	40,870	食品・飲料・タバコ	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	2,120	2,120	1,225	24,164	一般消費財・サービス流通・小売り	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	1,256	1,256	2,775	54,737	消費者サービス	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	940	1,310	1,459	28,778	消費者サービス	
TRIP.COM GROUP LTD	—	567	23,955	472,404	消費者サービス	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	620	620	3,794	74,825	食品・飲料・タバコ	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	1,260	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	370	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,170	5,170	2,455	48,427	食品・飲料・タバコ	
WEICHAI POWER CO LTD-H	1,964	1,964	3,268	64,446	資本財	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	3,915	4,150	6,017	118,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WUXI APPTTEC CO LTD-H	372	346	1,430	28,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	849	816	6,270	123,663	公益事業	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	5,220	5,220	2,970	58,571	半導体・半導体製造装置	
XIAOMI CORP-CLASS B	16,206	16,258	32,483	640,574	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XPENG INC - CLASS A SHARES	896	1,183	3,649	71,969	自動車・自動車部品	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	1,485	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	1,700	2,300	4,158	82,003	エネルギー	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	1,320	1,320	1,932	38,108	自動車・自動車部品	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	550	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
YUEXIU PROPERTY CO LT-RIGHTS	477	—	—	—	不動産管理・開発	
ZAI LAB LTD	—	1,005	1,681	33,153	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	707	707	1,063	20,968	保険	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1,180	1,370	1,890	37,282	素材	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	1,330	1,835	950	18,748	運輸	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	704	636	2,038	40,196	資本財	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	725	815	1,227	24,204	一般消費財・サービス流通・小売り	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	—	520	1,622	31,993	自動車・自動車部品	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	6,257	5,437	9,994	197,084	素材	
ZTE CORP-H	712	712	1,274	25,132	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	102	102	1,317	25,987	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数	金 額	893,188	837,713	1,280,573	25,252,905
	銘柄 数 < 比 率 >		192	169	—	<20.3%>

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	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリングギット	千円	
AMMB HOLDINGS BHD	1,958	1,958	830	27,285	銀行
AXIATA GROUP BERHAD	2,964	2,964	838	27,568	電気通信サービス
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	7,853	6,673	4,524	148,698	銀行
DIALOG GROUP BHD	3,577	—	—	—	エネルギー
CELCOMDIGI BHD	3,361	3,396	1,382	45,427	電気通信サービス
GAMUDA BHD	2,287	2,287	1,246	40,965	資本財
GENTING BHD	2,189	2,189	1,031	33,886	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BHD	3,154	3,154	848	27,884	消費者サービス
HAP SENG CONSOLIDATED	637	—	—	—	資本財
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	271	—	—	—	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	648	648	1,258	41,359	銀行
IHH HEALTHCARE BHD	1,664	2,029	1,264	41,545	ヘルスケア機器・サービス
INARI AMERTRON BHD	3,249	3,249	1,016	33,423	半導体・半導体製造装置
IOI CORPORATION BERHAD	2,568	2,568	1,042	34,277	食品・飲料・タバコ
KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	451	525	1,179	38,754	食品・飲料・タバコ
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	657	992	1,031	33,907	運輸
MAXIS BHD	2,354	2,354	847	27,852	電気通信サービス
MALAYAN BANKING BHD	4,896	5,506	5,440	178,808	銀行
MISC BHD	1,359	1,359	1,119	36,804	運輸
MR DIY GROUP M BHD	2,209	4,197	751	24,694	一般消費財・サービス流通・小売り
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	65	65	838	27,558	食品・飲料・タバコ
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,495	3,064	2,086	68,579	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	306	306	638	20,979	エネルギー
PETRONAS GAS BERHAD	796	796	1,440	47,353	公益事業
PPB GROUP BERHAD	639	639	978	32,173	食品・飲料・タバコ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	4,359	4,014	2,167	71,240	素材
PUBLIC BANK BERHAD	15,686	15,223	6,317	207,643	銀行
QL RESOURCES BHD	1,145	1,145	752	24,724	食品・飲料・タバコ
RHB BANK BHD	1,548	1,548	848	27,891	銀行
SIME DARBY BERHAD	2,790	2,790	792	26,044	資本財
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,441	2,131	946	31,100	食品・飲料・タバコ
TENAGA NASIONAL BERHAD	2,929	2,569	3,185	104,709	公益事業
TELEKOM MALAYSIA BHD	1,102	1,283	794	26,101	電気通信サービス
TOP GLOVE CORP BHD	6,083	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	—	2,416	1,241	40,814	公益事業
YTL CORP BHD	—	3,197	1,160	38,142	公益事業
小 計	株 数	金 額			
銘柄数 < 比率 >	90,694	87,238	49,843	1,638,202	
	34	32	—	< 1.3% >	
(タイ)			千タイバート		
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,216	1,180	24,308	103,309	電気通信サービス
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	4,291	4,233	28,361	120,534	運輸
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	9,119	9,119	3,793	16,122	消費者サービス
B GRIMM POWER PCL-NVDR	835	—	—	—	公益事業
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	11,447	11,447	33,196	141,084	ヘルスケア機器・サービス
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	8,837	—	—	—	エネルギー
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	7,838	7,838	6,231	26,482	運輸
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,237	—	—	—	生活必需品流通・小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	8,026	8,026	4,775	20,295	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	615	615	15,559	66,127	ヘルスケア機器・サービス
CARABAO GROUP PCL-NVDR	345	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,970	2,148	13,425	57,056	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		
(タイ)	百株	百株	千タイバーツ	千円		
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	2,301	2,064	6,605	28,072	一般消費財・サービス流通・小売り	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	3,533	4,066	9,026	38,362	食品・飲料・タバコ	
CP ALL PCL-NVDR	5,984	5,984	36,502	155,135	生活必需品流通・小売り	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	3,320	3,195	23,004	97,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	221	—	—	—	公益事業	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	1,772	1,772	4,607	19,580	公益事業	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	649	649	3,228	13,722	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	3,149	3,149	12,993	55,221	公益事業	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	7,571	6,654	6,720	28,562	一般消費財・サービス流通・小売り	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	1,968	1,968	4,801	20,408	素材	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	1,203	999	6,793	28,871	電気通信サービス	
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	799	—	—	—	金融サービス	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	600	600	7,890	33,532	銀行	
KRUNG THAI BANK - NVDR	3,942	3,942	6,662	28,315	銀行	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	878	1,304	5,639	23,969	金融サービス	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	9,177	9,177	6,194	26,326	不動産管理・開発	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,240	3,240	10,856	46,139	消費者サービス	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	769	769	3,498	14,870	金融サービス	
OSOTSPA PCL-NVDR	1,638	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,567	1,466	22,651	96,267	エネルギー	
PTT PCL-NVDR	10,133	10,133	34,198	145,345	エネルギー	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,211	2,102	7,621	32,390	素材	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	4,154	3,500	6,335	26,923	一般消費財・サービス流通・小売り	
RATCH GROUP PCL-NVDR	1,018	—	—	—	公益事業	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	1,309	1,309	4,025	17,106	素材	
SCB X PCL-NVDR	851	851	8,935	37,975	銀行	
CP AXTRA PCL-NVDR	—	2,087	6,417	27,274	生活必需品流通・小売り	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	899	812	20,056	85,239	素材	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	656	—	—	—	金融サービス	
THAI OIL PCL-NVDR	1,381	1,381	7,215	30,666	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	3,192	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	—	23,420	4,051	17,219	銀行	
TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	15,027	10,027	8,422	35,797	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	150,891	151,228	414,606	1,762,077	
	銘柄 数 < 比 率 >	43	35	—	< 1.4% >	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
MONDE NISSAN CORP	6,429	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	2,100	1,904	7,044	18,845	資本財	
ACEN CORP (N)	682	—	—	—	公益事業	
AYALA CORPORATION	243	304	17,814	47,655	資本財	
AYALA LAND INC	7,530	6,825	19,248	51,490	不動産管理・開発	
BDO UNIBANK INC	2,696	2,421	33,413	89,383	銀行	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	1,827	1,824	22,738	60,827	銀行	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN(N)	163	—	—	—	銀行	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,120	1,018	35,538	95,069	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	3,003	3,003	9,761	26,112	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	475	475	10,553	28,232	消費者サービス	
MANILA ELECTRIC COMPANY	316	316	11,766	31,476	公益事業	
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,882	1,882	13,515	36,155	銀行	
PLDT INC	95	83	12,212	32,670	電気通信サービス	
SM INVESTMENTS CORP	239	239	20,777	55,583	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピンペソ	千円		
SM PRIME HOLDINGS INC	12,425	10,742	29,111	77,875	不動産管理・開発	
UNIVERSAL ROBINA CORP	1,046	904	9,878	26,425	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	42,277	31,946	253,374	677,802	
	銘柄 数 < 比 率 >	17	14	—	< 0.5% >	
(インドネシア)			千インドネシアルピア			
ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	14,852	14,852	4,203,116	40,349	エネルギー	
AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	—	6,680	6,813,600	65,410	素材	
ANEKA TAMBANG TBK	8,993	8,993	1,407,404	13,511	素材	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	22,399	20,919	9,476,307	90,972	資本財	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	58,805	57,399	54,529,050	523,478	銀行	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	73,542	70,133	33,804,106	324,519	銀行	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	8,297	15,704	7,891,260	75,756	銀行	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	40,110	38,317	24,427,087	234,500	銀行	
BARITO PACIFIC TBK PT	30,967	30,967	3,189,699	30,621	素材	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	7,281	7,281	3,913,537	37,569	食品・飲料・タバコ	
GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	—	885,290	5,842,914	56,091	一般消費財・サービス流通・小売り	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	2,123	1,894	2,007,640	19,273	食品・飲料・タバコ	
PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	4,526	4,526	2,760,860	26,504	食品・飲料・タバコ	
VALE INDONESIA TBK PT	2,362	—	—	—	素材	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	2,830	2,830	2,745,100	26,352	素材	
KALBE FARMA TBK PT	21,877	21,877	3,161,226	30,347	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	13,568	13,568	3,731,400	35,821	素材	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	53,554	51,729	16,035,990	153,945	電気通信サービス	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	23,142	23,142	1,735,650	16,662	電気通信サービス	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	3,477	3,477	1,432,573	13,752	素材	
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	18,362	21,772	6,074,388	58,314	生活必需品流通・小売り	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	7,530	7,530	2,018,040	19,373	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED TRACTORS TBK PT	1,756	1,600	3,560,000	34,176	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	420,354	1,310,481	200,760,951	1,927,305	
	銘柄 数 < 比 率 >	21	22	—	< 1.6% >	
(韓国)			千韓国ウォン			
AMOREPACIFIC CORP	29	29	505,310	57,706	家庭用品・パーソナル用品	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	7	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
CELLTRION INC	108	156	2,993,312	341,836	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHEIL WORLDWIDE INC	80	—	—	—	メディア・娯楽	
SAMSUNG C&T CORP	92	84	1,273,050	145,382	資本財	
CJ CORP	16	—	—	—	資本財	
CJ CHEILJEDANG CORP	8	8	290,605	33,187	食品・飲料・タバコ	
COSMOAM&T CO LTD	—	27	387,729	44,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
POSCO INTERNATIONAL CORP	—	55	256,215	29,259	資本財	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	340	248	195,959	22,378	金融サービス	
HANWHA OCEAN CO LTD	—	55	180,667	20,632	資本財	
KAKAO CORP	330	324	1,512,159	172,688	メディア・娯楽	
DONGBU INSURANCE CO LTD	49	48	504,885	57,657	保険	
DOOSAN ENERILITY	444	499	883,323	100,875	資本財	
DOOSAN BOBCAT INC	62	56	317,526	36,261	資本財	
ECOPRO MATERIALS CO LTD	—	13	131,220	14,985	資本財	
E-MART CO LTD	21	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
F&F CO LTD / NEW	19	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
GS HOLDINGS	43	43	197,335	22,535	資本財	
HANA FINANCIAL GROUP	312	309	1,900,821	217,073	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
HANWHA SOLUTIONS CORP	107	140	410, 143	46, 838	素材
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	79	79	358, 635	40, 956	自動車・自動車部品
HANON SYSTEMS	189	189	106, 407	12, 151	自動車・自動車部品
HANJIN KAL CORP	—	25	160, 368	18, 314	運輸
HANMI PHARM CO LTD	7	7	231, 361	26, 421	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	—	50	709, 000	80, 967	半導体・半導体製造装置
HOTEL SHILLA CO LTD	33	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
LOTTE CHEMICAL CORP	20	20	243, 812	27, 843	素材
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	18	18	351, 747	40, 169	運輸
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	35	35	547, 503	62, 524	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	75	75	265, 356	30, 303	資本財
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	50	44	600, 270	68, 550	資本財
HMM CO LTD	293	259	467, 179	53, 351	運輸
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	28	—	—	—	資本財
HYUNDAI MOBIS	65	63	1, 414, 350	161, 518	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	147	141	3, 485, 510	398, 045	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	96	96	310, 564	35, 466	素材
SK HYNIX INC	586	567	10, 506, 510	1, 199, 843	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	24	24	370, 080	42, 263	自動車・自動車部品
HD HYUNDAI	49	49	335, 115	38, 270	エネルギー
HYBE CO LTD	20	24	468, 270	53, 476	メディア・娯楽
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	17	21	311, 637	35, 588	資本財
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	25	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	239	276	379, 776	43, 370	銀行
KANGWON LAND INC	108	108	168, 419	19, 233	消費者サービス
KAKAOBANK CORP	161	168	399, 819	45, 659	銀行
KAKAOPAY CORP	25	25	90, 551	10, 340	金融サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	413	402	3, 207, 084	366, 248	銀行
KIA CORP	283	272	3, 108, 331	354, 971	自動車・自動車部品
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	19	19	290, 969	33, 228	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	207	148	325, 083	37, 124	運輸
KOREA ELECTRIC POWER CORP	267	267	526, 510	60, 127	公益事業
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	39	39	281, 341	32, 129	金融サービス
KOREA ZINC CO LTD	9	8	438, 102	50, 031	素材
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	79	79	432, 730	49, 417	資本財
KRAFTON INC	32	29	755, 580	86, 287	メディア・娯楽
KT CORP	—	63	231, 361	26, 421	電気通信サービス
KT&G CORP	123	108	970, 105	110, 786	食品・飲料・タバコ
KUM YANG CO LTD	—	32	312, 939	35, 737	素材
LG INNOTEK CO LTD	14	14	360, 112	41, 124	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD	52	50	2, 039, 467	232, 907	素材
LG CORP	100	96	773, 685	88, 354	資本財
LG ELECTRONICS INC	112	109	1, 071, 961	122, 418	耐久消費財・アパレル
LG H&H	9	9	429, 750	49, 077	家庭用品・パーソナル用品
LG DISPLAY CO LTD	258	308	328, 563	37, 521	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG UPLUS CORP.	219	219	219, 219	25, 034	電気通信サービス
LG CHEM LTD-PRF	8	7	202, 510	23, 126	素材
LG ENERGY SOLUTION	37	47	1, 833, 052	209, 334	資本財
LOTTE SHOPPING CO	12	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	119	107	921, 124	105, 192	金融サービス
NCSOFT CORP	18	14	314, 600	35, 927	メディア・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		
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円		
NETMARBLE CORP	22	22	139,009	15,874	メディア・娯楽	
NAVER CORP	138	133	2,453,442	280,183	メディア・娯楽	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	26	23	212,363	24,251	食品・飲料・タバコ	
POSCO FUTURE M CO LTD	28	32	881,968	100,720	資本財	
POSCO HOLDINGS INC	76	74	2,983,145	340,675	素材	
S-OIL CORPORATION	48	48	336,516	38,430	エネルギー	
S1 CORPORATION	15	—	—	—	商業・専門サービス	
SAMSUNG SDS CO LTD	39	39	643,168	73,449	ソフトウェア・サービス	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	870	855	5,519,265	630,300	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	58	58	889,134	101,539	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	68	68	268,536	30,666	金融サービス	
SAMSUNG E&A CO LTD	169	165	415,800	47,484	資本財	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	32	32	1,076,800	122,970	保険	
SAMSUNG SDI CO LTD	59	56	2,483,225	283,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	630	675	683,967	78,109	資本財	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5,113	4,961	38,844,630	4,436,056	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	—	40	868,000	99,125	資本財	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	83	80	744,465	85,017	保険	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	18	17	1,397,990	159,650	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SD BIOSENSOR INC	38	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	478	447	2,126,955	242,898	銀行	
SK INC	40	37	609,034	69,551	資本財	
SK INNOVATION CO LTD	60	61	683,928	78,104	エネルギー	
SK TELECOM	—	56	296,208	33,826	電気通信サービス	
SKC CO LTD	21	21	236,964	27,061	素材	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	29	33	293,125	33,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	28	28	163,878	18,714	資本財	
SK BIOSCIENCE CO LTD	24	29	174,636	19,943	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SK SQUARE CO LTD	110	105	829,737	94,755	資本財	
PAN OCEAN CO LTD	305	—	—	—	運輸	
COWAY CO LTD	56	56	331,632	37,872	耐久消費財・アパレル	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	117	117	149,479	17,070	金融サービス	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	559	625	903,814	103,215	銀行	
YUHAN CORP	54	69	483,638	55,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	99	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
CELLTRION PHARM INC	17	18	181,312	20,705	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ECOPRO BM CO LTD	52	50	1,070,182	122,214	資本財	
ECOPRO CO LTD	—	107	1,047,530	119,627	資本財	
HLB INC	117	123	1,171,337	133,766	ヘルスケア機器・サービス	
KAKAO GAMES CORP	39	—	—	—	メディア・娯楽	
L&F CO LTD	25	25	393,472	44,934	資本財	
PEARL ABYSS CORP	32	—	—	—	メディア・娯楽	
POSCO DX CO LTD	—	54	223,177	25,486	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額	16,726	16,386	125,808,154	14,367,291	
	銘柄数<比率>	102	99	—	<11.6%>	
(台湾)			千新台幣ドル			
ACER INC	3,248	3,248	15,607	74,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	530	530	24,883	118,938	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ADVANTECH CO LTD	436	469	16,679	79,723	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	146	146	17,341	82,887	資本財	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	—	80	22,840	109,170	半導体・半導体製造装置	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千新台幣ドル	千円	
ASIA CEMENT CORP	2,279	2,099	9,574	45,766	素材
ASUSTEK COMPUTER INC	797	737	36,750	175,661	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT	3,633	3,153	47,623	227,630	半導体・半導体製造装置
AUO CORP	6,647	6,647	12,066	57,673	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	9,100	9,470	53,602	256,210	保険
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	664	664	15,505	74,113	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	19,117	17,897	66,041	315,665	銀行
CHINA STEEL CORP	12,801	12,311	30,471	145,648	素材
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,213	5,343	9,858	47,122	銀行
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	15,447	16,407	23,380	111,752	保険
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	4,023	3,933	49,368	235,969	電気通信サービス
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	2,049	2,119	11,063	52,881	自動車・自動車部品
CHALEASE HOLDING CO LTD	1,543	1,534	23,482	112,240	金融サービス
CHINA AIRLINES LTD	3,380	3,190	7,257	34,688	運輸
COMPAL ELECTRONICS	4,379	4,379	16,007	76,511	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	2,055	1,985	63,334	302,726	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	14,744	14,472	40,522	193,689	銀行
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	202	202	9,924	47,436	耐久消費財・アパレル
EMEMORY TECHNOLOGY INC	71	71	17,253	82,465	半導体・半導体製造装置
EVA AIRWAYS CORP	2,520	2,810	10,116	48,352	運輸
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,092	1,092	22,222	106,217	運輸
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,920	1,780	14,756	70,531	電気通信サービス
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	3,229	3,229	11,093	53,025	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	449	639	10,164	48,583	耐久消費財・アパレル
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	11,211	11,259	31,075	148,532	銀行
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,180	1,170	8,219	39,285	エネルギー
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	3,760	3,600	20,306	97,061	素材
FORMOSA PLASTICS CORP	4,524	3,964	26,996	129,037	素材
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	7,771	7,826	57,760	276,085	保険
GIANT MANUFACTURING	389	—	—	—	耐久消費財・アパレル
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	—	570	17,727	84,731	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GLOBAL UNICHIP CORP	—	90	12,690	60,655	半導体・半導体製造装置
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	310	316	19,699	94,158	一般消費財・サービス流通・小売り
HON HAI PRECISION INDUSTRY	13,392	12,902	219,981	1,051,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	9,280	9,280	24,174	115,549	銀行
INVENTEC CORP	2,891	2,891	15,759	75,326	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INNOLUX CORP	9,387	8,918	12,128	57,971	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LARGAN PRECISION CO LTD	102	107	24,376	116,514	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	2,097	2,097	21,922	104,786	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	12,231	11,634	47,528	227,178	銀行
MEDIATEK INC	1,624	1,574	181,833	869,129	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	680	840	14,196	67,854	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOMO.COM INC	70	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	230	230	4,393	20,997	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,490	1,400	9,044	43,228	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	5,191	4,901	27,840	133,070	素材
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	180	180	6,336	30,284	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	635	605	35,042	167,494	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	1,998	1,998	20,085	96,003	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHARMAESSENTIA CORP	200	270	9,531	45,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
POU CHEN	2,261	2,261	8,683	41,507	耐久消費財・アパレル

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	千新台幣ドル	千円			
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	3,130	3,130	7,731	36,953	半導体・半導体製造装置		
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	564	564	15,494	74,062	生活必需品流通・小売り		
QUANTA COMPUTER INC	2,974	2,854	81,914	391,534	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	538	508	26,982	128,972	半導体・半導体製造装置		
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,839	1,655	7,707	36,841	不動産管理・開発		
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	14,479	13,629	12,307	58,827	保険		
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	11,943	11,192	25,240	120,642	銀行		
SILERGY CORP	338	338	13,858	66,238	半導体・半導体製造装置		
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,421	1,421	12,293	58,759	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
TAIWAN CEMENT	6,714	6,624	22,058	105,435	素材		
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	26,343	25,593	2,147,298	10,263,659	半導体・半導体製造装置		
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,951	1,801	18,919	90,432	電気通信サービス		
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	11,597	11,771	22,013	105,220	銀行		
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	10,648	10,582	27,936	133,532	銀行		
TAIWAN BUSINESS BANK	6,890	6,369	10,859	51,906	銀行		
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,670	2,030	6,161	29,448	運輸		
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	3,946	3,946	18,250	87,234	銀行		
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	5,107	4,727	37,390	178,720	食品・飲料・タバコ		
UNITED MICROELECTRONICS CORP	12,995	11,915	61,724	295,030	半導体・半導体製造装置		
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	1,320	1,450	26,462	126,485	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	70	70	11,410	54,537	資本財		
WAN HAI LINES LTD	695	695	4,905	23,445	運輸		
WALSIN LIHWA CORP	2,697	3,017	10,803	51,640	資本財		
WINBOND ELECTRONICS CORP	3,260	3,391	8,647	41,331	半導体・半導体製造装置		
WISTRON CORP	—	2,710	31,165	148,962	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
WIWYNN CORP	90	105	27,247	130,237	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
WPG HOLDINGS LTD	1,755	1,755	15,358	73,408	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
YANG MING MARINE TRANSPORT	2,010	1,940	13,851	66,207	運輸		
YAGEO CORPORATION	378	368	23,236	111,067	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	10,874	10,499	33,440	159,839	金融サービス		
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	690	690	8,176	39,082	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
GLOBALWAFERS CO LTD	232	232	11,901	56,887	半導体・半導体製造装置		
WIN SEMICONDUCTORS CORP	350	—	—	—	半導体・半導体製造装置		
E INK HOLDINGS INC	940	890	19,313	92,312	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
PARADE TECHNOLOGIES LTD	80	80	6,104	29,175	半導体・半導体製造装置		
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	1,000	1,000	9,210	44,021	半導体・半導体製造装置		
小 計	株 数	金 額	366,354	361,090	4,423,501	21,143,453	
銘 柄	数 < 比 率 >		88	89	—	<17.0% >	
(インド)			千インドルピー				
NESTLE INDIA LTD	35	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
ABB INDIA LTD	60	54	44,301	82,401	資本財		
ADANI ENTERPRISES LTD	191	180	55,017	102,332	資本財		
ADANI GREEN ENERGY LTD	326	326	59,956	111,518	公益事業		
ADANI TRANSMISSION LTD	282	—	—	—	公益事業		
ADANI TOTAL GAS LTD	302	—	—	—	公益事業		
ADANI POWER LTD	765	829	53,048	98,669	公益事業		
AMBUJA CEMENTS LIMITED	637	637	39,119	72,761	素材		
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	109	102	59,833	111,289	ヘルスケア機器・サービス		
APL APOLLO TUBES LTD	—	170	26,863	49,965	素材		
ASIAN PAINTS LTD	409	401	112,829	209,862	素材		
ACC LTD	77	—	—	—	素材		

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	
ASHOK LEYLAND LTD	—	1,453	29,263	54,429	資本財
ASTRAL LTD	—	121	26,771	49,794	資本財
AUROBINDO PHARMA LTD	272	272	31,520	58,627	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AU SMALL FINANCE BANK LTD	210	178	11,094	20,636	銀行
AVENUE SUPERMARTS LTD	166	166	77,416	143,995	生活必需品流通・小売り
AXIS BANK LTD	2,425	2,361	266,422	495,546	銀行
BANK OF BARODA	1,005	1,005	26,521	49,330	銀行
BAJAJ AUTO LTD	66	69	62,054	115,422	自動車・自動車部品
BAJAJ FINSERV LTD	406	385	60,549	112,622	金融サービス
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	28	28	24,278	45,157	金融サービス
BAJAJ FINANCE LTD	291	292	195,189	363,052	金融サービス
BANDHAN BANK LTD	742	742	14,098	26,222	銀行
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	79	79	19,981	37,166	自動車・自動車部品
BERGER PAINTS INDIA LTD	284	341	16,561	30,804	素材
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	952	784	49,035	91,205	エネルギー
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	—	1,050	30,591	56,900	資本財
BHARAT FORGE LTD	250	277	40,546	75,415	自動車・自動車部品
BHARTI AIRTEL LTD	2,369	2,311	302,789	563,189	電気通信サービス
INDUS TOWERS LTD	645	—	—	—	電気通信サービス
BHARAT ELECTRONICS LTD	4,160	3,909	91,021	169,299	資本財
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	112	112	56,919	105,870	食品・飲料・タバコ
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	455	471	58,021	107,919	金融サービス
CIPLA LTD	508	550	77,368	143,905	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COAL INDIA LTD	1,686	1,666	77,981	145,045	エネルギー
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	299	299	30,756	57,206	運輸
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	129	159	42,493	79,037	家庭用品・パーソナル用品
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	693	633	40,639	75,588	資本財
CUMMINS INDIA LTD	—	143	52,964	98,513	資本財
DABUR INDIA LTD	720	659	35,987	66,937	家庭用品・パーソナル用品
DIVI'S LABORATORIES LTD	138	128	49,980	92,963	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DLF LTD	588	750	61,965	115,254	不動産管理・開発
DR. REDDY'S LABORATORIES	122	121	71,263	132,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EICHER MOTORS LTD	151	145	67,834	126,171	自動車・自動車部品
GAIL INDIA LTD	2,678	2,348	47,148	87,696	公益事業
GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	—	2,410	20,183	37,541	運輸
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	415	415	53,685	99,854	家庭用品・パーソナル用品
GODREJ PROPERTIES LTD	124	127	35,829	66,643	不動産管理・開発
GRASIM INDUSTRIES LTD	297	272	64,598	120,152	素材
HAVELLS INDIA LTD	255	255	44,818	83,362	資本財
HCL TECHNOLOGIES LTD	1,020	972	129,664	241,175	ソフトウェア・サービス
HDFC BANK LIMITED	—	2,901	417,442	776,443	銀行
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	1,042	997	55,472	103,179	保険
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	85	31,977	59,478	金融サービス
HERO MOTOCORP LTD	126	118	59,777	111,185	自動車・自動車部品
HINDUSTAN UNILEVER LTD	874	835	194,018	360,874	家庭用品・パーソナル用品
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	1,517	1,378	90,125	167,633	素材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	613	613	31,101	57,848	エネルギー
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	—	220	92,137	171,375	資本財
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,840	—	—	—	金融サービス
ICICI BANK LTD	5,487	5,359	602,636	1,120,904	銀行
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	274	253	41,884	77,905	保険

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	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	355	355	20,508	38,145	保険
IDFC FIRST BANK LTD	—	3,905	30,029	55,854	銀行
INDUSIND BANK LTD	—	295	41,804	77,756	銀行
INDIAN HOTELS CO LTD	909	909	51,002	94,864	消費者サービス
INFOSYS LTD	3,605	3,432	487,423	906,607	ソフトウェア・サービス
INDIAN OIL CORP LTD	2,705	3,119	50,470	93,874	エネルギー
INTERGLOBE AVIATION LTD	93	172	74,269	138,140	運輸
INFO EDGE INDIA LTD	72	72	42,957	79,901	メディア・娯楽
INDRAPRASTHA GAS LTD	302	302	13,299	24,737	公益事業
INDIAN RAILWAY CATERING & TO ITC LTD	260 3,141	260 3,174	26,744 135,785	49,745 252,561	商業・専門サービス 食品・飲料・タバコ
JINDAL STEEL & POWER LTD	457	382	37,983	70,649	素材
JSW STEEL LTD	773	635	55,340	102,932	素材
JUBILANT FOODWORKS LTD	461	444	20,823	38,731	消費者サービス
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	594	1,124	185,599	345,214	銀行
LTIMINDTREE LTD	97	98	45,567	84,756	ソフトウェア・サービス
LARSEN & TOUBRO LTD	734	694	237,051	440,915	資本財
LUPIN LTD	208	208	34,240	63,687	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	919	959	220,836	410,756	自動車・自動車部品
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	127	147	188,062	349,795	自動車・自動車部品
MARICO LTD	630	557	32,952	61,290	食品・飲料・タバコ
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	—	798	66,252	123,229	ヘルスケア機器・サービス
MACROTECH DEVELOPERS LTD	—	247	29,379	54,645	不動産管理・開発
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN MPHASIS LTD	2,151 91	2,408 78	30,432 17,830	56,604 33,165	自動車・自動車部品 ソフトウェア・サービス
MRF LTD	2	2	29,312	54,521	自動車・自動車部品
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	584	541	72,461	134,779	運輸
MUTHOOT FINANCE LTD	146	130	21,813	40,572	金融サービス
NESTLE INDIA LTD	—	338	83,317	154,969	食品・飲料・タバコ
NMDC LTD	—	1,030	27,531	51,209	素材
NTPC LIMITED	4,037	4,469	161,495	300,381	公益事業
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,747	3,179	86,951	161,730	エネルギー
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	—	228	7,826	14,556	金融サービス
PAGE INDUSTRIES LTD	6	6	23,106	42,978	耐久消費財・アパレル
PETRONET LNG LTD	789	789	24,262	45,128	エネルギー
PERSISTENT SYSTEMS LTD	—	115	40,245	74,856	ソフトウェア・サービス
PIDILITE INDUSTRIES LTD	161	161	48,157	89,573	素材
PI INDUSTRIES LTD	77	86	31,843	59,229	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	3,490	4,775	150,367	279,683	公益事業
POWER FINANCE CORPORATION	—	1,574	68,712	127,806	金融サービス
POLYCAB INDIA LTD	—	46	29,812	55,451	資本財
PUNJAB NATIONAL BANK	—	2,230	27,718	51,557	銀行
RELIANCE INDUSTRIES LTD	3,249	3,145	890,842	1,656,967	エネルギー
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	—	2,958	104,669	194,685	金融サービス
REC LTD	—	1,397	73,859	137,378	金融サービス
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	492	470	67,271	125,125	保険
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	238	319	22,773	42,358	金融サービス
VEDANTA LTD	754	976	42,716	79,452	素材
SHRIRAM FINANCE LTD	249	293	68,054	126,582	金融サービス
SHREE CEMENT LTD	10	9	24,657	45,863	素材
SIEMENS LTD	77	89	63,646	118,382	資本財

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円		
SONA BLW PRECISION FORGINGS	—	405	24,484	45,540	自動車・自動車部品	
SRF LTD	166	156	35,718	66,436	素材	
STATE BANK OF INDIA	1,875	1,833	150,377	279,701	銀行	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	1,002	995	152,058	282,829	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SUPREME INDUSTRIES LTD	—	71	38,565	71,731	素材	
SUZLON ENERGY LTD	—	9,040	38,148	70,956	資本財	
TATA STEEL LTD	7,911	7,683	127,242	236,670	素材	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	970	929	360,718	670,935	ソフトウェア・サービス	
TATA POWER CO LTD	1,501	1,501	64,772	120,477	公益事業	
TATA MOTORS LTD	1,768	1,717	162,658	302,545	自動車・自動車部品	
TATA COMMUNICATIONS LTD	—	117	20,695	38,493	電気通信サービス	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	—	469	29,889	55,594	自動車・自動車部品	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	626	590	63,129	117,420	食品・飲料・タバコ	
TATA ELXSI LTD	34	34	25,133	46,748	ソフトウェア・サービス	
TECH MAHINDRA LTD	605	559	71,257	132,538	ソフトウェア・サービス	
TITAN CO LTD	384	362	118,550	220,503	耐久消費財・アパレル	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	104	104	27,602	51,339	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRENT LTD	190	190	86,058	160,068	一般消費財・サービス流通・小売り	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	113	113	42,942	79,872	自動車・自動車部品	
TVS MOTOR CO LTD	231	255	53,590	99,678	自動車・自動車部品	
ULTRATECH CEMENT LTD	104	123	118,830	221,024	素材	
UNITED SPIRITS LTD	296	296	34,851	64,824	食品・飲料・タバコ	
UNION BANK OF INDIA	—	1,480	20,564	38,250	銀行	
UPL LTD	572	534	27,503	51,155	素材	
VARUN BEVERAGES LTD	243	484	72,645	135,121	食品・飲料・タバコ	
WIPRO LTD	1,459	1,406	64,468	119,911	ソフトウェア・サービス	
YES BANK LTD	11,466	13,776	31,133	57,908	銀行	
ZOMATO LTD	3,158	6,273	120,441	224,021	消費者サービス	
小 計	株 数	金 額	110,324	149,590	11,217,467	20,864,489
	銘柄	数<比率>	114	136	—	<16.8%>
(サウジアラビア)					千サウジアラビアリヤル	
ACWA POWER CO	80	100	4,358	179,213	公益事業	
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	148	148	594	24,434	素材	
ADES HOLDING CO	—	329	588	24,215	エネルギー	
AL RAJHI BANK	2,103	2,005	16,067	660,692	銀行	
ALMARAI CO	266	243	1,336	54,947	食品・飲料・タバコ	
ALINMA BANK	1,045	1,270	3,990	164,075	銀行	
ARAB NATIONAL BANK	611	709	2,021	83,112	銀行	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	28	25	779	32,060	ソフトウェア・サービス	
BANK AL-JAZIRA	424	530	843	34,684	銀行	
BANK ALBILAD	523	624	2,190	90,091	銀行	
BANQUE SAUDI FRANSI	650	611	2,238	92,060	銀行	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	85	92	2,291	94,228	保険	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	—	85	1,218	50,122	保険	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	615	579	746	30,707	不動産管理・開発	
DALLAH HEALTHCARE CO	44	45	758	31,176	ヘルスケア機器・サービス	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	92	89	2,593	106,653	ヘルスケア機器・サービス	
ELM CO	27	25	2,182	89,729	ソフトウェア・サービス	
EMAAR ECONOMIC CITY	420	—	—	—	不動産管理・開発	
ETIHAD ETISALAT CO	389	389	1,994	82,024	電気通信サービス	
JARIR MARKETING CO	69	628	842	34,625	一般消費財・サービス流通・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		
(サウジアラビア)	百株	百株	千サウジアラビアリヤル	千円		
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	472	472	545	22,421	電気通信サービス	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	50	100	1,219	50,136	ヘルスケア機器・サービス	
THE SAUDI NATIONAL BANK	3,107	3,024	10,586	435,336	銀行	
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	382	—	—	—	素材	
NAHDI MEDICAL CO	39	39	538	22,163	生活必需品流通・小売り	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	—	73	480	19,772	公益事業	
RABIGH REFINING AND PETROCHE	381	—	—	—	エネルギー	
RIYAD BANK	1,423	1,530	4,016	165,158	銀行	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	234	240	2,640	108,556	素材	
SAUDI ARABIAN MINING CO	909	1,331	6,558	269,670	素材	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	965	932	7,425	305,352	素材	
SAUDI AWWAL BANK	982	1,039	4,158	170,976	銀行	
SAUDI ELECTRICITY CO	897	832	1,474	60,637	公益事業	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	380	380	827	34,015	素材	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	805	805	708	29,117	素材	
SAUDI TELECOM CO	1,575	2,019	7,654	314,751	電気通信サービス	
SAVOLA	329	268	1,232	50,675	食品・飲料・タバコ	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	383	383	1,222	50,278	素材	
SAUDI ARABIAN OIL CO	2,844	2,758	8,082	332,335	エネルギー	
SAUDI RESEARCH AND MARKETING	39	39	920	37,834	メディア・娯楽	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	48	48	1,165	47,922	金融サービス	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	527	658	860	35,383	銀行	
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	—	62	881	36,243	素材	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	274	281	1,048	43,121	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	24,681	25,860	111,885	4,600,717	
	銘柄 数 < 比 率 >	40	41	—	< 3.7% >	
(カタール)			千カタールリアル			
BARWA REAL ESTATE CO	2,147	2,147	645	27,290	不動産管理・開発	
COMMERCIAL BANK PQSC	3,531	3,424	1,406	59,512	銀行	
DUKHAN BANK	—	1,790	680	28,772	銀行	
INDUSTRIES QATAR	1,572	1,572	1,886	79,799	資本財	
MASRAF AL RAYAN	5,752	5,752	1,386	58,637	銀行	
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	4,738	4,738	816	34,551	素材	
OOREDOO QPSC	776	776	764	32,342	電気通信サービス	
QATAR NATIONAL BANK	4,964	4,921	6,781	286,865	銀行	
QATAR ISLAMIC BANK	1,821	1,815	3,198	135,276	銀行	
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	440	440	655	27,725	公益事業	
QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	2,486	3,097	1,300	55,021	エネルギー	
QATAR FUEL QSC	676	676	996	42,147	エネルギー	
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	1,009	1,161	1,173	49,650	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	29,914	32,311	21,692	917,594	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	13	—	< 0.7% >	
(クウェート)			千クウェートディナール			
AGILITY	1,505	—	—	—	運輸	
BOUBYAN BANK K. S. C	1,423	1,658	99	49,645	銀行	
GULF BANK	1,947	2,431	63	31,760	銀行	
KUWAIT FINANCE HOUSE	8,621	9,543	709	354,883	銀行	
MABANEE CO KPSC	676	717	57	28,904	不動産管理・開発	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	2,547	2,184	103	51,589	電気通信サービス	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	価 値		
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(クウェート)	百株	百株	千クウェートディナール	千円	
NATIONAL BANK OF KUWAIT	7,991	8,217	724	362,722	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,714 7	24,753 6	1,757 —	879,505 <0.7%>
(エジプト)			千エジプトポンド		
COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN EASTERN CO	2,682 1,325	— —	— —	— —	銀行 食品・飲料・タバコ
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,007 2	— —	— —	— <—%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
ABSA GROUP LTD	891	891	13,695	115,591	銀行
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	132	—	—	—	素材
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	52	66	5,028	42,438	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	452	—	—	—	素材
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	—	436	19,665	165,979	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	422	396	9,130	77,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIDVEST GROUP LTD	345	302	7,988	67,421	資本財
BID CORP LTD	347	347	15,380	129,811	生活必需品流通・小売り
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	92	91	20,673	174,480	銀行
CLICKS GROUP LTD	239	260	8,068	68,099	生活必需品流通・小売り
DISCOVERY LTD	518	550	6,163	52,023	保険
EXXARO RESOURCES LTD	304	249	4,620	38,993	エネルギー
FIRSTSTRAND LTD	5,294	5,234	35,404	298,810	金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	330	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
GOLD FIELDS LTD	952	936	28,923	244,116	素材
HARMONY GOLD MINING CO LTD	613	575	9,952	84,000	素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	940	933	9,641	81,373	素材
KUMBA IRON ORE LTD	70	70	3,756	31,703	素材
MR PRICE GROUP LTD	275	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
MTN GROUP LTD	1,822	1,774	15,339	129,468	電気通信サービス
MULTICHOICE GROUP LTD	445	—	—	—	メディア・娯楽
NASPERS LTD-N SHS	232	188	75,973	641,217	一般消費財・サービス流通・小売り
NEDBANK GROUP LTD	493	487	11,703	98,781	銀行
NEPI ROCKCASTLE N.V.	472	496	6,327	53,405	不動産管理・開発
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	338	364	5,286	44,616	素材
OLD MUTUAL LTD	5,528	5,083	5,663	47,798	保険
PEPKOR HOLDINGS LTD	2,356	1,938	3,719	31,396	一般消費財・サービス流通・小売り
REINET INVESTMENTS SCA	150	131	5,930	50,054	金融サービス
REMGRO LTD	622	553	6,940	58,581	金融サービス
OUTSURANCE GROUP LTD	1,008	972	4,063	34,299	保険
SANLAM LTD	1,817	1,817	13,095	110,529	保険
SASOL LTD	623	600	7,982	67,371	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD	530	504	13,065	110,270	生活必需品流通・小売り
SIBANYE STILLWATER LTD	2,928	2,928	6,931	58,500	素材
STANDARD BANK GROUP LTD	1,403	1,369	25,793	217,694	銀行
VODACOM GROUP LTD	710	628	5,903	49,829	電気通信サービス
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	1,021	955	5,906	49,851	一般消費財・サービス流通・小売り
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	34,783 36	32,141 32	417,721 —	3,525,572 <2.8%>
(アラブ首長国連邦)			千アラブディルハム		
DUBAI ISLAMIC BANK	2,947	3,166	1,773	74,436	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	7,209	6,764	5,337	224,055	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	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千アラブディルハム	千円	
EMIRATES NBD PJSC	1,979	2,010	3,317	139,275	銀行
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	3,091	2,915	2,448	102,793	銀行
ABU DHABI ISLAMIC BANK	1,630	1,500	1,770	74,329	銀行
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	3,229	3,229	1,094	45,952	一般消費財・サービス流通・小売り
ALDAR PROPERTIES PJSC	4,020	4,189	2,362	99,193	不動産管理・開発
AMERICANA RESTAURANTS INTERN	—	2,500	810	34,003	消費者サービス
EMIRATES TELECOM GROUP CO	3,724	3,637	5,892	247,364	電気通信サービス
MULTIPLY GROUP	3,558	4,021	920	38,655	資本財
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	4,768	4,578	5,585	234,465	銀行
Q HOLDING PJSC	2,410	—	—	—	資本財
小 計	株 数	金 額			
銘 柄 数 < 比 率 >	11	11	—	< 1.1% >	
(中国オフショア)			千香港・オフショア人民元		
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	645	645	548	11,723	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	41	58	758	16,206	半導体・半導体製造装置
AECC AVIATION POWER CO-A	241	241	877	18,746	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	6,726	6,726	2,919	62,346	銀行
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	509	661	834	17,823	ヘルスケア機器・サービス
AIR CHINA LTD-A	615	1,100	796	17,009	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	1,172	1,172	891	19,049	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	342	342	832	17,771	素材
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	89	45	190	4,066	食品・飲料・タバコ
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	32	32	842	17,984	食品・飲料・タバコ
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	50	50	361	7,727	食品・飲料・タバコ
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	19	32	262	5,612	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OVCTEK CHINA INC-A	67	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	1,414	707	212	4,545	金融サービス
AVICOPTER PLC-A	94	94	410	8,767	資本財
BANK OF NINGBO CO LTD -A	454	454	1,128	24,099	銀行
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	2,062	2,062	1,426	30,476	素材
BANK OF NANJING CO LTD -A	791	791	757	16,187	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	557	557	772	16,506	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3,135	3,135	2,166	46,268	銀行
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	1,400	1,699	1,386	29,612	銀行
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	714	1,343	1,016	21,718	銀行
BANK OF BEIJING CO LTD -A	2,009	1,999	1,137	24,296	銀行
BANK OF CHINA LTD-A	1,808	1,808	802	17,145	銀行
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	380	380	611	13,050	銀行
BBMG CORPORATION-A	1,314	—	—	—	素材
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	274	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	227	227	202	4,334	メディア・娯楽
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	520	520	247	5,275	食品・飲料・タバコ
BEIJING TONGRENTANG CO-A	—	130	613	13,111	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	122	122	435	9,304	資本財
KUNLUN TECH CO LTD-A	—	64	236	5,061	メディア・娯楽
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	—	4,641	2,422	51,742	運輸
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	42	42	1,174	25,080	ソフトウェア・サービス
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	40	56	375	8,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGI GENOMICS CO LTD-A	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	3,207	3,207	1,388	29,659	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BYD CO LTD -A	128	128	2,804	59,909	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千円	千円	
BY-HEALTH CO LTD-A	255	255	405	8,659	家庭用品・パーソナル用品
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	735	735	548	11,723	金融サービス
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	—	39	682	14,572	半導体・半導体製造装置
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	692	692	1,010	21,573	金融サービス
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	3,871	4,399	1,390	29,689	銀行
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	477	907	638	13,637	銀行
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	610	610	619	13,240	不動産管理・開発
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	2,147	2,147	1,359	29,029	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A	752	752	581	12,415	不動産管理・開発
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	533	533	1,455	31,085	保険
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	654	654	934	19,957	自動車・自動車部品
CHANGCHUN HIGH-TECH INDUST-A	33	33	379	8,101	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA STATE CONSTRUCTION-A	3,240	3,240	1,788	38,198	資本財
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	1,392	1,392	1,270	27,144	素材
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,249	1,785	1,618	34,578	公益事業
CHINA NORTHERN RARE EARTH-A	381	381	754	16,112	素材
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	1,850	1,850	1,230	26,276	資本財
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	1,359	1,695	4,319	92,248	公益事業
CHINA MERCHANTS BANK-A	1,538	1,544	5,412	115,592	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	1,283	3,352	1,300	27,778	銀行
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	714	714	401	8,570	運輸
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	871	871	492	10,529	金融サービス
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,137	1,617	616	13,158	運輸
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	488	488	380	8,129	資本財
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	23	23	301	6,439	自動車・自動車部品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	128	192	661	14,131	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	125	185	1,358	29,014	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	228	228	723	15,452	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	494	494	1,984	42,383	エネルギー
CHINA UNITED NETWORK-A	2,170	2,170	996	21,273	電気通信サービス
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	97	97	619	13,234	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	231	231	212	4,539	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	577	577	567	12,114	エネルギー
CHINA JUSHI CO LTD -A	262	262	328	7,018	素材
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	409	409	1,511	32,277	資本財
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	1,800	2,707	1,264	27,000	公益事業
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	3,082	3,082	684	14,613	資本財
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-A	—	229	756	16,164	金融サービス
CITIC SECURITIES CO-A	949	949	1,780	38,032	金融サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,037	1,037	1,480	31,631	運輸
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	297	297	5,877	125,529	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	236	236	421	9,007	エネルギー
CRRC CORP LTD-A	2,312	2,312	1,662	35,504	資本財
CSC FINANCIAL CO LTD-A	298	410	898	19,186	金融サービス
DAQIN RAILWAY CO LTD-A	1,358	1,358	961	20,535	運輸
DHC SOFTWARE CO LTD -A	482	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DONGXING SECURITIES CO LT-A	435	435	375	8,027	金融サービス
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	217	217	377	8,059	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	1,238	1,238	1,574	33,625	金融サービス
EVE ENERGY CO LTD-A	173	173	650	13,885	資本財
EVERBRIGHT SECURITIE CO-A	308	308	498	10,650	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	
(中国オフショア)	百株	百株	千円	千円	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	600	600	306	6,542	資本財
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	552	552	307	6,566	金融サービス
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,432	1,281	883	18,878	メディア・娯楽
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING-A	257	308	1,170	24,990	食品・飲料・タバコ
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	671	1,049	2,549	54,443	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	150	150	165	3,533	不動産管理・開発
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	—	189	955	20,405	自動車・自動車部品
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	1,119	1,686	893	19,085	公益事業
GEM CO LTD-A	554	554	373	7,986	素材
GEMDALE CORP-A	561	—	—	—	不動産管理・開発
GF SECURITIES CO LTD-A	467	467	608	12,996	金融サービス
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	53	53	448	9,578	半導体・半導体製造装置
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	35	35	210	4,503	資本財
GOERTEK INC -A	357	357	601	12,847	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	181	181	773	16,530	耐久消費財・アパレル
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	478	478	531	11,360	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	689	689	465	9,933	金融サービス
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	141	141	262	5,598	資本財
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	593	593	520	11,110	金融サービス
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	691	691	949	20,289	金融サービス
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	37	37	133	2,840	ヘルスケア機器・サービス
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	131	131	430	9,202	ヘルスケア機器・サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	146	146	766	16,371	食品・飲料・タバコ
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	363	363	381	8,148	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	166	166	350	7,480	素材
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	465	465	359	7,677	エネルギー
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	94	94	245	5,238	耐久消費財・アパレル
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	174	174	455	9,733	メディア・娯楽
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	—	4,084	563	12,037	運輸
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	882	882	727	15,541	金融サービス
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	34	34	193	4,131	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	105	147	389	8,317	半導体・半導体製造装置
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	316	316	817	17,462	食品・飲料・タバコ
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	509	665	1,052	22,473	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	—	44	510	10,905	金融サービス
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	130	130	373	7,986	資本財
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	74	74	375	8,022	素材
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	681	681	935	19,970	金融サービス
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	176	176	363	7,754	ソフトウェア・サービス
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	209	209	414	8,860	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,260	1,254	846	18,084	銀行
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS-A	182	294	485	10,373	自動車・自動車部品
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	52	52	554	11,832	自動車・自動車部品
HUANENG POWER INTL INC-A	—	869	792	16,927	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-A	719	719	496	10,611	公益事業
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	414	—	—	—	金融サービス
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	—	91	652	13,925	半導体・半導体製造装置
IFLYTEK CO LTD-A	174	174	748	15,980	ソフトウェア・サービス
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	13	18	398	8,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	543	543	1,509	32,241	食品・飲料・タバコ
IND & COMM BK OF CHINA-A	3,841	3,841	2,066	44,136	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	
(中国オフショア)	百株	百株	千円	千円	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	1,528	1,528	2,599	55,520	銀行
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	686	686	379	8,107	金融サービス
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	4,387	4,387	697	14,901	素材
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	145	133	525	11,216	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	665	665	287	6,135	素材
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	58	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	256	256	364	7,789	半導体・半導体製造装置
JIANGSU YANGHE DISTILLERY-A	103	103	994	21,244	食品・飲料・タバコ
JIANGSU HENGRIU MEDICINE C-A	476	476	2,129	45,483	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	118	118	633	13,523	資本財
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	100	100	396	8,468	ヘルスケア機器・サービス
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	161	161	562	12,018	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A	206	206	553	11,813	素材
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	116	116	647	13,829	食品・飲料・タバコ
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	308	308	452	9,670	資本財
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	326	588	572	12,219	素材
JINKO SOLAR CO LTD-A	-	630	487	10,414	半導体・半導体製造装置
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	56	56	158	3,390	食品・飲料・タバコ
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	196	410	338	7,237	ヘルスケア機器・サービス
LINGYI ITECH GUANGDONG CO-A	450	450	219	4,690	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	82	81	13,872	296,282	食品・飲料・タバコ
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	411	411	593	12,675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	160	160	259	5,540	ヘルスケア機器・サービス
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	542	542	1,012	21,626	半導体・半導体製造装置
LB GROUP CO LTD-A	148	148	318	6,808	素材
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	515	515	1,580	33,763	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	96	96	1,735	37,075	食品・飲料・タバコ
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	48	48	425	9,087	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	232	232	107	2,301	ヘルスケア機器・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,575	1,575	526	11,235	資本財
MIDEA GROUP CO LTD-A	-	205	1,430	30,544	耐久消費財・アパレル
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	344	344	1,608	34,348	食品・飲料・タバコ
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	44	44	1,276	27,257	半導体・半導体製造装置
NAVINFO CO LTD-A	303	-	-	-	ソフトウェア・サービス
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	542	650	1,532	32,734	資本財
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	210	210	286	6,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	150	150	481	10,277	保険
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	417	417	396	8,476	食品・飲料・タバコ
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	77	77	457	9,762	自動車・自動車部品
NINESTAR CORP-A	168	168	448	9,587	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGBO JOYSON ELECTRONIC-A	118	118	199	4,254	自動車・自動車部品
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	675	675	1,134	24,220	素材
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	13	23	221	4,720	資本財
OPPEIN HOME GROUP INC-A	37	37	260	5,573	耐久消費財・アパレル
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	601	601	499	10,677	金融サービス
PERFECT WORLD CO LTD-A	153	153	151	3,231	メディア・娯楽
PETROCHINA CO LTD-A	1,662	1,662	1,644	35,113	エネルギー
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	69	103	230	4,916	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PING AN BANK CO LTD-A	1,476	1,476	1,598	34,151	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	766	766	3,207	68,503	保険
PICC HOLDING CO-A	779	779	417	8,918	保険

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	
(中国オフショア)	百株	百株	千円	千円	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	847	847	836	17,866	不動産管理・開発
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,227	1,227	641	13,706	資本財
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	2,797	1,725	852	18,200	銀行
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	10	-	-	-	資本財
HAIER SMART HOME CO LTD-A	531	531	1,723	36,813	耐久消費財・アパレル
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	500	500	892	19,051	素材
RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	778	778	845	18,062	素材
S F HOLDING CO LTD-A	322	322	1,180	25,212	運輸
SAIC MOTOR CORP LTD-A	642	642	928	19,827	自動車・自動車部品
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	-	472	573	12,258	半導体・半導体製造装置
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	691	691	1,160	24,794	資本財
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	38	38	199	4,265	ソフトウェア・サービス
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	-	705	1,120	23,926	公益事業
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	703	-	-	-	金融サービス
SERES GROUP CO L-A	-	144	1,223	26,130	自動車・自動車部品
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1,855	1,855	1,463	31,263	銀行
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	179	179	333	7,114	ヘルスケア機器・サービス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	84	84	2,203	47,061	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	239	125	767	16,387	資本財
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,200	2,200	1,014	21,661	金融サービス
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	764	764	208	4,460	不動産管理・開発
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	737	737	1,813	38,723	エネルギー
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	272	272	849	18,143	素材
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	207	207	490	10,473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	113	113	411	8,790	運輸
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	190	229	892	19,054	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	175	175	310	6,621	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	92	92	183	3,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	77	77	2,412	51,520	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	70	70	201	4,293	消費者サービス
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	877	877	207	4,439	資本財
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	1,217	1,217	528	11,280	資本財
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	240	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	125	125	286	6,127	自動車・自動車部品
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	54	54	212	4,548	商業・専門サービス
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	307	307	180	3,862	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	153	153	448	9,583	素材
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	1,450	1,450	533	11,396	素材
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	322	322	192	4,112	一般消費財・サービス流通・小売り
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	655	655	486	10,394	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	74	68	973	20,791	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	306	537	576	12,306	エネルギー
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	122	170	204	4,359	半導体・半導体製造装置
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	-	39	519	11,095	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	437	421	713	15,247	公益事業
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	63	63	289	6,185	食品・飲料・タバコ
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	173	173	177	3,784	消費者サービス
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	889	889	347	7,424	金融サービス
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	799	799	527	11,268	金融サービス
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	13	13	169	3,610	半導体・半導体製造装置
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	131	131	1,377	29,423	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千円	千円	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	253	253	393	8,408	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	122	122	180	3,851	資本財
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	16	25	319	6,820	半導体・半導体製造装置
TBEA CO LTD-A	395	513	752	16,078	資本財
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	1,729	1,729	790	16,878	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	275	275	222	4,751	半導体・半導体製造装置
TIANQI LITHIUM CORP-A	135	135	516	11,023	素材
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	244	305	321	6,872	半導体・半導体製造装置
TIANMA MICROELECTRONICS-A	323	323	250	5,353	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	334	334	743	15,879	半導体・半導体製造装置
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	34	34	217	4,641	ヘルスケア機器・サービス
TONGKUN GROUP CO LTD-A	146	146	222	4,761	素材
TRINA SOLAR CO LTD-A	162	162	340	7,281	半導体・半導体製造装置
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	66	66	568	12,146	食品・飲料・タバコ
UNISPLENDOR CORP LTD-A	—	270	548	11,713	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	65	65	372	7,961	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	225	225	1,995	42,625	素材
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	148	148	212	4,545	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEICHAI POWER CO LTD-A	575	575	1,033	22,081	資本財
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	552	552	388	8,300	金融サービス
WENS FOODSTUFFS GROUP CO-A	430	430	901	19,248	食品・飲料・タバコ
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	83	83	218	4,664	素材
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	101	101	1,038	22,183	半導体・半導体製造装置
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	123	123	381	8,157	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	255	255	3,859	82,441	食品・飲料・タバコ
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	173	173	296	6,325	メディア・娯楽
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	298	149	476	10,171	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTEC CO LTD-A	194	194	881	18,821	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	195	253	170	3,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	679	679	333	7,120	一般消費財・サービス流通・小売り
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	—	1,117	869	18,560	資本財
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	439	439	346	7,397	資本財
XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	—	168	404	8,630	半導体・半導体製造装置
YANTAI JEREH OILFIELD-A	149	149	502	10,731	エネルギー
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	241	361	860	18,376	エネルギー
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	54	76	294	6,282	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	51	71	323	6,898	生活必需品流通・小売り
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	133	133	417	8,919	食品・飲料・タバコ
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	315	315	361	7,714	ソフトウェア・サービス
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	127	127	707	15,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C-A	83	83	339	7,259	素材
YUNDA HOLDING CO LTD-A	245	245	201	4,297	運輸
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	116	116	202	4,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	280	280	487	10,405	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANL-A	135	135	438	9,373	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	201	201	415	8,882	資本財
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	72	72	1,200	25,645	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	151	151	432	9,228	素材
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	244	244	495	10,587	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	64	64	384	8,212	耐久消費財・アパレル
ZHANGZHOU PIENITZEHUANG PHA-A	49	49	1,164	24,874	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	当 期		業 種 等
		株数	評 価 額	
(中国オフショア)	百株	百株	千円	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	438	438	528	金融サービス
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	582	582	245	メディア・娯楽
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	1,546	1,546	2,829	素材
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	490	490	425	資本財
ZTE CORP-A	361	361	1,017	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	160,420	177,612	241,782	5,164,056
株数・金額	279	286	—	<4.2%>
銘柄数<比率>	6,168,321	7,218,613	—	120,137,812
株数・金額	1,206	1,186	—	<96.8%>
銘柄数<比率>				

(注) 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) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
インド	千インドルピー 368	千インドルピー 0	千円 0	% 0.0	% —	% —	% —	% —
合 計	368	0	0	0.0	—	—	—	—

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
インド		%	千インドルピー	千インドルピー	千円		
	普通社債券 (含む投資法人債券)	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5.5	368	0	0	2024/6/3
合 計					0		

(注) 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。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				比 率
		口 数	口 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)		口	口	千メキシコペソ	千円	%
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	317,500		299,900	7,611	70,239	0.1
OPERADORA DE SITES MEX- A-1XXX	180,500		—	—	—	—
PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	—		72,738	4,822	44,502	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	498,000	372,638	12,433	114,742	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	329,830		—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	329,830	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	827,830	372,638	—	114,742	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	2	—	<0.1%>	

(注) 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) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 株式先物取引 MINMSCIE	百万円 3,901	百万円 —

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2024年5月16日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	120,137,812	96.6
投資証券	114,742	0.1
コール・ローン等、その他	4,174,429	3.3
投資信託財産総額	124,426,983	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（124,343,862千円）の投資信託財産総額（124,426,983千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 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。1アメリカドル=153.94円、1メキシコペソ=9.2281円、1ブラジルレアル=29.9511円、1チリペソ=0.169982円、1コロンビアペソ=0.040235円、1ユーロ=167.67円、1イギリスポンド=195.43円、1トルコリラ=4.7864円、1チェココルナ=6.7803円、1ハンガリーフォリント=0.434929円、1ポーランドズロチ=39.342円、1香港ドル=19.72円、1マレーシアリングギット=32.8667円、1タイバーツ=4.25円、1フィリピンペソ=2.6751円、1インドネシアルピア=0.0096円、1韓国ウォン=0.1142円、1新台湾ドル=4.7798円、1インドルピー=1.86円、1サウジアラビアリヤル=41.12円、1カタールリアル=42.30円、1クウェートディナール=500.46円、1エジプトポンド=3.2854円、1南アフリカランド=8.44円、1アラブディルハム=41.98円、1香港・オフショア人民元=21.3583円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年5月16日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	124,751,047,065	
コール・ローン等	290,274,775	
株式(評価額)	120,137,812,589	
投資証券(評価額)	114,742,116	
未収入金	520,991,068	
未収配当金	224,980,032	
未収利息	34,283	
差入委託証拠金	3,462,212,202	
(B) 負債	609,957,100	
未払金	324,104,100	
未払解約金	285,853,000	
(C) 純資産総額(A-B)	124,141,089,965	
元本	42,921,270,031	
次期繰越損益金	81,219,819,934	
(D) 受益権総口数	42,921,270,031口	
1万口当たり基準価額(C/D)	28,923円	

(注) 当ファンドの期首元本額は44,148,290,863円、期中追加設定元本額は8,686,359,432円、期中一部解約元本額は9,913,380,264円です。

(注) 2024年5月16日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式 19,924,750,782円
- ・グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け） 17,210,582,934円
- ・インデックスファンド新興国株式（適格機関投資家向け） 3,103,483,723円
- ・日興五大陸株式ファンド 1,830,911,786円
- ・インデックスファンドMSCIオール・カンントリー（全世界株式） 713,307,052円
- ・Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式） 133,248,678円
- ・Tracers グローバル3分法（おとなのバランス） 3,657,028円
- ・Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型） 910,528円
- ・Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型） 417,520円

(注) 1口当たり純資産額は2,8923円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年5月17日から2024年5月16日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

○損益の状況（2023年5月17日～2024年5月16日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	3,199,736,820	
受取配当金	2,946,148,886	
受取利息	90,401	
その他収益金	253,559,016	
支払利息	△ 61,483	
(B) 有価証券売買損益	25,566,540,979	
売買益	33,717,014,958	
売買損	△ 8,150,473,979	
(C) 先物取引等取引損益	224,193,725	
取引益	795,870,689	
取引損	△ 571,676,964	
(D) 保管費用等	△ 189,165,230	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	28,801,306,294	
(F) 前期繰越損益金	54,730,051,498	
(G) 追加信託差損益金	12,423,117,320	
(H) 解約差損益金	△14,734,655,178	
(I) 計(E+F+G+H)	81,219,819,934	
次期繰越損益金(I)	81,219,819,934	

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

(注) 損益の状況の中で(H)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。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2024年6月17日）
（2023年6月16日～2024年6月17日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2005年6月30日から原則無期限です。
運用方針	主として日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、「S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）」と連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主要運用対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、「S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）」に連動した投資成果をめざします。
不動産投資信託の組入比率は、高位を維持することを基本とします。
外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。
ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<936472>

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		投資信託 組入比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円
15期(2020年6月15日)	18,451	△15.0	174.14	△15.6	99.1	123,251
16期(2021年6月15日)	26,113	41.5	245.18	40.8	99.4	81,352
17期(2022年6月15日)	27,245	4.3	253.60	3.4	98.2	54,462
18期(2023年6月15日)	28,616	5.0	265.31	4.6	99.6	57,457
19期(2024年6月17日)	34,217	19.6	314.59	18.6	99.1	56,436

(注)「S & P 先進国REIT指数(除く日本)」は、「スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エルエルシー(S & P社)」が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。同指数の(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2024年6月17日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		S & P 先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		投資信託 組入比率
	騰落	率	騰落	率	
(期首) 2023年6月15日	円	%		%	%
6月末	28,616	—	265.31	—	99.6
7月末	29,405	2.8	272.31	2.6	99.0
8月末	29,568	3.3	273.71	3.2	99.5
9月末	30,023	4.9	277.81	4.7	99.3
10月末	28,349	△0.9	261.72	△1.4	98.9
11月末	26,722	△6.6	246.55	△7.1	99.5
12月末	29,490	3.1	272.10	2.6	99.5
2024年1月末	31,842	11.3	294.08	10.8	99.0
2月末	31,587	10.4	291.24	9.8	99.1
3月末	32,144	12.3	296.38	11.7	99.0
4月末	33,396	16.7	307.65	16.0	98.7
5月末	32,823	14.7	302.02	13.8	97.2
5月末	33,368	16.6	306.99	15.7	99.4
(期末) 2024年6月17日					
	34,217	19.6	314.59	18.6	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2023年6月16日～2024年6月17日）

基準価額の推移

期間の初め28,616円の基準価額は、期間末に34,217円となり、騰落率は+19.6%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）議長が利下げを巡る議論を始めたことを受けて、FRBが2024年に複数回にわたり利下げを行なうとの観測が強まり米国の長期金利が総じて低下したこと（2023年11月上旬～12月下旬）。
- ・欧州中央銀行（ECB）やカナダの中央銀行が利下げを決定したことや、市場予想を下回る米国のインフレ指標などを受けてFRBによる利下げへの期待が高まり米国をはじめとする主要国の長期金利が低下したこと（2024年6月上旬～期間末）。
- ・米国の主要REIT決算が概ね堅調な内容となったこと。

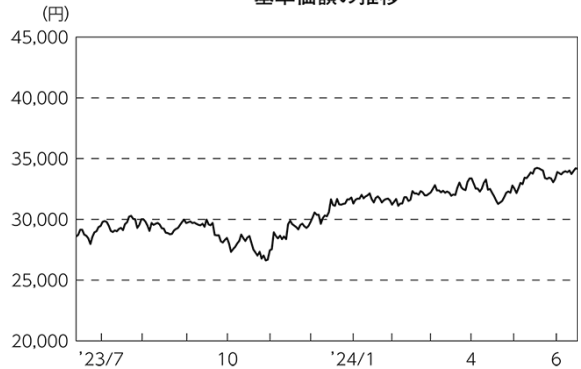
<値下がり要因>

- ・格付け会社が米国国債の格付けを引き下げたことや、米国連邦公開市場委員会（FOMC）の結果を受けて米国の金融引き締めが長期化する見方が改めて広がり米国の長期金利が上昇したこと（期間の初め～2023年10月下旬）。
- ・中東情勢の緊迫化などからリスク回避姿勢が強まったこと。

（海外不動産投資信託市況）

海外のREIT市場では、S&P先進国REIT指数（除く日本）は期間の初めと比べて上昇しました。期間の初めから2023年10月下旬にかけては、格付け会社が米国国債の格付けを引き下げたことや、FOMCの結果を受けて米国の金融引き締めが長期化する見方が改めて広がり米国の長期金利が上昇したこと、米国連邦議会で政府の予算案を巡る協議が難航し政府機関の一部が閉鎖される懸念が高まったことなどが重しとなり、同指数は下落しました。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2023/06/15	2024/05/20	2023/10/30	2024/06/17
28,616円	34,271円	26,637円	34,217円

S&P先進国REIT指数
（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）（指数化）の推移



11月上旬から12月下旬にかけては、米国の雇用統計で非農業部門の雇用者数が市場予想を下回ったことや、FRB議長が利下げを巡る議論を始めたことと明言したことを受けて、FRBが2024年に複数回にわたり利下げを行なうとの観測が強まり米国の長期金利が総じて低下したことなどから、同指数は上昇しました。

2024年1月上旬から5月下旬にかけては、米国の主要REIT決算が概ね堅調な内容となったことや、世界的な人工知能（AI）の導入の加速とともにAI関連企業の業績拡大および米国経済のソフトランディング（軟着陸）への期待が高まり株式市場が上昇したことがREIT価格の支援材料となったものの、FRB議長がFOMC後の記者会見で金融緩和に慎重な考えを示したことを受けてFRBによる政策金利の早期引き下げ観測が後退したことや、米国の景況感に関する経済指標などが市場予想を上回り米国の景気減速への懸念が後退し米国の長期金利が上昇したこと、中東情勢の緊迫化などからリスク回避姿勢が強まったことなどが重しとなり、同指数は下落しました。

6月上旬から期間末にかけては、ECBやカナダの中央銀行が利下げを決定したことや、市場予想を下回る米国のインフレ指標などを受けてFRBによる利下げへの期待が高まり米国をはじめとする主要国の長期金利が低下したこと、株式市場が上昇したことなどが支援材料となり、同指数は上昇しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



ポートフォリオ

ポートフォリオは、リスクコントロールモデルなどを使用し、ベンチマーク採用国の時価総額ウェイトなどを考慮したうえで、米国・オーストラリア・イギリス・フランス・オランダ・カナダ・シンガポール・香港・ベルギー・ニュージーランド・ドイツ・イタリア・スペイン・アイルランド・イスラエル・韓国などのREITで構築しました。また、ベンチマーク採用銘柄の入れ替えなどに対応するため、随時ポートフォリオの見直しを行ないました。

（組入比率）

未収配当金などを考慮したうえで、海外REITの組入比率が高位となるように調整を行ないました。

（為替ヘッジ）

外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、外貨エクスポージャーを高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、19.6%の値上がりとなり、ベンチマークである「S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）」の上昇率18.6%を概ね1.0%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異が寄与したこと。

<マイナス要因>

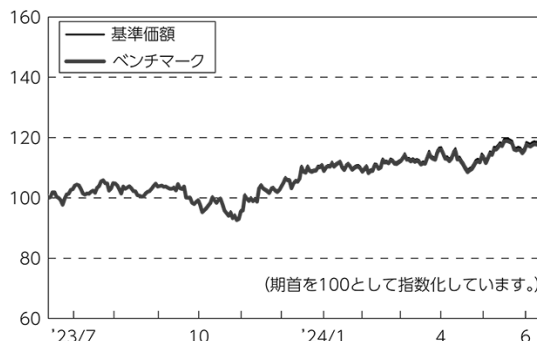
- ・REITの組入比率による要因が影響したこと。
- ・売買手数料や海外口座管理費用などのコストが発生したこと。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークである「S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）」との連動をめざし、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した海外REITポートフォリオへの投資を継続するとともに、海外REITの組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は原則として為替ヘッジを行わず、高位の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○1万口当たりの費用明細

（2023年6月16日～2024年6月17日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 4 (4)	% 0.013 (0.013)	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券)	2 (2)	0.006 (0.006)	(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)	18 (15) (3)	0.059 (0.049) (0.010)	(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、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	24	0.078	
期中の平均基準価額は、30,726円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2023年6月16日～2024年6月17日)

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
ACADIA REALTY TRUST	5,492	86	8,958	140
AGREE REALTY CORPORATION	5,781	364	7,389	451
ALEXANDER & BALDWIN INC	1,564	30	6,106	107
ALEXANDER'S INC	62	11	248	48
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	4,296	505	13,000	1,512
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,095	17	2,210	37
AMERICAN ASSETS TRUST INC	—	—	3,978	83
PROLOGIS INC	23,576	2,848	74,310	8,841
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	10,239	368	24,165	855
AMERICOLD REALTY TRUST INC	10,244	315	25,892	778
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	3,632	26	5,287	37
	(△ 40,796)	(△ 288)		
APPLE HOSPITALITY REIT INC	6,138	94	17,684	273
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	—	—	13,941	108
APARTMENT INCOME REIT CO	3,632	124	12,896	452
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	—	—	2,869	34
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	—	3,792	10
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	3,185	11	9,401	29
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,803	715	11,004	2,026
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	—	1,014	14
BOSTON PROPERTIES INC	3,948	248	11,339	699
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,912	176	23,970	524
BRANDYWINE REALTY TRUST	10,170	44	19,563	88
BRT APARTMENTS CORP	—	—	772	15
BROADSTONE NET LEASE INC-A	7,781	127	13,671	213
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,780	295	9,715	1,013
CARETRUST REIT INC	12,620	282	9,792	211
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,596	35	2,820	63
CHATHAM LODGING TRUST	2,726	25	5,463	53
CLIPPER REALTY INC	—	—	1,958	10
COPT DEFENSE PROPERTIES	2,414	61	8,817	216
COUSINS PROPERTIES INC	3,430	80	11,866	268
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	961	27	1,784	51
CTO REALTY GROWTH INC	667	11	2,214	38
SITE CENTERS CORP	5,439	73	15,996	215
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	5,128	41	16,639	139
DIGITAL REALTY TRUST INC	16,273	2,137	22,724	2,880
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	139,224	79	29,300	18
	(—)	(△ 3)	(—)	(0.914)

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
DOUGLAS EMMETT INC	3,808	51	15,997	213
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	4,773	64	9,168	116
EASTGROUP PROPERTIES INC	2,133	381	3,443	591
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	3,304	26	10,302	91
EPR PROPERTIES	1,803	80	5,806	253
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,855	533	14,353	949
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	9,409	610	26,960	1,707
EQUINIX INC	2,398	1,899	7,148	5,473
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	6,875	168	10,985	268
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,657	393	5,328	1,263
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,403	738	14,931	2,047
	(22,715)	(3,248)		
FARMLAND PARTNERS INC	1,048	11	6,172	70
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,919	192	5,844	572
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	3,471	176	10,744	544
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,830	98	6,670	162
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	8,667	414	20,194	936
GETTY REALTY CORPORATION	2,811	88	3,769	109
GLOBAL NET LEASE INC	3,331	30	12,312	109
	(27,333)	(288)		
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,397	16	2,845	36
GLADSTONE LAND CORP	1,786	29	3,424	50
GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,777	27	7,397	72
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	14,089	286	46,925	924
	(45,491)	(976)		
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	9,836	174	30,824	526
WELLTOWER INC	35,331	2,963	39,847	3,455
HERSHA HOSPITALITY TRUST	—	—	1,161	11
			(9,863)	(59)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,316	56	8,101	190
SERVICE PROPERTIES TRUST	3,787	33	13,216	104
HOST HOTELS & RESORTS INC	18,344	313	59,987	1,066
EQUITY COMMONWEALTH	3,388	67	9,015	174
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	8,533	47	14,389	81
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,421	76	16,450	271
CENTERSPACE	—	—	901	56
INVITATION HOMES INC	14,925	515	48,526	1,647
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	3,168	12	10,088	38
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	647	50	2,124	179
INDUS REALTY TRUST INC	—	—	—	—
			(1,721)	(115)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	1,675	41	5,238	126
IRON MOUNTAIN INC	7,512	471	23,193	1,500
JBG SMITH PROPERTIES	2,702	40	11,659	183

外

国

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	-	-	46,700	15
	(-)	(△ 2)		
KILROY REALTY CORPORATION	3,343	112	8,756	297
KIMCO REALTY CORP	16,298	322	50,832	980
	(13,409)	(229)		
KITE REALTY GROUP TRUST	5,894	132	17,650	382
LXP INDUSTRIAL TRUST	10,527	107	22,020	205
LTC PROPERTIES INC	1,209	40	3,266	107
MACERICH CO/THE	5,161	65	17,728	232
VERIS RESIDENTIAL INC	745	12	4,882	79
MANULIFE US REAL ESTATE INV	73,100	8	243,300	25
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	14,072	117	46,972	309
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,034	439	9,061	1,263
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,074	70	8,638	310
NNN REIT INC	4,909	205	14,649	596
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,333	70	3,717	204
NEXPOINT RESIDENTIAL	-	-	1,450	54
NETSTREIT CORP	4,996	88	4,369	75
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	1,853	11	2,863	19
	(375)	(2)		
NET LEASE OFFICE PROPERTY	-	-	-	-
	(42)	(1)		
NET LEASE OFFICE PROPERTY (N)	-	-	-	-
	(4,209)	(54)		
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9,018	291	18,877	584
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	580	11	1,835	37
ORION OFFICE REIT INC	3,800	23	10,795	55
PARAMOUNT GROUP INC	4,879	24	15,441	74
PARK HOTELS & RESORTS INC	5,135	69	21,266	304
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,342	44	14,013	195
PEAKSTONE REALTY TRUST	11,627	221	1,923	28
PHYSICIANS REALTY TRUST	7,243	105	13,431	181
	(△ 67,495)	(△ 976)		
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	4,654	163	9,768	331
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	1,987	15	8,057	58
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	814	20	4,368	97
PRIME US REIT	-	-	-	-
	(-)	(△ 1)		
PRIME US REIT (N)	-	-	-	-
	(18,420)	(-)		
PUBLIC STORAGE	4,049	1,134	12,725	3,541
RPT REALTY	-	-	5,103	59
	(△ 22,168)	(△ 229)		
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	2,101	30	8,202	109

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
REALTY INCOME CORP	43,862 (30,279)	2,552 (1,585)	54,222	3,027
REGENCY CENTERS CORP	4,273 (3,003)	268 (180)	12,932	795
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	10,786	571	15,454	779
RLJ LODGING TRUST	2,259	22	13,002	137
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,921	265	4,716	463
SABRA HEALTH CARE REIT INC	5,562	72	17,853	232
SAUL CENTERS INC	—	—	725	26
SAFEHOLD INC	2,144	44	3,455	73
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	8,479	23	27,417	72
SIMON PROPERTY GROUP INC	8,268	1,001	26,603	3,383
SL GREEN REALTY CORP	1,664	61	5,206	200
LIFE STORAGE INC	— (△ 25,381)	— (△ 3,248)	1,890	248
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,433 (△ 39,736)	138 (△ 1,585)	8,533	335
STAG INDUSTRIAL INC	5,195	193	14,503	521
STAR HOLDINGS	—	—	4,193	58
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3,937	23	8,590	52
SUN COMMUNITIES INC	3,192	417	9,857	1,237
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6,992	65	19,350	192
TANGER INC	3,079	75	8,029	198
TERRENO REALTY CORP	7,633	470	6,173	358
CUBESMART	5,691	243	18,040	769
UDR INC	7,928	317	26,771	1,044
UMH PROPERTIES INC	772	11	1,857	28
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	252	11	848	37
UNITI GROUP INC	75,581	400	11,703	59
URBAN EDGE PROPERTIES	2,924	47	9,377	152
URSTADT BIDDLE - CLASS A	— (△ 8,655)	— (△ 180)	953	19
VENTAS INC	10,560	492	32,000	1,467
VICI PROPERTIES INC	32,478	1,017	79,282	2,393
VORNADO REALTY TRUST	4,460	97	13,579	307
ELME COMMUNITIES	1,709	28	6,337	97
WHITESTONE REIT	2,889	29	6,374	68
WP CAREY INC	6,970	459	16,472 (—)	1,031 (54)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	1,144	14	9,806	125
小計	1,001,751 (△ 38,955)	33,849 (52)	2,146,742 (11,584)	79,574 (230)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	1,410	23	5,299	97

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	2,823	19
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	—	—	6,925	70
BOARDWALK EQUITIES INC	850	58	1,638	109
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	47	0.686	—	—
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	11,109	37	12,900	41
CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	1,595	81	6,830	322
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,422	34	4,617	108
CHOICE PROPERTIES REIT	5,203	69	13,428	178
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	2,556	34
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	—	—	2,850	39
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4,727	63	9,454	123
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,430	51	6,379	78
	(△ 3,012)	(△ 41)		
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV(N)	—	—	—	—
	(1,506)	(41)		
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	5,674	16	18,801	46
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	—	6,555	98
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,181	85	3,024	222
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,675	24	10,456	99
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,252	15	3,539	45
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	—	—	7,702	24
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,292	41	5,400	96
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,070	16	1,178	16
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	—	—	957	14
NEXUS INDUSTRIAL REIT	—	—	2,049	14
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,331	15	7,683	41
PRIMARIS REIT	4,115	56	7,695	101
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	6,325	33	4,896	26
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,375	66	11,269	209
SLATE GROCERY REIT	3,463	46	6,007	76
SLATE OFFICE REIT	—	—	12,044	18
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	—	—	—	—
	(△ 12,783)	(△ 32)		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E(N)	—	—	—	—
	(2,223)	(32)		
小 計	63,546	839	184,954	2,378
	(△ 12,066)	(—)		
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
ドイツ				
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	—	—	2,768	11
HAMBORNER REIT AG	—	—	3,652	23
	(—)	(△ 5)		
小 計	—	—	6,420	34
	(—)	(△ 5)		

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
イタリア				
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	8,956	21	7,153	17
小 計	8,956	21	7,153	17
フランス				
ALTAREA	240 (-)	22 (△ 0.121)	545	48
CARMILA	1,432 (-)	21 (△ 14)	5,521	83
COVIVIO	1,724	76	3,941	174
GECINA SA	1,358	133	5,171	504
ICADE	595 (-)	22 (△ 16)	2,851	92
KLEPIERRE	5,041 (-)	119 (△ 51)	15,604	368
MERCIALYS	7,496	64	7,169	65
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,697 (-)	143 (△ 69)	9,942	556
小 計	20,583 (-)	604 (△ 151)	50,744	1,893
オランダ				
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	1,888	41	4,126	88
NSI NV	-	-	821	16
VASTNED RETAIL	1,411	28	2,435	47
WERELDHAVE NV	1,553	24	4,759	68
小 計	4,852	94	12,141	221
スペイン				
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	6,854 (-)	39 (△ 4)	28,376	160
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	- (-)	- (△ 0.754)	5,305	32
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	7,444 (-)	63 (△ 21)	25,773	229
小 計	14,298 (-)	102 (△ 27)	59,454	423
ベルギー				
AEDIFICA	1,306 (2,254)	78 (131)	3,715 (-)	223 (14)
AEDIFICA SA-RTS	-	-	-	-
AEDIFICA SA-RTS(N)	- (12,400)	- (14)	(12,400)	(14)
CARE PROPERTY INVEST	1,623	20	3,751	49
COFINIMMO	2,952	206	3,022	203
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	-	-	8,508	176

外

国

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
ベルギー				
MONTEA	1,461	109	917	70
RETAIL ESTATES	689	39	811	47
WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,640	258	13,331	341
XIOR STUDENT HOUSING NV	2,902	77	1,561	42
小計	20,573 (14,654)	791 (145)	35,616 (12,400)	1,155 (28)
アイルランド				
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,708	10	29,794	31
小計	10,708	10	29,794	31
ガーンジー				
SHURGARD SELF STORAGE LTD	9,300	371	1,034	41
小計	9,300	371	1,034	41
シンガポール				
CROMWELL REIT EUR	7,200 (-)	10 (△9)	45,400	66
小計	7,200 (-)	10 (△9)	45,400	66
ユーロ計	96,470 (14,654)	2,007 (△47)	247,756 (12,400)	3,883 (28)
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
AEW UK REIT PLC	12,301	12	9,248	9
ASSURA PLC	131,515	59	287,533	125
BIG YELLOW GROUP PLC	10,105	117	14,176	150
BALANCED COMM PROPERTY TRUST	25,143	19	97,308	69
BRITISH LAND COMPANY PLC	25,176	85	76,443	266
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	82,646	99	143,092	176
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	-	-	205,988	163
CLS HOLDINGS PLC	-	-	24,512	31
CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	28,116	23	49,132	38
DERWENT LONDON PLC	2,110	44	8,527	176
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	-	-	76,805	52
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	-	-	19,978	18
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	3,911	17	20,263 (-)	81 (58)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC(N)	- (41,438)	- (153)	-	-
GREAT PORTLAND ESTATES -NIL-RTS	- (41,438)	- (58)	- (41,438)	- (58)
HAMMERSON PLC	198,068	50	477,180	122
HELICAL PLC	33,388	91	4,241	8
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	-	-	32,084	28
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	-	-	41,928	17
PICTON PROPERTY INCOME LTD	42,814	29	82,902	54

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	LAND SECURITIES GROUP PLC	18,916	120	60,259	368
	LIFE SCIENCE REIT PLC	110,213	77	—	—
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	57,388	110	95,564	176
	LXI REIT PLC	(266,982)	(461)		
		57,859	54	123,185	111
		(△ 485,422)	(△ 461)		
	NEWRIVER REIT PLC	24,244	19	33,017	26
	PRS REIT PLC/THE	19,156	15	56,814	43
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	45,151	43	117,806	110
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	3,847	34	15,851	129
	SEGRO PLC	61,702	510	94,309	737
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	39,617	19	80,302	40
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	13,026	9	79,179	59
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	197,418	155	28,404	22
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	46,279	64	146,617	212
		(106,872)	(127)		
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	—	—	19,080	10
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	41,433	22	78,700	41
		(△ 240,704)	(△ 127)		
UNITE GROUP PLC/THE	21,897	209	44,591	409	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	16,766	20	47,154	55	
WAREHOUSE REIT PLC	13,438	12	43,925	34	
WORKSPACE GROUP PLC	3,835	19	13,178	65	
小 計	1,387,478	2,172	2,849,275	4,248	
	(△ 269,396)	(212)	(41,438)	(116)	
国	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
	ABACUS GROUP	16,470	17	25,646	41
				(—)	(161)
	ABACUS STORAGE KING	38,130	45	17,021	19
	ABACUS STORAGE KING (N)	—	—	—	—
		(125,940)	(161)		
	ARENA REIT	10,400	38	30,244	113
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	15,528	45	27,756	78
	BWP TRUST	10,300	36	18,344	63
	VICINITY CENTRES	102,628	193	316,779	591
	CENTURIA OFFICE REIT	—	—	23,484	26
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	—	—	27,204	85
	CENTURIA CAPITAL GROUP	52,852	81	62,798	102
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	24,939	90	56,099	204
	CHARTER HALL GROUP	10,825	121	37,271	410
	CROMWELL PROPERTY GROUP	—	—	78,933	38
	DEXUS/AU	27,964	215	86,934	650
GOODMAN GROUP	46,134	1,027	136,128	3,246	
GPT GROUP	50,157	208	157,020	654	

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	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
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	—	—	22,189	59
HEALTHCO REIT	12,629 (2,114)	18 (—)	13,665 (451)	15 (—)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	12,889	39	23,455	74
HMC CAPITAL LTD	20,438	98	19,494	111
HOMECO DAILY NEEDS REIT	152,142	186	163,419	191
DEXUS INDUSTRIA REIT	14,502	39	24,936	67
INGENIA COMMUNITIES GROUP	15,636	64	36,597	155
CHARTER HALL RETAIL REIT	12,214	45	39,337	139
MIRVAC GROUP	100,697	228	320,682	693
NATIONAL STORAGE REIT	34,301	77	78,842	173
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	—	—	132,547	94
RURAL FUNDS GROUP	17,224	34	39,171	77
SCENTRE GROUP	132,176	363	419,593	1,168
REGION RE LTD	29,439	67	89,128	197
STOCKLAND	59,863	246	194,389	814
WAYPOINT REIT	—	—	35,841	85
小 計	1,020,477 (128,054)	3,635 (161)	2,754,946 (451)	10,447 (161)
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
GOODMAN PROPERTY TRUST	38,815	86	112,622	247
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	27,888	64	257,844	531
STRIDE PROPERTY GROUP	27,285	39	352,069	457
小 計	93,988	191	722,535	1,236
香港		千香港ドル		千香港ドル
CHAMPION REIT	—	—	114,000	254
FORTUNE REIT	85,000	440	171,000	839
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	—	—	193,500	217
LINK REIT	70,200	2,843	197,000	7,694
PROSPERITY REIT	—	—	94,000	130
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	25,000	64
小 計	155,200	3,283	794,500	9,200
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
AIMS APAC REIT-RIGHTS	—	—	— (5,992)	— (—)
CAPITALAND ASCENDAS REIT	143,600 (—)	401 (△ 13)	277,400	753
CAPITALAND ASCOTT TRUST	126,900 (—)	125 (△ 11)	169,000	164
CAPITALAND CHINA TRUST	20,100 (—)	15 (△ 14)	84,400	68
ESR-LOGOS REIT	342,500 (—)	107 (△ 5)	684,300	210

銘 柄	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
シンガポール		口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	130,200 (-)	254 (△ 6)	398,900	767	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	15,100 (-)	15 (△ 2)	110,000	115	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	- (-)	- (△ 4)	173,500	95	
EC WORLD REIT	-	-	7,400	2	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	32,000	20	92,100	56	
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	- (-)	- (△ 1)	428,740	97	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	41,300	90	78,400	170	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	82,800 (-)	100 (△ 10)	243,400	275	
KEPPEL REIT	128,400 (-)	109 (△ 3)	160,300	142	
KEPPEL DC REIT	38,600 (-)	85 (△ 7)	112,400	221	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	83,000	51	208,500	125	
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	45,300 (-)	73 (△ 7)	164,100	245	
AIMS APAC REIT	59,900 (-)	77 (△ 3)	40,400	51	
AIMS APAC REIT(N)	- (5,992)	- (7)	-	-	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	111,300 (-)	184 (△ 31)	258,800	402	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	60,800 (-)	137 (△ 0.935)	150,300	339	
OEUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	- (-)	- (△ 0.437)	808,535	182	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	15,300 (-)	56 (△ 3)	38,600	140	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	45,000 (-)	31 (△ 0.315)	60,000	42	
PARAGON REIT	88,200	80	103,000	92	
STARHILL GLOBAL REIT	68,200	34	141,700	70	
SUNTEC REIT	89,700 (-)	108 (△ 3)	200,700	240	
小 計	1,768,200 (5,992)	2,162 (△ 126)	5,194,875 (5,992)	5,073 (-)	
韓国		千韓国ウォン		千韓国ウォン	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	-	-	6,184	19,617	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	1,650	8,566	10,420	51,842	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	-	-	9,603	38,857	

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	韓国	口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	—	—	16,227	68,786
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD(N)	(—)	(0.00042)	(—)	(1,947)
	IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS	—	—	—	—
	IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS(N)	(4,636)	(21,743)	—	—
	JR REIT XXVII	—	—	—	—
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	(4,636)	(1,947)	(4,636)	(1,947)
	LOTTE REIT CO LTD	(4,636)	(921)	(4,636)	(921)
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	5,242	21,524	11,062	44,669
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	2,772	15,538	4,869	22,726
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	—	—	4,526	14,264
	SK REITS CO LTD	—	—	8,226	32,907
	SK REITS CO LTD(N)	7,252	45,219	7,989	47,596
	SK REITS CO LTD-RIGHTS	—	—	9,014	29,080
	SK REITS CO LTD-RIGHTS(N)	8,635	39,901	14,246	64,034
国	小 計	(—)	(—)	(—)	(—)
	SK REITS CO LTD-RIGHTS	(10,314)	(44,835)	(10,314)	(1,929)
	SK REITS CO LTD-RIGHTS(N)	—	—	—	—
	小 計	(10,314)	(729)	—	—
	イスラエル	25,551	130,749	102,366	434,384
	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	(34,536)	(71,377)	(19,586)	(8,675)
	REIT 1 LTD	—	—	—	—
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	—	—	—	—
	小 計	30,522	86	75,781	273
	千イスラエルシュケル	—	—	—	—
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	27,785	43	61,119	100	
REIT 1 LTD	2,737	42	7,274	116	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	—	—	7,388	56	

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年6月16日～2024年6月17日)

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年6月16日～2024年6月17日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2024年6月17日現在)

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%
ACADIA REALTY TRUST	30,497	27,031	467	73,666	0.1
AGREE REALTY CORPORATION	28,539	26,931	1,650	259,934	0.5
ALEXANDER & BALDWIN INC	23,359	18,817	310	48,939	0.1
ALEXANDER'S INC	722	536	114	18,005	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	50,562	41,858	4,868	767,001	1.4
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,274	3,159	47	7,509	0.0
AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,903	12,925	279	44,081	0.1
PROLOGIS INC	296,391	245,657	27,584	4,345,437	7.7
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	98,538	84,612	2,998	472,377	0.8
AMERICOLD REALTY TRUST INC	86,587	70,939	1,808	284,851	0.5
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	42,451	—	—	—	—
APPLE HOSPITALITY REIT INC	68,189	56,643	817	128,847	0.2
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	48,569	34,628	279	44,021	0.1
APARTMENT INCOME REIT CO	47,872	38,608	1,502	236,708	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	21,195	18,326	202	31,871	0.1
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,534	8,742	8	1,376	0.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	19,121	12,905	37	5,956	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	44,944	37,743	7,619	1,200,368	2.1
BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,014	—	—	—	—
BOSTON PROPERTIES INC	45,817	38,426	2,368	373,122	0.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	96,060	80,002	1,782	280,788	0.5
BRANDYWINE REALTY TRUST	54,422	45,029	206	32,487	0.1
BRT APARTMENTS CORP	4,170	3,398	58	9,265	0.0
BROADSTONE NET LEASE INC-A	55,637	49,747	760	119,743	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	35,361	28,426	3,071	483,797	0.9
CARETRUST REIT INC	32,095	34,923	879	138,470	0.2
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,008	6,784	148	23,372	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	15,405	12,668	104	16,523	0.0
CITY OFFICE REIT INC	11,825	11,825	58	9,146	0.0
CLIPPER REALTY INC	5,351	3,393	12	1,961	0.0
COPT DEFENSE PROPERTIES	36,311	29,908	729	114,864	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	48,600	40,164	927	146,091	0.3
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,590	6,767	158	24,912	0.0
CTO REALTY GROWTH INC	6,938	5,391	93	14,793	0.0
SITE CENTERS CORP	58,231	47,674	694	109,346	0.2
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	66,791	55,280	453	71,494	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	92,356	85,905	12,878	2,028,809	3.6
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	99,300	209,224	112	17,797	0.0
DOUGLAS EMMETT INC	56,612	44,423	590	93,072	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	29,998	25,603	311	49,084	0.1

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
EASTGROUP PROPERTIES INC	13,983	12,673	2,101	331,119	0.6	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	500,700	68	10,805	0.0	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	41,824	34,826	324	51,130	0.1	
EPR PROPERTIES	24,069	20,066	809	127,483	0.2	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	56,245	49,747	3,120	491,514	0.9	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	109,435	91,884	6,129	965,592	1.7	
EQUINIX INC	29,720	24,970	19,133	3,014,102	5.3	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	45,562	41,452	1,144	180,226	0.3	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,763	17,092	4,760	749,862	1.3	
EXTRA SPACE STORAGE INC	42,999	56,186	8,797	1,385,798	2.5	
FARMLAND PARTNERS INC	16,202	11,078	126	19,894	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,502	19,577	1,980	312,066	0.6	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	42,418	35,145	1,669	262,923	0.5	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	27,250	24,410	595	93,748	0.2	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	26,426	43	6,868	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	82,740	71,213	3,091	486,981	0.9	
GETTY REALTY CORPORATION	13,776	12,818	343	54,054	0.1	
GLOBAL NET LEASE INC	33,648	52,000	374	59,061	0.1	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	12,252	10,804	152	23,980	0.0	
GLADSTONE LAND CORP	10,188	8,550	114	18,021	0.0	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	19,349	14,729	132	20,928	0.0	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	15,503	34	5,470	0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	175,861	188,516	3,704	583,544	1.0	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	122,512	101,524	1,675	263,885	0.5	
WELLTOWER INC	151,742	147,226	15,317	2,412,948	4.3	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	11,024	—	—	—	—	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	33,638	27,853	715	112,675	0.2	
SERVICE PROPERTIES TRUST	53,199	43,770	215	33,992	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	229,502	187,859	3,347	527,354	0.9	
EQUITY COMMONWEALTH	35,461	29,834	573	90,329	0.2	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	40,730	34,874	172	27,193	0.0	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	71,469	59,440	1,065	167,889	0.3	
CENTERSPACE	4,765	3,864	261	41,172	0.1	
INVITATION HOMES INC	186,547	152,946	5,429	855,322	1.5	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	22,244	15,324	57	9,100	0.0	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,884	7,407	789	124,406	0.2	
INDUS REALTY TRUST INC	1,721	—	—	—	—	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21,653	18,090	447	70,445	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	93,321	77,640	6,833	1,076,539	1.9	
JBG SMITH PROPERTIES	32,271	23,314	342	53,988	0.1	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	265,800	219,100	30	4,832	0.0	
KILROY REALTY CORPORATION	33,819	28,406	903	142,388	0.3	
KIMCO REALTY CORP	198,312	177,187	3,322	523,355	0.9	
KITE REALTY GROUP TRUST	70,167	58,411	1,282	202,064	0.4	
LXP INDUSTRIAL TRUST	88,596	77,103	678	106,885	0.2	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
LTC PROPERTIES INC	13,161	11,104	373	58,878	0.1	
MACERICH CO/THE	69,743	57,176	827	130,420	0.2	
VERIS RESIDENTIAL INC	25,599	21,462	324	51,085	0.1	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	602,247	432,047	29	4,628	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	192,265	159,365	772	121,758	0.2	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	37,085	31,058	4,327	681,632	1.2	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	27,073	20,509	837	131,977	0.2	
NNN REIT INC	58,384	48,644	2,048	322,760	0.6	
NATL HEALTH INVESTORS INC	13,925	11,541	766	120,791	0.2	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,127	5,677	210	33,160	0.1	
NETSTREIT CORP	17,712	18,339	314	49,545	0.1	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	9,913	9,278	44	7,073	0.0	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	—	4,251	105	16,641	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	75,381	65,522	2,120	334,112	0.6	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,324	4,069	96	15,127	0.0	
ORION OFFICE REIT INC	19,338	12,343	42	6,669	0.0	
PARAMOUNT GROUP INC	52,137	41,575	192	30,388	0.1	
PARK HOTELS & RESORTS INC	72,033	55,902	820	129,275	0.2	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	42,092	31,421	436	68,752	0.1	
PEAKSTONE REALTY TRUST	—	9,704	111	17,533	0.0	
PHYSICIANS REALTY TRUST	73,683	—	—	—	—	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	37,757	32,643	1,052	165,734	0.3	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	39,572	33,502	237	37,417	0.1	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,592	9,038	189	29,827	0.1	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,728	5,728	75	11,901	0.0	
PRIME US REIT	184,200	202,620	23	3,734	0.0	
PUBLIC STORAGE	50,764	42,088	11,921	1,877,982	3.3	
RPT REALTY	27,271	—	—	—	—	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	39,729	33,628	413	65,211	0.1	
REALTY INCOME CORP	201,523	221,442	11,818	1,861,746	3.3	
REGENCY CENTERS CORP	49,444	43,788	2,704	426,084	0.8	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	60,598	55,930	2,507	394,981	0.7	
RLJ LODGING TRUST	51,972	41,229	394	62,155	0.1	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,684	15,889	1,570	247,370	0.4	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	74,182	61,891	884	139,323	0.2	
SAUL CENTERS INC	4,133	3,408	125	19,724	0.0	
SAFEHOLD INC	12,902	11,591	217	34,236	0.1	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	77,917	58,979	166	26,200	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	105,004	86,669	12,898	2,031,971	3.6	
SL GREEN REALTY CORP	20,710	17,168	977	153,965	0.3	
LIFE STORAGE INC	27,271	—	—	—	—	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	44,836	—	—	—	—	
STAG INDUSTRIAL INC	57,532	48,224	1,685	265,581	0.5	
STAR HOLDINGS	4,193	—	—	—	—	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	34,272	29,619	172	27,108	0.0	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
SUN COMMUNITIES INC	39,798	33,133	3,864	608,795	1.1	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67,090	54,732	545	85,874	0.2	
TANGER INC	33,546	28,596	773	121,852	0.2	
TERRENO REALTY CORP	23,355	24,815	1,439	226,689	0.4	
CUBESMART	72,101	59,752	2,642	416,325	0.7	
UDR INC	99,430	80,587	3,246	511,349	0.9	
UMH PROPERTIES INC	17,055	15,970	246	38,792	0.1	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	4,210	3,614	139	22,038	0.0	
UNITI GROUP INC	—	63,878	175	27,672	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	37,518	31,065	556	87,743	0.2	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	9,608	—	—	—	—	
VENTAS INC	128,494	107,054	5,363	844,897	1.5	
VICI PROPERTIES INC	322,178	275,374	7,790	1,227,210	2.2	
VORNADO REALTY TRUST	51,585	42,466	1,079	170,118	0.3	
ELME COMMUNITIES	28,439	23,811	371	58,589	0.1	
WHITESTONE REIT	15,152	11,667	156	24,591	0.0	
WP CAREY INC	67,745	58,243	3,266	514,626	0.9	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	36,413	27,751	395	62,251	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	8,680,656	7,485,126	276,110	43,495,744	
	銘柄 数 < 比 率 >	145	138	—	< 77.1% >	
(カナダ)			千カナダドル			
ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	20,353	16,464	259	29,721	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,810	15,987	103	11,863	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	6,925	—	—	—	—	
BOARDWALK EQUITIES INC	7,139	6,351	436	50,055	0.1	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,270	5,317	81	9,299	0.0	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	12,031	10,240	32	3,693	0.0	
CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	27,035	21,800	952	109,235	0.2	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	23,078	19,883	437	50,145	0.1	
CHOICE PROPERTIES REIT	52,246	44,021	559	64,169	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,470	14,914	186	21,398	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,654	13,804	186	21,357	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	40,108	35,381	443	50,885	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	6,850	2,395	45	5,235	0.0	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	13,127	—	—	—	—	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	34,752	28,197	414	47,570	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	10,051	8,208	547	62,817	0.1	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	41,720	33,939	305	35,032	0.1	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,919	19,632	230	26,478	0.0	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	7,702	—	—	—	—	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,130	15,022	257	29,547	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,756	5,648	84	9,697	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,901	4,944	74	8,550	0.0	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,851	7,802	54	6,245	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	38,193	32,841	159	18,305	0.0	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)			千カナダドル	千円	%	
PRIMARIS REIT	16,018	12,438	167	19,200	0.0	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	7,180	8,609	43	4,976	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	47,388	39,494	659	75,643	0.1	
SLATE GROCERY REIT	9,526	6,982	77	8,912	0.0	
SLATE OFFICE REIT	12,044	—	—	—	—	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	12,783	2,223	19	2,187	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	566,010	432,536	6,820	782,226	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	26	—	< 1.4% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,768	—	—	—	—	
HAMBORNER REIT AG	23,984	20,332	131	22,218	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	26,752	20,332	131	22,218	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	15,466	17,269	31	5,311	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	15,466	17,269	31	5,311	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)						
ALTAREA	1,522	1,217	102	17,362	0.0	
CARMILA	18,680	14,591	233	39,419	0.1	
COVIVIO	14,961	12,744	570	96,238	0.2	
GECINA SA	17,487	13,674	1,251	211,112	0.4	
ICADE	10,336	8,080	206	34,882	0.1	
KLEPIERRE	62,529	51,966	1,327	223,820	0.4	
MERCIALYS	24,638	24,965	270	45,553	0.1	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,229	26,984	1,956	329,917	0.6	
小 計	口 数 ・ 金 額	184,382	154,221	5,919	998,307	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	< 1.8% >	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,509	11,271	244	41,151	0.1	
NSI NV	5,548	4,727	92	15,672	0.0	
VASTNED RETAIL	5,856	4,832	113	19,067	0.0	
WERELDHAVE NV	13,084	9,878	131	22,255	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	37,997	30,708	581	98,146	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.2% >	
(ユーロ…スペイン)						
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	97,537	76,015	456	77,043	0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,678	14,373	99	16,724	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	107,784	89,455	948	159,908	0.3	
小 計	口 数 ・ 金 額	224,999	179,843	1,504	253,676	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.4% >	
(ユーロ…ベルギー)						
AEDIFICA	12,843	12,688	714	120,465	0.2	
CARE PROPERTY INVEST	12,243	10,115	141	23,812	0.0	
COFINIMMO	9,907	9,837	564	95,221	0.2	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)	口	口	千ユーロ	千円	%	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,508	—	—	—	—	
MONTEA	4,282	4,826	383	64,701	0.1	
RETAIL ESTATES	3,603	3,481	217	36,748	0.1	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	49,759	46,068	1,165	196,553	0.3	
XIOR STUDENT HOUSING NV	7,427	8,768	251	42,436	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	108,572	95,783	3,438	579,940	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	7	—	<1.0%>	
(ユーロ…アイルランド)						
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	148,779	129,693	118	19,968	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	148,779	129,693	118	19,968	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…ガーンジー)						
SHURGARD SELF STORAGE LTD	—	8,266	319	53,946	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	—	8,266	319	53,946	
	銘柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.1%>	
(ユーロ…シンガポール)						
CROMWELL REIT EUR	119,560	81,360	115	19,483	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	119,560	81,360	115	19,483	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	866,507	717,475	12,162	2,051,000	
	銘柄 数 < 比 率 >	28	27	—	<3.6%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
AEW UK REIT PLC	45,713	48,766	41	8,353	0.0	
ASSURA PLC	959,228	803,210	319	63,765	0.1	
BIG YELLOW GROUP PLC	55,973	51,902	608	121,579	0.2	
BALANCED COMM PROPERTY TRUST	263,699	191,534	144	28,902	0.1	
BRITISH LAND COMPANY PLC	301,054	249,787	1,065	212,979	0.4	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	580,353	519,907	711	142,258	0.3	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	205,988	—	—	—	—	
CLS HOLDINGS PLC	65,076	40,564	34	6,988	0.0	
CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	145,337	124,321	89	17,890	0.0	
DERWENT LONDON PLC	36,165	29,748	690	138,059	0.2	
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	76,805	—	—	—	—	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	188,560	168,582	157	31,504	0.1	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	81,648	106,734	362	72,425	0.1	
HAMMERSON PLC	1,284,082	1,004,970	281	56,281	0.1	
HELICAL PLC	—	29,147	63	12,699	0.0	
HOME REIT PLC	256,438	256,438	97	19,502	0.0	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	138,665	106,581	90	18,128	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	181,830	139,902	62	12,443	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	178,755	138,667	89	17,793	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	241,057	199,714	1,242	248,282	0.4	
INTU PROPERTIES PLC	758,746	758,746	0	0	0.0	
LIFE SCIENCE REIT PLC	—	110,213	37	7,555	0.0	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	312,753	541,559	1,053	210,529	0.4	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	口	口	千イギリスポンド	千円	%	
LXI REIT PLC	550,748	—	—	—	—	
NEWRIVER REIT PLC	104,390	95,617	69	13,836	0.0	
PRS REIT PLC/THE	183,163	145,505	111	22,247	0.0	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	434,401	361,746	329	65,939	0.1	
REGIONAL REIT LTD	147,696	147,696	31	6,317	0.0	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	69,370	57,366	457	91,496	0.2	
SEGREO PLC	388,367	355,760	3,233	646,351	1.1	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	136,620	95,935	48	9,740	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	402,889	336,736	242	48,525	0.1	
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	—	169,014	134	26,855	0.0	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	599,772	606,306	932	186,378	0.3	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	122,256	103,176	58	11,692	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	277,971	—	—	—	—	
UNITE GROUP PLC/THE	128,188	105,494	959	191,874	0.3	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	147,039	116,651	139	27,884	0.0	
WAREHOUSE REIT PLC	133,669	103,182	82	16,415	0.0	
WORKSPACE GROUP PLC	43,943	34,600	195	39,003	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	10,228,407	8,455,776	14,271	2,852,484	
	銘柄 数 < 比 率 >	37	36	—	< 5.1% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
ABACUS GROUP	134,724	125,548	141	14,778	0.0	
ABACUS STORAGE KING	—	147,049	179	18,688	0.0	
ARENA REIT	111,547	91,703	341	35,536	0.1	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	106,144	93,916	226	23,577	0.0	
BWP TRUST	159,304	151,260	544	56,724	0.1	
VICINITY CENTRES	1,248,198	1,034,047	1,923	200,353	0.4	
CENTURIA OFFICE REIT	145,435	121,951	145	15,117	0.0	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	175,393	148,189	460	48,008	0.1	
CENTURIA CAPITAL GROUP	219,440	209,494	362	37,753	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	211,787	180,627	619	64,538	0.1	
CHARTER HALL GROUP	151,785	125,339	1,540	160,465	0.3	
CROMWELL PROPERTY GROUP	463,054	384,121	161	16,805	0.0	
DEXUS/AU	347,700	288,730	1,873	195,199	0.3	
GDI PROPERTY GROUP	181,454	181,454	109	11,435	0.0	
GOODMAN GROUP	549,629	459,635	16,441	1,712,673	3.0	
GPT GROUP	618,719	511,856	2,083	217,012	0.4	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	98,916	76,727	175	18,303	0.0	
HEALTHCO REIT	135,075	135,702	154	16,044	0.0	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	65,655	55,089	177	18,535	0.0	
HMC CAPITAL LTD	63,267	64,211	474	49,430	0.1	
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	505,795	494,518	605	63,104	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	70,496	60,062	177	18,519	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	120,549	99,588	484	50,521	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	169,868	142,745	468	48,772	0.1	
MIRVAC GROUP	1,273,685	1,053,700	1,986	206,905	0.4	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	口	口	千オーストラリアドル	千円	%	
NATIONAL STORAGE REIT	389,844	345,303	797	83,091	0.1	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	132,547	—	—	—	—	
RURAL FUNDS GROUP	125,402	103,455	207	21,661	0.0	
SCENTRE GROUP	1,673,884	1,386,467	4,325	450,616	0.8	
REGION RE LTD	374,135	314,446	691	72,062	0.1	
STOCKLAND	768,929	634,403	2,816	293,420	0.5	
WAYPOINT REIT	220,218	184,377	427	44,559	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	11,012,578	9,405,712	41,127	4,284,218	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	31	—	< 7.6% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
GOODMAN PROPERTY TRUST	428,056	354,249	745	72,078	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	229,956	—	—	—	—	
STRIDE PROPERTY GROUP	324,784	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	982,796	354,249	745	72,078	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	1	—	< 0.1% >	
(香港)			千香港ドル			
CHAMPION REIT	617,000	503,000	804	16,224	0.0	
FORTUNE REIT	484,900	398,900	1,555	31,363	0.1	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	733,110	539,610	555	11,204	0.0	
LINK REIT	812,880	686,080	22,366	450,902	0.8	
PROSPERITY REIT	411,000	317,000	427	8,627	0.0	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	331,000	306,000	529	10,672	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	3,389,890	2,750,590	26,239	528,995	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 0.9% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
AIMS APAC REIT-RIGHTS	5,992	—	—	—	—	
CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,085,132	951,332	2,444	284,760	0.5	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	714,492	672,392	598	69,699	0.1	
CAPITALAND CHINA TRUST	374,585	310,285	203	23,670	0.0	
ESR-LOGOS REIT	1,938,319	1,596,519	447	52,065	0.1	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,620,692	1,351,992	2,622	305,485	0.5	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	267,100	172,200	164	19,153	0.0	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	173,500	—	—	—	—	
EC WORLD REIT	77,700	70,300	19	2,292	0.0	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	355,700	295,600	181	21,173	0.0	
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	428,740	—	—	—	—	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	347,005	309,905	666	77,603	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	928,360	767,760	733	85,397	0.2	
KEPPEL REIT	649,000	617,100	518	60,373	0.1	
KEPPEL DC REIT	431,277	357,477	639	74,527	0.1	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	602,552	477,052	264	30,837	0.1	
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	742,831	624,031	761	88,670	0.2	
AIMS APAC REIT	171,225	196,717	249	29,097	0.1	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,038,387	890,887	1,175	136,965	0.2	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	646,408	556,908	1,202	140,104	0.2	

銘柄	口数	期首(前期末)	当 期 末		
		口数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)			千シンガポールドル	千円	%
OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE I	808,535	—	—	—	—
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	125,800	102,500	373	43,454	0.1
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	169,400	154,400	102	11,958	0.0
PARAGON REIT	360,200	345,400	288	33,590	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	467,500	394,000	189	22,026	0.0
SUNTEC REIT	730,000	619,000	656	76,420	0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	15,260,432 26	11,833,757 22	14,504 —	1,689,328 <3.0%>
(韓国)			千韓国ウォン		
D&D PLATFORM REIT CO LTD	22,899	16,715	58,669	6,705	0.0
E KOCREF CR-REIT CO LTD	8,770	—	—	—	—
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	55,071	45,468	209,380	23,932	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,591	—	—	—	—
JR REIT XXVII	51,208	45,388	187,679	21,451	0.0
KORAMCO LIFE INFRA REIT	13,627	11,530	53,268	6,088	0.0
LOTTE REIT CO LTD	39,257	34,731	115,654	13,219	0.0
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	8,226	—	—	—	—
NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	12,699	46,859	5,356	0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,648	22,911	139,986	16,000	0.0
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	9,014	—	—	—	—
SK REITS CO LTD	29,394	34,097	165,881	18,960	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	285,404 12	223,539 8	977,379 —	111,714 <0.2%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	231,039	197,705	307	13,028	0.0
REIT 1 LTD	60,560	56,023	771	32,694	0.1
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	71,314	63,926	414	17,573	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	362,913 3	317,654 3	1,494 —	63,296 <0.1%>
合計	口数・金額 銘柄数<比率>	51,635,593 321	41,976,414 298	—	55,931,087 <99.1%>

(注) 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) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

(2024年6月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	55,931,087	99.1
コール・ローン等、その他	511,109	0.9
投資信託財産総額	56,442,196	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（56,421,034千円）の投資信託財産総額（56,442,196千円）に対する比率は100.0%です。

(注) 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。1アメリカドル=157.53円、1カナダドル=114.69円、1ユーロ=168.64円、1イギリスポンド=199.87円、1オーストラリアドル=104.17円、1ニュージーランドドル=96.66円、1香港ドル=20.16円、1シンガポールドル=116.47円、1韓国ウォン=0.1143円、1イスラエルシェケル=42.3507円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年6月17日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	56,442,196,143	
コール・ローン等	363,354,170	
投資証券(評価額)	55,931,087,801	
未収入金	1,339,882	
未収配当金	146,414,243	
未収利息	47	
(B) 負債	6,033,914	
未払解約金	6,033,914	
(C) 純資産総額(A－B)	56,436,162,229	
元本	16,493,547,462	
次期繰越損益金	39,942,614,767	
(D) 受益権総口数	16,493,547,462口	
1口当たり基準価額(C/D)	34,217円	

(注) 当ファンドの期首元本額は20,078,950,947円、期中追加設定元本額は1,493,687,941円、期中一部解約元本額は5,079,091,426円です。

(注) 2024年6月17日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け） 14,316,410,946円
- ・世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 1,941,127,001円
- ・海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け） 213,731,951円
- ・Tracers グローバル3分法（おとなのバランス） 20,686,523円
- ・Niつみインデックススラップ世界10指数（均等型） 841,098円
- ・Niつみインデックススラップ世界10指数（安定成長型） 749,943円

(注) 1口当たり純資産額は3,4217円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年6月16日から2024年6月17日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、運用目標とするベンチマークを構成する指数につき「S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」を採用しておりました。このたび、当該ベンチマークが「税引後配当込み」の値動きであることを明確化するため、そのベンチマーク表記を「S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）」に変更すべく、2023年6月20日付けにて信託約款の一部に所要の変更を行ないました。（付表、第28条）

○損益の状況

（2023年6月16日～2024年6月17日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	2,358,564,395	
受取配当金	2,356,553,122	
受取利息	22,832	
その他収益金	2,006,164	
支払利息	△ 17,723	
(B) 有価証券売買損益	7,581,454,103	
売買益	11,176,846,404	
売買損	△ 3,595,392,301	
(C) 保管費用等	△ 35,228,093	
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,904,790,405	
(E) 前期繰越損益金	37,378,877,807	
(F) 追加信託差損益金	2,904,525,394	
(G) 解約差損益金	△10,245,578,839	
(H) 計(D+E+F+G)	39,942,614,767	
次期繰越損益金(H)	39,942,614,767	

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2024年6月17日）
（2023年6月16日～2024年6月17日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2005年6月30日から原則無期限です。
運用方針	わが国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、「東証REIT指数（配当込み）」と連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。

ファンド概要

主として、東京証券取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、「東証REIT指数（配当込み）」に連動した投資成果をめざします。

不動産投資信託の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<936464>

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証REIT指数（配当込み） （ベンチマーク）		投資信託 組入比率	純資産額
	円 騰落	率 中率	騰落	率 中率		
15期(2020年6月15日)	19,644	△12.1	3,448.87	△12.3	98.6	120,656
16期(2021年6月15日)	26,874	36.8	4,720.99	36.9	99.0	81,728
17期(2022年6月15日)	24,402	△9.2	4,278.73	△9.4	96.7	58,945
18期(2023年6月15日)	25,260	3.5	4,424.14	3.4	99.0	60,326
19期(2024年6月17日)	24,259	△4.0	4,239.82	△4.2	99.4	60,052

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証REIT指数（配当込み） （ベンチマーク）		投資信託 組入比率
	円 騰落	率 騰落率	騰落	率 騰落率	
(期首) 2023年6月15日	25,260	—	4,424.14	—	99.0
6月末	25,243	△0.1	4,421.28	△0.1	99.0
7月末	25,538	1.1	4,472.88	1.1	98.9
8月末	25,916	2.6	4,539.20	2.6	98.5
9月末	25,517	1.0	4,468.30	1.0	98.6
10月末	25,002	△1.0	4,372.14	△1.2	98.8
11月末	25,483	0.9	4,455.46	0.7	99.1
12月末	25,070	△0.8	4,382.85	△0.9	99.0
2024年1月末	25,048	△0.8	4,378.56	△1.0	98.7
2月末	23,849	△5.6	4,166.74	△5.8	98.4
3月末	25,222	△0.2	4,410.17	△0.3	98.8
4月末	25,481	0.9	4,455.74	0.7	96.3
5月末	24,611	△2.6	4,302.09	△2.8	99.0
(期末) 2024年6月17日	24,259	△4.0	4,239.82	△4.2	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2023年6月16日～2024年6月17日)

基準価額の推移

期間の初め25,260円の基準価額は、期間末に24,259円となり、騰落率は△4.0%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

＜値上がり要因＞

- ・都心部オフィスにおける空室率が低下したことに加え平均賃料が上昇したこと。
- ・国内株式市場が堅調に推移したこと。

＜値下がり要因＞

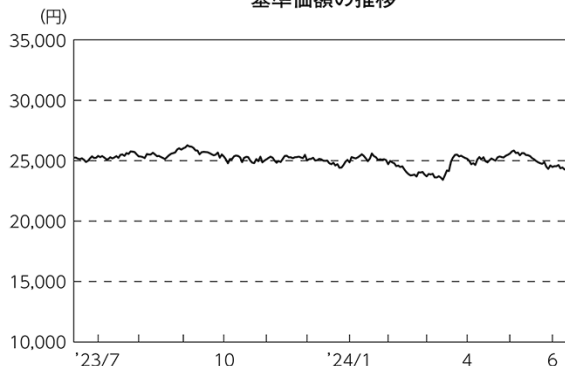
- ・日銀が金融政策決定会合にて長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用の柔軟化を決定したこと。
- ・日銀がマイナス金利政策の解除を決定したことに加え、追加利上げや国債買入れの減額などの金融政策の正常化を進めるとの思惑が高まり国内長期金利が上昇したこと。

(国内不動産投資信託市況)

国内不動産投資信託市場では、東証REIT指数（配当込み）は期間の初めと比べて下落しました。

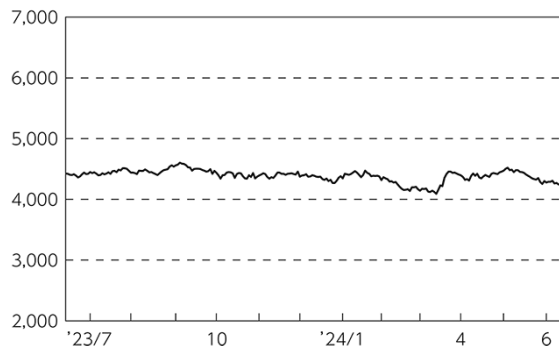
都心部オフィスの空室率が低下したことに加え平均賃料が上昇したことや、国内株式市場が堅調に推移したことなどがREIT価格の支援材料となったものの、日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用の柔軟化を決定したことや、米国の商業用不動産市場の混乱が警戒されたこと、日銀がマイナス金利政策の解除を決定したこと、日銀が追加利上げや国債買入れの減額などの金融政策の正常化を進めるとの思惑が高まり国内長期金利が上昇したことなどがREIT価格の重しとなり、東証REIT指数（配当込み）は下落しました。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2023/06/15	2023/09/05	2024/03/13	2024/06/17
25,260円	26,269円	23,421円	24,259円

東証REIT指数（配当込み）の推移



ポートフォリオ

東京証券取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、ベンチマークである「東証REIT指数（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざすため、組入比率を高位に維持し、「東証REIT指数」と同じような個別銘柄の時価構成比を持つポートフォリオを構築して運用を行ないました。また、不動産投資信託の新規上場など「東証REIT指数」の採用銘柄に追加・変更があった場合は、基本的に「東証REIT指数」への追加・変更タイミングに応じて対象不動産投資信託の売買を実施しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、4.0%の値下がりとなり、ベンチマークである「東証REIT指数（配当込み）」の下落率4.2%を概ね0.2%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・信託財産留保額の計上が影響したこと。

<マイナス要因>

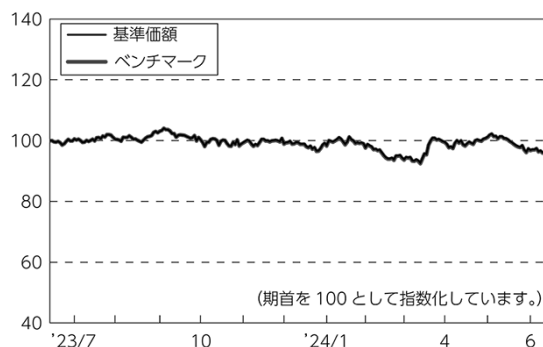
- ・売買委託手数料などの諸費用が発生したこと。

○今後の運用方針

引き続き、これまでの運用方針を継続します。主として、東京証券取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、ベンチマークである「東証REIT指数（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざすため、原則として「東証REIT指数」と同じような個別銘柄の時価構成比を持つポートフォリオを構築する方針です。不動産投資信託の新規上場など「東証REIT指数」の採用銘柄に追加・変更があった場合は、基本的に「東証REIT指数」への追加・変更タイミングに応じて対象不動産投資信託の売買を実施する方針です。また、不動産投資信託の組入比率は原則として高位に保ち、「東証REIT指数（配当込み）」との連動性を維持するように努めます。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○1万口当たりの費用明細

(2023年6月16日～2024年6月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、25,165円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2023年6月16日～2024年6月17日)

投資信託証券

銘柄	買付	売付	
		口数	金額
	口	口	千円
エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	230	146	17,291
サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	364	232	21,137
S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	575	359	44,320
東海道リート投資法人 投資証券	307	210	25,627
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	391	248	158,287
森ヒルズリート投資法人 投資証券	1,334	847	119,456
産業ファンド投資法人 投資証券	3,542	1,114	151,726
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	1,278	977	332,548
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	173 (△ 3,926)	396	89,047
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	581	382	153,284
GLP投資法人 投資証券	3,854	2,532	335,631
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	632	352	116,122
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1,992	1,252	345,106
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	418	132	81,190
One リート投資法人 投資証券	198	126	32,326
イオンリート投資法人 投資証券	1,831	878	126,135
ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,059	671	105,573
日本リート投資法人 投資証券	369	234	81,405
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	3,404	2,158	176,945
トーセイ・リート投資法人 投資証券	238	214	29,435
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	99 (△ 2,324)	235	67,164
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	278	176	24,729
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	379	196	21,924
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	3,665	2,324	379,359
いちごホテルリート投資法人 投資証券	189	120	13,456
ラサールロジポート投資法人 投資証券	1,752	917	136,324
スターアジア不動産投資法人 投資証券	3,045	751	44,224
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	183	111	14,025
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	589	298	138,332
日本ホテル&レジデンシャル投資法人 投資証券	172	157	10,483
投資法人みらい 投資証券	2,392	932	43,230
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	401	248	95,635
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	499	309	49,412
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	183	116	13,566
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	917	349	34,101
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	510	315	39,426
日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,319	836	495,879

○組入資産の明細

(2024年6月17日現在)

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	口数	評価額	比率
	口	口	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,150	1,234		146,229	0.2
サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,813	1,945		161,824	0.3
S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	2,814	3,030		348,450	0.6
東海道リート投資法人 投資証券	941	1,038		126,324	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,954	2,097		1,342,080	2.2
森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,654	7,141		927,615	1.5
産業ファンド投資法人 投資証券	8,633	11,061		1,350,548	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,657	5,958		1,906,560	3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,149	—		—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,987	3,186		1,167,669	1.9
G L P 投資法人 投資証券	19,076	20,398		2,649,700	4.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,706	2,986		939,097	1.6
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,839	10,579		2,645,807	4.4
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	990	1,276		649,484	1.1
O n e リート投資法人 投資証券	987	1,059		270,045	0.4
イオンリート投資法人 投資証券	6,496	7,449		981,033	1.6
ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,294	5,682		816,503	1.4
日本リート投資法人 投資証券	1,838	1,973		655,036	1.1
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,002	18,248		1,412,395	2.4
トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,255	1,279		175,734	0.3
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,460	—		—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,395	1,497		189,220	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,471	1,654		171,850	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	18,297	19,638		2,755,211	4.6
いちごホテルリート投資法人 投資証券	937	1,006		109,654	0.2
ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,927	7,762		1,139,461	1.9
スターアジア不動産投資法人 投資証券	7,065	9,359		554,988	0.9
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	864	936		122,241	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,235	2,526		1,088,706	1.8
日本ホテル&レジデンシャル投資法人 投資証券	913	928		68,857	0.1
投資法人みらい 投資証券	6,874	8,334		370,446	0.6
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,944	2,097		787,423	1.3
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,424	2,614		371,449	0.6
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	918	985		115,540	0.2
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,667	3,235		318,971	0.5
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,466	2,661		316,659	0.5
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,601	7,084		4,101,636	6.8
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,802	6,238		3,162,666	5.3
日本都市ファンド投資法人 投資証券	28,549	29,108		2,613,898	4.4
オリックス不動産投資法人 投資証券	11,274	12,100		1,906,960	3.2
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,870	4,153		1,358,031	2.3
N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	5,439	6,157		712,980	1.2

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	評 価 額	比 率
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,794	4,071	4,071	629,783	1.0
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,164	4,484	4,484	446,606	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,657	13,584	13,584	1,931,644	3.2
森トラストリート投資法人 投資証券	10,531	11,705	11,705	804,133	1.3
インヴィンシブル投資法人 投資証券	24,904	29,403	29,403	1,996,463	3.3
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,099	2,253	2,253	1,002,585	1.7
平和不動産リート投資法人 投資証券	3,987	4,706	4,706	616,486	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,815	3,876	3,876	1,028,690	1.7
福岡リート投資法人 投資証券	2,926	3,141	3,141	496,278	0.8
KDX不動産投資法人 投資証券	3,292	17,207	17,207	2,624,067	4.4
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,636	4,976	4,976	404,548	0.7
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,172	2,516	2,516	703,473	1.2
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,556	2,896	2,896	379,955	0.6
スターツプロシード投資法人 投資証券	981	1,053	1,053	211,021	0.4
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,529	9,154	9,154	2,239,983	3.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	18,247	20,328	20,328	1,603,879	2.7
大和証券リビング投資法人 投資証券	7,841	8,943	8,943	920,234	1.5
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	5,191	5,277	5,277	634,295	1.1
合 計	口 数 ・ 金 額	344,949	387,264	59,683,122	
	銘 柄 数 < 比 率 >	60	58	< 99.4% >	

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 上記投資信託証券の「エスコンジャパンリート投資法人 投資証券」、「SOS i LA物流リート投資法人 投資証券」、「日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券」、「森ヒルズリート投資法人 投資証券」、「産業ファンド投資法人 投資証券」、「アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券」、「ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券」、「アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券」、「日本プロロジスリート投資法人 投資証券」、「One リート投資法人 投資証券」、「イオンリート投資法人 投資証券」、「ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券」、「ラサールロジポート投資法人 投資証券」、「スターアジア不動産投資法人 投資証券」、「マリモ地方創生リート投資法人 投資証券」、「三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券」、「日本ホテル&レジデンシャル投資法人 投資証券」、「タカラレーベン不動産投資法人 投資証券」、「アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券」、「日本ビルファンド投資法人 投資証券」、「ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券」、「日本都市ファンド投資法人 投資証券」、「オリックス不動産投資法人 投資証券」、「N T T都市開発リート投資法人 投資証券」、「東急リアル・エステート投資法人 投資証券」、「ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券」、「森トラストリート投資法人 投資証券」、「インヴィンシブル投資法人 投資証券」、「フロンティア不動産投資法人 投資証券」、「平和不動産リート投資法人 投資証券」、「日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券」、「福岡リート投資法人 投資証券」、「KDX不動産投資法人 投資証券」、「大和証券オフィス投資法人 投資証券」、「スターツプロシード投資法人 投資証券」、「大和ハウスリート投資法人 投資証券」、「ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券」につきましては、委託会社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等）である三井住友信託銀行株式会社が投資法人の一般事務受託会社等になっています。また、「日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券」の資産運用会社である「三井物産ロジスティクス・パートナーズ株式会社」は、委託会社の利害関係人等です。

○投資信託財産の構成

(2024年6月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 59,683,122	% 99.1
コール・ローン等、その他	550,387	0.9
投資信託財産総額	60,233,509	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年6月17日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	60,233,509,301	
コール・ローン等	214,999,838	
投資証券(評価額)	59,683,122,100	
未収配当金	335,386,878	
未収利息	485	
(B) 負債	180,665,430	
未払金	179,233,450	
未払解約金	1,431,980	
(C) 純資産総額(A-B)	60,052,843,871	
元本	24,754,972,956	
次期繰越損益金	35,297,870,915	
(D) 受益権総口数	24,754,972,956口	
1万口当たり基準価額(C/D)	24,259円	

(注) 当ファンドの期首元本額は23,882,441,576円、期中追加設定元本額は4,090,508,774円、期中一部解約元本額は3,217,977,394円です。

(注) 2024年6月17日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	19,637,886,849円
・世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,486,965,212円
・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,696,418,639円
・財産3分法（適格機関投資家専用）	722,843,641円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	159,795,689円
・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	47,493,070円
・Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,885,915円
・Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,160,932円
・Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	523,009円

(注) 1口当たり純資産額は2,4259円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年6月16日から2024年6月17日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

○損益の状況（2023年6月16日～2024年6月17日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	2,616,790,585	
受取配当金	2,616,793,736	
受取利息	44,182	
支払利息	△ 47,333	
(B) 有価証券売買損益	△ 5,006,989,421	
売買益	679,705,241	
売買損	△ 5,686,694,662	
(C) 保管費用等	△ 2	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,390,198,838	
(E) 前期繰越損益金	36,443,645,990	
(F) 追加信託差損益金	6,116,019,674	
(G) 解約差損益金	△ 4,871,595,911	
(H) 計(D+E+F+G)	35,297,870,915	
次期繰越損益金(H)	35,297,870,915	

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

マネー・オープン・マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2024年 1月15日）
 (2023年 1月17日～2024年 1月15日)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2003年3月28日から原則無期限です。
運用方針	公社債への投資により、安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要運用対象	わが国の国債および格付の高い公社債を主要投資対象とします。
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。

ファンド概要

わが国の国債および格付の高い公社債に投資を行ない、利息等収益の確保をめざして安定運用を行いません。
 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 組 入 比	券 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%		%	百万円
17期(2020年1月15日)	10,162		△0.0		—	696
18期(2021年1月15日)	10,159		△0.0		—	521
19期(2022年1月17日)	10,158		△0.0		—	398
20期(2023年1月16日)	10,155		△0.0		—	316
21期(2024年1月15日)	10,152		△0.0		—	293

(注) 元本の安全性を優先した運用を行なっているため、ベンチマークおよび適切な参考指数となる指標はございません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	
		騰 落	率
(期 首)	円		%
2023年1月16日	10,155		—
1月末	10,155		0.0
2月末	10,155		0.0
3月末	10,155		0.0
4月末	10,155		0.0
5月末	10,154		△0.0
6月末	10,154		△0.0
7月末	10,153		△0.0
8月末	10,153		△0.0
9月末	10,153		△0.0
10月末	10,152		△0.0
11月末	10,152		△0.0
12月末	10,152		△0.0
(期 末)			
2024年1月15日	10,152		△0.0

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2023年1月17日～2024年1月15日)

基準価額の推移

期間の初め10,155円の基準価額は、期間末に10,152円となり、騰落率は $\Delta 0.0\%$ となりました。

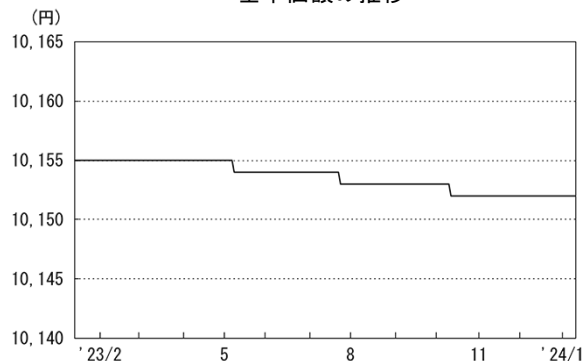
基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

<値下がり要因>

- ・無担保コール翌日物金利がマイナス圏で推移したこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2023/01/16	2023/01/17	2023/10/12	2024/01/15
10,155円	10,155円	10,152円	10,152円

(国内短期金利市況)

無担保コール翌日物金利は、期間の初めの -0.03% 近辺から、日銀によるマイナス金利政策の下でコール市場でもマイナス圏での取引が続き、 -0.01% 近辺で期間末を迎えました。

国庫短期証券（TB）3ヵ月物金利は、期間の初めの -0.19% 近辺から、日銀による国債買入れの継続などを受けてマイナス圏での推移が続き、 -0.22% 近辺で期間末を迎えました。

ポートフォリオ

運用の基本方針に従い、国庫短期証券の購入や現先取引、コールローンや金銭信託などを通じて、元本の安全性を重視した運用を行ないました。

○今後の運用方針

引き続き、安定した収益の確保をめざして安定運用を行なう方針です。主要投資対象は原則として、わが国の国債および格付の高い公社債とし、それらの現先取引なども活用する方針です。また、コールローンや金銭信託などに投資することもあります。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○1万口当たりの費用明細

(2023年1月17日～2024年1月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,153円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2023年1月17日～2024年1月15日)

該当事項はございません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月17日～2024年1月15日)

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年1月17日～2024年1月15日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2024年1月15日現在)

2024年1月15日現在、有価証券等の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

(2024年1月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	293,708	100.0
投資信託財産総額	293,708	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	293,708,776
コール・ローン等	293,708,776
(B) 負債	198,597
未払解約金	198,565
未払利息	32
(C) 純資産総額(A-B)	293,510,179
元本	289,106,290
次期繰越損益金	4,403,889
(D) 受益権総口数	289,106,290口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,152円

(注) 当ファンドの期首元本額は311,251,070円、期中追加設定元本額は8,857,811円、期中一部解約元本額は31,002,591円です。

(注) 2024年1月15日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・グローバル3倍3分法ファンド(1年決算型)	153,800,333円
・グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型)	68,175,020円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(株ドルコース)	13,739,040円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(ドルリラコース)	9,629,170円
・世界銀行債券ファンド(毎月分配型)	9,000,074円
・資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース	7,904,694円
・日興・GS世界ソブリン・ファンド(毎月分配型)	6,352,120円
・グローバル3倍3分法(適格機関投資家専用)	5,642,457円
・高金利先進国債券オープン(毎月分配型)	5,477,282円
・資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース	2,481,609円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(ブラジルリアルコース)	2,121,761円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(円ヘッジコース)	2,048,723円
・資源ファンド(株式と通貨)オーストラリアドル・コース	1,047,314円
・高金利先進国債券オープン(資産成長型)	538,501円
・グローバル3倍3分法オープン(適格機関投資家専用)	469,797円
・日興・世界ソブリン・ファンドVA(適格機関投資家転売制限付)	460,360円
・上場インデックスファンド中国A株(パンダ)E Fund CSI300	198,295円
・上場インデックスファンド海外債券(FI SE WGBI)毎月分配型	19,740円

(注) 1口当たり純資産額は1.0152円です。

○損益の状況 (2023年1月17日～2024年1月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 83,775
支払利息	△ 83,775
(B) 保管費用等	△ 385
(C) 当期損益金(A+B)	△ 84,160
(D) 前期繰越損益金	4,826,068
(E) 追加信託差損益金	136,117
(F) 解約差損益金	△ 474,136
(G) 計(C+D+E+F)	4,403,889
次期繰越損益金(G)	4,403,889

(注) 損益の状況の中で(E)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) 損益の状況の中で(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。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年1月17日から2024年1月15日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、新NISA制度における成長投資枠の要件に適合させるため、投資対象ファンドにて行なうデリバティブ取引の利用目的を明確化するべく、2023年10月11日付けにて信託約款の一部に所要の変更を行ないました。(付表、第14条、第15条、第16条)