

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1月24日から無期限です。												
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。												
主要投資対象	ベビーファンド*	以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、「D1AMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に直接投資する場合もあります。											
	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。											
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。											
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の株式を主要投資対象とします。											
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。											
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。											
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	海外の証券取引所に上場している株式*を主要投資対象とします。 ※DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。											
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。												
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とします。												
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券*を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券とします。												
運用方法	<p>主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、各資産クラスの代表的な指数に連動する投資成果をめざして運用を行い、実質的に国内株式、国内債券、国内リート、先進国株式(除く日本)、先進国債券(除く日本)、先進国債券(除く日本、ヘッジあり)、先進国リート(除く日本)、新興国株式、新興国債券へ投資します。なお、先進国株式(除く日本)については、各ファンドにおいて部分的に為替ヘッジ¹⁾を行う場合があります。</p> <p>(注)一部の通貨については流動性の観点等から対円での為替ヘッジが困難であるため、主要国通貨で代替的にヘッジする場合があります。</p> <p>ファンドごとに目標とするリスク水準(標準偏差)¹⁾を設定します。</p> <p>(*)目標とするリスク水準(標準偏差)とは、ファンドの月次収益率の標準偏差(年率)の目標を指し、保有資産比率を決定する際の目標値として使用します。このため実際のリスク水準が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。また目標リスク水準は今後変更される場合があります。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>ファンド名</th> <th>(保守型)</th> <th>(安定型)</th> <th>(安定成長型)</th> <th>(成長型)</th> <th>(積極型)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>目標リスク水準(年率標準偏差)</td> <td>約2%程度</td> <td>約5%程度</td> <td>約7%程度</td> <td>約10%程度</td> <td>約13%程度</td> </tr> </tbody> </table> <p>資産別の投資比率は、各資産に期待される収益率や過去一定期間における資産価格変動性(標準偏差)等、客観的に入手しうるデータに基づき、最適化計算(目標リスク水準に対してリターンが最大化されるような投資比率を求める計算)を行い定量的に算出されます。決定された投資比率に基づき、各マザーファンド受益証券への投資を行いポートフォリオを構築します。投資比率の見直しは原則として年2回行うこととします。なお、一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。</p>	ファンド名	(保守型)	(安定型)	(安定成長型)	(成長型)	(積極型)	目標リスク水準(年率標準偏差)	約2%程度	約5%程度	約7%程度	約10%程度	約13%程度
ファンド名	(保守型)	(安定型)	(安定成長型)	(成長型)	(積極型)								
目標リスク水準(年率標準偏差)	約2%程度	約5%程度	約7%程度	約10%程度	約13%程度								
組入制限	株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。												
分配方針	決算日(原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。)に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。												

*ベビーファンドとは、たわらノーロード 最適化バランス(保守型)、たわらノーロード 最適化バランス(安定型)、たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)、たわらノーロード 最適化バランス(成長型)、たわらノーロード 最適化バランス(積極型)です。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

運用報告書(全体版)

第4期<決算日2021年10月12日>

たわらノーロード 最適化バランス
(保守型) / (安定型) / (安定成長型) / (成長型) / (積極型)

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「たわらノーロード 最適化バランス」は、2021年10月12日に第4期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

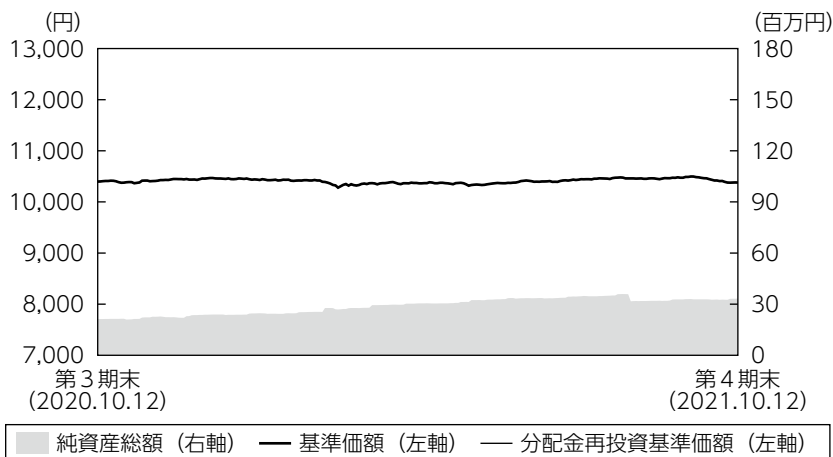
アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

■当期の運用経過 (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

たわらノーロード 最適化バランス (保守型) 基準価額等の推移



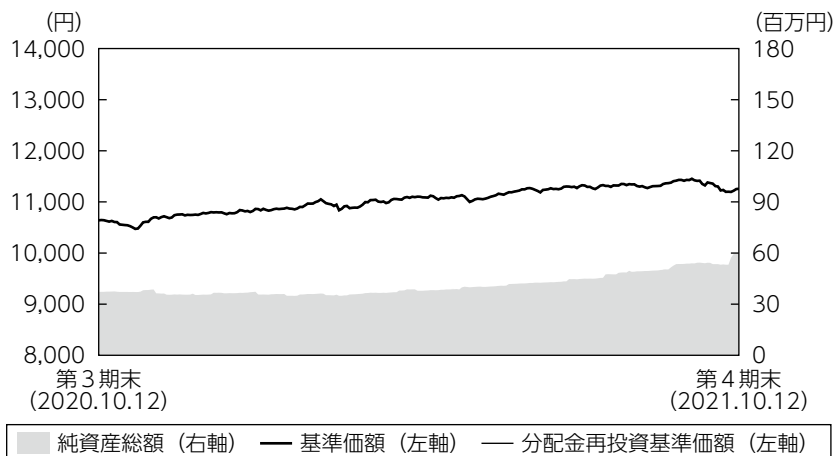
第4期首：10,398円
第4期末：10,379円
(既払分配金0円)
騰落率：△0.2%
(分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

各国で新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から主要国の債券市場で金利が上昇（価格は下落）したことがマイナスに寄与しました。一方、米国の大統領選挙を巡る政治不透明感が払拭したことや、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から世界的に株式市場とリート市場が大きく上昇したこと、また、為替市場で多くの組入通貨に対し円安現地通貨高となったこと等がプラスに寄与しました。

たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 基準価額等の推移



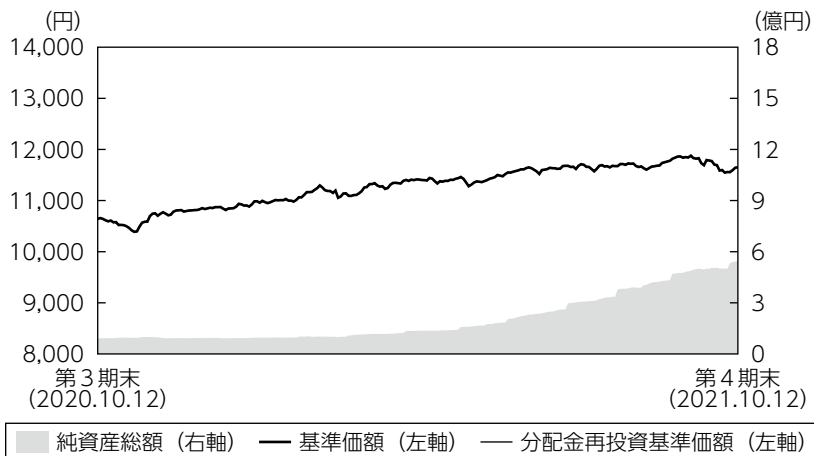
第4期首：10,639円
 第4期末：11,257円
 (既払分配金0円)
 騰落率：5.8%
 (分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

各国で新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から主要国の債券市場で金利が上昇（価格は下落）したことがマイナスに寄与しました。一方、米国の大統領選挙を巡る政治不透明感が払拭したことや、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から世界的に株式市場とリート市場が大きく上昇したこと、また、為替市場で多くの組入通貨に対し円安現地通貨高となったこと等がプラスに寄与しました。

たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 基準価額等の推移



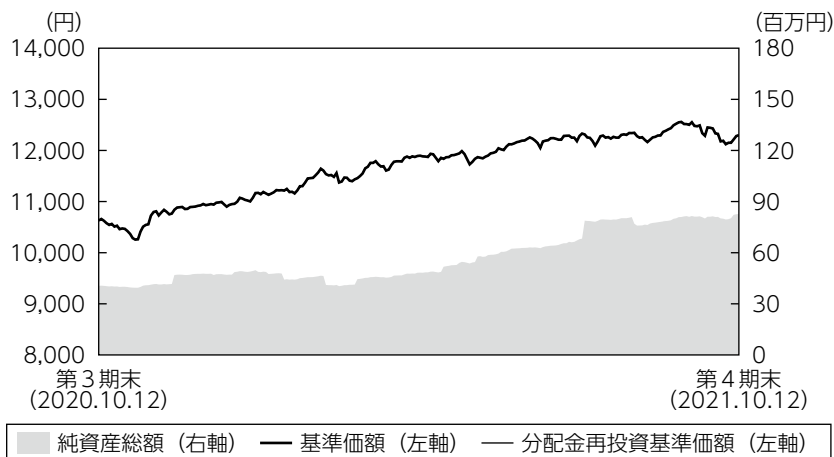
第4期首：10,644円
 第4期末：11,651円
 (既払分配金0円)
 騰落率：9.5%
 (分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

各国で新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から主要国の債券市場で金利が上昇（価格は下落）したことがマイナスに寄与しました。一方、米国の大統領選挙を巡る政治不透明感が払拭したことや、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から世界的に株式市場とリート市場が大きく上昇したこと、また、為替市場で多くの組入通貨に対し円安現地通貨高となったこと等がプラスに寄与しました。

たわらノーロード 最適化バランス（成長型） 基準価額等の推移



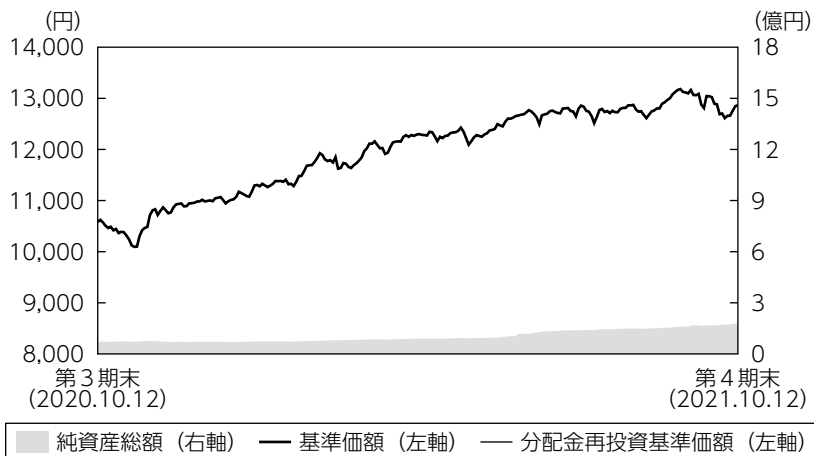
第4期首：10,631円
 第4期末：12,298円
 (既払分配金0円)
 騰落率：15.7%
 (分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

各国で新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から主要国の債券市場で金利が上昇（価格は下落）したことがマイナスに寄与しました。一方、米国の大統領選挙を巡る政治不透明感が払拭したことや、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から世界的に株式市場とリート市場が大きく上昇したこと、また、為替市場で多くの組入通貨に対し円安現地通貨高となったこと等がプラスに寄与しました。

たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 基準価額等の推移



第4期首：10,582円
 第4期末：12,864円
 (既払分配金0円)
 騰落率：21.6%
 (分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

各国で新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から主要国の債券市場で金利が上昇（価格は下落）したことがマイナスに寄与しました。一方、米国の大統領選挙を巡る政治不透明感が払拭したことや、経済活動の正常化に対する期待感が高まったこと等から世界的に株式市場とリート市場が大きく上昇したこと、また、為替市場で多くの組入通貨に対し円安現地通貨高となったこと等がプラスに寄与しました。

投資環境

国内株式市場は、期初は下落して始まりましたが、2020年11月から2021年3月半ばまでは世界的な低金利継続や新型コロナウイルスのワクチン開発の期待などを受けて続伸しました。その後は、新型コロナウイルスの感染状況、ワクチン接種の進捗、米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月から期末にかけては、菅首相の退陣と共に上昇した後、岸田新首相の政策不安や米国の金利上昇などを要因として下落しました。

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2021年2月にかけては国内株式市場の上昇などを受けて利回りは上昇しました。3月から8月にかけては、新型コロナウイルスの感染収束が見通せない中、国内景気の先行き不透明感が意識され利回りは低下（価格は上昇）しました。9月から期末にかけては、米国で金融当局による年内の資産買い入れ縮小が示唆されたことや、エネルギー価格の上昇を受けインフレ懸念が高まったことなどを背景に、利回りは上昇しました。

先進国株式市場は上昇しました。期初は米国の大統領選挙を巡る不透明感などから調整しました。2020年11月以降は新型コロナウイルスのワクチン開発や接種の進展などを受け堅調に推移し、2021年に入っても変異株の感染拡大による不透明感や米国のインフレ加速への懸念などから調整する場面も見られましたが、経済活動正常化への期待感やF R B（米連邦準備理事会）議長が利上げを急がないとの姿勢を示したことなどを受け、堅調に推移し期末を迎えました。

先進国債券市場では、米国債、ドイツ債の利回りは、ともに上昇（価格は下落）しました。米国債は、新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により米国の景気回復が加速するとの見方や、F O M C（米連邦公開市場委員会）で早期にテーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）が開始される可能性が示されたことをを受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についても、E C B（欧州中央銀行）が資産買い入れペースを減速させるとの見方などをを受けて利回りは上昇しました。

新興国株式市場は上昇しました。2020年11月以降、新型コロナウイルスのワクチン開発や接種の進展、経済活動正常化への期待感を受け堅調に推移しました。2021年2月に入ると米国長期金利の上昇などから上値の重い展開となりました。その後はインドでの新型コロナウイルス新規感染者数の減少などが好感され、中国株やインド株を中心に上昇しました。7月以降、中国のインターネット企業に対する監督強化が嫌気されたことや、中国大手不動産会社の破綻懸念などから調整して期末を迎えました。

新興国債券市場は小幅に下落（利回りは上昇）しました。2020年12月までは米国大統領選挙でのバイデン氏勝利や新型コロナウイルスのワクチンの開発や接種進展への期待感などから上昇（利回りは低下）しましたが、過度なインフレへの懸念が台頭すると大きく下落しました。その後は米金融緩和の早期縮小懸念の後退などにより反発しましたが、2021年9月半ば以降は中国不動産大手の資金繰り悪化などからリスク回避姿勢が強まったこと、米金融政策がタカ派的と受け止められたことなどから、急落しました。対米国債スプレッド（利回り格差）は縮小しました。

国内リート市場は上昇しました。期初は新型コロナウイルス用ワクチン開発への期待やその後の欧米でのワクチン接種の進展が相場を支えました。中旬以降は国内におけるワクチン接種の進展、長期金利の低位安定や相対的に高い配当利回りに着目した資金流入などを背景に堅調な推移となりました。期末にかけては利益確定の売りや相次ぐ公募増資による需給悪化懸念などにより、やや軟調な推移となりました。

先進国リート市場は上昇しました。米国リート市場は新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済正常化への期待や、大型経済対策法案の可決を受け堅調に推移した後、期末には中国大手不動産を巡る懸念から上昇幅を縮小しました。欧州リート市場はワクチン接種の進展が支援材料となり上昇しました。オーストラリアリート市場は前半ばにロックダウンを受けて下落する局面がありましたが、その後は好調な経済指標の発表などから上昇しました。

為替市場では多くの先進国通貨に対して円安の動きとなりました。ドル/円相場は、新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済活動の正常化に対する期待感等から米国の金利が大きく上昇し内外金利差が拡大する中、円安ドル高となりました。その他の主要通貨に対しても、経済活動の正常化に対する期待感等から主要国の金利が大きく上昇し内外金利差が拡大する中、円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

各ファンドは、マザーファンドを通じて実質的に国内外の株式、債券およびリートに投資を行いました。また、各ファンドは決定された投資比率に基づき、各マザーファンドの組入れを行い、先進国株式については各ファンドにおいてその一部または全部の為替ヘッジを行いました。なお、2021年1月と2021年7月に基本配分比率を変更しました。

○組入ファンドの当作成期間の騰落率および期末時点の組入比率

投資対象資産	組入ファンド	騰落率	組入比率				
			(保守型)	(安定型)	(安定成長型)	(成長型)	(積極型)
国内株式	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	23.2%	5.9%	12.7%	16.6%	20.5%	27.4%
国内債券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.1%	60.6%	23.5%	16.5%	8.5%	0.5%
先進国株式	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	35.9%	0.0%	7.1%	12.2%	20.4%	27.5%
先進国債券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.4%	1.0%	9.0%	8.1%	6.0%	3.0%
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△3.6%	25.9%	30.9%	25.9%	18.9%	11.9%
新興国株式	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	21.9%	—	1.0%	2.0%	3.1%	4.1%
新興国債券	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	4.7%	6.0%	8.0%	7.0%	5.0%	3.0%
国内リート	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	23.5%	—	6.9%	8.9%	10.9%	12.9%
先進国リート	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	38.0%	—	0.3%	2.0%	6.1%	9.2%
現金等	—	—	0.5%	0.5%	0.6%	0.6%	0.5%

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

各組入ファンドはベンチマークのリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

○組入ファンドのベンチマーク

組入ファンド	ベンチマーク
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）

分配金

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

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当			期	
	(保守型)	(安定型)	(安定成長型)	(成長型)	(積極型)
当期分配金（税引前）	-円	-円	-円	-円	-円
対基準価額比率	-%	-%	-%	-%	-%
当期の収益	-円	-円	-円	-円	-円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	379円	1,256円	1,651円	2,298円	2,863円

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

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

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

今後の運用方針

各ファンドでは、各ファンドとも各資産の保有比率が決定された投資比率に維持されるように各マザーファンドへの投資を実施します。マザーファンドの組入比率につきましては、高位組入れを維持します。

各組入ファンドは、引き続きベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■分配金のお知らせ

各ファンドの収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■各ファンドが投資対象とする「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において信託金の限度額を1兆円から5兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年1月8日)

■各ファンドが投資対象とする「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」において信託金の限度額を2,000億円から5,000億円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年6月2日)

たわらノーロード 最適化バランス (保守型)

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	新株予約権付社債(転換社債)比率	投資信託受託証券、投資証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率							
(設定日) 2018年1月24日	円 10,000	円 -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 1
1期 (2018年10月12日)	9,833	0	△1.7	5.5	0.2	91.7	-	-	0.0	2
2期 (2019年10月15日)	10,351	0	5.3	6.8	0.2	88.6	-	-	0.1	15
3期 (2020年10月12日)	10,398	0	0.5	4.9	0.1	93.5	-	-	0.0	21
4期 (2021年10月12日)	10,379	0	△0.2	5.7	0.2	93.3	-	-	0.0	33

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

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

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注6) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基準価額		株 式 組 比	株 式 先 物 率	債 券 組 比	券 入 率	新株予約権付社債(転換社債)組入比率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
	円	騰落率							
(期首) 2020年10月12日	10,398	% -	% 4.9	% 0.1	% 93.5	% -	% -	% -	% 0.0
10月 末	10,366	△0.3	4.8	0.1	92.7	-	-	0.0	
11月 末	10,440	0.4	4.8	0.2	94.3	-	-	0.0	
12月 末	10,455	0.5	5.0	0.1	93.4	-	-	0.0	
2021年1月 末	10,415	0.2	4.8	0.1	94.0	-	-	0.0	
2月 末	10,279	△1.1	4.8	0.1	93.9	-	-	0.0	
3月 末	10,356	△0.4	5.0	0.2	93.9	-	-	0.0	
4月 末	10,345	△0.5	4.8	0.2	93.8	-	-	0.0	
5月 末	10,368	△0.3	4.9	0.2	93.8	-	-	0.0	
6月 末	10,393	△0.0	4.8	0.2	93.5	-	-	0.0	
7月 末	10,448	0.5	5.8	0.2	92.5	-	-	0.0	
8月 末	10,466	0.7	5.9	0.2	92.4	-	-	0.0	
9月 末	10,420	0.2	5.7	0.2	93.8	-	-	0.0	
(期末) 2021年10月12日	10,379	△0.2	5.7	0.2	93.3	-	-	0.0	

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	(2020年10月13日 ～2021年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	57円	0.550%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,410円です。
(投信会社)	(26)	(0.253)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(26)	(0.253)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(5)	(0.044)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.007	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(0)	(0.004)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	58	0.557	

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

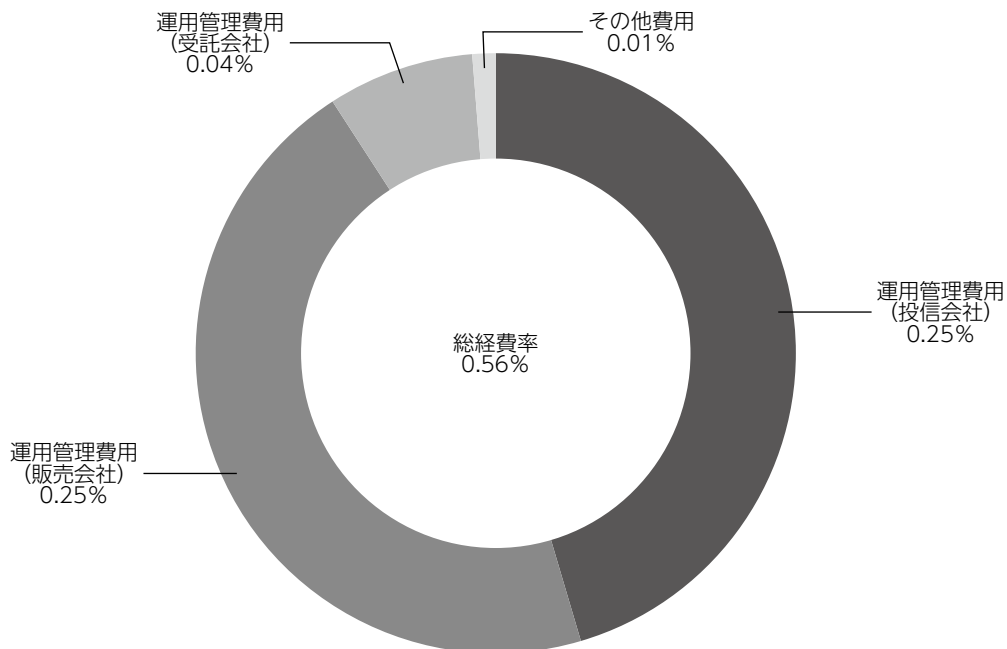
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.56%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	513	1,586	320	996
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	10,046	13,120	4,575	5,984
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	－	－	－	－
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	160	322	212	434
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	4,327	6,281	1,998	2,901
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	652	1,394	247	533

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	566,365,897千円	433,615,079千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	322,384,030千円	485,262,670千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.75	0.89

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

【たわらノーロード 最適化バランス（保守型）における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 318,180	百万円 50,087	% 15.7	百万円 248,185	百万円 7,021	% 2.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 2,570	百万円 1,904	百万円 3,236

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当	期
	買 付 額	買 付 額
株 式		百万円 523

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 561,417	百万円 60,978	% 10.9	百万円 257,326	百万円 30,397	% 11.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
公 社 債	百万円 304

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期		末
	□ 数	□ 数	評 価	額
	千□	千□		千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	403	596		1,955
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,998	15,470		20,189
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1	1		8
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	213	161		333
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,724	6,052		8,630
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	515	920		2,011

■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,955	5.9
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20,189	60.5
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8	0.0
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	333	1.0
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,630	25.8
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	2,011	6.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	268	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	33,395	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年10月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは603,957,812千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは148,874,094千円、97.8%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは528,845,695千円、99.5%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは113,656,003千円、99.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円、1カナダ・ドル=90.84円、1オーストラリア・ドル=83.31円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.70円、1ニュージーランド・ドル=78.66円、1台湾・ドル=4.041円、1イギリス・ポンド=154.20円、1イスラエル・シェケル=35.165円、1スイス・フラン=122.32円、1トルコ・リラ=12.613円、1デンマーク・クローネ=17.62円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=5.436円、1フィリピン・ペソ=2.234円、100チリ・ペソ=13.755円、100コロンビア・ペソ=3,012円、1クウェート・ディナール=376.95円、1カタール・リアル=31.07円、1サウジアラビア・リアル=30.31円、1インド・ルピー=1.51円、1パキスタン・ルピー=0.67円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.95円、1ブラジル・レアル=20.489円、1チェコ・コルナ=5.162円、100韓国・ウォン=9.47円、1オフショア・人民元=17.572円、1マレーシア・リンギット=27.173円、1南アフリカ・ランド=7.52円、1タイ・バーツ=3.39円、1ポーランド・ズロチ=28.559円、100ハンガリー・フォリント=36.457円、1ユーロ=131.12円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	33,395,825円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	268,921
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	1,955,407
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	20,189,058
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	8,073
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	333,100
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	8,630,066
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	2,011,200
(B) 負 債	91,069
未 払 信 託 報 酬	90,520
そ の 他 未 払 費 用	549
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	33,304,756
元 本	32,087,475
次 期 繰 越 損 益 金	1,217,281
(D) 受 益 権 総 口 数	32,087,475口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	10,379円

(注) 期首における元本額は20,448,102円、当期中における追加設定元本額は24,844,256円、同解約元本額は13,204,883円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△6円
支 払 利 息	△6
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	88,722
売 買 益	414,318
売 買 損	△325,596
(C) 信 託 報 酬 等	△159,651
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△70,935
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	106,796
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,181,420
(配 当 等 相 当 額)	(753,037)
(売 買 損 益 相 当 額)	(428,383)
(G) 合 計(D+E+F)	1,217,281
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,217,281
追 加 信 託 差 損 益 金	1,181,420
(配 当 等 相 当 額)	(765,527)
(売 買 損 益 相 当 額)	(415,893)
分 配 準 備 積 立 金	336,175
繰 越 損 益 金	△300,314

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	207,381円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	881,106
(d) 分 配 準 備 積 立 金	128,794
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,217,281
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	379.36
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

たわらノーロード 最適化バランス (安定型)

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	投資信託(受益証券)比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率							
(設定日) 2018年1月24日	円 10,000	円 -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 1
1期 (2018年10月12日)	9,790	0	△2.1	12.5	0.7	70.7	-	-	11.5	3
2期 (2019年10月15日)	10,636	0	8.6	14.5	0.7	68.1	-	-	14.0	33
3期 (2020年10月12日)	10,639	0	0.0	13.7	0.6	74.3	-	-	10.0	37
4期 (2021年10月12日)	11,257	0	5.8	20.0	0.8	71.1	-	-	7.2	59

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注6) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注7) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基準価額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 率
	円	騰 落 率						
(期 首) 2020 年 10 月 12 日	10,639	% -	% 13.7	% 0.6	% 74.3	% -	% -	% 10.0
10 月 末	10,472	△1.6	13.2	0.6	73.5	-	-	9.7
11 月 末	10,737	0.9	13.7	0.7	75.1	-	-	10.0
12 月 末	10,833	1.8	13.6	0.6	74.1	-	-	10.1
2021 年 1 月 末	10,866	2.1	17.8	0.7	72.1	-	-	8.6
2 月 末	10,837	1.9	18.3	0.6	71.3	-	-	8.3
3 月 末	11,049	3.9	18.1	0.9	71.3	-	-	8.4
4 月 末	11,082	4.2	18.2	0.8	71.1	-	-	8.5
5 月 末	11,151	4.8	18.1	0.8	71.5	-	-	8.4
6 月 末	11,248	5.7	17.9	1.0	70.9	-	-	8.5
7 月 末	11,294	6.2	19.9	0.7	70.2	-	-	7.5
8 月 末	11,363	6.8	20.3	0.7	70.0	-	-	7.5
9 月 末	11,302	6.2	19.4	0.8	69.1	-	-	7.1
(期 末) 2021 年 10 月 12 日	11,257	5.8	20.0	0.8	71.1	-	-	7.2

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	(2020年10月13日 ～2021年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	61円	0.550%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,037円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(28)	(0.253)	
(販売会社)	(28)	(0.253)	
(受託会社)	(5)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.004	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.003)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	2	0.020	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.007)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(1)	(0.009)	
合計	63	0.575	

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

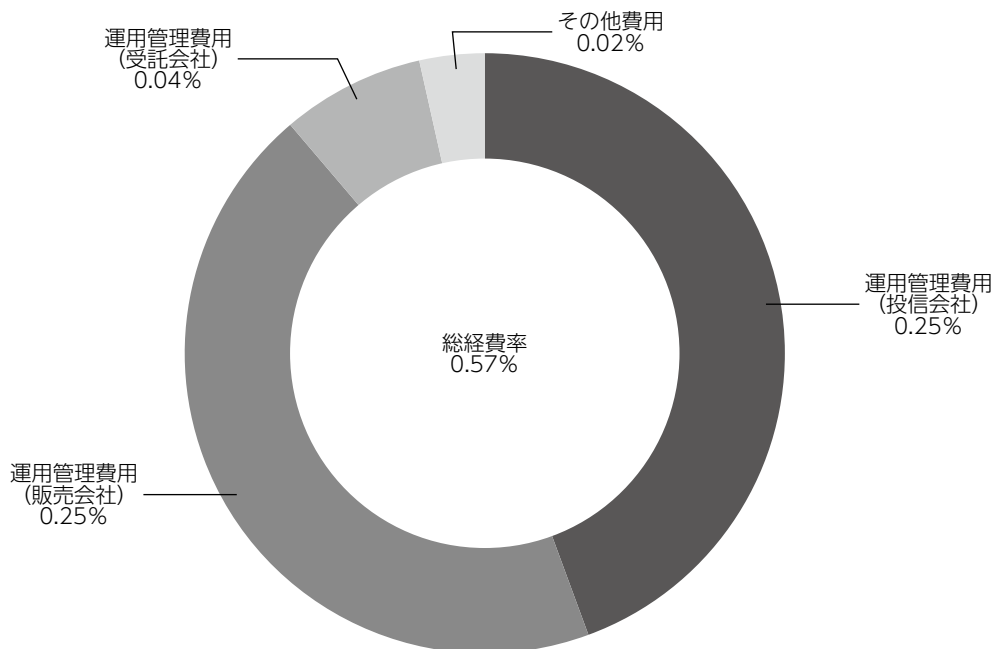
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.57%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	1,755	5,508	698	2,139
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	7,055	9,225	2,902	3,793
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	696	3,347	308	1,489
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,477	3,000	1,269	2,529
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	7,707	11,144	2,456	3,604
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	223	323	146	201
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	1,136	2,437	372	785
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	1,284	2,914	707	1,591
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	153	174	1,390	1,664

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期		
	国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド	エマージング株式 パッシブ・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	566,365,897千円	433,615,079千円	124,981,010千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	322,384,030千円	485,262,670千円	57,916,864千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	1.75	0.89	2.15

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

【たわらノーロード 最適化バランス（安定型）における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 318,180	百万円 50,087	% 15.7	百万円 248,185	百万円 7,021	% 2.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 2,570	百万円 1,904	百万円 3,236

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 523

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 561,417	百万円 60,978	% 10.9	百万円 257,326	百万円 30,397	% 11.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
公 社 債	百万円 304

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 270,034	百万円 720	% 0.3	百万円 128,009	百万円 237	% 0.2

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 12,271

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	1,265	2,321	7,609
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,647	10,800	14,094
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	375	763	4,257
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,423	2,632	5,418
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,726	12,977	18,502
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	323	400	587
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,435	2,199	4,807
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1,125	1,702	4,142
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,364	126	200

■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	7,609	12.7
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14,094	23.5
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,257	7.1
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,418	9.0
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	18,502	30.8
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	587	1.0
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	4,807	8.0
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	4,142	6.9
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	200	0.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	461	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	60,083	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年10月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは603,957,812千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは148,874,094千円、97.8%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは528,845,695千円、99.5%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは63,210,342千円、99.2%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは113,656,003千円、99.4%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは64,355,846千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円、1カナダ・ドル=90.84円、1オーストラリア・ドル=83.31円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.70円、1ニューージーランド・ドル=78.66円、1台湾・ドル=4.041円、1イギリス・ポンド=154.20円、1イスラエル・シェケル=35.165円、1スイス・フラン=122.32円、1トルコ・リラ=12.613円、1デンマーク・クローネ=17.62円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=5.436円、1フィリピン・ペソ=2.234円、100チリ・ペソ=13.755円、100コロンビア・ペソ=3.012円、1クウェート・ディナール=376.95円、1カタール・リアル=31.07円、1サウジアラビア・リアル=30.31円、1インド・ルピー=1.51円、1パキスタン・ルピー=0.67円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.95円、1ブラジル・レアル=20.489円、1チェコ・コルナ=5.162円、100韓国・ウォン=9.47円、1オフショア・人民元=17.572円、1マレーシア・リンギット=27.173円、1南アフリカ・ランド=7.52円、1タイ・バーツ=3.39円、1ポーランド・ズロチ=28.559円、100ハンガリー・フォリント=36.457円、1ユーロ=131.12円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	60,083,408円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	461,672
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	7,609,425
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	14,094,103
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	4,257,789
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	5,418,781
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	18,502,876
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	587,768
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	4,807,676
J-R-E-I-Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	4,142,508
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	200,810
(B) 負 債	138,409
未 払 解 約 金	11,519
未 払 信 託 報 酬	126,077
そ の 他 未 払 費 用	813
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	59,944,999
元 本	53,251,724
次 期 繰 越 損 益 金	6,693,275
(D) 受 益 権 総 口 数	53,251,724口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	11,257円

(注) 期首における元本額は34,965,629円、当期中における追加設定元本額は33,732,331円、同解約元本額は15,446,236円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△6円
支 払 利 息	△6
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,959,876
売 買 益	2,785,100
売 買 損	△825,224
(C) 信 託 報 酬 等	△227,160
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,732,710
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	426,941
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,533,624
(配 当 等 相 当 額)	(2,732,808)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,800,816)
(G) 合 計(D+E+F)	6,693,275
次 期 繰 越 損 益 金(G)	6,693,275
追 加 信 託 差 損 益 金	4,533,624
(配 当 等 相 当 額)	(2,756,511)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,777,113)
分 配 準 備 積 立 金	2,159,651

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	686,595円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	857,843
(c) 収 益 調 整 金	4,533,624
(d) 分 配 準 備 積 立 金	615,213
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	6,693,275
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	1,256.91
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債比率	債券先物比率	投資信託受託資産比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率							
(設定日) 2018年1月24日	円 10,000	円 -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 1
1期 (2018年10月12日)	9,769	0	△2.3	18.9	1.0	57.3	-	-	17.8	21
2期 (2019年10月15日)	10,707	0	9.6	22.1	1.0	54.6	-	-	20.1	50
3期 (2020年10月12日)	10,644	0	△0.6	19.5	0.8	61.2	-	-	17.1	92
4期 (2021年10月12日)	11,651	0	9.5	29.7	1.1	57.3	-	-	11.0	546

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注6) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注7) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基準価額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 率
	円	騰 落 率						
(期 首) 2020 年 10 月 12 日	10,644	% -	% 19.5	% 0.8	% 61.2	% -	% -	% 17.1
10 月 末	10,388	△2.4	18.9	0.8	60.8	-	-	16.7
11 月 末	10,785	1.3	19.2	0.9	61.2	-	-	16.9
12 月 末	10,925	2.6	19.5	0.8	61.0	-	-	17.3
2021 年 1 月 末	10,999	3.3	26.4	1.0	58.4	-	-	13.3
2 月 末	11,054	3.9	26.8	0.9	58.0	-	-	13.3
3 月 末	11,341	6.5	26.7	1.4	57.7	-	-	13.1
4 月 末	11,403	7.1	26.9	1.2	57.5	-	-	13.1
5 月 末	11,486	7.9	26.9	1.2	57.7	-	-	12.9
6 月 末	11,619	9.2	26.3	1.4	57.6	-	-	13.0
7 月 末	11,648	9.4	29.6	1.1	56.5	-	-	11.2
8 月 末	11,750	10.4	29.9	1.1	56.4	-	-	11.2
9 月 末	11,693	9.9	29.3	1.2	55.1	-	-	10.5
(期 末) 2021 年 10 月 12 日	11,651	9.5	29.7	1.1	57.3	-	-	11.0

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	(2020年10月13日 ～2021年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	62円	0.550%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,280円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(29)	(0.253)	
(販売会社)	(29)	(0.253)	
(受託会社)	(5)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	0	0.004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.002)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	1	0.008	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.005)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(d) その他費用	3	0.029	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.008)	
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(2)	(0.017)	
合計	67	0.590	

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

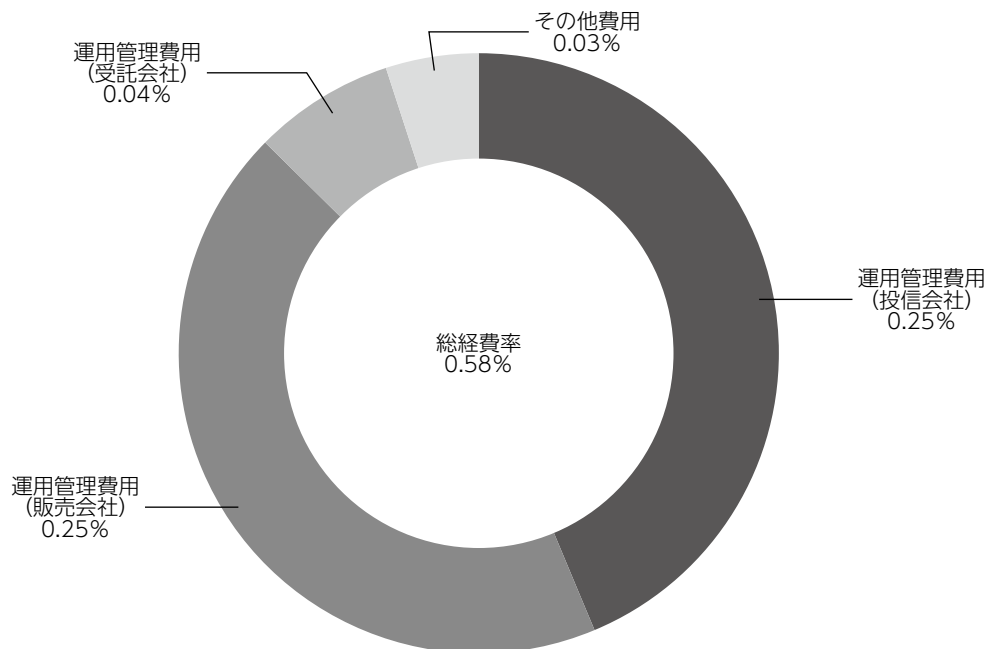
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.58%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	25,469	80,844	1,545	4,610
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	68,055	89,018	10,401	13,599
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	10,865	57,163	736	3,334
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	18,839	38,472	3,412	6,796
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	87,753	126,752	3,887	5,707
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	7,330	10,675	500	711
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	15,608	33,762	1,533	3,225
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	19,005	46,187	3,114	7,356
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	6,583	9,635	6,284	7,539

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期		
	国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド	エマージング株式 パッシブ・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	566,365,897千円	433,615,079千円	124,981,010千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	322,384,030千円	485,262,670千円	57,916,864千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	1.75	0.89	2.15

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021年10月12日まで）
【たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況
 期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	7千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.008千円
(B)／(A)	0.1%

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

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 318,180	百万円 50,087	% 15.7	百万円 248,185	百万円 7,021	% 2.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 2,570	百万円 1,904	百万円 3,236

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 523

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 561,417	百万円 60,978	% 10.9	百万円 257,326	百万円 30,397	% 11.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
公 社 債	百万円 304

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期 末		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 270,034	百万円 720	% 0.3	百万円 128,009	百万円 237	% 0.2

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 12,271

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	3,821	27,745	90,929
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,531	69,185	90,287
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,855	11,985	66,876
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,989	21,415	44,079
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,394	99,261	141,526
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	799	7,630	11,187
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	3,546	17,621	38,514
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4,170	20,061	48,811
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,744	7,042	11,138

■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	90,929	16.6
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	90,287	16.5
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	66,876	12.2
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	44,079	8.0
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	141,526	25.8
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	11,187	2.0
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	38,514	7.0
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	48,811	8.9
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,138	2.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,482	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	547,835	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年10月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは603,957,812千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは148,874,094千円、97.8%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは528,845,695千円、99.5%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは63,210,342千円、99.2%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは113,656,003千円、99.4%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは64,355,846千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円、1カナダ・ドル=90.84円、1オーストラリア・ドル=83.31円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.70円、1ニューージーランド・ドル=78.66円、1台湾・ドル=4.041円、1イギリス・ポンド=154.20円、1イスラエル・シェケル=35.165円、1スイス・フラン=122.32円、1トルコ・リラ=12.613円、1デンマーク・クローネ=17.62円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=5.436円、1フィリピン・ペソ=2.234円、100チリ・ペソ=13.755円、100コロンビア・ペソ=3.012円、1クウェート・ディナール=376.95円、1カタール・リアル=31.07円、1サウジアラビア・リアル=30.31円、1インド・ルピー=1.51円、1パキスタン・ルピー=0.67円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.95円、1ブラジル・レアル=20.489円、1チェコ・コルナ=5.162円、100韓国・ウォン=9.47円、1オフショア・人民元=17.572円、1マレーシア・リンギット=27.173円、1南アフリカ・ランド=7.52円、1タイ・バーツ=3.39円、1ポーランド・ズロチ=28.559円、100ハンガリー・フォリント=36.457円、1ユーロ=131.12円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	547,835,686円
コール・ローン等	4,482,757
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	90,929,819
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	90,287,342
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	66,876,503
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	44,079,869
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	141,526,693
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	11,187,786
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	38,514,980
J-R-E-I-Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	48,811,604
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	11,138,333
(B) 負 債	1,405,852
未払解約金	550,951
未払信託報酬	848,953
その他未払費用	5,948
(C) 純資産総額(A-B)	546,429,834
元 本	468,979,128
次期繰越損益金	77,450,706
(D) 受益権総口数	468,979,128口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,651円

(注) 期首における元本額は86,738,094円、当期中における追加設定元本額は444,800,840円、同解約元本額は62,559,806円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△314円
受 取 利 息	19
支 払 利 息	△333
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,877,147
売 買 益	14,236,646
売 買 損	△4,359,499
(C) 信 託 報 酬 等	△1,133,399
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	8,743,434
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,411,761
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	67,295,511
(配 当 等 相 当 額)	(35,584,265)
(売 買 損 益 相 当 額)	(31,711,246)
(G) 合 計(D+E+F)	77,450,706
次 期 繰 越 損 益 金(G)	77,450,706
追 加 信 託 差 損 益 金	67,295,511
(配 当 等 相 当 額)	(35,922,598)
(売 買 損 益 相 当 額)	(31,372,913)
分 配 準 備 積 立 金	10,155,195

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	3,897,058円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	4,525,949
(c) 収 益 調 整 金	67,295,511
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,732,188
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	77,450,706
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,651.47
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

たわらノーロード 最適化バランス (成長型)

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	投資信託(受益証券)組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率							
(設定日) 2018年1月24日	円 10,000	円 -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 1
1期 (2018年10月12日)	9,720	0	△2.8	31.1	1.6	36.9	-	-	25.2	11
2期 (2019年10月15日)	10,764	0	10.7	32.7	1.4	34.3	-	-	30.1	20
3期 (2020年10月12日)	10,631	0	△1.2	32.9	1.3	40.4	-	-	24.2	40
4期 (2021年10月12日)	12,298	0	15.7	42.2	1.5	38.3	-	-	17.1	82

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注6) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注7) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基準価額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 率
	円	騰 落 率						
(期 首) 2020 年 10 月 12 日	10,631	% -	% 32.9	% 1.3	% 40.4	% -	% -	% 24.2
10 月 末	10,256	△3.5	32.2	1.3	40.6	-	-	23.7
11 月 末	10,853	2.1	32.7	1.5	41.3	-	-	24.0
12 月 末	11,058	4.0	32.7	1.4	40.4	-	-	24.2
2021 年 1 月 末	11,191	5.3	39.8	1.5	38.5	-	-	19.5
2 月 末	11,373	7.0	40.0	1.3	38.4	-	-	19.5
3 月 末	11,788	10.9	40.1	1.9	37.6	-	-	19.3
4 月 末	11,910	12.0	40.3	1.8	37.6	-	-	19.2
5 月 末	12,021	13.1	40.3	1.7	38.0	-	-	19.1
6 月 末	12,211	14.9	39.5	2.1	37.8	-	-	19.3
7 月 末	12,231	15.1	41.9	1.6	37.9	-	-	17.4
8 月 末	12,384	16.5	42.4	1.5	37.7	-	-	17.4
9 月 末	12,323	15.9	41.5	1.6	36.5	-	-	16.1
(期 末) 2021 年 10 月 12 日	12,298	15.7	42.2	1.5	38.3	-	-	17.1

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	(2020年10月13日 ～2021年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	64円	0.550%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,662円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(30)	(0.253)	
(販売会社)	(30)	(0.253)	
(受託会社)	(5)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	1	0.006	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.003)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	2	0.014	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.008)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(1)	(0.006)	
(d) その他費用	5	0.040	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.011)	
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(3)	(0.026)	
合計	71	0.611	

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

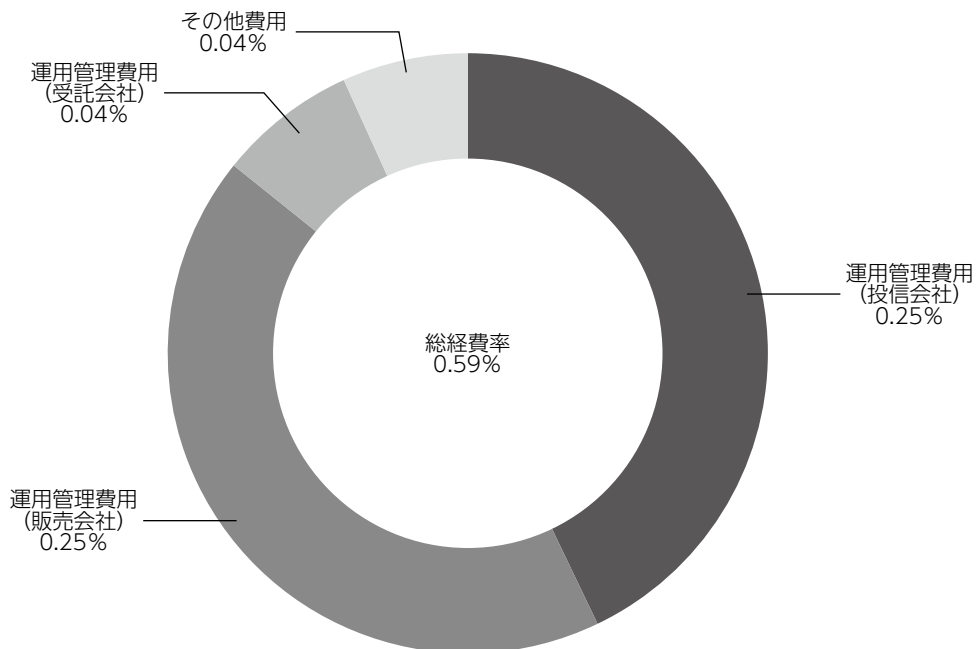
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.59%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	4,544	14,083	1,637	5,101
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,418	7,083	2,928	3,827
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,390	11,917	990	4,822
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,072	4,181	2,056	4,108
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	8,936	12,921	2,274	3,320
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	1,325	1,906	643	922
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	1,486	3,194	358	762
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	3,018	6,965	1,738	4,008
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	2,283	3,195	3,500	4,326

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期		
	国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド	エマージング株式 パッシブ・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	566,365,897千円	433,615,079千円	124,981,010千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	322,384,030千円	485,262,670千円	57,916,864千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	1.75	0.89	2.15

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

【たわらノーロード 最適化バランス（成長型）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	3千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.002千円
(B)／(A)	0.1%

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

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 318,180	百万円 50,087	% 15.7	百万円 248,185	百万円 7,021	% 2.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 2,570	百万円 1,904	百万円 3,236

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 523

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 561,417	百万円 60,978	% 10.9	百万円 257,326	百万円 30,397	% 11.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
公 社 債	百万円 304

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 270,034	百万円 720	% 0.3	百万円 128,009	百万円 237	% 0.2

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 12,271

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	2,271	5,177	16,969
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,893	5,383	7,025
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,617	3,017	16,837
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,409	2,426	4,993
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,294	10,956	15,621
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,046	1,728	2,534
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	773	1,900	4,154
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	2,424	3,704	9,012
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,408	3,191	5,047

■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	16,969	20.4
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,025	8.4
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	16,837	20.2
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,993	6.0
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,621	18.8
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2,534	3.0
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	4,154	5.0
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	9,012	10.8
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,047	6.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	959	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	83,157	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年10月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは603,957,812千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは148,874,094千円、97.8%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは528,845,695千円、99.5%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは63,210,342千円、99.2%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは113,656,003千円、99.4%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは64,355,846千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円、1カナダ・ドル=90.84円、1オーストラリア・ドル=83.31円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.70円、1ニューージーランド・ドル=78.66円、1台湾・ドル=4.041円、1イギリス・ポンド=154.20円、1イスラエル・シェケル=35.165円、1スイス・フラン=122.32円、1トルコ・リラ=12.613円、1デンマーク・クローネ=17.62円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=5.436円、1フィリピン・ペソ=2.234円、100チリ・ペソ=13.755円、100コロンビア・ペソ=3.012円、1クウェート・ディナール=376.95円、1カタール・リアル=31.07円、1サウジアラビア・リアル=30.31円、1インド・ルピー=1.51円、1パキスタン・ルピー=0.67円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.95円、1ブラジル・レアル=20.489円、1チェコ・コルナ=5.162円、100韓国・ウォン=9.47円、1オフショア・人民元=17.572円、1マレーシア・リンギット=27.173円、1南アフリカ・ランド=7.52円、1タイ・バーツ=3.39円、1ポーランド・ズロチ=28.559円、100ハンガリー・フォリント=36.457円、1ユーロ=131.12円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	83,157,612円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	859,698
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	16,969,679
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	7,025,472
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	16,837,576
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	4,993,851
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	15,621,983
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	2,534,256
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	4,154,993
J-R-E-I-Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	9,012,333
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	5,047,771
未 収 入 金	100,000
(B) 負 債	441,342
未 払 解 約 金	250,384
未 払 信 託 報 酬	189,704
そ の 他 未 払 費 用	1,254
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	82,716,270
元 本	67,259,471
次 期 繰 越 損 益 金	15,456,799
(D) 受 益 権 総 口 数	67,259,471口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	12,298円

(注) 期首における元本額は38,133,188円、当期中における追加設定元本額は51,733,528円、同解約元本額は22,607,245円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△15円
支 払 利 息	△15
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,004,774
売 買 益	7,778,355
売 買 損	△1,773,581
(C) 信 託 報 酬 等	△314,607
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	5,690,152
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	648,572
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,118,075
(配 当 等 相 当 額)	(5,746,927)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,371,148)
(G) 合 計(D+E+F)	15,456,799
次 期 繰 越 損 益 金(G)	15,456,799
追 加 信 託 差 損 益 金	9,118,075
(配 当 等 相 当 額)	(5,790,902)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,327,173)
分 配 準 備 積 立 金	6,338,724

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,165,968円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	4,348,441
(c) 収 益 調 整 金	9,118,075
(d) 分 配 準 備 積 立 金	824,315
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	15,456,799
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	2,298.09
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債比率	債券先物比率	投資信託受託資産比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率							
(設定日) 2018年1月24日	円 10,000	円 -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 1
1期 (2018年10月12日)	9,689	0	△3.1	42.5	2.1	16.1	-	-	33.6	25
2期 (2019年10月15日)	10,762	0	11.1	45.9	1.8	14.0	-	-	37.2	41
3期 (2020年10月12日)	10,582	0	△1.7	45.4	1.6	21.8	-	-	30.2	71
4期 (2021年10月12日)	12,864	0	21.6	56.6	2.0	18.4	-	-	22.3	177

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注6) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注7) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基準価額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 率
	円	騰 落 率						
(期 首) 2020 年 10 月 12 日	10,582	% -	% 45.4	% 1.6	% 21.8	% -	% -	% 30.2
10 月 末	10,094	△4.6	44.9	1.6	22.0	-	-	29.6
11 月 末	10,887	2.9	45.0	2.0	21.3	-	-	29.7
12 月 末	11,148	5.3	45.2	1.8	21.8	-	-	30.3
2021 年 1 月 末	11,328	7.0	52.2	1.9	20.3	-	-	24.6
2 月 末	11,624	9.8	52.8	1.6	20.3	-	-	24.5
3 月 末	12,158	14.9	52.4	2.5	20.0	-	-	24.4
4 月 末	12,332	16.5	52.7	2.2	19.8	-	-	24.5
5 月 末	12,469	17.8	52.8	2.2	20.1	-	-	24.2
6 月 末	12,713	20.1	51.9	2.7	20.2	-	-	24.2
7 月 末	12,709	20.1	56.3	2.1	18.1	-	-	22.5
8 月 末	12,922	22.1	56.8	2.0	18.0	-	-	22.3
9 月 末	12,881	21.7	55.6	2.2	16.9	-	-	20.8
(期 末) 2021 年 10 月 12 日	12,864	21.6	56.6	2.0	18.4	-	-	22.3

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	(2020年10月13日 ～2021年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	66円	0.550%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,974円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(30)	(0.253)	
(販売会社)	(30)	(0.253)	
(受託会社)	(5)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	1	0.009	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.004)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(0)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	2	0.020	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.011)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(1)	(0.008)	
(d) その他費用	6	0.050	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.012)	
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(4)	(0.034)	
合計	75	0.629	

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

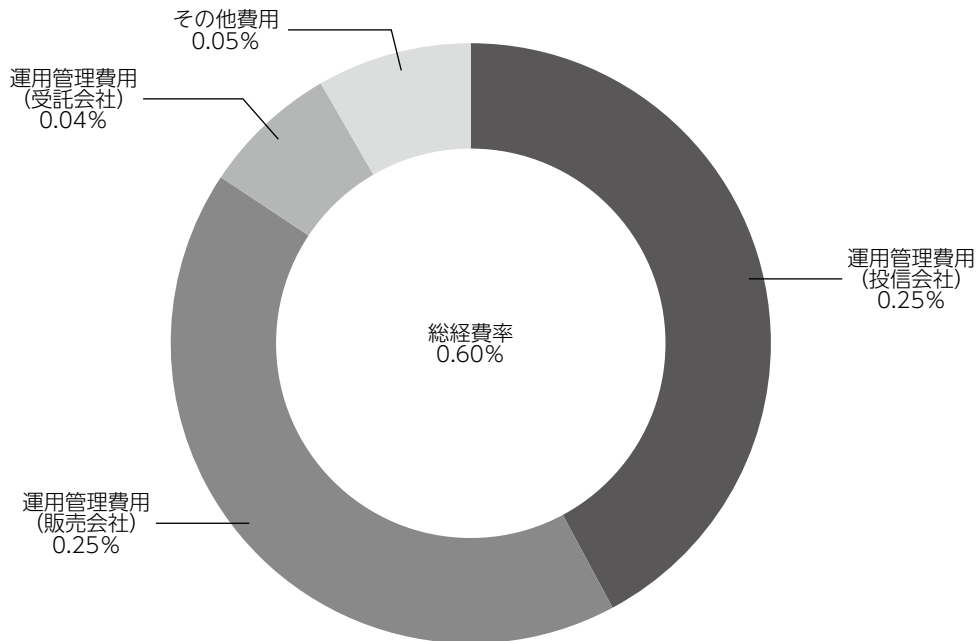
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.60%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	11,083	34,976	1,632	4,829
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	4,258	5,562	4,386	5,736
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,732	29,483	1,284	5,814
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,052	4,160	2,642	5,260
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド	11,763	16,984	1,195	1,750
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	3,806	5,541	713	966
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	1,631	3,502	210	442
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	6,718	15,977	2,328	5,270
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	6,563	9,519	6,681	8,134

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期		
	国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド	エマージング株式 パッシブ・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	566,365,897千円	433,615,079千円	124,981,010千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	322,384,030千円	485,262,670千円	57,916,864千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	1.75	0.89	2.15

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

【たわらノーロード 最適化バランス（積極型）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	9千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.007千円
(B)／(A)	0.1%

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

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 318,180	百万円 50,087	% 15.7	百万円 248,185	百万円 7,021	% 2.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 2,570	百万円 1,904	百万円 3,236

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 523

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 561,417	百万円 60,978	% 10.9	百万円 257,326	百万円 30,397	% 11.8

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
公 社 債	百万円 304

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 270,034	百万円 720	% 0.3	百万円 128,009	百万円 237	% 0.2

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 12,271

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	5,345	14,796	48,493
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	806	678	884
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,283	8,730	48,717
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,190	2,599	5,351
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,263	14,831	21,146
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,846	4,940	7,243
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,023	2,445	5,344
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4,992	9,382	22,828
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	10,378	10,260	16,227

■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	48,493	27.3
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	884	0.5
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	48,717	27.4
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,351	3.0
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21,146	11.9
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	7,243	4.1
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5,344	3.0
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	22,828	12.9
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	16,227	9.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,277	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	177,515	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年10月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは603,957,812千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは148,874,094千円、97.8%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは528,845,695千円、99.5%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは63,210,342千円、99.2%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは113,656,003千円、99.4%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは64,355,846千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円、1カナダ・ドル=90.84円、1オーストラリア・ドル=83.31円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.70円、1ニューージーランド・ドル=78.66円、1台湾・ドル=4.041円、1イギリス・ポンド=154.20円、1イスラエル・シェケル=35.165円、1スイス・フラン=122.32円、1トルコ・リラ=12.613円、1デンマーク・クローネ=17.62円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=5.436円、1フィリピン・ペソ=2.234円、100チリ・ペソ=13.755円、100コロンビア・ペソ=3.012円、1クウェート・ディナール=376.95円、1カタール・リアル=31.07円、1サウジアラビア・リアル=30.31円、1インド・ルピー=1.51円、1パキスタン・ルピー=0.67円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.95円、1ブラジル・レアル=20.489円、1チェコ・コルナ=5.162円、100韓国・ウォン=9.47円、1オフショア・人民元=17.572円、1マレーシア・リンギット=27.173円、1南アフリカ・ランド=7.52円、1タイ・バーツ=3.39円、1ポーランド・ズロチ=28.559円、100ハンガリー・フォリント=36.457円、1ユーロ=131.12円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	177,515,911円
コール・ローン等	1,277,770
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	48,493,746
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	884,869
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	48,717,083
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	5,351,409
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	21,146,749
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	7,243,948
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	5,344,156
J-R-E-I-Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	22,828,475
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	16,227,706
(B) 負 債	371,038
未 払 解 約 金	7,596
未 払 信 託 報 酬	360,979
そ の 他 未 払 費 用	2,463
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	177,144,873
元 本	137,707,368
次 期 繰 越 損 益 金	39,437,505
(D) 受 益 権 総 口 数	137,707,368口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,864円

(注) 期首における元本額は68,013,037円、当期中における追加設定元本額は99,789,186円、同解約元本額は30,094,855円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△77円
受 取 利 息	2
支 払 利 息	△79
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	14,829,988
売 買 益	17,438,987
売 買 損	△2,608,999
(C) 信 託 報 酬 等	△572,714
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	14,257,197
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,642,790
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	23,537,518
(配 当 等 相 当 額)	(13,855,447)
(売 買 損 益 相 当 額)	(9,682,071)
(G) 合 計(D+E+F)	39,437,505
次 期 繰 越 損 益 金(G)	39,437,505
追 加 信 託 差 損 益 金	23,537,518
(配 当 等 相 当 額)	(13,957,301)
(売 買 損 益 相 当 額)	(9,580,217)
分 配 準 備 積 立 金	15,899,987

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	2,355,397円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	11,438,466
(c) 収 益 調 整 金	23,537,518
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,106,124
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	39,437,505
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	2,863.86
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第19期（決算日 2021年2月8日）

（計算期間 2020年2月8日～2021年2月8日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落 中率			
15期 (2017年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
15期 (2017年2月7日)	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249
16期 (2018年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
17期 (2019年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
18期 (2020年2月7日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
19期 (2021年2月8日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈩東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

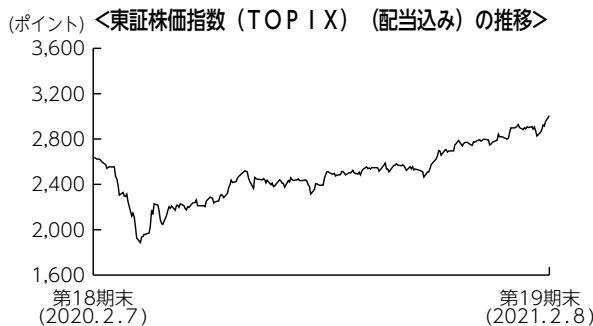
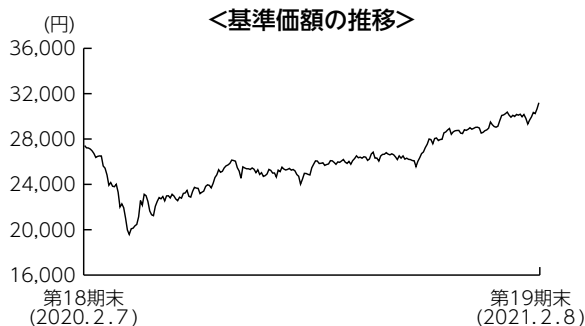
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2020年 2月7日	円 27,423	% -	ポイント 2,642.55	% -	% 97.6	% 2.4
2 月 末	23,926	△12.8	2,305.76	△12.7	97.8	1.9
3 月 末	22,498	△18.0	2,167.60	△18.0	100.1	3.3
4 月 末	23,470	△14.4	2,261.88	△14.4	97.1	3.0
5 月 末	25,068	△8.6	2,416.04	△8.6	92.2	2.2
6 月 末	25,027	△8.7	2,411.45	△8.7	97.4	2.6
7 月 末	24,020	△12.4	2,314.39	△12.4	98.2	1.8
8 月 末	25,983	△5.3	2,503.59	△5.3	97.8	2.4
9 月 末	26,316	△4.0	2,536.14	△4.0	96.6	3.4
10 月 末	25,569	△6.8	2,464.21	△6.7	96.8	2.8
11 月 末	28,422	3.6	2,738.72	3.6	97.0	3.2
12 月 末	29,264	6.7	2,819.93	6.7	97.1	2.7
2021年 1 月 末	29,330	7.0	2,826.50	7.0	97.6	2.4
(期 末) 2021年 2月8日	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月8日から2021年2月8日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,202円となり、前期末比で13.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大による景気への影響が嫌気されて急落する場面もありましたが、世界各国での経済対策や金融政策、新型コロナウイルスのワクチン開発による感染収束への期待の高まりなどを要因として、基準価額は上昇しました。

投資環境

期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。ただ、4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種
 期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	14.2%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.4
4	化学	6.9
5	医薬品	6.1
6	銀行業	5.5
7	サービス業	5.1
8	機械	5.0
9	卸売業	4.9
10	小売業	4.4



期末

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

○組入上位10銘柄
 期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.5%
2	ソニー	日本・円	2.0
3	ソフトバンクグループ	日本・円	1.6
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.6
5	武田薬品工業	日本・円	1.5
6	日本電信電話	日本・円	1.5
7	キーエンス	日本・円	1.4
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.2
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.1
10	KDDI	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,151銘柄	



期末

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で13.8%上昇しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)
合 計	0	0.001

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(25,909円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については11ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2020年2月8日から2021年2月8日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株 63,510.4 (△11,652.101)	千円 127,938,692 (-)	千株 55,403.199	千円 112,472,446

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 71,359	百万円 71,662	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	240,411,139千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	237,278,032千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.01

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年2月8日から2021年2月8日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 127,938	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,472	百万円 7,504	% 6.7

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,047	百万円 867	百万円 2,537

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 250

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	3,691千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	207千円
(B) / (A)	5.6%

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円
イフジ産業	1.9	2.3	2,081		ラサ工業	3.8	3.8	9,146		ハリマ化成グループ	8.8	8.7	8,404	
ピツルスコポーレーション	2.3	2.8	9,996		クレハ	9.1	9.9	70,587		花王	258.1	283.1	2,128,062	
北の達人コーポレーション	37.7	41.4	25,957		多木化学	3.1	4.5	27,945		第一工業製薬	4	3.9	15,015	
ユーグレナ	46.2	51.2	47,104		テイカ	7.8	8.4	12,793		石原ケミカル	3	3	6,240	
ミヨシ油脂	4.4	4.4	5,302		石原産業	19	20.6	17,036		日華化学	3.7	4.3	3,857	
理研ビタミン	5.1	11.2	15,792		片倉コープアグリ	3	2.4	3,033		ニイタカ	1.6	2.4	6,835	
繊維製品 (0.5%)					日本曹達	15.6	16.2	54,270		三洋化成工業	6.3	6.9	37,191	
片倉工業	15.4	15.6	21,715		東ソー	163.3	178.9	334,364		有機合成薬品工業	8.5	9.2	2,815	
グンゼ	7.8	8.5	32,895		トクヤマ	30.5	34.3	91,615		日本塗料	12	13.2	13,002	
東洋紡	41.7	45.8	63,707		セントラル硝子	21.6	22	49,038		大日本ペイント	87.2	95.5	926,350	
ユニチカ	31.2	33.8	15,345		東亞合成	66.4	70.7	84,274		関西ペイント	118.7	130.1	404,611	
富士紡ホールディングス	5.1	5.6	24,948		大阪ソーダ	10.8	11.9	32,713		神東塗料	8.8	9.3	1,953	
倉敷紡績	10.9	10.7	20,811		関東電化工業	25.1	27.3	23,778		中国塗料	30.1	27.9	25,891	
シキボウ	5.6	6.6	6,890		デンカ	38.6	42.2	175,763		日本特殊塗料	8	8.7	9,952	
日本毛織	34.8	38.1	38,100		信越化学工業	181.3	214.1	3,869,857		藤倉化成	14.5	16	8,256	
ダイトウボウ	17.8	19.3	2,161		日本カーバイド工業	3.7	4.2	5,712		太陽ホールディングス	7.8	8.5	52,105	
トー紡コーポレーション	4.1	4.1	1,927		堺化学工業	6.8	8.1	17,293		D I C	44.7	48.9	134,866	
ダイドーリミテッド	14.1	16.6	3,170		第一稀元素化学工業	11.5	11.7	11,594		サカタインクス	23.2	25.3	28,513	
帝国繊維	11.8	13	30,407		エア・ウォーター	90.2	118.1	208,800		兼キョウキ(Cホールディングス)	22.4	24.5	47,309	
帝人	86.2	109	211,351		日本薬業ホールディングス	101.5	95.3	196,413		T & K TOKA	8.4	9.4	7,802	
東レ	764.7	838.4	618,655		日本化学工業	3.3	3.2	9,712		富士フイルムホールディングス	206.7	207.8	1,281,918	
サカイオーベックス	2.9	3.1	6,767		東邦アセチレン	1.5	1.9	2,758		資生堂	214.3	235	1,830,180	
住江織物	2.3	2.1	4,332		日本パーカラijing	53.3	58.4	64,824		ライオン	140.2	153.7	363,961	
日本フェルト	5.7	5.5	2,480		高圧ガス工業	16.9	18.5	13,912		高砂香料工業	6.8	7.4	19,336	
イチカフ	1.5	1.3	1,683		チタン工業	1.3	1.5	3,553		マンダム	24.3	24.7	43,076	
日東製網	1.2	1.3	1,970		四国化成工業	16.3	15.5	19,313		ミルボン	14.4	15.8	111,232	
アツギ	8.8	9.3	4,770		戸田工業	2.4	2.4	5,347		ファンケル	43.7	43	168,560	
ダイニック	3.9	3.6	2,851		ステラ ケミファ	5.8	6.3	22,522		コーセー	20.3	22.2	385,614	
セーレン	26	28.5	52,012		保土谷化学工業	4	3.4	17,238		コタ	5.7	7	10,703	
ソトー	3.8	4	3,272		日本触媒	16.4	21	126,000		シーボン	1.2	1.3	2,581	
東海染工	1.4	1.3	1,458		大日精化学工業	9.4	9.6	22,790		ホーラルホルディングス	46	50.5	109,585	
小松マテール	17.3	19.1	20,093		カナカ	27.3	30	119,850		ノビアホールディングス	10.3	10	50,500	
ワコールホールディングス	27.5	28.9	68,695		三菱瓦斯化学	99.7	116	291,972		アジパノコスジャパン	2.3	3	3,267	
ホグメディカル	12	15.6	50,934		三井化学	96	100	335,500		新日本製薬	—	2.4	6,506	
レナウン	28.2	—	—		J S R	98.4	116.2	362,544		エステー	6.9	7.7	16,016	
クラウディアホールディングス	2.9	2.4	691		東京応化工業	18.2	19.9	142,882		アグロ カネショウ	3.4	4.5	6,961	
T S Iホールディングス	35.5	34.7	10,028		大阪有機化学工業	9.8	10.7	39,162		コニシ	17.7	19.5	32,311	
マツオカコーポレーション	3.1	3.7	7,788		三菱ケミカルホールディングス	706.2	774.1	577,943		長谷川香料	14.4	20.5	43,009	
ワールド	15	15.1	21,789		K Hネオケム	18.6	19.1	48,380		星光PMC	6.3	6.9	5,361	
三陽商会	5.5	6	4,512		ダイセル	144.5	155.5	130,309		小林製薬	30.2	33.1	364,100	
ナイガイ	4	3.8	1,250		住友ベークライト	16.6	18.2	74,074		荒川化学工業	9.7	9.9	12,780	
オンワードホールディングス	63.5	69.3	20,166		積水化学工業	227.1	244.9	502,289		メック	7.4	8.1	17,293	
ルックホールディングス	3.6	4	3,752		日本ゼオン	95.3	104.5	172,425		日本高純度化学	3.1	3.3	9,147	
キムラタン	57.9	68.3	1,707		アイカ工業	31.7	32.2	122,360		タカラバイオ	28.2	31	96,565	
ゴールドウイン	19.2	19.1	139,812		宇部興産	53.3	58.4	123,048		J C U	13.1	13.3	49,010	
デサント	20.6	19.8	35,224		積水樹脂	19	19.1	41,408		新田セラチン	6.7	7.7	5,197	
キング	5	4.6	2,737		タキロンシーアイ	22.8	25.2	17,589		O A Tアグリオ	1.8	2.3	3,061	
ヤマトインターナショナル	6.3	10.6	3,710		旭有機材	6	6.6	10,553		デクセリアルズ	27.8	33	46,860	
パルプ・紙 (0.2%)					日立化成	48.9	—	—		アース製薬	8.2	8.9	55,269	
特種東海製紙	6.7	7.2	34,452		ニチパン	5.6	6.2	11,315		北興化学工業	11.1	10.9	12,415	
王子ホールディングス	441.3	521.3	347,185		リケンテクノス	26.7	28.2	14,128		大成ラミック	3.3	3.7	11,081	
日本製紙	46.7	51.1	75,219		大倉工業	5	5.5	10,923		クミアイ化学工業	44.7	48.8	44,359	
三菱製紙	12	17.1	5,950		積水化成工業	14.2	15.6	8,923		日本農業	19.4	21.2	10,833	
北越コーポレーション	70	82.9	38,797		群栄化学工業	2.4	2.2	5,526		アキレス	7.4	8.2	12,464	
中越パルプ工業	4.5	4.7	5,705		タイガースポリマー	5.6	6.7	2,914		有沢製作所	17	16.5	16,665	
巴川製紙所	3.2	3.7	3,048		ミライアル	3.8	3.7	4,421		日東電工	74.5	75.7	734,290	
大王製紙	46.3	56	103,936		ダイキアクシス	3.8	4.3	4,592		レック	11.5	14	18,802	
阿波製紙	2.8	3	1,407		ダイキョーニシカワ	22.2	24.5	22,025		三光合成	12.4	12.4	5,642	
レンゴー	99.9	119.4	110,206		竹本容器	3.8	4.2	3,691		きもと	18.5	18.9	3,761	
トーモク	6.5	7.2	13,788		森六ホールディングス	5.7	6.3	13,721		藤森工業	9.7	10.6	50,774	
ザ・パッケ	8	8.7	23,307		恵和	—	1.7	3,525		前澤化成工業	6.9	7.8	7,776	
化学 (7.4%)					日本化薬	65.4	71.6	75,251		未来工業	5.8	4.3	7,705	
クラレ	166.4	182.3	220,947		カリットホールディングス	11.3	11.5	8,682		ウェーブロックホールディングス	3.9	4	3,344	
旭化成	700	767.5	953,618		日本精化	8.6	8.4	11,978		J S P	6.3	7	12,943	
共栄レザー	5.8	6.8	4,664		扶桑化学工業	10.7	9.1	32,987		エフビコ	11.8	21.8	91,887	
昭和電工	75.2	87.9	233,110		トリケミカル研究所	2.3	9.8	40,572		天馬	7.1	8.9	19,731	
住友化学	776	911.2	467,445		A D E K A	48.7	53.3	99,564		信越ポリマー	19.4	18.2	19,019	
住友精化	4.7	5.7	23,769		日油	39.8	43.6	248,084		東リ	27.1	31.1	7,837	
日産化学	59.1	63.9	382,761		新日本理化	18	19	5,054		ニフコ	39.6	43.4	173,166	

銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株	数	株	数		株	数	株	数		株	数	株	数
				千円					千円					千円
プロネックス	9.3	10.3	12,030		鴻池運輸	17.1	19	20,805		クロスキャット	2.8	3	3,690	
ホクシン	7.2	8.5	994		西日本鉄道	29.9	32.8	97,088		システナ	37.7	41.4	83,172	
ウッドワン	3.5	3.4	3,733		ハマコウワックス	8.3	9.1	30,667		デジタルアーツ	5.2	6.8	70,040	
大建工業	7.2	8	14,808		サイカイ越センター	5.7	5.5	29,095		日鉄ソリューションズ	15.9	17.3	60,896	
凸版印刷	152.2	179.6	290,952		近鉄ブルーホールディングス	102.1	111.9	536,001		キューブシステム	5.6	6.2	7,303	
大日本印刷	141.1	142.8	286,456		阪急神戸ホールディングス	136.2	149.3	555,396		エイジア	1.9	1.8	3,319	
共同印刷	3.4	3.7	13,597		南海電気鉄道	48.4	53.1	144,697		コア	4.5	4.9	7,599	
NISSHA	22.1	24.3	35,235		京阪ホールディングス	45.5	49.9	257,983		ラクーンホールディングス	5.1	8.2	16,334	
光村印刷	0.9	0.8	1,436		神戸電鉄	2.4	2.8	10,500		ソリトシステムズ	4.6	5.8	10,242	
TAKARA & COMPANY	5.2	5.8	10,440		名古屋鉄道	83.9	92.1	261,379		ソフトクリエイティブホールディングス	4.6	4.5	12,123	
アシックス	89	104.6	204,702		山陽電気鉄道	7.3	8.1	17,074		T I S	35.3	116	283,272	
ツツミ	3.4	3	5,739		日本通運	36.1	38.8	299,536		JNSホールディングス	4.3	5.5	3,151	
ローランド	—	6.9	27,117		ヤマトホールディングス	179	157	449,962		電算システム	4.1	4.3	13,029	
小松ウオール工業	3.4	3.7	6,645		丸連	28.4	28.7	128,289		グリニ	64.9	71.1	43,726	
ヤマハ	64.2	70.3	447,108		丸全昭和運輸	5.9	7.6	1,968		GMOペパボ	—	0.8	4,624	
河合楽器製作所	3.4	3.3	10,065		丸正総合研究所	8.3	9.1	32,396		コーエーテクモホールディングス	21.6	23.7	149,073	
クニナップ	10.1	11.4	5,814		トナミホールディングス	56.3	61.9	62,828		三菱総合研究所	4.6	5	20,975	
ビジョン	65.2	75.9	340,411		ニコッホールディングス	2.4	2.3	13,501		ボルテージ	1.9	2.8	1,512	
オリバー	2.2	2.4	6,345		日本石油輸送	36.5	37.6	85,540		電算	1.2	1	2,539	
兼松サステック	0.7	0.6	1,057		福山通運	1.1	0.9	2,394		AGS	5.9	6.1	5,105	
キングジム	9	10.2	9,169		セイノーホールディングス	13.1	14.4	65,232		ファイナデックス	9	9.7	10,864	
リンテック	25.6	25.4	61,366		セイライ	76.5	83.9	128,702		ブレインパッド	2.1	2.9	12,397	
イトーキ	22.9	23.3	8,108		神奈川中央交通	3.1	3	2,709		K L a b	20.4	21.2	20,966	
任天堂	66.1	67.7	4,295,565		日百物流	2.5	2.5	9,825		ニトロワイヤ・ビートルホールディングス	12.7	15.4	18,587	
三菱鉛筆	17.7	19.5	27,865		丸和運輸機関	18.8	24.7	84,721		インテグニシアジヤジャパン	1.5	1.9	4,727	
タカラスタンダード	22.2	24.5	40,400		C&Fグローバルディングス	10.8	23.6	50,409		ネクソン	301.2	293.1	1,017,057	
ココヨ	51.7	56.6	82,239		九州旅客鉄道	10.3	11.4	23,210		アイスタイル	27.3	35.3	16,696	
ナカバヤシ	10.7	12.1	7,562		S Gホールディングス	91.1	86.4	220,665		エムアールホールディングス	3.1	3	7,266	
グローブライド	4.8	5.7	24,367		日本郵船	107.2	211.7	544,492		エイチーム	7.2	8	9,792	
オカムラ	37.6	45.4	49,440		商船三井	85.4	93.6	276,120		エニグモ	7.5	10.9	14,137	
美津濃	9.8	11.7	27,144		川崎汽船	64.6	66.4	204,844		テクノスジャパン	8.3	8.9	6,363	
電気・ガス業 (1.3%)					NSユニテッド海運	31.4	34.5	67,930		enish	4.7	5.9	2,979	
東京電力ホールディングス	860.8	1,002.3	407,936		明治海運	5.6	5.4	8,456		コロプラ	34.7	38	35,986	
中部電力	330	361.8	488,249		飯野海運	10.2	12.3	5,043		オルトプラス	7.9	6.8	2,944	
関西電力	408.6	448	479,360		共栄タンカー	48.1	52.4	22,741		ブロードリーフ	52.5	57.4	37,424	
中国電力	149.1	170.7	223,787		乾汽船	1.8	2.2	2,085		クロス・マーケティンググループ	4.9	5.4	2,143	
北陸電力	98.6	108.1	75,886		日本航空	5.9	5.9	5,846		デジタルハーツホールディングス	5.6	5.3	6,990	
東北電力	269.6	276.8	259,361		ANAホールディングス	183.8	272.7	606,212		システム情報	5.4	8.5	10,081	
四国電力	97.2	98.2	74,533		ANAホールディングス	186.6	302.1	721,565		メディアアドヴ	3.4	4.4	27,236	
九州電力	222.3	261	246,123		パスコ	1.9	2.2	3,416		じげん	26.2	28.2	11,928	
北海道電力	101	110.3	51,841		倉庫・運輸関連業 (0.2%)				アイキューブ	6.5	6.3	19,246		
沖縄電力	20	23	33,281		トランコム	2.9	3.4	29,648		エンレックジ・テクノロジ	1.7	2.2	1,471	
電源開発	85.9	94	164,970		日新	8.8	9	12,591		サイバーリンクス	1.6	3.8	8,208	
エフオン	5.1	7.2	8,071		三菱倉庫	32.4	38.7	125,001		ディー・エル・イー	7.9	9.2	2,999	
イーレックス	15.3	17.3	30,396		三井倉庫ホールディングス	11.6	11.9	27,036		フィックスターズ	11.2	12.2	12,322	
レノバ	17.8	19.9	74,426		住友倉庫	37.5	40.3	56,460		CARTA HOLDINGS	5.1	4.7	6,283	
東京瓦斯	207.5	227.3	527,676		滋澤倉庫	5.6	6.3	14,565		オプティム	2.8	8.1	26,365	
大阪瓦斯	209.3	214.1	432,053		東陽倉庫	18.5	16.8	5,796		セレス	3.5	3.8	10,260	
東邦瓦斯	53	58.1	381,136		日本トランスシティ	25.5	25.1	14,809		S H I F T	2.8	5.2	67,288	
北海道瓦斯	5.8	6.6	10,791		ケイヒン	2.5	1.7	2,327		ディーガイア	9.4	12.3	23,628	
広島ガス	22.4	25.4	9,804		中央倉庫	6.2	6.4	7,628		セック	1.5	1.7	4,836	
西部瓦斯	12.1	13.3	39,806		川西倉庫	1.8	2.1	2,480		日本アジアグループ	11.1	11.2	14,425	
静岡ガス	30.6	33.5	33,165		安田倉庫	8.4	9.6	9,177		豆蔵ホールディングス	7.2	—	—	
メタウォーター	5.2	13.4	30,860		アズホールディングス	2.2	2	2,296		テックマトリックス	7.4	17.9	34,708	
陸運業 (3.6%)					東洋埠頭	3.1	3	4,266		プロシッパ	3.1	3.4	4,848	
SBSホールディングス	9.3	8.7	22,011		宇徳	8.7	8.5	3,995		ガッパラス	5.6	4.6	2,093	
東武鉄道	113.7	123.2	394,240		上組	58.5	62.4	123,614		システムリサーチ	2.9	3.4	6,245	
相鉄ホールディングス	34.5	40.5	106,393		サンリツ	2.3	2.3	1,649		インターネットイニシアティブ	15.6	30.9	70,050	
東急	271.9	298.1	432,245		キムラユニティ	2.8	3.5	3,976		ざくらインターネット	11.3	12.2	8,491	
京浜急行電鉄	138.5	151.8	268,230		キューソー流通システム	2.5	2.9	4,663		ヴィンクス	3	3.2	3,843	
小田急電鉄	160.3	189.4	623,126		近鉄エクスプレス	21.6	21.2	57,579		GMOアロウ・バウイング・ホールディングス	1.9	2.5	24,950	
京王電鉄	56	66	564,960		東海運	5.8	7.9	2,512		S R Aホールディングス	5.6	6.2	16,002	
京成電鉄	75.1	88.6	352,628		エアアイトイー	7.2	7.2	7,905		システムインテグレート	3.4	3.2	2,025	
富士急行	14.7	16.1	92,736		内外トランスライン	3.6	4.1	5,161		朝日ネット	7.5	9.4	8,262	
新京成電鉄	2.8	3	6,873		日本コンセプト	3.3	3.7	6,397		e B A S E	6.3	13.8	14,172	
東日本旅客鉄道	189.8	208.1	1,600,497		情報・通信業 (9.5%)				アバント	7.5	12.4	19,108		
西日本旅客鉄道	96.1	105.3	680,448		NECネットシステム	10	38.3	76,408		アドソール日進	3.8	4.1	11,951	
東海旅客鉄道	89.7	98.3	1,678,472											
西武ホールディングス	144.7	142.4	170,025											

銘柄	前 期 (前期末)		当 期 末		銘柄	前 期 (前期末)		当 期 末		銘柄	前 期 (前期末)		当 期 末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ODKソリューションズ	—	—	2	1,550	ベース	—	—	1	5,420	ゼンリン	—	—	21	29,505
フリービット	6.3	6.9	6.9	6,706	フォークシステムズ	6.5	7.7	7.7	7,546	昭文ホールディングス	5	4.4	21	2,050
コムチュア	11.8	10.7	10.7	33,116	フレスコ	6.5	7.9	7.9	11,194	インプレスホールディングス	8.8	10	10	1,950
サイバーコム	1.8	2.1	2.1	3,654	フジ・メディア・ホールディングス	101.9	120.1	120.1	159,372	アイネット	5.4	6	6	9,168
アステリア	6.4	8.3	8.3	8,715	オービック	36.7	36.6	36.6	718,824	アイ竹	7	7.6	7.6	116,888
アール	3.8	6.5	6.5	10,276	ジャストシステム	17.2	16.5	16.5	129,300	東宝	63.2	68.5	68.5	289,412
マークラインズ	5.3	4.8	4.8	12,086	TDCソフト	9.3	10.2	10.2	9,904	東映	4	3.8	3.8	76,646
メディカル・データ・ビジョン	8.1	13.2	13.2	33,950	Zホールディングス	1,452.9	1,593.8	1,593.8	1,063,064	エヌ・ティ・ティ・データ	281.7	309	309	518,193
gumi	13.6	16	16	14,672	トレンドマイクロ	47	61.9	61.9	372,019	ピー・シー・エー	1.3	1.7	1.7	7,633
ショークス	2.4	2.4	2.4	2,409	IDホールディングス	4.1	4.5	4.5	5,728	ビジネスブレイン太田昭昭	1.8	4	4	7,236
モバイルファクトリー	2.3	2.4	2.4	2,680	日本オラクル	21.4	23.5	23.5	301,035	DT S	23.7	24	24	58,080
テラスカイ	3.8	3.7	3.7	14,152	アルファシステムズ	3.3	3.1	3.1	11,966	スクウェア・エニックス・ホールディングス	45.1	49.5	49.5	346,995
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4.7	5.1	5.1	8,221	フューチャー	12.7	14	14	27,356	シーイーシー	11.3	12.2	12.2	17,677
PCIホールディングス	2.1	4.4	4.4	6,116	CAC Holdings	6.8	7.5	7.5	10,725	カブコム	49.9	49.7	49.7	339,948
パイプHD	1.3	2.4	2.4	3,796	S Bテクノロジ	3.8	4.2	4.2	12,999	アイ・エス・ピー	2	5.3	5.3	7,234
アイビーシー	1.9	1.9	1.9	2,101	トーセ	2.9	3.3	3.3	2,653	ジャステック	6.7	7.3	7.3	9,117
ネオジャパン	1.9	2.2	2.2	4,052	オービックビジネスコンサルタント	10.8	11.9	11.9	80,920	S C S K	24.4	26.8	26.8	179,024
P R T I M E S	0.9	2.4	2.4	8,964	伊藤忠テクノソリューションズ	48.2	52.9	52.9	195,730	日本システムウエア	3.5	3.8	3.8	7,923
ランドコンピュータ	1.6	1.5	1.5	1,707	アイティフォー	12.9	15.1	15.1	13,741	アイネス	10.4	11.3	11.3	15,740
ダブルスタンダード	1.3	1.5	1.5	6,615	東計電算	1.5	1.8	1.8	7,542	T K C	9	9.8	9.8	71,050
オープンドア	5.2	6.9	6.9	14,276	エックスネット	1.6	2.2	2.2	2,206	富士ソフト	13.6	12.3	12.3	70,479
マイネット	3.5	3.8	3.8	3,587	大塚商会	57.2	62.8	62.8	331,584	N S D	34.8	37.3	37.3	75,980
アカツキ	3.8	4.6	4.6	19,964	サイボウズ	12.3	13.5	13.5	37,732	コナミホールディングス	38.5	42.1	42.1	309,435
ベネフィットジャパン	0.8	0.9	0.9	1,746	ソフトブレーン	6.2	—	—	—	番信コンピュータホールディングス	4.2	5.3	5.3	20,908
Ubicomホールディングス	2.3	3	3	9,720	電通国際情報サービス	6.5	14.4	14.4	58,032	J B C Cホールディングス	7.1	7.8	7.8	11,832
L I N E	24.2	—	—	—	A C C E S S	—	10.8	10.8	8,424	ミロク情報サービス	9.3	11.5	11.5	25,656
カナミックネットワーク	6.4	10.6	10.6	7,706	デジタルガレージ	19.1	19.1	19.1	77,164	ソフトバンクグループ	839.5	920.5	8,730,942	
ノムラシステムコーポレーション	2.3	5.1	5.1	1,907	イーエムシステムズ	14.9	19.2	19.2	18,316	卸売業 (4.5%)	—	—	—	—
チェンジ	2.1	16.2	58,887	ウェジャーニューズ	C I J	7.9	7.9	7.9	7,149	ホウスイ	0.9	0.6	0.6	604
シンクロ・フード	4.6	6.9	2,566	C I J	7.9	7.9	7.9	7,149	高千穂交易	4.1	4.7	4.7	5,729	
オークネット	6.5	6.1	8,021	ビジネスエンジニアリング	1.2	1.2	1.2	4,080	オムハルステアホールディングス	—	1.6	1.6	2,544	
キャピタル・アセット・フランジング	—	1.5	1,491	日本エンタープライズ	10.8	11.6	11.6	2,865	伊藤忠食品	2.4	2.4	2.4	12,768	
セググループ	1.7	2.9	3,775	WOWOW	5.1	5.7	5.7	16,404	エレマテック	9.9	9.4	10,020		
エイトレッド	1.3	2.2	5,717	スカラ	7.5	10.3	8,549	J A L U X	3.1	3.3	3.3	5,240		
AOI TYO HOLDINGS	10.7	12	5,580	インテリジェント ウェブ	4	6.9	4,974	あらた	8.5	9.3	9.3	45,570		
マクミル	18.9	23.6	20,437	I M A G I C A G R O U P	9	10	4,030	トーマンデバイス	1.6	1.6	1.6	6,400		
ビーグリー	2	2.3	4,054	ネットワシシステムズ	40.3	47.3	172,172	東原レトロ デバイス	3.9	3.8	3.8	13,813		
オロ	2.8	3.6	13,860	システムソフト	26.3	25.5	3,162	フィールズ	8.2	10.2	10.2	5,783		
ユーザーローカル	—	1.8	7,560	アルゴグラフィックス	9	9	28,305	双日	586.6	641.6	168,740			
テモナ	1.3	2.5	2,527	ペーペラス	16.1	18.2	16,398	アルフレッサ ホールディングス	118	120.7	267,471			
ニーズウェル	1.2	2.2	1,515	エイベックス	18.2	19.9	28,536	横浜冷凍	29.9	30.8	27,812			
サンポスト	1.6	2.6	2,631	日本ユニシス	33	40.3	143,266	神栄	1.5	1.6	2,657			
ソルクシーズ	4.5	4.4	4,386	兼松エレクトロニクス	5.7	6.4	24,576	ラサ商事	5.6	6.5	6,051			
フェイス	3.8	3.6	3,002	都築電気	—	4.3	6,712	アルコニクス	11.2	12.3	20,750			
プロトコーポレーション	9.5	10.4	12,823	T B Sホールディングス	64.4	76.9	170,641	神戸物産	36.6	80.4	244,014			
ハイマックス	1.2	2.9	4,355	日本テレビホールディングス	88.3	96.6	137,751	ハイパー	—	2	1,088			
野村総合研究所	149.9	211.8	751,890	朝日放送グループホールディングス	10.5	12.1	8,796	あい ホールディングス	15.2	16.7	35,003			
サイバネットシステム	7.5	6.2	8,077	テレビ朝日ホールディングス	29.1	35.8	77,614	ディーピーエックス	3.8	4	4,268			
C Eホールディングス	6.1	8.2	3,844	スカパーJ S A Tホールディングス	69.6	76.3	37,844	ダイワホールディングス	9.1	10.6	90,312			
日本システム技術	1.7	2.1	3,303	テレビ東京ホールディングス	8.7	8.5	21,173	マクニオ・富士エレクトロニクス	25.3	27.7	61,909			
インテジールホールディングス	13.3	14.4	17,323	日本B S放送	3.6	4.1	4,825	ラクト・ジャパン	4	5.1	13,882			
東邦システムサイエンス	2.9	3	2,817	ビジョン	9.9	14.2	14,185	グリムス	—	2.5	4,362			
ソースネクスト	50.2	54.7	17,230	スマートバリュー	3.1	3.1	2,938	バタカケエースター・ホールディングス	20	20.6	17,180			
インフォコム	11.5	10.6	32,489	USEN-NEXT HOLDINGS	4	4.4	7,810	八洲電機	8.3	9.2	8,914			
HE RO Z	0.5	3.2	9,888	ワイヤレスゲート	5	4.8	3,124	メディアスホールディングス	6	6.8	6,038			
ラクスル	5.6	9.4	38,493	コネクシオ	6	6.7	9,393	レスタールホールディングス	11.1	12.2	26,242			
I P S	—	2.1	5,592	日本通信	81.8	102	20,910	ジューテックホールディングス	2.3	2.3	2,449			
F I G	11.6	12.6	3,376	クロップス	1.9	2.3	1,826	大光	4.6	4.9	3,278			
システムサポート	0.9	3.4	5,215	日本電信電話	1,414.3	1,357.1	3,781,559	O C H Iホールディングス	3.1	3.5	4,777			
イースル	3.8	6.2	8,314	K D D I	788.5	930.4	3,104,744	T O K A Iホールディングス	56.2	56.6	56,883			
アルテリア・ネットワークス	11.7	12.8	21,030	ソフトバンク	961.6	1,054.5	1,495,808	黒谷	1.9	3.3	2,372			
EDULAB	—	1.1	8,041	光通信	10.9	13.7	295,920	Cominix	1.8	1.7	1,319			
東海ソフト	—	1.4	1,668	N T Tドコモ	781.6	—	—	三洋貿易	10.6	11.6	12,980			
ヒト・コミュニケーションズホールディングス	2.4	2	2,428	エムティーアイ	10.2	11.4	10,077	ビューティガレージ	1.7	1.9	4,755			
東名	—	0.6	670	GMOインターネット	41.7	41.5	134,875	ウイン・パートナーズ	7.6	8.5	9,987			
ヴィン	—	0.4	854	ファイバーゲート	2	3.7	8,091	ミタチ産業	3.2	3	1,785			
ピラシシステムズ	—	1.1	1,579	アイトマータウンコミュニケーションズ	3.2	2.9	1,342	ソフトバンクホールディングス	17	20.6	130,604			
Link-U	—	0.7	966	K A D O K A W A	28.5	31.3	121,757	明治電機工業	3.4	3.1	4,495			
ギフト	—	5.2	17,784	学研ホールディングス	3.6	15.6	26,754	デリカハウスホールディングス	3.9	5.2	3,328			

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株	数	株	価 値 額		株	数	株	価 値 額		株	数	株	価 値 額
		千株		千円			千株		千円			千株		千円
スターティアホールディングス		2.4		2,454	佐藤商事		8.8		9,850	スズケン		45		49.3
コマダホールディングス		23.2		50,342	菱洋エレクトロ		10.8		25,678	ジェコス		7.3		8.2
ピーバンドットコム		-		1,426	東京産業		9.6		11	グロースル		9.4		12.9
アセンテック		0.8		5,417	ユアサ商事		10.1		12	小売業 (4.7%)				
富士興産		3.3		4,665	神鋼商事		2.7		2.7	ローソン		26.8		29.5
協栄産業		1.2		2,095	トルク		6.3		5.8	サンエー		8.9		8.8
小野建		9.6		13,407	阪和興業		19.9		23.2	カワチ薬品		8.3		8.1
南陽		2.1		3,540	正栄食品工業		6.8		7.5	エービーシー・マート		16.6		18.1
佐島電機		7.9		5,638	カナデン		8.6		9.6	ハードオフコーポレーション		4.2		5.4
エコトレーディング		2.3		1,799	菱電商事		7.6		8.4	アスフル		11.1		10.1
伯東		6.5		9,201	フルサト工業		5.9		6.3	ゲオホールディングス		19.1		15.6
コンドーテック		8.3		9,926	岩谷産業		23.6		27.9	アダストリア		14.7		16.1
中山福		6.2		3,819	ナイス		4.6		4.7	ジーフット		6.4		7.6
ナガイレーベン		15.4		48,205	昭光通商		3.5		3.4	シー・ヴィー・エス・バイエリア		1.5		2
三菱食品		11.6		37,474	ニチモウ		1.7		1.6	くら寿司		5.5		6.9
松田産業		7.8		16,192	極東貿易		3.1		3	キャンドウ		5.1		5.6
第一興商		15.8		69,373	イワキ		14		15.2	アイケイ		-		2.5
メディアルホールディングス		114.6		261,174	三菱石油		26.1		28.7	パルグループホールディングス		5.4		10.2
S P K		2.2		6,812	稲畑産業		23.4		27.9	エディオン		48.8		49.3
萩原電気ホールディングス		4		12,315	G S Iクレオス		2.5		2.8	サラコーポレーション		21.6		23.9
アズワン		6.9		127,820	明和産業		9.8		10.8	ワッツ		4.8		5.2
スズデン		3.7		4,389	クワザホールディングス		3.8		4.4	ハロース		4		4.4
尾家産業		3.1		3,978	ヤマエ久野		-		8.5	フジオードグループ本社		9		9.8
シモンヤ		6.5		9,145	ワキタ		22.6		22.9	あみやき亭		2.2		2.5
ドウシヤ		10.1		20,680	東邦ホールディングス		34.1		37.3	ひらまつ		19.6		21.9
小津産業		2.3		4,397	サンゲツ		29.2		31.5	大黒天物産		2.5		2.7
高速		3.3		10,111	ミックロググループホールディングス		15.7		17.1	ハニースホールディングス		9.4		9.1
たけびし		6.5		5,565	シナネンホールディングス		4.4		4.3	ファーマライズホールディングス		2.5		3.3
リックス		2.3		3,773	伊藤忠エネクス		23.5		26	アルペン		8.2		8.9
丸文		9.4		10.6	サンリオー		29.8		32.6	ハブ		3.1		3.6
ハビネット		8.9		16,266	サンワ テクノス		7.5		7.6	クオールホールディングス		15.6		15.7
橋本製菓ホールディングス		2.1		5,008	リョーサン		11.7		12.8	ジンスホールディングス		5.6		6.2
日本ライフライン		31.4		55,384	新光商事		16.7		15.9	ビックカメラ		62.9		69
タカショー		5.4		7.4	トーホー		4.8		5.4	DCMホールディングス		57.3		71.9
エクセル		3.1		-	三信電気		5.7		6.4	ペッパーフードサービス		8.5		13.2
マルカ		3.8		7,527	東陽テクニカ		12.2		12.2	MonotaRO		75.5		82.8
I DOM		28.7		26,095	モスフードサービス		14		16.5	東京一番フーズ		2.7		2.6
進和		6.3		15,638	加賀電子		10.6		10.5	DDホールディングス		4.2		5.2
エスケイジャパン		2.2		1,236	ソーダニッカ		10.8		11.3	きちりホールディングス		2.9		3.4
ダイトロン		4.5		8,300	立花エレテック		7.9		8.7	アークランドサービスホールディングス		7.8		9.7
シークス		13.5		24,375	フォーバル		4.7		4.3	J. フロント リテイリング		126.8		139
田中商事		3.4		2,176	P A L T A C		17		18.7	ドール・プレスホールディングス		16.9		18.4
オーハシテクニカ		5.9		8,500	三谷産業		14.2		15.6	マツモトキヨシホールディングス		43.9		48.1
白銅		3.9		5,320	太平洋興発		4.1		5.1	ブロンコビリー		5.5		6.1
ダイコー通産		-		1,741	smeltacホールディングス		1.9		2.6	ZOZO		73		68.7
伊藤忠商事		742.8		2,526,074	ヤマシタヘルスケアホールディングス		0.8		1.1	トレジャー・ファクトリー		3.2		3.4
丸紅		1,105.3		853,956	コア商事ホールディングス		-		3.3	物語コーポレーション		2.7		3.1
高島		1.6		2,710	国際紙パルプ商事		25.2		25.5	ココカラファイン		11.1		10.4
長瀬産業		59.8		114,297	ヤマタネ		5.3		5.3	三越伊勢丹ホールディングス		185.6		203.4
蝶理		6.8		12,412	丸紅建材リース		1		0.9	Hamee		3.3		2.9
豊田通商		118.5		550,599	日鉄物産		7.5		8.3	ウエルシアホールディングス		31.6		61.5
三共生興		16		9,396	泉州電業		3.3		3.3	クワイエSDホールディングス		17.8		17.1
兼松		39.6		67,378	トラスコ中山		22.1		26.7	丸善CHホールディングス		12.4		15.4
ツカモトコーポレーション		1.8		2,585	オートバックスセブン		39.4		43.2	ミザウ		2.1		2.4
三井物産		933.4		1,900,455	モリト		7.8		9	ディーライフ		1.4		1.7
日本紙パルプ商事		6		22,539	加藤産業		16.6		16.9	イー・ピーホールディングス		2		1.9
日立ハイテク		36.9		-	北恵		2		3.2	チムニー		3.3		3.5
カメイ		13.9		18,939	イノテック		6.3		6.6	シュッピン		7.2		7.9
東都水産		1.3		4,963	イエローハット		20.1		21.9	オイシックス・ラ・大地		-		11.5
OUGホールディングス		1.6		5,122	J Kホールディングス		9.6		10.7	ネクステージ		15.2		19.9
スターゼン		3.9		19,371	日伝		9.6		9.7	ジョイフル本田		31.1		34.2
山善		41.4		47,502	北沢産業		7.8		7.3	鳥貴族ホールディングス		3.5		3.3
橋本興業		1.9		6,230	杉本商事		5.7		5.9	キリン堂ホールディングス		4.2		-
住友商事		670		1,094,633	東陽電機産業		30.2		31.1	ホットランド		7.1		8.6
内田洋行		4.5		20,447	因テック		3.5		3.9	すかいらくホールディングス		119		130.4
三菱商事		745.2		2,012,142	ミスミグループ本社		133		146	SFPホールディングス		4.5		5.7
第一実業		5.2		22,472	アルテック		8.6		8.8	綿半ホールディングス		4		8.8
キャノンマーケティングジャパン		30.4		71,469	タキヒヨー		3.1		4	ヨシックス		1.7		2.3
西華産業		6		8,872	蔵王産業		2.1		1.9	2019年度スノーリゾートホールディングス		30.9		33.9

銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末				
	株	数	価 値 額	株	数	千 円		株	数	価 値 額	株	数	千 円		株	数	価 値 額	株	数	千 円	株	数
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.9	6	5,916	SRSホールディングス	12.5	14.6	12,585	ヤマザワ	2	2.6	4,555											
B E E N O S	4	5.4	12,792	千趣会	19.2	20.9	7,064	やまや	2.1	2.5	5,577											
あさひ	8	8.6	13,975	タカキュー	8.6	9.9	1,485	ベルーナ	22.7	25	26,350											
日本調剤	3.3	7.1	11,786	リテールパートナーズ	—	14.1	19,711	銀行業 (4.7%)														
コスモス薬品	4.7	11.8	197,296	ケーヨー	21.8	21.6	16,372	島根銀行	2.1	4.3	2,906											
トーエル	5.2	5.7	4,776	上新電機	12.5	13.7	42,744	じもとホールディングス	72.2	8	6,648											
オンライン	1.8	2.6	1,209	日本瓦斯	16.8	19.2	100,800	めざましフィナンシャルグループ	552.6	604.6	130,593											
セブ&アイ・ホールディングス	415.4	455.6	1,935,388	ロイヤルホールディングス	18.6	20.3	38,955	東京さくらフィナンシャルグループ	14.4	14.6	17,052											
クワイート・レストラン・ホールディングス	28.6	62.5	55,437	東天紅	0.8	0.6	554	九州フィナンシャルグループ	174.5	238	105,196											
ツルハホールディングス	23.1	25.4	372,110	いなげや	13.2	13	22,750	ゆうちょ銀行	301.3	330.8	318,560											
サンマルクホールディングス	8.4	9.1	14,696	島忠	20	—	—	富山第一銀行	25.4	28.6	8,608											
フェリシモ	2.3	2.6	3,458	チヨダ	11.1	12.2	12,285	三井住友フィナンシャルグループ	625.3	709.7	291,686											
トリドールホールディングス	13.2	28.8	47,001	ライフコーポレーション	8.1	8.8	29,656	西宮フィナンシャルホールディングス	72.5	77.6	53,388											
TOKYO BASE	9.6	10.4	6,905	リンガーハット	13.1	14.4	35,913	鹿沼みらいフィナンシャルグループ	62.4	54.8	31,181											
ウィルバスホールディングス	1.6	1.9	1,575	M r M a x H D	14.6	15.9	12,465	三十三フィナンシャルグループ	9.9	10.2	13,637											
JMホールディングス	5.4	8.8	18,647	テンアライド	9.8	11.7	4,223	新設越前フィナンシャルグループ	18.5	19	44,270											
サツドラホールディングス	1.5	1.5	3,097	AOKIホールディングス	21.2	23.1	14,691	ひろさちホールディングス	—	172.2	110,380											
アレクザホールディングス	5.3	6.7	9,339	オークワ	16.6	18.2	23,314	新生銀行	78	95.1	131,428											
軌道田中ホールディングス	1.6	3	5,172	オメリ	16.4	18	51,948	あおぞら銀行	63.3	69.4	148,169											
パロックスジャパンリミテッド	7.3	8.1	6,625	青山商事	21.9	25.7	18,735	三井住友フィナンシャルグループ	7,320.8	7,977.2	4,144,953											
グスリのアオキホールディングス	9.5	11.6	102,544	しまむら	12.3	13.5	157,545	りそなホールディングス	1,167	1,267.6	513,758											
かの源ホールディングス	4.8	5.4	3,520	はせがわ	5.3	5.2	1,549	三井住友トラスト・ホールディングス	201	220.5	771,529											
スシローグローバルホールディングス	11.6	63.9	269,658	高島屋	77.4	84.7	93,000	三井住友フィナンシャルグループ	735.5	807.1	2,881,347											
L I X I L ビバ	10.5	—	—	松屋	21.4	25.4	24,384	千葉銀行	365.7	388.8	250,776											
メディカルシステムネットワーク	10.3	10.2	7,701	エチ・ツウ・オー リテイリング	50.3	55	45,815	群馬銀行	209	239.8	81,532											
はるやまホールディングス	4.5	6.1	4,385	近鉄百貨店	4	4.5	15,277	武蔵野銀行	15.8	17.3	28,233											
ノジマ	18.9	20.7	57,525	パルコ	10.2	—	—	千葉興業銀行	29.2	29.8	7,688											
カッパ・クリエイト	14.9	16.4	25,420	丸井グループ	97.3	98.5	207,539	筑波銀行	44.4	48.4	9,002											
ライトオン	8	8.8	5,737	アグシアル リテイリング	8.8	9.7	48,694	七十七銀行	35.9	36.6	51,715											
ジーンズメイト	3.4	3.6	1,130	井筒屋	5.8	6.3	1,417	青森銀行	8.3	9	22,077											
良品計画	141	154.5	391,348	イオン	408.7	448.1	1,543,704	秋田銀行	6.8	7.1	10,089											
三城ホールディングス	11.5	14.9	4,410	イズミ	21.6	23.6	95,580	山形銀行	11.9	13	13,884											
アドヴァン	16.2	12	13,560	平和堂	21.5	21.5	47,558	岩手銀行	6.9	7.6	15,481											
アルビス	4	3.7	9,375	フジ	12.9	14.1	28,482	東邦銀行	95.1	104.1	22,069											
コナカ	12.5	14.1	4,808	ヤオコー	12	13.2	92,004	東北銀行	5.1	5.9	6,578											
ハウス オブ ローゼ	1.3	1.2	2,034	ゼビオホールディングス	12.9	14	13,440	みちのく銀行	6.8	7.5	7,792											
G-7ホールディングス	6.2	6.9	16,870	ケーズホールディングス	102.5	103.7	153,683	みくおフィナンシャルグループ	89.5	105.1	216,716											
イオン北海道	10.7	15.6	16,426	Ol ymp icグループ	5.5	6	5,526	静岡銀行	263.3	283.9	230,526											
ゴジマ	18.3	19.9	13,273	日産東横店ホールディングス	15.9	14.3	3,875	十六銀行	13.4	14.6	29,127											
ヒマラヤ	3.5	4.3	4,067	シルバーライフ	—	1.6	3,393	スルガ銀行	108.8	101.6	34,645											
コーナン商事	15.1	16.6	49,401	一家ガニンプロジェクト	—	1.1	687	八十二銀行	256.7	262.3	97,051											
エコス	3.9	4.3	8,380	Genky DrugStores	5.2	5.1	20,145	山梨中央銀行	12.3	13.6	11,655											
ワタシ	12.5	15.3	15,682	ナルミヤ・インターナショナル	1.8	2.3	2,263	大垣共立銀行	21	23	47,817											
マルシェ	2.9	3	1,524	聯合メディアカルホールディングス	9.3	—	—	福井銀行	9.1	10	19,210											
ユンベルフワード・インターナショナルホールディングス	233.4	232.8	572,688	フクオクグループホールディングス	6.2	6.8	5,997	北國銀行	10.9	10.9	28,797											
西松屋チェーン	23.3	25.5	38,683	ギフト	—	1.1	2,302	清水銀行	4.4	4.9	8,374											
ゼンショーホールディングス	50.9	62.5	181,312	アインホールディングス	13.1	16.9	122,525	富山銀行	2	1.9	5,449											
幸楽苑ホールディングス	6.7	7.3	12,942	元気寿司	2.7	3.2	8,102	滋賀銀行	21.3	23.3	46,157											
ハウスレイ	2	2	1,852	ヤマダホールディングス	323.6	390.2	214,610	南都銀行	17.6	17	30,685											
サイゼリヤ	17.5	17.2	37,083	アークランドサカモト	16.6	18.2	28,301	百五銀行	95.7	105.2	32,401											
V Tホールディングス	44.1	43.9	19,140	ニトリホールディングス	46	46.3	954,011	京都銀行	38	41.7	254,787											
魚力	3	3.5	6,443	グルメ軒屋	7.5	8.4	8,509	紀陽銀行	37.6	41.3	58,728											
ポプラ	2.8	3.3	1,135	愛眼	8.3	7.6	1,770	ほくほくフィナンシャルグループ	70.7	77.5	75,950											
フジ・コーポレーション	2.9	3.1	6,993	ケーユーホールディングス	5.5	6	5,088	広島銀行	157.1	—	—											
ユニテッドアローズ	11.1	13.2	26,637	吉野家ホールディングス	34.9	38.2	84,956	山陰合同銀行	63	73.6	36,652											
ハイデイ日高	15.3	16.8	31,197	松屋フーズホールディングス	5.1	5.6	20,524	中国銀行	91.5	100.4	86,344											
京都さきもの友禅	7	6.4	1,561	サガミホールディングス	14.2	15.7	19,106	鳥取銀行	3.7	4	4,480											
コロワイド	35.3	38.6	76,775	関西スーパーマーケット	8.9	8.8	10,419	伊予銀行	151.7	154.6	99,717											
ピーシーズコーポレーション	14.1	13.6	8,214	王将フードサービス	7.8	7.7	46,354	百十四銀行	11.3	12.2	19,202											
壹番屋	7.4	8.2	42,640	プレナス	11.9	13.2	26,386	四国銀行	16.1	16.7	12,007											
トップカルチャー	3.9	4.8	1,689	ミニストップ	7.9	8.7	12,693	阿波銀行	17.3	17.8	40,441											
P L A N T	2.8	3.1	2,321	アークス	21.7	22.1	53,238	大分銀行	6.1	6.8	14,518											
スギホールディングス	21.2	23.2	171,216	パローホールディングス	23.5	23.8	60,618	宮崎銀行	7	7.3	16,498											
薬王堂ホールディングス	4.6	5.1	13,729	藤久	0.9	2.7	2,119	佐賀銀行	6.4	6.7	9,065											
ヴィア・ホールディングス	13.1	14.2	4,047	バルク	5.2	5.8	35,438	沖繩銀行	9.7	10.7	30,291											
スクロール	16.3	16.6	20,766	大 庄	5.7	6.3	6,684	琉球銀行	24.6	25.4	19,761											
ヨドショーホールディングス	10.8	10.8	22,064	ファーストリテイリング	14.2	15.6	1,460,628	セブン銀行	355.3	389	95,694											
ファミリーマート	84.9	—	—	サンドラッグ	40	43.8	191,844	みずほフィナンシャルグループ	14,451.2	1,584.6	2,423,645											
木曾路	13.9	15.3	36,857	サックスーパー ホールディングス	9	10	5,900	高知銀行	4	4.2	3,229											

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	価 値	株	数	評 価 額		株	数	価 値	株	数	評 価 額		株	数	価 値	株	数	評 価 額
山口フィナンシャルグループ	132.8	145.4	92,474	千株	千株	千円	アコム	213.7	234.5	110,684	千株	千株	千円	日清グループホールディングス	15.7	17.6	7,990	千株	千株	千円
長野銀行	3.5	3.9	4,992				ジャックス	11.7	12.8	27,737				日本エスコ	19.2	21.1	16,521			
名古屋銀行	8.6	9.4	26,263				オリエントコーポレーション	287.8	315.1	45,059				タカラレーベン	48.7	48.6	16,961			
北洋銀行	160.2	176	40,832				日立キャピタル	25.1	27.5	79,227				AVANTIA	6	6.6	6,072			
愛知銀行	3.9	3.9	11,352				アプラスフィナンシャル	51.2	—	—				イオンモール	53.3	58.4	108,215			
中京銀行	4.4	4.3	7,817				オリックス	665.2	723.4	1,331,779				毎日コムネット	2.2	3.5	2,418			
大光銀行	3.7	3.5	4,501				三菱UFJリース	269.9	262.4	149,830				ファースト住建	4.6	5	5,535			
愛媛銀行	14.9	16.5	16,153				九州リースサービス	5	6.5	4,257				ランド	589.5	624.6	6,246			
トマト銀行	4.1	4.5	4,810				日本取引所グループ	305.3	315	800,257				カチタス	13.2	28.9	90,746			
京葉銀行	45.3	49.7	21,718				イー・ギャランティ	11.4	13.3	32,731				トーセイ	14.7	16.1	17,339			
栃木銀行	51.4	56.1	10,210				アサックス	5.5	6.5	4,888				穴吹興産	2.2	2.7	4,514			
北日本銀行	3.4	3.7	7,078				NECキャピタルソリューション	4.3	4.8	9,777				サンフロンティア不動産	14.7	14.1	13,352			
東和銀行	18.7	20.5	14,022				不動産業 (2.0%)						エフ・ジェー・ネクスト	9.3	11.6	13,282				
福島銀行	10.4	13.2	3,009				いちご	135.3	129.6	41,990				インテリクス	3.1	2.7	1,490			
大東銀行	5.6	5.9	3,829				日本駐車場開発	117.2	115.5	16,747				ランドビジネス	4.3	4.4	1,491			
トモニホールディングス	82.3	90.1	29,012				スター・マイカ・ホールディングス	5.5	6.1	7,118				サンネクスタグループ	2.8	3.8	3,701			
フィデアホールディングス	103.6	114	13,224				SREホールディングス	—	1.3	6,175				グラディハウス	8.3	8.1	3,636			
池田泉州ホールディングス	122.8	133.5	21,360				ADワックスグループ	—	22.5	3,555				日本空港ビルディング	34	37.2	212,040			
証券・商品先物取引業 (0.8%)							ヒューリック	227.1	247.2	303,314				サービス業 (5.6%)						
F P G	32.8	35.8	21,515				三栄建築設計	4.3	4.7	8,492				明豊ファシリティワークス	—	5.3	3,614			
ジャフインベストメントアドバイザー	—	5.9	7,634				野村不動産ホールディングス	64.5	70.7	171,094				日本工営	6.9	7.1	19,716			
マセリアインベストメント	4.7	4.8	3,624				三菱UFJホールディングス	21.5	23.7	11,968				LIFULL	36	39.4	17,690			
SBIホールディングス	118.8	143	413,270				サムディ	15.1	16.5	28,578				ミクシィ	—	21.6	54,367			
日本アジア投資	9.3	10.1	2,454				ディア・ライフ	13.7	16.4	7,412				ジェイエイリビークロメント	6.9	7.5	14,617			
ジャパコ グループ	16.3	17.9	107,937				コーセーアールイー	3.2	3.5	2,149				日本M&Aセンター	77.8	92.6	561,156			
大和証券グループ本社	853.2	873.3	452,107				イー・ディー・ワークス	201.8	—	—				メンバーズ	3.1	3.3	8,556			
野村ホールディングス	1,871.3	1,780.3	1,072,986				日本商業開発	6.7	7.3	12,629				中広	1.1	1.2	422			
岡三証券グループ	90.6	99.2	39,580				フルサンスコーポレーション	17.4	19.1	28,650				UTグループ	12.1	16.3	58,680			
丸三証券	31.5	34.6	20,414				ユニツホールディングス	16	—	—				アイティメディア	3.1	3.7	8,295			
東洋証券	38.2	58.82	5,882				THEグローバル社	5.5	7.3	2,014				タケエイ	9.9	12.5	16,412			
親野フィナンシャルホールディングス	122	123.8	43,082				ハウスコム	1.4	1.2	1,588				E・Jホールディングス	1.2	4.4	4,422			
光世証券	2.5	3	1,962				日本管理センター	7	6.2	7,582				ビーネックスグループ	11.3	14.1	17,568			
水戸証券	30.8	31.2	8,455				サンセイランディング	3.2	3.5	2,618				コジカホールディングス	24.8	26.8	13,480			
いちよし証券	19.8	23.2	13,270				エストラスト	1.4	1.3	929				アルトナー	2.5	2.8	2,514			
松井証券	60.7	57.1	49,962				フージャースホールディングス	21.2	19	13,110				パソナグループ	11.1	12.2	25,010			
だいこう証券ビジネス	5.2	—	—				オープンハウス	30.9	36.7	164,049				CD S	2.5	2.4	3,492			
マネックスグループ	80.3	104.4	73,497				東急不動産ホールディングス	289.3	316.7	206,805				リゾランドモチベーション	22.7	20.7	13,579			
極東証券	14.3	15.7	12,607				飯田グループホールディングス	88.7	97.2	242,319				GCA	12.4	14.6	11,008			
岩井コスモホールディングス	10	11.9	17,980				イープランド	1.7	2.3	1,927				エス・エム・エス	32	38.4	145,344			
監理證券	19.1	21.7	17,913				ムゲンエステート	7.3	7.3	3,577				エーサイドアップグループ	2.3	4	2,720			
マネパートナーズグループ	11.5	12.8	2,777				ビーロット	2.4	5.4	3,531				パルソールホールディングス	103	113	246,905			
スパークス・グループ	36.8	53.8	16,893				ファーストブラザーズ	2.4	2.2	2,206				リニカル	5	6.5	4,972			
小林洋行	3.2	3	822				ハウスドゥ	5.9	5.6	6,949				クックパッド	36.1	35.6	11,605			
保険業 (1.9%)							シーアールイー	2.7	3	3,777				エスクリ	3.3	3.6	1,299			
かんぽ生命保険	37.6	144.5	324,836				プロ/ティエーエント	1.6	1.9	2,603				アイ・ケイ・ケイ	5.1	5.6	3,500			
SOMPOホールディングス	200	205.6	897,855				ケイアিসター不動産	3.4	3.6	9,540				学情	3.7	3.9	5,541			
アコム ホールディングス	8.8	32.8	36,932				アグレ都市デザイン	1.5	2.1	1,644				スタジオアリス	5.2	5.7	12,135			
M&S&Mインベストメントグループホールディングス	278	283.3	906,560				グッドコムアート	2.4	5.5	7,293				シミツホールディングス	5.7	5.6	9,088			
ソニーフィナンシャルホールディングス	87.4	—	—				ジェイ・エス・ビー	1.1	2.2	7,821				エブコ	1.6	2.8	2,741			
第一生命ホールディングス	601.8	616	1,114,960				テンポインノベーション	2.4	3.3	3,111				NJ S	2.2	2.8	5,656			
東京海上ホールディングス	380.3	386.6	2,135,965				グローバル・リゾ・マージント	1.7	2	1,500				総合整備保障	41	45	237,150			
T&Dホールディングス	317.8	348.4	496,818				パーク24	57.1	62.5	142,937				カカコム	77.1	83.5	288,075			
アドバンスクリエイティブ	2.4	2.4	4,596				バラカ	2.8	3.1	5,118				アイロムグループ	3.7	4	7,684			
その他金融業 (1.1%)							三井不動産	524.5	531.4	1,279,079				セントケア・ホールディング	6.7	8.3	8,466			
全国保証	30	30.3	150,591				三菱地所	745.2	766	1,401,780				サイネックス	1.7	2.2	1,617			
ジェイリース	3	3.8	2,922				平和不動産	19.5	20	76,400				ルネサンス	5.7	7	7,938			
イントラスト	3.8	3.3	2,508				東京建物	116.3	114.9	183,495				ディップ	14.5	17.6	52,553			
日本モーゲージサービス	2.1	5.9	7,056				ダイヤビル	27.4	30.1	38,528				デジタルホールディングス	5.6	7.8	15,748			
CASA	3.7	3.2	3,257				京阪神ビルディング	17.2	20.1	31,778				新日本科学	11.2	13.7	9,439			
アルヒ	16.9	17.1	29,736				住友不動産	239.1	262.1	943,822				ツイクホールディングス	24.3	26.7	18,289			
プレミアアグループ	5.8	5.4	13,300				テオーシー	20.9	22.9	17,518				キャリアデザインセンター	2.7	2.5	2,412			
クレディセゾン	74.5	68	91,868				東京楽天地	1.4	2	9,060				ペムフィット・フン	28.2	41.2	130,810			
芙蓉総合リース	11.1	12.2	93,330				レバロビズ 21	139.4	96.5	15,729				エムスリー	227.1	199.3	1,717,168			
みずほリース	16.4	18	61,290				スターツコーポレーション	14.5	13.8	39,633				ツカダグループホールディング	6.7	9.5	2,964			
東京センチュリー	21.4	27.1	237,125				フジ住宅	12.4	13.6	9,125				プラス	0.8	1.5	732			
日本証券金融	46.8	49.4	30,825				空港施設	10.8	12.1	6,497				アウトソーシング	59	64.7	96,532			
アイフル	162.3	195.2	55,436				明和地所	5.9	5.5	3,542				ウエルネット	9.8	11.5	5,681			
リコーリース	8.4	9.2	30,360				ゴールドクレスト	8.4	10.5	18,952				ワールドホールディングス	3.5	3.9	7,889			
イオンフィナンシャルサービス	65.1	71.3	99,748				エスリード	4.2	4.6	7,130				ディー・エヌ・エー	50.5	47.8	100,858			

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	T O P I X	百万円 7,442		百万円 -

■投資信託財産の構成

2021年2月8日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 311,274,068		% 97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,511,950		2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	318,786,019		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	318,786,019,057円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,651,925,208
株 式(評価額)	311,274,068,500
未 収 入 金	391,827,620
未 収 配 当 金	389,312,729
差 入 委 託 証 拠 金	78,885,000
(B) 負 債	199,379,000
未 払 解 約 債 金	199,379,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	318,586,640,057
元 次 期 繰 越 損 益 金	102,105,610,506
(D) 受 益 権 総 口 数	216,481,029,551
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	102,105,610,506円
	31,202円

(注1) 期首元本額	98,370,254,055円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	19,134,149円
追加設定元本額	67,069,989,134円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	9,070,573円
一部解約元本額	63,334,632,683円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (D/C)	2,599,277円
(注2) 期末における元本の内訳		投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	42,338,447円
One DC 国内株式インデックスファンド	15,975,939,497円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	98,734,309円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	3,179,107,702円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,803,475,886円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,626,890円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	265,437,692円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	5,088,758円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	9,278,066円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	8,151,762円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	5,239,774円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	24,072,359円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	5,173,103円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	14,018,113円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,626,870円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	12,980,814円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	52,904,100円
たわらノーロード TOPIX	784,765,731円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	64,217,224円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	612,281,321円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	71,448,850円
たわらノーロード バランス (堅実型)	23,454,696円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	32,545,912円
たわらノーロード バランス (標準型)	140,720,417円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	41,658,362円
たわらノーロード バランス (積極型)	207,209,167円	日米東証分散戦略ファンド (インカム重視) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	562,668,029円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,707,448円	インカム重視マルチアセット運用ファンド	85,977,917円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	108,252,549円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	72,359,909円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	245,952,107円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	128,443,286円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	166,536,220円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	7,951,637円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	228,275,842円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	35,906,053円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	431,973円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	8,484,030円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,205,302円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,658,825円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	4,833,419円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	21,889,554円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,885,817円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	46,792,943円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	6,004,044円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	689,878,804円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,764,926,964円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	729,307,036円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,023,160,847円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,064,787,625円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,393,344,349円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	150,408,971円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,451,908,533円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	37,142,128円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	332,009,300円	DIAM アスク グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	373,020,041円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,152,607,788円	DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	102,439,732円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,085,041,257円	DIAM世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,576,268円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	35,744,954円	DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	468,054,341円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,112,139,190円	DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	24,008,365円
マネックス資産設計ファンド エゴリレーション	21,186,872円	DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	99,685,187円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	313,080,893円	DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	238,004,405円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	264,026,418円	DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	323,286,503円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	439,000,020円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	45,168,755円
投資のソムリエ	15,620,354,669円	DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	20,550,710円
グループコントロール	637,176,611円	DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212) (適格機関投資家限定)	362,800,005円
投資のソムリエ<DC年金>	960,546,202円	DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	1,106,076,367円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	294,854,779円	DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	1,467,666,407円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	367,544,221円	DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	58,984,178円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	6,918,316円	期末元本合計	102,105,610,506円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	16,838,854円	(注3) 担保資産	
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	264,587,992円	代用として担保を提供している資産はありません。	
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,928,248,506円		

■損益の状況

当期 自2020年2月8日 至2021年2月8日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	5,192,079,491円	
	受取配当金	5,191,315,557	
	受取利息	7,434	
	その他の収益	3,319,941	
	支払利息	△2,563,441	
(B)	有価証券売買損益	32,654,345,029	
	売却益	50,944,545,133	
	売却損	△18,290,200,104	
(C)	先物取引等取引損益	1,230,944,200	
	取引益	2,753,684,220	
	取引損	△1,522,740,020	
(D)	当期損益金(A+B+C)	39,077,368,720	
(E)	前期繰越損益金	171,390,003,476	
(F)	解約差損益金	△99,083,661,761	
(G)	追加信託差損益金	105,097,319,116	
(H)	計(D+E+F+G)	216,481,029,551	
	次期繰越損益金(H)	216,481,029,551	

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

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第18期 (決算日 2021年2月15日)

(計算期間 2020年2月15日～2021年2月15日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月3日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債券組入 比率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率				
14期 (2017年2月14日)	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	—	—	百万円 379,734
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	—	355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	292,112
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	222,859
18期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	—	273,346

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

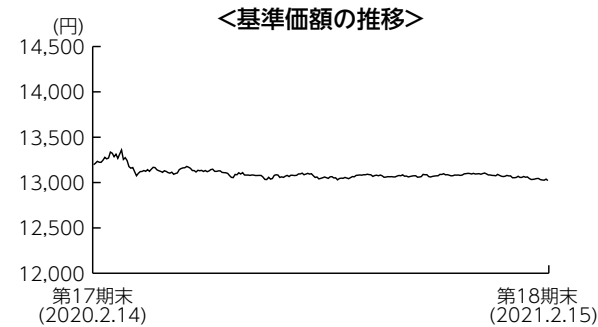
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債券組入 率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2020年 2月14日	円 13,197	% -	ポイント 390.72	% -	% 99.4	% -	% -
2 月 末	13,336	1.1	394.74	1.0	101.0	-	-
3 月 末	13,124	△0.6	388.45	△0.6	101.4	-	-
4 月 末	13,169	△0.2	389.79	△0.2	99.4	-	-
5 月 末	13,112	△0.6	388.13	△0.7	99.4	-	-
6 月 末	13,060	△1.0	386.56	△1.1	99.7	-	-
7 月 末	13,104	△0.7	387.91	△0.7	99.5	-	-
8 月 末	13,044	△1.2	386.09	△1.2	100.0	-	-
9 月 末	13,081	△0.9	387.22	△0.9	99.7	-	-
10 月 末	13,059	△1.0	386.63	△1.0	99.5	-	-
11 月 末	13,076	△0.9	387.12	△0.9	99.9	-	-
12 月 末	13,078	△0.9	387.20	△0.9	99.3	-	-
2021年 1 月 末	13,045	△1.2	386.25	△1.1	99.2	-	-
(期 末) 2021年 2月15日	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月15日から2021年2月15日まで）

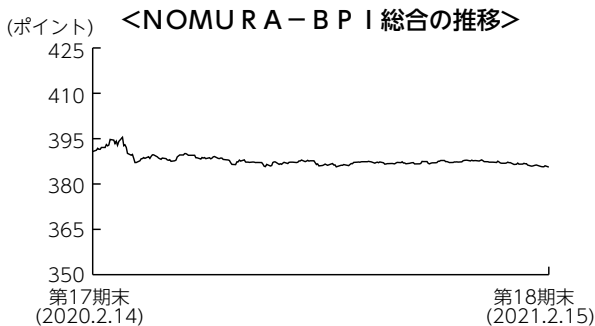


基準価額の推移

当期末の基準価額は13,022円となり、前期末比で1.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり基準価額は上昇して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和政策などを受けて基準価額は下落に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に基準価額は下落しました。



投資環境

国内債券市場では、利回りが上昇（価格は下落）しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり利回りは低下（価格は上昇）して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和

政策などを受けて利回りは上昇に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に利回りは上昇しました。

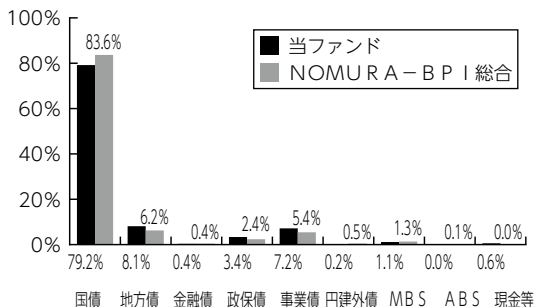
ポートフォリオについて

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

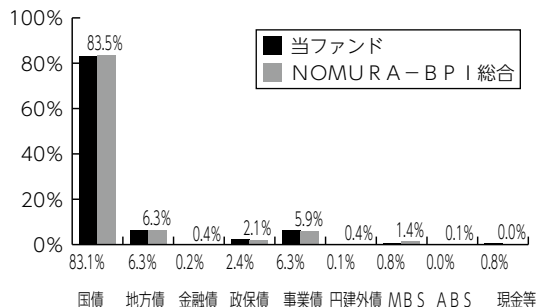
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

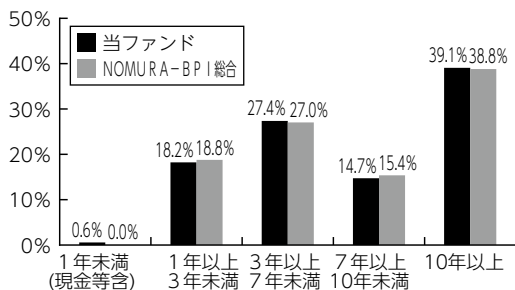


期末

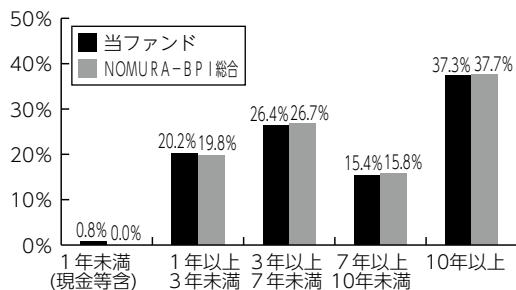


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で1.3%下落しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2020年2月15日から2021年2月15日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	191,780,597	136,499,291 (-)
	地方債証券	2,830,950	3,489,753 (-)
	特殊債証券	2,021,381	1,817,635 (203,888)
	社債証券	1,451,683	1,318,867 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年2月15日から2021年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 198,084	百万円 4,470	% 2.3	百万円 143,125	百万円 11,792	% 8.2

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	212,920,000	227,135,859	83.1	—	55.9	18.5	8.7
地 方 債 証 券	16,600,000	17,224,060	6.3	5.1	2.3	2.8	1.1
特 殊 債 券	14,894,979	15,838,836	5.8	—	3.8	1.5	0.5
金 融 債 券	500,000	500,321	0.2	—	—	0.2	—
普 通 社 債 券	10,281,000	10,583,824	3.9	0.1	1.2	2.0	0.7
合 計	255,195,979	271,282,901	99.2	5.2	63.1	25.1	11.0

(注 1) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第 2 位を四捨五入しています。

(注 2) 無格付銘柄については、B B 格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
3 2 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	1,300,000	1,315,925	2022/03/20
4 1 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	900,000	902,367	2022/04/01
4 1 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,500,000	1,504,245	2022/05/01
4 1 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	400,000	401,184	2022/06/01
1 3 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,500,000	2,507,700	2022/06/20
3 2 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.9000	3,200,000	3,244,000	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,050,000	1,063,030	2022/06/20
4 1 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,000,000	1,003,220	2022/07/01
4 1 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	200,000	200,684	2022/08/01
4 1 6 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,270,000	1,274,597	2022/09/01
1 3 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,980,000	1,987,246	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,400,000	1,420,650	2022/09/20
4 1 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,300,000	1,305,330	2022/11/01
4 1 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	600,000	602,526	2022/12/01
1 3 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,690,000	1,697,165	2022/12/20
3 2 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.7000	500,000	507,610	2022/12/20
3 2 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,200,000	1,220,472	2022/12/20
4 2 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,600,000	1,607,056	2023/01/01
1 3 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,840,000	1,848,648	2023/03/20
3 2 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,790,000	1,817,154	2023/03/20
1 3 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,250,000	1,256,587	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,770,000	1,808,196	2023/06/20
1 3 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,400,000	1,408,190	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,250,000	1,279,887	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	650,000	662,161	2023/09/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
1 3 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,550,000	2,567,085	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,360,000	2,408,781	2023/12/20
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,720,000	1,732,263	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,250,000	2,300,557	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,690,000	1,702,742	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,380,000	2,437,453	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,660,000	1,673,163	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	2,940,000	3,005,209	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	350,000	377,958	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,920,000	1,935,916	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	760,000	777,882	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	1,340,000	1,361,185	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	340,000	367,672	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,500,000	1,513,245	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	2,030,000	2,072,508	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	152,703	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,750,000	2,775,162	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	3,040,000	3,107,579	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	190,000	206,606	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,000,000	2,019,380	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	2,350,000	2,405,295	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	240,000	263,308	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,100,000	1,110,967	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	2,210,000	2,253,537	2025/12/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	2,580,000	2,605,696	2026/03/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
85回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	489,249	2026/03/20
343回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,280,000	2,303,233	2026/06/20
88回 利付国庫債券(20年)	2.3000	350,000	394,775	2026/06/20
344回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,280,000	2,303,689	2026/09/20
90回 利付国庫債券(20年)	2.2000	300,000	338,418	2026/09/20
345回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,010,000	3,041,785	2026/12/20
92回 利付国庫債券(20年)	2.1000	870,000	981,012	2026/12/20
346回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,470,000	2,496,429	2027/03/20
93回 利付国庫債券(20年)	2.0000	250,000	281,637	2027/03/20
94回 利付国庫債券(20年)	2.1000	450,000	509,697	2027/03/20
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,010,000	2,031,748	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	350,000	402,692	2027/06/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,980,000	2,001,621	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	574,780	2027/09/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,060,000	2,082,639	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	450,000	516,591	2027/12/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,700,000	2,727,837	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	695,772	2028/03/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,960,000	1,979,462	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	360,000	424,504	2028/06/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,220,000	2,241,090	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	400,000	464,652	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	350,000	409,230	2028/09/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,840,000	1,856,596	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	400,000	466,412	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	400,000	460,132	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,870,000	1,885,876	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	220,000	253,908	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	330,000	386,202	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,920,000	1,935,187	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	290,000	343,064	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	550,000	646,052	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,180,000	2,195,892	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	100,000	123,791	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	770,000	907,753	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,160,000	2,173,327	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	550,000	650,386	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	200,000	238,268	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	121,243	2030/02/20
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,100,000	2,111,403	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	320,000	382,585	2030/03/20
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	650,000	771,238	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,160,000	2,169,028	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	310,000	366,193	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	300,000	348,804	2030/06/20
120回 利付国庫債券(20年)	1.6000	400,000	457,636	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,090,000	2,096,959	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	634,451	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	350,000	407,883	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	254,984	2030/11/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	800,000	801,952	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	898,800	2030/12/20
124回 利付国庫債券(20年)	2.0000	390,000	463,565	2030/12/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	800,012	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	340,000	405,324	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	420,000	496,490	2031/03/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	620,000	734,582	2031/06/20
129回 利付国庫債券(20年)	1.8000	590,000	692,996	2031/06/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	680,000	800,734	2031/09/20
131回 利付国庫債券(20年)	1.7000	300,000	350,124	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	248,698	2031/11/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	420,000	491,278	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	672,839	2031/12/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	630,000	745,397	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	350,000	410,284	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	440,000	510,972	2032/03/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	350,000	411,176	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	380,000	437,931	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	450,000	523,629	2032/06/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,090,000	1,283,224	2032/09/20
8回 利付国庫債券(30年)	1.8000	200,000	238,010	2032/11/22
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	750,000	884,730	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	400,000	476,508	2032/12/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	700,000	889,245	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	430,000	498,030	2033/03/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	200,000	236,840	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,410,000	1,669,722	2033/06/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	200,000	247,280	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,050,000	1,245,741	2033/09/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	100,000	122,688	2033/12/20
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,180,000	1,387,691	2033/12/20
148回 利付国庫債券(30年)	2.4000	290,000	371,606	2034/03/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,090,000	1,269,904	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	259,598	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,130,000	1,318,291	2034/06/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	150,000	195,262	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	1,230,000	1,420,600	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	258,562	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,410,000	1,592,383	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	320,000	410,387	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,270,000	1,435,150	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	257,114	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	1,170,000	1,339,135	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	263,350	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,030,000	1,165,290	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	258,300	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	1,230,000	1,356,185	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	220,000	291,332	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	940,000	953,564	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	265,498	2036/06/20

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
157回	利付国庫債券(20年)	0.2000	1,150,000	1,130,645	2036/06/20
24回	利付国庫債券(30年)	2.5000	190,000	252,825	2036/09/20
158回	利付国庫債券(20年)	0.5000	980,000	1,006,195	2036/09/20
25回	利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	260,686	2036/12/20
159回	利付国庫債券(20年)	0.6000	1,050,000	1,093,501	2036/12/20
26回	利付国庫債券(30年)	2.4000	400,000	528,508	2037/03/20
160回	利付国庫債券(20年)	0.7000	1,080,000	1,140,166	2037/03/20
161回	利付国庫債券(20年)	0.6000	1,150,000	1,194,424	2037/06/20
27回	利付国庫債券(30年)	2.5000	420,000	564,253	2037/09/20
162回	利付国庫債券(20年)	0.6000	920,000	954,564	2037/09/20
163回	利付国庫債券(20年)	0.6000	1,070,000	1,109,012	2037/12/20
28回	利付国庫債券(30年)	2.5000	480,000	647,956	2038/03/20
164回	利付国庫債券(20年)	0.5000	1,160,000	1,182,330	2038/03/20
165回	利付国庫債券(20年)	0.5000	890,000	905,895	2038/06/20
29回	利付国庫債券(30年)	2.4000	560,000	749,616	2038/09/20
166回	利付国庫債券(20年)	0.7000	1,150,000	1,207,684	2038/09/20
167回	利付国庫債券(20年)	0.5000	950,000	963,404	2038/12/20
30回	利付国庫債券(30年)	2.3000	570,000	755,215	2039/03/20
168回	利付国庫債券(20年)	0.4000	850,000	845,716	2039/03/20
169回	利付国庫債券(20年)	0.3000	850,000	829,098	2039/06/20
31回	利付国庫債券(30年)	2.2000	460,000	603,280	2039/09/20
170回	利付国庫債券(20年)	0.3000	820,000	798,212	2039/09/20
171回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,060,000	1,029,694	2039/12/20
32回	利付国庫債券(30年)	2.3000	610,000	814,807	2040/03/20
172回	利付国庫債券(20年)	0.4000	760,000	751,336	2040/03/20
173回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,020,000	1,006,444	2040/06/20
33回	利付国庫債券(30年)	2.0000	930,000	1,194,910	2040/09/20
174回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,100,000	1,084,237	2040/09/20
175回	利付国庫債券(20年)	0.5000	400,000	401,812	2040/12/20
34回	利付国庫債券(30年)	2.2000	920,000	1,221,097	2041/03/20
35回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,100,000	1,422,652	2041/09/20
36回	利付国庫債券(30年)	2.0000	950,000	1,232,416	2042/03/20
37回	利付国庫債券(30年)	1.9000	990,000	1,267,506	2042/09/20
38回	利付国庫債券(30年)	1.8000	690,000	871,884	2043/03/20
39回	利付国庫債券(30年)	1.9000	610,000	783,972	2043/06/20
40回	利付国庫債券(30年)	1.8000	500,000	633,225	2043/09/20
41回	利付国庫債券(30年)	1.7000	500,000	623,635	2043/12/20
42回	利付国庫債券(30年)	1.7000	810,000	1,011,179	2044/03/20
43回	利付国庫債券(30年)	1.7000	520,000	649,740	2044/06/20
44回	利付国庫債券(30年)	1.7000	590,000	737,848	2044/09/20
45回	利付国庫債券(30年)	1.5000	580,000	700,564	2044/12/20
46回	利付国庫債券(30年)	1.5000	750,000	906,360	2045/03/20
47回	利付国庫債券(30年)	1.6000	710,000	874,720	2045/06/20
48回	利付国庫債券(30年)	1.4000	710,000	842,549	2045/09/20
49回	利付国庫債券(30年)	1.4000	800,000	949,648	2045/12/20
50回	利付国庫債券(30年)	0.8000	610,000	639,389	2046/03/20
51回	利付国庫債券(30年)	0.3000	620,000	576,550	2046/06/20
52回	利付国庫債券(30年)	0.5000	680,000	663,442	2046/09/20
53回	利付国庫債券(30年)	0.6000	750,000	748,320	2046/12/20
54回	利付国庫債券(30年)	0.8000	700,000	731,577	2047/03/20

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
55回	利付国庫債券(30年)	0.8000	700,000	731,010	2047/06/20
56回	利付国庫債券(30年)	0.8000	620,000	646,951	2047/09/20
57回	利付国庫債券(30年)	0.8000	690,000	719,407	2047/12/20
58回	利付国庫債券(30年)	0.8000	870,000	906,313	2048/03/20
59回	利付国庫債券(30年)	0.7000	680,000	691,097	2048/06/20
60回	利付国庫債券(30年)	0.9000	760,000	809,179	2048/09/20
61回	利付国庫債券(30年)	0.7000	660,000	668,566	2048/12/20
2回	利付国庫債券(40年)	2.2000	280,000	390,972	2049/03/20
62回	利付国庫債券(30年)	0.5000	500,000	480,470	2049/03/20
63回	利付国庫債券(30年)	0.4000	570,000	532,072	2049/06/20
64回	利付国庫債券(30年)	0.4000	640,000	596,384	2049/09/20
65回	利付国庫債券(30年)	0.4000	610,000	567,446	2049/12/20
3回	利付国庫債券(40年)	2.2000	290,000	406,925	2050/03/20
66回	利付国庫債券(30年)	0.4000	520,000	483,464	2050/03/20
67回	利付国庫債券(30年)	0.6000	690,000	676,496	2050/06/20
68回	利付国庫債券(30年)	0.6000	710,000	696,005	2050/09/20
69回	利付国庫債券(30年)	0.7000	400,000	402,480	2050/12/20
4回	利付国庫債券(40年)	2.2000	550,000	776,259	2051/03/20
5回	利付国庫債券(40年)	2.0000	500,000	683,400	2052/03/20
6回	利付国庫債券(40年)	1.9000	570,000	768,348	2053/03/20
7回	利付国庫債券(40年)	1.7000	530,000	688,099	2054/03/20
8回	利付国庫債券(40年)	1.4000	620,000	753,963	2055/03/20
9回	利付国庫債券(40年)	0.4000	1,020,000	928,567	2056/03/20
10回	利付国庫債券(40年)	0.9000	900,000	960,156	2057/03/20
11回	利付国庫債券(40年)	0.8000	750,000	776,655	2058/03/20
12回	利付国庫債券(40年)	0.5000	750,000	701,722	2059/03/20
13回	利付国庫債券(40年)	0.5000	560,000	523,213	2060/03/20
小計		-	212,920,000	227,135,859	-
(地方債証券)		%	千円	千円	
23年度20回	愛知県公募公債	1.0820	500,000	505,950	2022/03/29
109回	共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	506,155	2022/04/25
708回	東京都公募公債	0.8900	500,000	505,870	2022/06/20
111回	共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	708,288	2022/06/24
364回	大阪府公募公債	0.7900	300,000	303,675	2022/09/27
194回	神奈川県公募公債	0.7910	300,000	304,290	2022/12/20
24年度7回	千葉県公募公債	0.7400	300,000	304,020	2022/12/22
119回	共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	507,945	2023/02/24
121回	共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	506,070	2023/04/25
25年度4回	愛知県公募公債	0.8560	300,000	305,760	2023/05/30
720回	東京都公募公債	0.8700	300,000	306,006	2023/06/20
25年度4回	札幌市公募公債	0.8000	200,000	203,676	2023/06/20
25年度2回	横浜市公募公債	0.8880	400,000	408,404	2023/07/14
374回	大阪府公募公債	0.9380	300,000	306,657	2023/07/28
25年度5回	千葉県公募公債	0.8400	200,000	204,162	2023/08/25
128回	共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	305,367	2023/11/24
726回	東京都公募公債	0.7300	400,000	408,140	2023/12/20
25年度11回	福岡県公募公債	0.6940	200,000	204,114	2024/02/26
208回	神奈川県公募公債	0.5510	300,000	305,370	2024/06/20
1回	兵庫県公募公債(12年)	1.1000	300,000	310,767	2024/06/26
26年度5回	埼玉県公募公債	0.6110	400,000	408,188	2024/07/29

銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
488回 名古屋市公債券 10年	0.5980	450,000	459,342	2024/09/20
26年度11回 京都府公債券	0.4760	350,000	356,125	2024/12/19
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	506,395	2025/01/24
26年度17回 兵庫県公債券	0.4600	200,000	203,420	2025/02/26
5回 東京都公債券 20年	2.1100	100,000	108,538	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	407,380	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	409,088	2025/05/23
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	511,810	2025/07/25
1回 静岡県公債券 20年	2.1800	100,000	109,907	2025/09/19
9回 東京都公債券 20年	2.4400	200,000	225,162	2026/06/19
10回 東京都公債券 20年	2.3300	300,000	337,659	2026/09/18
4回 京都市公債券 20年	2.5100	100,000	113,555	2026/09/18
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	503,105	2027/01/25
29年度4回 大阪市公債券	0.1500	200,000	200,720	2027/09/21
29年度6回 広島市公債券	0.2300	300,000	302,616	2028/02/25
5回 兵庫県公債券 15年	1.3100	300,000	325,755	2028/05/26
30年度7回 神戸市公債券 30年	0.2540	300,000	302,910	2028/09/20
第91回 川崎市公債券	0.1850	200,000	200,902	2028/09/20
7回 静岡県公債券 20年	2.3200	300,000	349,713	2028/09/21
30年度14回 北海道公債券	0.1950	300,000	301,023	2028/12/28
30年度19回 愛知県公債券	0.1150	200,000	199,584	2029/03/28
802回 東京都公債券	0.1300	400,000	398,920	2030/03/19
8回 静岡県公債券 15年	0.8280	200,000	212,062	2030/06/07
36回2号 宮城県公債券 10年	0.1350	250,000	249,280	2030/10/28
19回 神奈川県公債券 20年	1.8180	100,000	117,027	2032/01/30
24年度2回 福岡県公債券(20年)	1.6350	300,000	346,629	2032/08/16
10回 大阪府公債券 20年	1.7200	200,000	233,022	2032/09/24
14回 千葉県公債券 20年	1.1370	100,000	110,202	2033/04/15
14回 埼玉県公債券 20年	1.5460	300,000	347,556	2034/05/08
17回 北九州市公債券 20年	1.5290	100,000	115,540	2034/06/20
2回 横浜市公債券 30年	2.4900	100,000	129,352	2035/03/20
18回 千葉県公債券 20年	1.1380	100,000	110,769	2035/04/13
14回 大阪府公債券 20年	0.5400	100,000	101,754	2036/09/29
30年度7回 福岡市公債券	0.7010	200,000	207,200	2038/10/19
27年度8回 愛知県公債券 30年	1.5790	150,000	180,630	2045/06/20
27年度2回 広島県公債券 30年	0.7110	100,000	100,534	2046/03/22
小 計	-	16,600,000	17,224,060	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	303,435	2022/05/20
96回 高速道路機構債	0.7960	700,000	708,715	2022/09/20
44回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	406,508	2023/01/20
55回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	508,535	2023/03/20
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	505,830	2023/04/28
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	510,330	2023/06/30
50回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	510,845	2023/07/14
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	337,296	2023/07/31
116回 高速道路機構債	0.7220	100,000	101,807	2023/09/20
56回 政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	553,696	2024/01/19
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	305,619	2024/09/13
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	508,850	2025/03/31

銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
85回 中日本高速道路債券	0.0700	300,000	299,988	2025/10/21
83回 地方公共団体金融機構債券	0.0900	400,000	400,100	2026/04/28
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	200,000	201,450	2027/04/13
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	804,584	2027/04/30
72回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	199,936	2027/06/18
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	301,809	2027/11/19
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	302,601	2028/02/18
9回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	216,500	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	229,678	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	200,000	234,800	2029/06/28
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	353,061	2029/08/28
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	233,760	2029/09/20
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	213,174	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	232,584	2030/10/29
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	580,090	2030/10/31
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	415,009	2031/06/13
9回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	233,608	2031/12/26
13回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.9600	9,602	9,625	2032/05/10
14回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.7000	48,380	48,479	2032/05/10
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	116,203	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	231,992	2032/09/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	400,000	524,544	2033/12/20
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	334,509	2035/02/28
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	224,840	2035/06/28
172回 高速道路機構債	0.2880	200,000	195,472	2036/06/20
6回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	33,729	34,375	2037/05/10
8回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	23,700	24,300	2037/05/10
9回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	35,535	36,439	2037/05/10
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	206,776	2037/07/31
26回 高速道路機構債	2.6700	200,000	269,850	2037/09/18
2回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	2.2700	37,851	39,092	2037/11/10
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	12,520	12,966	2041/06/10
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	48,532	49,903	2041/07/10
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	36,441	37,518	2042/02/10
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	59,815	61,473	2042/05/10
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	126,650	135,786	2044/10/10
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	201,216	212,960	2045/05/10
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	232,750	2045/10/31
169回 高速道路機構債	1.2000	100,000	109,874	2045/12/20
19回 高速道路機構債	2.7500	150,000	219,892	2047/03/20
131回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	97,973	2050/06/20
165回 都市再生機構債券	0.7090	100,000	98,305	2050/06/20
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	243,543	244,073	2051/11/10
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	256,239	258,150	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	256,635	258,377	2053/01/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	261,603	262,976	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	261,339	262,708	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	269,649	272,447	2053/10/10
小 計	-	14,894,979	15,838,836	-

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(金融債券)	%	千円	千円	
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,245	2024/05/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	400,076	2025/08/27
小 計	-	500,000	500,321	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
13回 パナソニック社債	0.5680	100,000	100,504	2022/03/18
9回 西日本旅客鉄道社債	2.2800	200,000	204,970	2022/03/25
45回 住友商事社債	1.1170	100,000	101,167	2022/04/20
23回 ゼイ エフ イー ホールディングス社債	0.0900	100,000	99,933	2022/05/23
1回 BPCE SA円債(ノンチャルボンド)	0.2140	200,000	200,026	2022/06/30
21回 東日本旅客鉄道社債	2.0200	100,000	103,163	2022/09/20
94回 丸紅社債	1.1700	100,000	101,679	2022/10/12
57回 東京三菱銀行社債	2.2200	200,000	207,266	2022/10/27
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.4760	100,000	100,632	2022/12/02
11回 東海旅客鉄道社債	1.1500	300,000	306,135	2022/12/20
18回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	102,634	2022/12/20
518回 中部電力社債	0.1900	200,000	200,522	2023/01/25
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	203,664	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	101,449	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	203,150	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	102,272	2023/03/24
23回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	306,687	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	101,833	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	204,340	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	102,389	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	410,484	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	315,429	2023/09/20
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	102,394	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	101,811	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	206,326	2023/11/24
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	211,196	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	307,551	2023/12/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	412,360	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	411,680	2024/02/23
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	203,324	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	106,595	2024/03/19
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	107,569	2024/09/20
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	203,108	2024/10/28
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー・円債社債	0.8650	200,000	204,512	2024/11/28
321回 北海道電力社債	0.8860	161,000	165,607	2024/12/25
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	325,155	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	216,228	2025/06/20
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	218,268	2025/09/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	134,320	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	104,642	2026/06/25
33回 西日本高速道路債券	0.2700	300,000	302,778	2026/12/14
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	202,562	2027/02/16
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	303,708	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	304,260	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,200	2027/05/07
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	200,000	202,036	2028/01/18
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	202,072	2028/06/06
14回 プリズトン社債	0.3750	200,000	200,284	2029/04/19
80回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	107,232	2029/04/27
18回 NTTファイナンス社債	0.3800	200,000	201,788	2030/09/20
73回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	235,190	2030/12/20
350回 北海道電力社債	0.7540	200,000	202,868	2038/03/25
43回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	99,910	2038/07/12
71回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	98,726	2059/12/24
47回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	97,235	2060/09/17
小 計	-	10,281,000	10,583,824	-
合 計	-	255,195,979	271,282,901	-

■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 271,282,901	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,188,062	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	273,470,964	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	273,470,964,587円
コ ー ル ・ 公 司 未 前 負 未 払 純 資 産 元 次 受 取 払 解 約 総 額 (A - B) 期 繰 越 損 益 受 益 権 総 口 数	1,577,987,460 271,282,901,629 528,367,341 81,708,157 124,841,000 124,841,000 273,346,123,587 209,919,027,595 63,427,095,992 209,919,027,595口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	13,022円

(注1) 期首元本額	168,870,516,479円
追加設定元本額	167,666,444,476円
一部解約元本額	126,617,933,360円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	20,138,397,472円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	75,739,659円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	64,284,684円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	13,922,204円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	698,579,753円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	175,024,830円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,170,668円
たわらノーロード 国内債券	13,371,410,550円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,375,425,101円
たわらノーロード バランス (堅実型)	479,364,723円
たわらノーロード バランス (標準型)	771,140,997円
たわらノーロード バランス (積極型)	94,268,225円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	35,956,909円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	841,677,984円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	857,299,721円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	267,544,001円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	94,593,242円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	11,595,925円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	7,216,822円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	15,550,209円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,935,187円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,527,471円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,617,188,939円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	7,945,845,516円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	10,564,168,081円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,214,698,647円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	1,934,636,468円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,100,996,248円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	317,515,894円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	69,643,768円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,183,121,770円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	9,343,546円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	3,834,269,246円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	1,215,297,756円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	244,940,249円
投資のソムリエ	19,968,780,596円
クルーズコントロール	1,710,359,908円
投資のソムリエ<DC年金>	1,200,230,759円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,601,786,821円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	458,001,465円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	6,432,489円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	14,490,817円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,572,825,479円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	28,534,806,570円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	15,124,286円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	7,164,986円

リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	25,891,763円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	37,090,342円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	588,184,487円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,654,944,013円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,553,714,682円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	8,354,710円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	4,154,214円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	4,151,302円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	10,186,401円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	1,324,203円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	18,427,003円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	1,519,942,923円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	9,097,902円
D I A M国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	7,795,147,063円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,101,630,563円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	308,141,870円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家限定)	5,804,574,674円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII (適格機関投資家限定)	5,780,092,239円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定)	5,759,938,173円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドV (適格機関投資家限定)	5,767,537,679円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	2,207,986円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA	194,833,349円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA	115,400,455円
D I A M国際分散バランスファンド30VA	41,774,211円
D I A M国際分散バランスファンド50VA	118,714,473円
D I A M国内重視バランスファンド30VA	47,275,935円
D I A M国内重視バランスファンド50VA	10,741,315円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	63,831,542円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	147,396,923円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,113,378,518円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,455,390,819円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,620,892,716円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA	512,197,093円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	209,605,289円
D I A M アグサ グローバル バランスファンド30VA	2,518,908,521円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	229,606,580円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	10,843,033円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	2,800,949,726円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	54,001,054円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	448,922,701円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	713,955,739円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	1,210,800,648円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	338,532,229円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	106,770,675円
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	928,960,030円
コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	382,409,178円
期末元本合計	209,919,027,595円

■損益の状況

当期 自2020年2月15日 至2021年2月15日

項	目	当	期					
(A) 配	当	等	収	益	1,854,548,870円			
受	取		利	息	1,855,446,015			
支	払		利	息	△897,145			
(B) 有	証	券	売	買	損	益	△5,046,081,656	
売		買			益	損	53,162,300	
売					損	益	△5,099,243,956	
(C) 当	期	損	益	金(A + B)	△3,191,532,786			
(D) 前	期	繰	越	損	益	金	53,988,844,136	
(E) 解	約	差	損	益	金	△39,191,042,382		
(F) 追	加	信	託	差	損	益	金	51,820,827,024
(G) 合				計(C + D + E + F)	63,427,095,992			
次	期	繰	越	損	益	金(G)	63,427,095,992	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2021年2月15日）

（計算期間 2020年2月18日～2021年2月15日）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年9月2日から無期限です。
運用方針	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCIコクサイ・インデックス		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	（円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
15期(2017年2月15日)	30,270	26.6	ポイント 971,437.64	% 27.0	% 95.6	% 1.7	百万円 278,963
16期(2018年2月15日)	33,302	10.0	1,070,930.74	10.2	95.7	2.2	284,448
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0	349,689
18期(2020年2月17日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7	370,420
19期(2021年2月15日)	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5	477,565

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

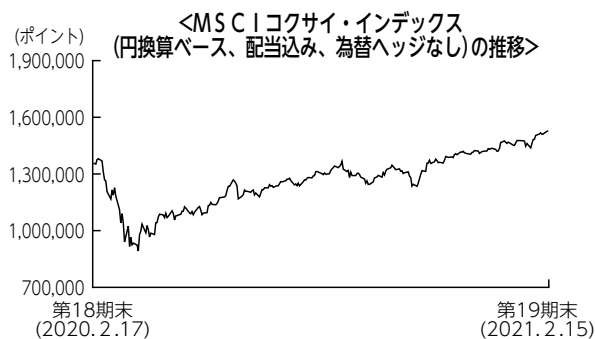
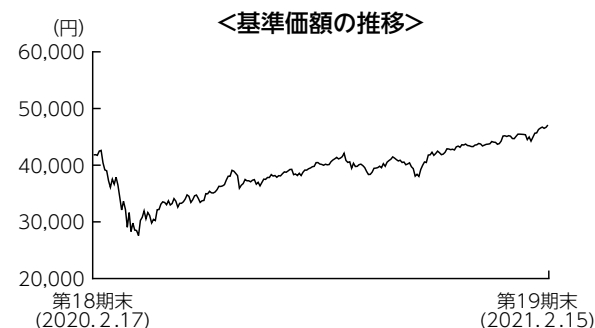
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2020年 2月 17日	41,812	% -	1,354,548.25	% -	% 94.7	% 2.7
2 月 末	37,252	△10.9	1,206,797.36	△10.9	95.7	1.4
3 月 末	31,648	△24.3	1,027,164.79	△24.2	96.5	2.6
4 月 末	34,754	△16.9	1,126,486.20	△16.8	94.3	3.0
5 月 末	36,243	△13.3	1,175,146.51	△13.2	94.1	3.4
6 月 末	36,940	△11.7	1,198,230.56	△11.5	96.0	1.5
7 月 末	38,177	△8.7	1,236,614.10	△8.7	95.4	2.2
8 月 末	41,110	△1.7	1,333,631.14	△1.5	90.7	7.9
9 月 末	39,487	△5.6	1,281,404.41	△5.4	95.4	2.1
10 月 末	38,389	△8.2	1,245,785.85	△8.0	95.9	1.6
11 月 末	42,818	2.4	1,390,283.49	2.6	95.9	2.9
12 月 末	44,055	5.4	1,430,471.52	5.6	96.0	2.3
2021年 1 月 末	44,967	7.5	1,461,431.17	7.9	96.1	1.7
(期 末) 2021年 2月 15日	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月18日から2021年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は47,083円となり、前期末比で12.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

株式市場では米国市場が新型コロナウイルスの感染拡大への懸念による急落から反発し、前期末の水準を大きく上回る上昇となり、基準価額を押し上げました。為替市場では米ドルなど一部の通貨が円高となりマイナスに寄与したものの、ユーロなどの欧州通貨が円安となりプラスの寄与となりました。こうした要因から当期の基準価額は上昇しました。

投資環境

先進国株式市場は上昇しました。米国市場は2020年2月下旬以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から急落しましたが、3月下旬以降は米景気対策法案への期待などから反発しました。その後も欧米における新型コロナウイルスの感染拡大から調整する場面もありましたが、ワク

チン開発や接種の進展、経済活動正常化への期待感などを受けて堅調に推移しました。欧州市場は急落後の反発力に欠ける市場もあり、前期末比では各国市場まちまちの値動きとなりました。

為替市場はまちまちの値動きとなりました。新型コロナウイルスの感染拡大から大きく変動した2020年2月、3月を除いて、米ドルに対してはほぼ一貫して円高となりました。これは米国が金融緩和を積極的に進めたことが主な要因です。一方でユーロなど他の多くの通貨に対しては円安となりました。経済活動再開への期待などによりリスク回避姿勢が後退したことから、安全資産と見られた円が売られ、その他の通貨が買われたためです。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.3%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.9
3	銀行	7.3
4	資本財	6.7
5	メディア・娯楽	6.1
6	ヘルスケア機器・サービス	4.9
7	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.9
8	小売	4.8
9	食品・飲料・タバコ	4.6
10	エネルギー	4.5

期末

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



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で12.9%上昇しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料	1円	0.004%
(株 式)	(1)	(0.002)
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)
(先物・オプション)	(1)	(0.002)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)
(投 資 証 券)	(0)	(0.000)
(b) 有価証券取引税	5	0.013
(株 式)	(5)	(0.012)
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)
(投 資 証 券)	(0)	(0.000)
(c) その他費用	9	0.024
(保 管 費 用)	(0)	(0.000)
(そ の 他)	(9)	(0.024)
合 計	16	0.040

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(39,034円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については11ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2020年2月18日から2021年2月15日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 76,463.16 (14,562.26)	千アメリカ・ドル 701,987 (△3,608)	百株 45,411.7	千アメリカ・ドル 353,039
	カ ナ ダ	百株 12,093.39 (△21.96)	千カナダ・ドル 51,424 (△0.21676)	百株 7,238.68	千カナダ・ドル 24,349
	オーストラリア	百株 21,852.12 (453.07)	千オーストラリア・ドル 36,147 (-)	百株 14,694.93	千オーストラリア・ドル 16,462
	香 港	百株 19,390 (△2,849.15)	千香港・ドル 83,001 (-)	百株 12,540.48	千香港・ドル 48,260
	シンガポール	百株 8,246.5 (2,113.75)	千シンガポール・ドル 3,326 (-)	百株 12,498.19	千シンガポール・ドル 2,401
	ニュージーランド	百株 872.37 (-)	千ニュージーランド・ドル 822 (-)	百株 719.94	千ニュージーランド・ドル 502
	イ ギ リ ス	百株 78,899.1 (5,792.39)	千イギリス・ポンド 42,047 (△8)	百株 50,946.95	千イギリス・ポンド 18,921
	イスラエル	百株 496.65 (39.42)	千イスラエル・シケル 1,841 (-)	百株 39.42	千イスラエル・シケル 32
	ス イ ス	百株 4,418.96 (0.31)	千スイス・フラン 31,583 (△340)	百株 2,215.29	千スイス・フラン 15,848
	デンマーク	百株 1,158.98 (-)	千デンマーク・クローネ 58,612 (-)	百株 555.11	千デンマーク・クローネ 28,435
	ノルウェー	百株 1,469.2 (-)	千ノルウェー・クローネ 19,876 (-)	百株 582.96	千ノルウェー・クローネ 8,645
	スウェーデン	百株 6,788.69 (375.01)	千スウェーデン・クローナ 111,556 (-)	百株 3,516.25	千スウェーデン・クローナ 42,207
国	イ ギ リ ス	百株 269.98 (-)	千ユーロ 1,265 (-)	百株 1,401.32	千ユーロ 6,758
	アイルランド	百株 458.5 (1.04)	千ユーロ 2,589 (-)	百株 1,443.88	千ユーロ 982
	オランダ	百株 4,881.21 (839.88)	千ユーロ 15,275 (△4)	百株 3,280.09	千ユーロ 7,736
	ベルギー	百株 432.31 (-)	千ユーロ 2,499 (-)	百株 232.58	千ユーロ 900
	ルクセンブルグ	百株 569.96 (101.97)	千ユーロ 530 (-)	百株 306.11	千ユーロ 153
	フランス	百株 6,144.78 (△285.63)	千ユーロ 29,258 (△125)	百株 3,419.66	千ユーロ 14,451
	ドイツ	百株 6,260.14 (378.62)	千ユーロ 29,572 (△322)	百株 3,026.64	千ユーロ 12,394

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユ ー ロ ム	ポ ル ト ガ ル	370.56 (2,016.06)	千ユーロ 154 (-)	2,016.06	百株 千ユーロ 18
		ス ペ イ ン	11,323.51 (36,219.26)	千ユーロ 6,785 (△1)	47,689.27	百株 千ユーロ 4,268
		イ タ リ ア	8,841.37 (-)	千ユーロ 6,080 (-)	3,017.58	百株 千ユーロ 2,303
		フ ィ ン ラ ン ド	2,365.02 (-)	千ユーロ 3,003 (-)	1,056.68	百株 千ユーロ 1,660
		オ ー ス ト リ ア	213.07 (-)	千ユーロ 503 (-)	140.25	百株 千ユーロ 378

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	9,583	千アメリカ・ドル 153	9,583 (-)	千アメリカ・ドル 29 (-)
	ス イ ス	87,844	千スイス・フラン 17	証券 (-)	千スイス・フラン (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ			千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		4.85 (-)	777 (-)	1.49 (-)	258 (-)
BOSTON PROPERTIES INC		4.047 (-)	379 (-)	3.127 (-)	267 (-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		4.922 (-)	183 (-)	- (-)	- (-)
SL GREEN		2.636 (-)	121 (-)	9.733 (-)	487 (-)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT		42.275 (-)	276 (-)	22.963 (-)	139 (-)
PROLOGIS INC		18.354 (-)	1,753 (-)	8.083 (-)	798 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC		2.743 (-)	435 (-)	0.905 (-)	145 (-)
CAMDEN PROPERTY TRUST		6.861 (-)	594 (-)	5.28 (-)	501 (-)
EQUINIX INC		2.314 (-)	1,707 (-)	0.844 (-)	633 (-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC		- (-)	- (-)	13.649 (-)	514 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
DUKE REALTY TRUST	9.24	334	4.589	173
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	11.24	1,808	3.992	639
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.316	285	0.887	186
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	14.226	867	6.987	404
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	-	-	6	523
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	11.492	269	6.111	200
	(-)	(-)	(-)	(-)
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.835	527	0.775	231
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	15.617	849	9.305	519
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	-	-	32.98	366
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	5.143	127	4.529	143
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2.461	151	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	8.836	125	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	4.745	576	2.725	311
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	9.434	560	3.459	207
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	3.096	123	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	10.298	374	5.586	190
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	7.149	492	2.372	151
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	3.283	697	1.637	311
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	2.252	330	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	8.055	304	2.539	132
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	3.954	132	3.712	139
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	15.289	354	8.814	254
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	3.124	339	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	9.706	1,350	1.819	276
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	21.376	429	7.418	132
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGNC INVESTMENT CORP	9.532	111	8.245	149
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	20.066	138	-	-
	(△82.136)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	10.881	2,582	5.358	1,305
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	7.024	454	4.534	323
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
INVITATION HOMES INC	8.091	231	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
VICI PROPERTIES INC	30.263	635	17.38	344
	(—)	(—)	(—)	(—)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	—	—	3.067	73
	(—)	(—)	(—)	(—)
CANADIAN APT PPTYS REIT	3.947	157	3.812	220
	(—)	(—)	(—)	(—)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	10.748	104
	(—)	(—)	(—)	(—)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12.935	174	30.611	555
	(—)	(—)	(—)	(—)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
DEXUS	24.397	218	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
GOODMAN GROUP	30.602	436	14.296	213
	(—)	(—)	(—)	(—)
VICINITY CENTRES	101.268	160	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	66.3	4,266	24	1,464
	(—)	(—)	(—)	(—)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	136.1	294	—	—
	(148.536)	(375)	(—)	(—)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	161.8	490	70	236
	(—)	(△7)	(—)	(—)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(△206.3)	(△429)	(—)	(—)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	563.1	1,151	293	609
	(—)	(△2)	(—)	(—)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△1)	(—)	(—)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
SEGRO PLC	13.709	129	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
ICADE	—	—	2.234	138
	(—)	(—)	(—)	(—)
KLEPIERRE	4.769	104	4.712	125
	(—)	(△14)	(—)	(—)
COVIVIO	1.942	112	1.544	148
	(—)	(—)	(—)	(—)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	2.022	119	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 147,648	百万円 147,076	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	160,063,426千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	346,644,284千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.46

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2020年2月18日から2021年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
AMAZON.COM INC	325.49	380.64	124,762	13,115,060			インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,365.53	1,585.92	20,336	2,137,746			ヘルスケア機器・用品
AES CORP	475.98	567.35	1,618	170,152			独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	35.74	39.87	1,309	137,620			ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	684.81	798.02	9,640	1,013,365			情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	790.23	1,053.11	9,875	1,038,061			半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	375.4	429.77	21,438	2,253,630			ソフトウェア
CHUBB LTD	352.14	406.4	6,671	701,304			保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	173.59	198.54	5,172	543,781			化学
ALLEGHANY CORP	10.94	12.63	769	80,865			保険
SAREPTA THERAPEUTICS INC	60.52	60.52	551	57,937			バイオテクノロジー
RALPH LAUREN CORP	34.22	-	-	-			繊維・アパレル・贅沢品
ALLSTATE CORP	258.32	283.81	2,963	311,557			保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	556.87	627.86	12,781	1,343,575			コングロマリット
AMGEN INC	464.84	524.53	12,442	1,307,942			バイオテクノロジー
HESS CORP	213.67	247.76	1,486	156,267			石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	544.74	616.15	7,986	839,544			消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	392.77	450.17	3,538	371,997			電力
AFLAC INC	570.28	582.83	2,734	287,465			保険
AMERICAN INTL GROUP	680.37	754.5	3,123	328,355			保険
AMERCO	5.85	9.29	464	48,851			陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	291.05	335.79	5,398	567,525			半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	181.92	192.19	3,044	319,995			バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	604.52	653.14	3,499	367,869			建設関連製品
JONES LANG LASALLE INC	40.87	-	-	-			不動産管理・開発
VALERO ENERGY CORP	314.33	374	2,421	254,524			石油・ガス・消耗燃料
APACHE CORP	314.7	-	-	-			石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	67.7	79.7	3,216	338,138			ソフトウェア
APPLE INC	3,499.77	15,286.24	206,929	21,752,463			コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	711.21	818.51	9,552	1,004,107			半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	76.34	95.36	1,570	165,039			化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	421.46	517.45	2,883	303,085			食品
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	78.13	92.78	706	74,308			電力
AMEREN CORP	194.87	222.73	1,632	171,573			総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	57.95	66.51	698	73,467			電子装置・機器・部品
AUTOLIV INC	59.13	75.7	713	75,016			自動車部品
AUTODESK INC	172.35	198.42	6,054	636,458			ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	334.93	386.31	6,452	678,290			情報技術サービス
AUTOZONE INC	19.17	21.6	2,476	260,357			専門小売り
AVERY DENNISON CORP	65.49	76.27	1,351	142,094			容器・包装
BALL CORP	252.62	288.47	2,586	271,945			容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,020.32	1,250.78	30,326	3,187,912			各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	666.37	702.98	2,947	309,851			資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	370.97	443.26	3,489	366,846			ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	207.72	260.87	6,686	702,897			ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	178.21	200.08	2,435	256,069			電気設備
VERIZON COMM INC	3,203.11	3,685.67	19,976	2,099,911			各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	122.01	125.11	849	89,272			保険
BEST BUY CO INC	187.2	215.6	2,598	273,122			専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	15.24	18.59	1,231	129,435			ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	231.1	273.93	2,889	303,706			ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	435.84	478	1,493	156,972			電力
BOEING CO	413.69	481.42	10,156	1,067,703			航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	83.24	111.11	819	86,174			専門サービス

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	
BORGLWARNER INC	172.1	219.38	921	96,834	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,066.58	1,290.98	4,956	520,982	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	99.88	117.19	1,069	112,472	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	87.66	106.87	2,135	224,526	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	19.29	22.08	2,695	283,321	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,814.88	2,018.55	12,109	1,272,927	医薬品
INGREDION INC	53.05	-	-	-	食品
ONEOK INC	324.27	392.84	1,772	186,283	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	59	80.93	874	91,913	保険
UNITED RENTALS INC	61.81	61.81	1,769	185,970	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	215.99	261.13	3,251	341,752	総合公益事業
FEDEX CORP	193.68	224.18	5,895	619,780	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	80.48	87.62	1,773	186,413	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	227.63	262.07	3,561	374,388	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	243.81	260.85	2,004	210,726	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,252.54	971.36	591	62,184	メディア
CSX CORP	595.4	686.59	6,188	650,579	陸運・鉄道
CABOT OIL & GAS CORP	314.16	314.16	572	60,203	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	140.5	166.23	777	81,691	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	200.52	196.41	1,418	149,089	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	128.2	146.75	3,540	372,191	飲料
CARDINAL HEALTH INC	229.5	247.18	1,281	134,750	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	319.62	471.45	971	102,091	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	432.58	486.12	9,624	1,011,747	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	98.65	98.65	1,190	125,187	ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	94.64	99.33	1,367	143,759	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	804.24	804.24	947	99,590	各種電気通信サービス
CERNER CORP	251.43	272.58	2,042	214,758	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,476.52	2,725.45	38,496	4,046,802	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	198.96	212.87	1,765	185,593	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	112.22	128.72	1,189	125,053	保険
CINTAS CORP	66.04	80.99	2,773	291,542	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	3,309.4	3,769.58	17,826	1,873,905	通信機器
CLOROX COMPANY	98.76	117.85	2,191	230,386	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	3,147.58	3,644.71	18,475	1,942,095	飲料
COPART INC	167.49	186.28	2,224	233,855	商業サービス・用品
COGNEX CORP	122.84	146.77	1,379	145,012	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	627.79	712.97	5,591	587,812	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	221.45	256.86	3,325	349,610	ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	-	52.03	1,125	118,292	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
COMERICA INC	119.85	-	-	-	銀行
NRG ENERGY, INC.	210.39	210.39	905	95,188	電力
COMCAST CORP-CL A	3,511.08	4,081.73	21,727	2,283,947	メディア
CONAGRA BRANDS INC	358.02	461.45	1,594	167,593	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	252.2	298.44	2,120	222,929	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	229.37	259.36	1,462	153,713	総合公益事業
COOPER COS INC	39.36	50.31	1,938	203,822	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	132.2	165.13	726	76,394	飲料
CORNING INC	583.76	710.11	2,618	275,297	電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	138.7	138.7	611	64,283	容器・包装
HEICO CORP-CL A	52.92	62.36	724	76,126	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	119.63	137.18	3,346	351,813	機械
DR HORTON INC	283.55	322.07	2,646	278,228	家庭用耐久財
DANAHER CORP	482.99	572.81	14,085	1,480,657	ヘルスケア機器・用品
MOODY'S CORP	129.22	151.99	4,235	445,236	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	423.7	470.43	3,620	380,579	情報技術サービス
TARGET CORP	394.21	449.86	8,611	905,258	複合小売り

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DEERE & CO	238.24	267.97	8,387	881,689	機械
MORGAN STANLEY	951.98	1,216.65	9,077	954,218	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	180.81	191.36	1,746	183,576	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	27.85	34.38	3,230	339,631	専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,394.4	1,619.66	30,396	3,195,244	娯楽
DOLLAR TREE INC	186.97	219.16	2,375	249,675	複合小売り
DOVER CORP	111.13	126.52	1,552	163,228	機械
OMNICOM GROUP	173.65	196.63	1,302	136,937	メディア
DTE ENERGY CO	148.17	177.93	2,151	226,206	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	568.01	642.05	5,766	606,215	電力
FLOWERVE CORP	98.82	-	-	-	機械
DARDEN RESTAURANTS INC	97	109.02	1,400	147,206	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	637.71	614.91	3,874	407,292	インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	6,844.79	6,976.37	23,280	2,447,209	銀行
CITIGROUP INC	1,746.72	1,867.17	11,880	1,248,909	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	94.23	122.29	1,335	140,416	化学
E*TRADE FINANCIAL CORP	171.04	-	-	-	資本市場
EATON CORP PLC	318.18	364.97	4,524	475,657	電気設備
EATON VANCE CORP	91.84	-	-	-	資本市場
CADENCE DESIGN SYS INC	226.28	246.39	3,589	377,318	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	177.49	214.2	671	70,612	メディア
ECOLAB INC	204.79	230.5	5,068	532,772	化学
PERKINELMER INC	83.38	97.55	1,468	154,401	ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	224.91	251.42	3,714	390,466	娯楽
SALESFORCE.COM INC	644.04	815.12	19,593	2,059,620	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	22.43	22.43	583	61,367	保険
EMERSON ELECTRIC CO	467.05	522.99	4,462	469,116	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	86.5	115.03	1,047	110,097	ガス
ENERGY CORP	150.31	171.95	1,631	171,517	電力
EOG RESOURCES INC	446.03	540.41	3,297	346,641	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	91.61	103.22	1,828	192,259	専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	173.46	202.15	5,867	616,781	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	125.15	139.42	1,346	141,546	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	3,276.09	3,789.44	19,144	2,012,443	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	102.09	114.16	1,229	129,221	化学
NEXTERA ENERGY INC	374.04	1,752.42	14,567	1,531,374	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	28.75	32.46	1,025	107,825	資本市場
FAIR ISAAC CORP	-	24.82	1,175	123,612	ソフトウェア
ASSURANT INC	45.94	55.23	707	74,389	保険
FASTENAL CO	458.91	504.82	2,392	251,482	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	581.44	636.46	2,069	217,507	銀行
M&T BANK CORP	99.99	114.32	1,625	170,922	銀行
FISERV INC	443.49	514.04	5,653	594,340	情報技術サービス
FLIR SYSTEMS INC	116.23	-	-	-	電子装置・機器・部品
FORD MOTOR CO	3,108.36	3,423.19	3,919	412,023	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	237.13	237.13	654	68,848	資本市場
FREEMONT-MCMORAN INC	1,149.93	1,269.73	3,965	416,839	金属・鉱業
FLEX LTD	351.27	-	-	-	電子装置・機器・部品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	142.7	179.22	2,091	219,820	保険
GAP INC/THE	182.95	-	-	-	専門小売り
DENTSPLY SIRONA INC	183.86	183.86	1,017	106,976	ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	188.21	215.99	3,560	374,244	航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	461.41	538.66	3,076	323,435	食品
GENUINE PARTS CO	116.05	133.93	1,330	139,829	販売
GILEAD SCIENCES INC	978.31	1,130.1	7,559	794,627	バイオテクノロジー
GARTNER INC	73.84	75.22	1,375	144,645	情報技術サービス
MCKESSON CORP	145.58	142.89	2,604	273,735	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	評価額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	千円	
NVIDIA CORP	447.12	552.38	33,057	3,474,970	3,474,970	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	6,747.57	7,857.77	9,217	968,908	968,908	コングロマリット
WW GRAINGER INC	37.62	42.34	1,575	165,604	165,604	商社・流通業
HALLIBURTON CO	668.43	774.83	1,562	164,284	164,284	エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	327.28	345.68	3,170	333,327	333,327	飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	249	293.78	8,999	945,982	945,982	資本市場
HARLEY-DAVIDSON INC	129.01	-	-	-	-	自動車
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	175.86	189.69	3,526	370,728	370,728	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	94.73	113.83	1,041	109,463	109,463	レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	115.16	115.16	799	84,085	84,085	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	22.78	36.23	465	48,954	48,954	航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	112.92	136.22	2,062	216,767	216,767	食品
HP INC	1,174.82	1,251.84	3,441	361,750	361,750	コンピュータ・周辺機器
F5 NETWORKS INC	48.74	55.29	1,164	122,414	122,414	通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	104.72	120.24	1,189	125,081	125,081	容器・包装
JUNIPER NETWORKS INC	279.39	279.39	705	74,157	74,157	通信機器
HOLLYFRONTIER CORP	118.55	-	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	196.88	240.09	1,992	209,427	209,427	ヘルスケア機器・用品
UNUM GROUP	151.85	-	-	-	-	保険
HOME DEPOT INC	846.67	963.81	26,746	2,811,612	2,811,612	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	131.85	162.88	1,417	149,029	149,029	バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	241.61	262.54	1,266	133,133	133,133	食品
CENTERPOINT ENERGY INC	376.78	490.65	1,049	110,271	110,271	総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	29.13	29.13	853	89,677	89,677	建設関連製品
HUMANA INC	103.84	119.37	4,543	477,633	477,633	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	60	75.44	1,118	117,621	117,621	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	795.17	938.57	1,356	142,567	142,567	銀行
BIOGEN INC	141.19	144.18	4,008	421,387	421,387	バイオテクノロジー
IDEX CORP	61.54	72.94	1,457	153,249	153,249	機械
ILLINOIS TOOL WORKS	247.55	275.8	5,543	582,683	582,683	機械
INTUIT INC	200.54	233.97	9,686	1,018,205	1,018,205	ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	67.91	77.82	4,234	445,081	445,081	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	109.6	109.6	625	65,739	65,739	バイオテクノロジー
TRANE TECHNOLOGIES PLC	182.44	218.91	3,304	347,317	347,317	建設関連製品
INTEL CORP	3,428.07	3,802.57	23,503	2,470,707	2,470,707	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	79.65	199.06	2,668	280,523	280,523	化学
INTERNATIONAL PAPER CO	294.11	319.83	1,572	165,345	165,345	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	288.62	353.17	869	91,439	91,439	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	101.08	110.33	1,267	133,259	133,259	建設・土木
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	60.19	68.74	1,001	105,238	105,238	情報技術サービス
INCYTE CORP	137.98	159.42	1,344	141,313	141,313	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,043.38	2,351.55	39,172	4,117,773	4,117,773	医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	287.53	334.76	1,660	174,577	174,577	保険
KLA CORPORATION	127.24	141.3	4,688	492,852	492,852	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	333.12	560.14	1,119	117,646	117,646	石油・ガス・消耗燃料
KELLOGG CO	191.81	219.54	1,259	132,421	132,421	食品
EAST WEST BANCORP INC	115.6	-	-	-	-	銀行
KEYCORP	794.97	875.97	1,670	175,600	175,600	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	261.25	308.61	4,077	428,644	428,644	家庭用品
BLACKROCK INC./NEW YORK	89.29	136.68	9,881	1,038,763	1,038,763	資本市場
KOHL'S CORP	119.1	-	-	-	-	複合小売り
KROGER CO	639.44	712.62	2,419	254,321	254,321	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	111.39	130.86	7,670	806,321	806,321	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	27.16	33.02	1,280	134,645	134,645	航空宇宙・防衛
PACKAGING CORP OF AMERICA	71.43	84.38	1,123	118,131	118,131	容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	132.54	141.53	1,437	151,141	151,141	情報技術サービス
LEGGETT & PLATT INC	109.28	-	-	-	-	家庭用耐久財

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LENINAR CORP	227.53	258.81	2,396	251,874	家庭用耐久財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	207.95	-	-	-	各種金融サービス
ELI LILLY & CO	672.42	771.11	15,984	1,680,273	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	153.44	180.9	947	99,549	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	539.13	633.18	10,345	1,087,521	航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	236.62	284.52	3,641	382,772	ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	196.76	225.05	7,600	798,976	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	217.59	217.59	1,057	111,208	保険
LOWE'S COS INC	599.41	679.92	12,045	1,266,219	専門小売り
DOMINION ENERGY INC	637.96	733.73	5,273	554,331	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	385.73	458.5	1,647	173,173	ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	99.35	215.14	1,928	202,748	食品
MCDONALD'S CORPORATION	587.12	664.19	14,207	1,493,442	ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	190.18	215.72	7,322	769,753	資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	31.14	34.16	831	87,452	保険
MANPOWERGROUP INC	45.55	-	-	-	専門サービス
MARKEL CORPORATION	10.65	12.01	1,329	139,752	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	165.61	561.91	4,925	517,730	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	388.72	442.08	4,986	524,197	保険
MASCO CORP	212.16	231.51	1,272	133,728	建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	47.86	52.58	1,739	182,856	建設資材
METLIFE INC	612.6	679.99	3,785	397,932	保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	213.86	235.91	2,269	238,614	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,037.71	1,200.14	14,370	1,510,624	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	602.43	696.43	7,229	759,979	娯楽
CVS HEALTH CORP	1,004.51	1,175.45	8,723	916,963	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	1,983.19	2,257.06	16,927	1,779,466	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	326.86	366.51	1,512	159,003	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	80.49	85.88	2,046	215,094	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	5,617.88	6,425.29	157,413	16,547,273	ソフトウェア
MICRON TECH INC	847.94	999.6	8,797	924,791	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	41.88	-	-	-	機械
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	184.73	218.94	3,493	367,203	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	487.15	612.87	3,298	346,734	半導体・半導体製造装置
3M CO	442.96	515.39	9,210	968,157	コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	49.76	49.76	842	88,546	家庭用耐久財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	125.93	150.06	2,717	285,625	通信機器
KANSAS CITY SOUTHERN	76.14	83.46	1,746	183,634	陸運・鉄道
MYLAN NV	435.74	-	-	-	医薬品
ILLUMINA INC	116.19	131.34	6,629	696,894	ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	389.63	465.91	2,867	301,401	電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	65.45	80.58	919	96,649	バイオテクノロジー
NOV INC	271.94	-	-	-	エネルギー設備・サービス
NETAPP INC	179.63	198.04	1,383	145,434	コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	333.17	333.17	805	84,720	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	638.69	726.65	4,282	450,215	金属・鉱業
NVR INC	2.63	3.05	1,433	150,690	家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	967	1,116.09	15,861	1,667,399	繊維・アパレル・贅沢品
NOBLE ENERGY INC	394.36	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	94.87	-	-	-	複合小売り
NORDSON CORP	-	46.44	874	91,909	機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	202.6	229.57	5,850	614,990	陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	247.68	305.69	2,603	273,686	電力
NISOURCE INC	315.48	314.27	708	74,430	総合公益事業
TAPESTRY INC	217.9	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
NORTHERN TRUST CORP	159.59	173.65	1,704	179,145	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	121.94	136.98	4,073	428,178	航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)		当期			業種等
	株数	株数	評価額		千円	
			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			
WELLS FARGO & CO	3,239.87	3,503.46	11,747	1,234,855	銀行	
NUCOR CORP	240.42	288.6	1,625	170,922	金属・鉱業	
CHENIERE ENERGY INC	191.75	191.9	1,297	136,406	石油・ガス・消耗燃料	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	359.69	417.51	4,916	516,788	消費者金融	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	695.5	852.06	2,163	227,414	石油・ガス・消耗燃料	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	52.09	87.12	1,848	194,343	陸運・鉄道	
OGE ENERGY CORP	160.28	160.28	505	53,140	電力	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	58.22	65.76	2,847	299,354	専門小売り	
ORACLE CORP	1,806.97	1,782.61	11,244	1,182,043	ソフトウェア	
PACCAR INC	273.94	304.46	2,983	313,647	機械	
PTC INC	77.66	94.33	1,346	141,520	ソフトウェア	
EXELON CORP	737.21	853.23	3,601	378,587	電力	
PARKER HANNIFIN CORP	100.92	119	3,287	345,556	機械	
PAYCHEX INC	253.29	298.42	2,667	280,446	情報技術サービス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	61.63	65.29	3,979	418,372	ヘルスケア機器・用品	
PPL CORPORATION	537.24	713.2	1,997	209,995	電力	
PEPSICO INC	1,082.92	1,235.16	16,535	1,738,168	飲料	
PENTAIR PLC	125.11	155.64	834	87,743	機械	
PFIZER INC	4,280.75	4,971.81	17,262	1,814,594	医薬品	
ESSENTIAL UTILITIES INC	155.16	229.37	1,070	112,503	水道	
CONOCOPHILLIPS	858.96	1,233.91	5,819	611,705	石油・ガス・消耗燃料	
PVH CORP	52.05	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品	
PG&E CORP	-	1,239.99	1,463	153,810	電力	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	129.08	181.44	2,400	252,316	石油・ガス・消耗燃料	
ALTRIA GROUP INC	1,442.97	1,673.74	7,264	763,595	タバコ	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	344.94	382.89	6,213	653,126	銀行	
BROWN & BROWN INC	172.94	203.08	909	95,638	保険	
POLARIS INC	40.95	-	-	-	レジャー用品	
GARMIN LTD	107.74	123.65	1,616	169,885	家庭用耐久財	
PPG INDUSTRIES INC	190.31	206.85	2,865	301,264	化学	
IPG PHOTONICS CORP	26.08	33.53	847	89,135	電子装置・機器・部品	
COSTCO WHOLESALE CORP	339.84	394.44	13,913	1,462,626	食品・生活必需品小売り	
T ROWE PRICE GROUP INC	184.83	200.07	3,264	343,210	資本市場	
QUEST DIAGNOSTICS	108.83	119.26	1,502	157,986	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PROCTER & GAMBLE CO	1,939.08	2,223.79	28,380	2,983,306	家庭用品	
PROGRESSIVE CORP	461.27	528.87	4,562	479,616	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	390.39	445.03	2,593	272,596	総合公益事業	
PULTE GROUP INC	212.09	243.05	1,178	123,863	家庭用耐久財	
GLOBAL PAYMENTS INC	236.92	271.25	5,348	562,235	情報技術サービス	
QUALCOMM INC	939.82	1,010	14,945	1,571,121	半導体・半導体製造装置	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	103.88	107.44	1,226	128,899	資本市場	
EXACT SCIENCES CORP	113.06	139.11	2,156	226,674	バイオテクノロジー	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	31.61	40.52	645	67,819	保険	
REGENERON PHARMACEUTICALS	61.16	95.04	4,615	485,163	バイオテクノロジー	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	50.42	60.97	688	72,423	保険	
RESMED INC	111.16	132.86	2,664	280,093	ヘルスケア機器・用品	
US BANCORP	1,156.14	1,226.62	5,843	614,281	銀行	
SEAGEN INC	91.5	102.96	1,707	179,491	バイオテクノロジー	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	315	343.83	1,208	127,044	保険	
ROSS STORES INC	288.14	311.97	3,715	390,547	専門小売り	
ROLLINS INC	123.78	185.67	697	73,366	商業サービス・用品	
ROPER TECHNOLOGIES INC	79.49	91.27	3,614	379,953	コングロマリット	
ROCKWELL AUTOMATION INC	92.51	107.18	2,670	280,745	電気設備	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	140.75	158.79	1,073	112,888	ホテル・レストラン・レジャー	
RPM INTERNATIONAL INC	111.41	110.04	955	100,405	化学	
RAYTHEON COMPANY	219.72	-	-	-	航空宇宙・防衛	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	38.48	-	-	-	情報技術サービス	

銘柄	期首(前期末)		当期			業種等
	株数	株数	評価額		金額	
			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		
ACCENTURE PLC-CL A	493.57	568.7	14,642	1,539,200		情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,113.85	1,278.63	7,056	741,806		食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	101.9	117.94	2,682	281,951		保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	195.63	221.48	3,232	339,823		保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	474.12	557.29	7,556	794,376		情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	32.83	36.87	7,929	833,516		インターネット販売・通信販売
SCHLUMBERGER LTD	1,065.93	1,309.4	3,505	368,473		エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	898.67	1,376.29	8,008	841,867		資本市場
POOL CORP	—	35.32	1,193	125,434		販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	155.9	181.87	2,935	308,529		ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	106.22	133.04	1,037	109,084		食品
SEI INVESTMENTS CO	106.53	106.53	611	64,323		資本市場
ANTHEM INC	197.28	226.07	6,571	690,785		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	127.49	138.36	1,455	152,978		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	221.75	250.38	1,355	142,469		保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	63.67	73.88	5,327	559,986		化学
CENTENE CORP	461.24	509.9	3,018	317,316		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	40.44	45.32	2,295	241,298		銀行
IAC INTERACTIVE CORP	62.52	—	—	—		インタラクティブ・メディアおよびサービス
SMITH (A.O.) CORP	113.51	113.51	685	72,034		建設関連製品
ACUITY BRANDS INC	30.87	—	—	—		電気設備
SNAP-ON INC	39.81	48.25	916	96,343		機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	313.88	372.26	3,010	316,421		保険
ADVANCE AUTO PARTS	52.97	62.26	951	100,010		専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	266.52	350.41	2,029	213,312		電力
SOUTHERN CO	800.67	923.98	5,553	583,743		電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,036.81	1,215.55	6,565	690,132		銀行
SOUTHWEST AIRLINES	113.52	117.91	605	63,634		旅客航空輸送業
AT&T INC	5,656.86	6,363.97	18,328	1,926,663		各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,471.08	1,721.63	15,933	1,674,949		石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	117.76	140.26	2,462	258,862		機械
STATE STREET CORP	295.9	324.04	2,381	250,363		資本市場
STARBUCKS CORP	923.12	1,049.03	11,046	1,161,185		ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	175.47	175.47	690	72,545		金属・鉱業
STRYKER CORP	258.5	304.36	7,552	793,939		ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	338.6	394.98	21,981	2,310,687		娯楽
NORTONLIFELOCK INC	489.55	489.55	1,051	110,487		ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	97.93	97.93	424	44,615		陸運・鉄道
SYNOPSIS INC	118.55	133.81	3,908	410,856		ソフトウェア
SYSCO CORP	382.29	421.71	3,215	337,973		食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	88.5	105.44	8,517	895,364		ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	34.55	40.02	1,625	170,880		ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	883.22	883.22	982	103,242		医薬品
TERADYNE INC	121.62	142.84	2,034	213,833		半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	720.56	818.5	14,703	1,545,635		半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	163.04	194.86	991	104,241		航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	309.95	354.62	18,008	1,893,071		ライフサイエンス・ツール/サービス
TIFFANY & CO	87.33	—	—	—		専門小売り
GLOBE LIFE INC	72.82	105.78	994	104,546		保険
DAVITA INC	81.59	64.97	682	71,704		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	95.73	104.62	1,673	175,885		専門小売り
TRIMBLE INC	200.73	224.42	1,660	174,502		電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	28.51	34.73	1,648	173,337		ソフトウェア
TYSON FOODS INC	227.36	249.8	1,637	172,153		食品
UGI CORP	147.97	200.72	780	82,035		ガス
MARATHON OIL CORP	584.18	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	544.82	605.64	12,909	1,357,080		陸運・鉄道

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	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	634.51	1,372.1	9,962	1,047,291	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	733.07	849.87	27,896	2,932,441	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	61.53	61.53	795	83,618	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	72.26	81.39	1,433	150,683	ヘルスケア機器・用品
VF CORP	267.5	287.12	2,282	239,977	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOMCBS INC	453.61	493.63	2,878	302,572	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	198.29	239.38	5,122	538,451	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	97.94	121.7	2,001	210,446	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	602.5	668.71	3,368	354,145	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,104.64	1,264.14	18,263	1,919,809	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	323	383.57	4,343	456,633	商業サービス・用品
WATERS CORP	54.68	52.11	1,479	155,542	ライフサイエンス・ツール/サービス
ALLERGAN PLC	252.62	—	—	—	医薬品
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	52.4	70.09	2,060	216,622	ヘルスケア機器・用品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	91.76	103.06	1,186	124,695	食品
VAIL RESORTS INC	31.09	35.9	1,031	108,447	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	225.67	258.67	1,696	178,293	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	149.64	162.57	1,309	137,620	機械
WHIRLPOOL CORP	46.14	56.56	1,130	118,870	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	139.02	153.31	2,905	305,397	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	79.7	86.39	1,018	107,023	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	90.2	100.97	1,433	150,707	資本市場
CME GROUP INC	276.73	321.8	5,933	623,679	資本市場
WILLIAMS COS INC	907.18	1,125.35	2,570	270,189	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	221.96	236.91	874	91,945	販売
ALLIANT ENERGY CORP	172.21	228.29	1,102	115,885	電力
WEC ENERGY GROUP INC	238.39	290.02	2,408	253,193	総合公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	218.2	—	—	—	資本市場
CARMAX INC	120.81	142.09	1,777	186,855	専門小売り
XILINX INC	189.97	214	3,119	327,874	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	930.1	1,081.5	7,354	773,073	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	41.28	45.61	2,178	229,053	電子装置・機器・部品
ZIONS BANCORP NA	131.42	—	—	—	銀行
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	274	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	764	1,087	498	52,447	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	157	206	1,116	117,368	コンゴロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	171	432	45,460	コンゴロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	81.78	102.39	1,616	169,973	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	41.71	—	—	—	銀行
CBRE GROUP INC	236.13	296.17	2,112	222,074	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	127.32	127.32	319	33,566	各種電気通信サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	764.8	855.82	1,673	175,969	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	32.56	36.41	1,402	147,420	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	37.37	1,442	151,602	半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CHEMICAL CORP	30	—	—	—	化学
T-MOBILE US INC	256.75	499.8	6,181	649,802	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	277.59	302.77	1,696	178,295	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	282.49	325.92	953	100,281	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	28.92	32.09	1,773	186,391	資本市場
CELANESE CORP	103.26	115.88	1,538	161,682	化学
DEXCOM INC	72.16	87.06	3,591	377,564	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	104.23	153.62	734	77,189	メディア
EXPEDIA GROUP INC	115.27	115.08	1,686	177,236	インターネット販売・通信販売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	184.75	819	86,151	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	103.12	106.14	2,314	243,321	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	340.23	843	88,625	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	442.48	487.85	5,418	569,597	資本市場

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	評価額	
			千アメリカ・ドル	千円	千円	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	千円	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	146.96	—	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
LIVE NATION	113.39	138.04	1,161	122,137	—	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	20.4	23.26	3,553	373,536	—	ホテル・レストラン・レジャー
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	45.08	—	—	—	—	旅客航空輸送業
TRANSDIGM GROUP INC	36.81	47.45	2,735	287,549	—	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	699.14	798.24	27,219	2,861,364	—	情報技術サービス
HANESBRANDS INC	276.19	—	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
WESTERN UNION CO	352.22	353.67	848	89,189	—	情報技術サービス
OWENS CORNING	77.56	99.65	854	89,824	—	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	111.13	128.66	1,386	145,796	—	情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV	88.07	—	—	—	—	商社・流通業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	70.67	—	—	—	—	航空宇宙・防衛
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	173.5	308	32,464	—	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	91.76	99.59	1,474	155,013	—	情報技術サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	295.45	—	—	—	—	銀行
DELTA AIR LINES INC	111.58	147.23	637	66,999	—	旅客航空輸送業
INSULET CORP	47.81	55.66	1,612	169,543	—	ヘルスケア機器・用品
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	60.38	—	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
DISCOVER FINANCIAL	239.78	269.75	2,528	265,753	—	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	256.41	289.3	3,754	394,646	—	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	—	45.05	1,242	130,571	—	ヘルスケア機器・用品
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	159.7	—	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WABCO HOLDING INC	40.76	—	—	—	—	機械
LULULEMON ATHLETICA INC	82.55	108.17	3,708	389,860	—	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	65.32	74.64	1,083	113,871	—	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	35	40.41	7,851	825,366	—	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	45.77	45.38	1,451	152,593	—	専門小売り
INVESCO LTD	334.43	334.43	758	79,697	—	資本市場
MSCI INC	67.14	76.17	3,311	348,119	—	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,203.48	1,392.7	11,993	1,260,802	—	タバコ
VISA INC	1,337.71	1,505.8	31,615	3,323,450	—	情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	—	484.8	1,540	161,906	—	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	145.36	169.15	2,734	287,501	—	水道
DISCOVERY INC-C	304.21	304.21	1,239	130,312	—	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	514.74	595.87	3,006	316,070	—	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	116.24	117.44	1,055	110,910	—	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,600.64	1,859.92	2,760	290,143	—	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	132.37	172.22	1,707	179,444	—	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	208.76	246.36	2,368	248,977	—	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.79	34.84	613	64,505	—	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	111.94	146.41	2,537	266,765	—	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	40.23	53.33	2,134	224,393	—	情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC	—	53.66	1,088	114,473	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	148.14	762	80,135	—	資本市場
HCA HEALTHCARE INC	206.49	236.31	4,100	431,014	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	123.2	136.44	2,585	271,791	—	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	42.73	52.57	880	92,574	—	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	68.85	78.06	2,063	216,875	—	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	124.53	149.86	2,328	244,790	—	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	213.18	243.75	4,738	498,085	—	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	98.33	116.67	963	101,291	—	情報技術サービス
TARGA RESOURCES CORP	190.38	—	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	46.81	46.81	747	78,568	—	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	86.22	104.72	936	98,401	—	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	172.68	202.43	1,336	140,486	—	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	202.52	218.25	4,334	455,636	—	複合小売り
FORTINET INC	111.5	121.46	2,000	210,325	—	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AON PLC	181.89	—	—	—	保険
HORIZON PHARMA PLC	—	189.86	1,718	180,680	医薬品
TESLA INC	105.48	667.04	54,438	5,722,571	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	—	54.02	1,765	185,598	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	—	101.63	2,098	220,621	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,006.95	1,164.31	6,240	656,022	自動車
XPO LOGISTICS INC	76.14	76.14	923	97,094	航空貨物・物流サービス
TRIPADVISOR INC	92.63	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALLY FINANCIAL INC	318.71	338.57	1,422	149,515	消費者金融
CAPRI HOLDINGS LTD	121.38	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
VOYA FINANCIAL INC	102.73	135.03	742	78,040	各種金融サービス
APTIV PLC	189.2	236.97	3,703	389,322	自動車部品
PHILLIPS 66	342.35	399.51	3,085	324,338	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	58.85	71.72	922	97,022	ソフトウェア
FACEBOOK INC	1,861.56	2,150.14	58,161	6,113,914	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	134.53	168.96	3,255	342,184	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	114.24	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SERVENOW INC	144.06	172.89	10,222	1,074,622	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	72.72	84.6	3,342	351,386	ソフトウェア
WORKDAY INC	122.24	155.26	4,368	459,205	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,144.34	1,581.52	16,517	1,736,308	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	368.25	426.6	7,111	747,597	医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	168.99	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC	238.13	—	—	—	パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	302.63	717	75,459	メディア
HD SUPPLY HOLDINGS INC	140.75	—	—	—	商社・流通業
CDW CORP	114.06	127.68	1,984	208,573	電子装置・機器・部品
SPRINT CORP	638.82	—	—	—	無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	101.99	—	—	—	旅客航空輸送業
HOWMET AEROSPACE INC	307.49	381.27	1,078	113,343	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	91.9	119	5,179	544,516	情報技術サービス
COUPA SOFTWARE INC	—	62.46	2,289	240,642	ソフトウェア
SNAP INC	571.3	822.23	5,095	535,624	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	—	36.48	3,151	331,324	ソフトウェア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	143.04	195.46	888	93,426	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	50.06	83.24	362	38,124	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	142.05	142.05	610	64,149	メディア
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	154.1	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
OKTA INC	88.16	106.51	3,107	326,686	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	127	130.42	1,139	119,823	情報技術サービス
BAKER HUGHES CO	510.05	572.74	1,300	136,668	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	106.69	131.81	1,017	106,911	食品
ALTICE USA INC-A	138.87	215.06	744	78,220	メディア
TECHNIPFMC LTD	312.57	—	—	—	エネルギー設備・サービス
BROADCOM INC	307.62	360.27	17,520	1,841,770	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	57.25	67.99	3,013	316,824	ソフトウェア
MONGODB INC	34.23	41.88	1,770	186,156	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	50.95	56.02	1,471	154,675	専門小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	295.78	358.24	1,065	112,033	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	97.33	118.32	3,762	395,559	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	575.62	690.05	4,961	521,548	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	132.14	132.14	771	81,120	電気設備
EVERGY INC	183.88	210.39	1,145	120,378	電力
ALLEGION PLC	74.69	90.22	1,066	112,156	建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	114.54	1,119	117,647	ソフトウェア
STERIS PLC	66.58	73.9	1,352	142,161	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	72.2	152.47	4,014	422,007	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価価額		
			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	
WIX.COM LTD	40	49.18	1,440	151,376	情報技術サービス
DROPBOX INC	175.73	281.7	690	72,579	ソフトウェア
KKR & CO INC	373.07	472.67	2,278	239,541	資本市場
PERRIGO CO PLC	105.53	105.53	474	49,897	医薬品
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	-	155.78	6,746	709,243	ソフトウェア
MODERNA INC	-	240.31	4,415	464,152	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	206.55	258.78	2,901	305,053	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	181.44	186.32	670	70,509	ホテル・レストラン・レジャー
CIGNA CORP	290.83	331.16	6,852	720,355	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	129.6	205.86	1,647	173,228	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	564.34	647.07	3,762	395,536	化学
AMCOR PLC	1,300	1,461.49	1,680	176,676	容器・包装
PINTEREST INC	131.83	420.97	3,537	371,896	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PELOTON INTERACTIVE INC	-	178.7	2,763	290,546	レジャー用品
XEROX HOLDINGS CORP	174.55	-	-	-	コンピュータ・周辺機器
FOX CORP-A	262.57	317.51	1,034	108,774	メディア
FOX CORP-B	130.09	130.09	409	43,008	メディア
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	-	130.78	3,166	332,829	ソフトウェア
CHEVY INC	-	65.86	781	82,171	インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	-	445.09	1,365	143,498	ライフサイエンス・ツール/サービス
DYNATRACE INC	-	159.49	853	89,746	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	-	132.18	1,136	119,425	ソフトウェア
TRADEWEB MARKETS INC	-	70.65	482	50,717	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	-	750.77	2,798	294,217	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	-	375.35	2,399	252,247	機械
UBER TECHNOLOGIES INC	133.12	838.27	5,082	534,265	陸運・鉄道
CORTEVA INC	593.22	686.39	3,045	320,144	化学
MATCH GROUP INC	-	215.66	3,656	384,327	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SLACK TECHNOLOGIES INC	-	325.12	1,420	149,317	ソフトウェア
BLACKSTONE GROUP INC	508.89	585.87	4,113	432,399	資本市場
CARLYLE GROUP INC	-	125.09	464	48,863	資本市場
10X GENOMICS INC	-	53.12	1,045	109,926	ライフサイエンス・ツール/サービス
DATADOG INC	-	130.21	1,469	154,479	ソフトウェア
GRUBHUB INC	81.58	-	-	-	インターネット販売・通信販売
INGERSOLL RAND INC	-	312.82	1,373	144,424	機械
PAYCOM SOFTWARE INC	39.23	43.3	1,788	187,975	ソフトウェア
PPD INC	-	108.28	411	43,253	ライフサイエンス・ツール/サービス
SABRE CORP	198.09	-	-	-	情報技術サービス
AON PLC	-	208.07	4,744	498,776	保険
IAC/INTERACTIVECORP	-	70.64	1,853	194,812	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZENDESK INC	-	100.21	1,575	165,595	ソフトウェア
ROYALTY PHARMA PLC	-	103.61	497	52,257	医薬品
VIATRIS INC	-	1,128.66	2,058	216,408	医薬品
DRAFTKINGS INC	-	146.71	895	94,183	ホテル・レストラン・レジャー
SNOWFLAKE INC	-	28.05	840	88,302	情報技術サービス
ARISTA NETWORKS INC	44.41	50.42	1,630	171,359	通信機器
IHS MARKIT LTD	297.96	344.11	3,220	338,541	専門サービス
FNF GROUP	213.72	245.67	973	102,343	保険
CATALENT INC	-	146.73	1,838	193,219	医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	439.86	454.91	1,689	177,651	消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	358.2	415.03	1,681	176,780	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57	34.57	562	59,154	ソフトウェア
CDK GLOBAL INC	99.69	-	-	-	ソフトウェア
WAYFAIR INC	50.91	55.43	1,623	170,707	インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	139.54	174.07	2,671	280,841	電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	-	37.41	1,879	197,570	ソフトウェア
QORVO INC	88.71	101.68	1,789	188,119	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	168.88	—	—	—	—	—	各種電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	—	29.47	432	45,436	—	—	メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	83.07	131.89	1,973	207,423	—	—	メディア
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	170.18	170.18	463	48,730	—	—	化学
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	—	42.57	1,408	148,071	—	—	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	123.28	145.4	1,246	131,064	—	—	情報技術サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	262.04	—	—	—	—	—	専門サービス
ETSY INC	—	102.37	2,394	251,659	—	—	インターネット販売・通信販売
TRANSUNION	150	167.6	1,593	167,477	—	—	専門サービス
SQUARE INC	264.87	335.06	9,138	960,666	—	—	情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	587.57	477.57	3,413	358,794	—	—	化学
CARVANA CO	—	53.47	1,582	166,402	—	—	専門小売り
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	193.21	182.96	940	98,894	—	—	飲料
TELADOC HEALTH INC	—	104.54	3,069	322,710	—	—	ヘルスケア・テクノロジー
WESTROCK CO	182.84	227.78	1,007	105,929	—	—	容器・包装
KRAFT HEINZ CO	511.63	568.79	2,012	211,601	—	—	食品
NOVOCURE LTD	—	74.08	1,404	147,685	—	—	ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP	225	259.81	1,858	195,329	—	—	機械
MATCH GROUP INC	45.99	—	—	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
WASTE CONNECTIONS INC	204.17	247.78	2,461	258,799	—	—	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	231.32	269	56,356	5,924,174	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,040.4	1,162.57	1,671	175,737	—	—	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	864.04	1,000.53	29,852	3,138,127	—	—	情報技術サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	354.71	352.77	964	101,422	—	—	各種金融サービス
SUNRUN INC	—	100	836	87,964	—	—	電気設備
DXC TECHNOLOGY CO	208.48	—	—	—	—	—	情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC-C	81.66	133.76	2,645	278,137	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALPHABET INC-CL C	242.52	267.96	56,381	5,926,847	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
BEIGENE LTD ADR	31.59	—	—	—	—	—	バイオテクノロジー
ZSCALER INC	—	61.93	1,402	147,440	—	—	ソフトウェア
CABLE ONE INC	—	3.92	806	84,754	—	—	メディア
LINDE PLC	417.98	470.49	11,888	1,249,702	—	—	化学
ATHENE HOLDING LTD	118.47	118.47	535	56,252	—	—	保険
ROKU INC	66.74	95.87	4,493	472,318	—	—	娯楽
AVALARA INC	—	71.02	1,234	129,737	—	—	ソフトウェア
CHARTER COMMUNICATIONS INC	119.86	129.32	7,933	833,931	—	—	メディア
VISTRA CORP	300	380.32	811	85,275	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	232,877.56 608銘柄	278,491.28 592銘柄	3,119,137	—	327,883,766	<68.7%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円			
AGNICO EAGLE MINES LTD	163.02	205.78	1,742	144,386	—	—	金属・鉱業
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	684.96	784.79	3,125	258,877	—	—	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP	1,409.53	1,559.61	4,385	363,305	—	—	金属・鉱業
ATCO LTD	71.93	71.93	277	22,988	—	—	総合公益事業
BANK OF MONTREAL	502.86	584.93	5,708	472,926	—	—	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	945.61	1,094.36	7,771	643,753	—	—	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	255.48	291.32	2,117	175,374	—	—	銀行
BCE INC	116.73	149.59	830	68,763	—	—	各種電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	687.51	1,159.24	6,316	523,275	—	—	資本市場
BAUSCH HEALTH COS INC	204.15	281.92	1,118	92,669	—	—	医薬品
BOMBARDIER INC 'B'	1,516.15	—	—	—	—	—	航空宇宙・防衛
SAPUTO INC	186.01	253.95	958	79,415	—	—	食品
BLACKBERRY LTD	396.52	466.71	768	63,638	—	—	ソフトウェア
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	363.21	561.93	1,263	104,645	—	—	総合公益事業
CGI INC	186.86	198.59	1,997	165,449	—	—	情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC	113.4	153.58	1,017	84,248	—	—	容器・包装
CAE INC	230	250.06	802	66,495	—	—	航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAMECO CORP	326.27	326.27	653	54,110	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	276.96	315.43	1,813	150,248	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	341.11	409.56	4,645	384,844	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	914.93	1,007.58	3,440	285,042	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	48.62	48.62	846	70,138	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	91.19	91.19	294	24,415	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	554.93	634.82	8,918	738,815	陸運・鉄道
YAMANA GOLD INC	-	843.17	513	42,537	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	159.11	159.11	568	47,081	繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	217.95	252.61	1,539	127,503	ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	150.93	150.93	573	47,486	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	997.41	1,278.09	1,195	98,994	金属・鉱業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	-	99.63	734	60,851	商業サービス・用品
FORTIS INC	323.12	452.28	2,329	192,954	電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	552.96	496.94	1,252	103,739	金属・鉱業
TELUS CORP	159.45	318.9	850	70,482	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	207.22	252.5	785	65,052	保険
IMPERIAL OIL LTD	215.42	215.42	554	45,934	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,565.99	1,830.5	8,056	667,361	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	29.53	60.69	211	17,521	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,470.54	1,716.81	4,271	353,844	保険
LOBLAW CO LTD	153.54	151.36	947	78,466	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	239.09	270.24	2,672	221,359	自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	442.41	518.08	3,212	266,090	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	20.72	23.98	1,229	101,883	保険
METRO INC	199.49	207.6	1,136	94,173	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	287.49	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
EMERA INC	191.38	224.33	1,166	96,634	電力
METHANEX CORP	52.81	-	-	-	化学
ONEX CORP	66.46	66.46	481	39,898	各種金融サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	-	187.66	794	65,851	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	237.92	465.51	1,431	118,580	保険
POWER FINANCIAL CORP	216.76	-	-	-	保険
QUEBECOR INC-B	113.31	160.42	521	43,203	メディア
ROYAL BANK OF CANADA	1,113.11	1,270.82	13,496	1,118,017	銀行
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	107.47	122.36	5,673	470,010	陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	354.31	434.84	982	81,410	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,191.41	1,308.06	2,994	248,035	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	434.8	643.1	855	70,854	金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	410.16	410.16	1,026	85,046	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	163.94	150.49	1,582	131,111	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	-	74.17	689	57,110	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	1,409.24	1,612.38	12,160	1,007,381	銀行
TC ENERGY CORP	717.04	824.24	4,664	386,396	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	56.96	72	678	56,209	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	61.84	61.84	599	49,640	食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	109.89	125.15	1,867	154,723	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	349.63	409.93	2,091	173,290	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	15.65	18.64	3,008	249,222	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	149.22	176.52	2,714	224,856	金属・鉱業
B2GOLD CORP	-	1,016.75	649	53,821	金属・鉱業
CI FINANCIAL CORP	206.95	202.85	388	32,196	資本市場
KEYERA CORP	166.68	166.68	434	35,983	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	105.83	144.97	545	45,227	石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	239.44	239.44	476	39,432	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	426.84	504.1	1,775	147,077	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	235.36	269.06	1,311	108,636	複合小売り

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
STARS GROUP INC	185.29	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CENOVUS ENERGY INC W/I	807.21	1,197.09	1,025	84,986	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	—	175.68	864	71,631	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
TMX GROUP LTD	—	50.58	650	53,917	資本市場
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	152.5	218.4	1,061	87,910	金属・鉱業
INTER PIPELINE LTD	279.46	418.63	729	60,446	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD	444.53	506.3	3,599	298,206	化学
CRONOS GROUP INC	160	—	—	—	医薬品
SSR MINING INC	—	180	378	31,313	金属・鉱業
WSP GLOBAL INC	84	101.94	1,176	97,451	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	81.04	122.78	794	65,786	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	—	164.85	604	50,063	商業サービス・用品
OVINTIV INC	192.78	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	—	108.45	695	57,632	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	149.61	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
AIR CANADA	107.22	107.22	239	19,833	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	196.85	251.76	1,888	156,481	ホテル・レストラン・レジャー
AURORA CANNABIS INC	665.62	—	—	—	医薬品
SHOPIFY INC	76.05	97.39	17,989	1,490,281	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	—	35.03	664	55,008	不動産管理・開発
CANOPY GROWTH CORP	186.34	186.34	952	78,941	医薬品
HYDRO ONE LTD	273.4	273.4	787	65,272	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,926.62 85銘柄	35,759.37 87銘柄	192,614 15,956,174	<3.3%>
(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	124.32	168.54	1,087	88,733	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	2,181.8	2,577.13	6,396	521,949	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION	2,654.07	3,180.22	7,041	574,546	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,156.62	1,535.17	3,658	298,518	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	2,969.65	3,644.09	1,184	96,641	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	390.14	—	—	—	銀行
AMP LTD	3,024.14	3,024.14	399	32,573	各種金融サービス
ASX LTD	155.73	191.62	1,349	110,110	資本市場
BHP GROUP LTD	2,281.36	2,637.49	11,794	962,460	金属・鉱業
AMPOL LTD	209.46	209.46	560	45,720	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	148.67	—	—	—	複合小売り
COMPUTERSHARE LT	380.4	380.4	539	44,046	情報技術サービス
CSL LIMITED	351.66	407.66	11,282	920,643	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	41.19	57.45	902	73,675	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,064.75	2,508.16	3,273	267,088	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD	486.01	526.93	691	56,455	飲料
COCHLEAR LTD	43.81	55.33	1,142	93,192	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,328.6	1,328.6	579	47,268	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,370.26	1,589.4	13,807	1,126,660	銀行
BORAL LIMITED	861.01	—	—	—	建設資材
RIO TINTO LIMITED	280.81	338.59	3,973	324,225	金属・鉱業
APA GROUP	941.06	1,182.05	1,120	91,439	ガス
ARISTOCRAT LEISU	453.23	517.17	1,710	139,558	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,805.73	2,251.8	1,202	98,120	保険
TPG TELECOM LTD	287.19	287.19	212	17,365	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32.75	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	339.26	398.39	1,621	132,310	建設資材
ORICA LTD	278.65	413.11	632	51,575	化学
CIMIC GROUP LTD	87.09	87.09	178	14,603	建設・土木
LEND LEASE CORP LTD	429.74	621.16	741	60,519	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	369.41	496.93	844	68,934	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	851.3	1,160.56	648	52,938	運送インフラ

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MACQUARIE GROUP LTD	247.65	298.21	4,302	351,090	資本市場
WORLEY LTD	277.72	-	-	-	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD	1,047.83	1,174.54	1,235	100,826	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,264.21	2,998.19	7,474	609,918	銀行
NEWCREST MINING LTD	620.8	732.02	1,900	155,066	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	1,054.7	1,978.95	801	65,400	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	1,364.26	-	-	-	化学
QANTAS AIRWAYS LIMITED	622.82	622.82	283	23,124	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,078.2	1,448.68	1,254	102,371	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	-	934.04	1,126	91,918	金属・鉱業
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	457.07	-	-	-	各種金融サービス
SANTOS LTD	1,328.62	1,596.18	1,086	88,699	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	346.84	401.48	1,376	112,336	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	44.66	84.06	243	19,830	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	1,485.35	2,056.49	913	74,507	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	860.51	1,015.75	5,586	455,868	複合小売り
ALUMINA LIMITED	1,846.13	-	-	-	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM LTD	759.44	861.96	2,153	175,699	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	956.47	1,117.03	4,590	374,625	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	99.95	99.95	484	39,515	資本市場
SEEK LTD	258.99	358.36	1,119	91,381	インターネット・メディアおよびサービス
AUSNET SERVICES	1,650.66	1,650.66	282	23,032	電力
AGL ENERGY LTD	496.44	490.76	542	44,250	総合公益事業
BRAMBLES LTD	1,266.93	1,271.66	1,323	108,021	商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD	328.61	328.61	324	26,519	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD	-	1,409.64	651	53,142	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD	1,501.5	1,501.5	578	47,171	陸連・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	576.67	576.67	585	47,762	飲料
XERO LTD	-	104.98	1,367	111,585	ソフトウェア
AFTERPAY LTD	-	183.22	2,780	226,862	情報技術サービス
MEDIBANK PVT LTD	2,069.1	2,831.54	812	66,312	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	3,575.25	4,123.45	1,067	87,146	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	816.08	1,210.32	2,196	179,253	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	80	136.04	446	36,466	ソフトウェア
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	57,763.33 62銘柄	65,373.59 58銘柄	127,470 -	10,401,584 <2.2%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH	191	329	3,964	53,757	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	1,640	3,476	47,145	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	1,038.6	1,038.6	1,842	24,983	銀行
CLP HOLDINGS LTD	1,210	1,345	9,710	131,679	電力
PCCW LTD	3,310	3,310	1,515	20,556	各種電気通信サービス
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	495	495	2,096	28,426	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	944.4	1,090.4	58,336	791,041	資本市場
MTR CORP	1,260	1,260	5,657	76,714	陸連・鉄道
HANG SENG BANK LTD	577	657	9,605	130,248	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,154.5	1,154.5	3,607	48,921	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,015	1,345	5,561	75,414	電力
HONG KONG & CHINA GAS	7,767.55	9,132.92	10,027	135,978	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,570	1,970	13,583	184,187	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES LTD	735	-	-	-	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,750	3,175	7,508	101,820	銀行
NWS HOLDINGS LTD	1,350	-	-	-	コンプロマリット
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	505	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,842.66	1,630.66	5,788	78,496	不動産管理・開発
SINO LAND CO	2,554	2,554	2,911	39,480	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,250	1,085	11,804	160,073	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	
SWIRE PACIFIC LTD A	305	495	2,440	33,091	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,135	1,285	15,921	215,890	機械
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	700	—	—	—	食品
WHEELLOCK & CO LTD	640	—	—	—	不動産管理・開発
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	—	1,660	3,701	50,196	建設関連製品
SJM HOLDINGS LTD	1,560	1,560	1,539	20,878	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,244	1,244	1,749	23,717	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD	9,356.27	10,872.27	112,527	1,525,879	保険
HKT TRUST / HKT LTD	2,890	2,890	3,040	41,226	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	1,992	1,988	6,739	91,385	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,349	31,862	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	957.5	1,497.5	6,581	89,245	不動産管理・開発
ESR CAYMAN LTD	—	1,474	4,171	56,564	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,745	23,671	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	1,019	1,506	3,945	53,503	飲料
WH GROUP LTD	7,425	8,970	5,767	78,210	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,088.32	2,553.32	13,660	185,233	コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,983.32	2,248.32	8,982	121,796	不動産管理・開発
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	72,797.12 36銘柄	76,797.49 33銘柄	351,864 —	4,771,281 <1.0%>
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE TECH ENG	1,250	1,250	465	36,902	航空宇宙・防衛
SEMBCORP INDUSTRIES	814	—	—	—	総合公益事業
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,237	—	—	—	メディア
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,419	1,557	4,059	322,130	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	364	364	261	20,740	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	59.44	—	—	—	販売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	478	—	—	—	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	689	685	54,405	資本市場
CAPITALAND LTD	2,045.15	3,088.15	960	76,218	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	4,164	4,268	367	29,128	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,011	1,349	690	54,812	コングロマリット
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,779	—	—	—	陸運・鉄道
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,515.53	2,716.53	2,865	227,440	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,071.22	6,768.22	1,610	127,835	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	475	1,608.5	702	55,783	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	952	1,024	2,451	194,547	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	405	301	23,944	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	210	210	418	33,214	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,423	1,814	972	77,162	食品
YANGZHIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	1,888	—	—	—	機械
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	29,249.34 20銘柄	27,111.4 14銘柄	16,812 —	1,334,268 <0.3%>
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	852.45	1,102.26	760	57,726	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD	298.94	298.94	437	33,240	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD	550.91	550.91	587	44,573	食品
FISHER & PAYKEL	431.84	490.44	1,581	120,048	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	641.04	—	—	—	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,596.23	1,596.23	749	56,881	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	617.34	617.34	419	31,862	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	756.56	1,241.62	721	54,752	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,745.31 8銘柄	5,897.74 7銘柄	5,258 —	399,085 <0.1%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	317.98	317.98	487	71,096	金属・鉱業
ASHTREAD GROUP	366.89	389.16	1,524	222,381	商社・流通業

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SEVERN TRENT PLC	182.17	219.33	514	75,110	水道
BHP GROUP PLC	1,612.84	1,844.54	3,905	569,662	金属・鉱業
BARCLAYS PLC	13,428.31	16,088.89	2,347	342,363	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	822.83	822.83	559	81,606	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	6,307.77	7,955.07	986	143,870	各種電気通信サービス
BUNZL PLC	278.38	288.34	675	98,533	商社・流通業
EASYJET PLC	136.28	-	-	-	旅客航空輸送業
AVIVA PLC	3,146.91	3,634.64	1,267	184,797	保険
CRODA INTERNATIONAL	103.91	125.68	829	120,980	化学
DIAGEO PLC	1,828.12	2,096.47	6,308	920,062	飲料
SCHRODERS PLC	109.32	113.54	400	58,439	資本市場
DCC PLC	78.98	78.98	464	67,756	コンゴロマリット
NATIONAL GRID PLC	2,646.42	3,068.81	2,628	383,312	総合公益事業
KINGFISHER PLC	1,656.8	1,971.59	534	77,899	専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	2,486.72	2,737.49	1,313	191,646	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,772.72	2,065.85	5,607	817,890	タバコ
HALMA PLC	279.01	319.01	816	119,064	電子装置・機器・部品
NEXT PLC	100.18	114.67	880	128,411	複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	716.56	877.08	1,309	191,051	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	150.17	191.07	573	83,686	化学
ANGLO AMERICAN PLC	789.81	1,075.54	2,864	417,738	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,195.6	1,564.43	2,205	321,608	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	15,612.12	18,255.85	7,335	1,069,838	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,527.58	5,146.92	1,337	195,101	保険
CENTRICA PLC	4,713.4	-	-	-	総合公益事業
UNILEVER PLC	855.86	2,351.36	9,313	1,358,408	パーソナル用品
MEGGITT PLC	621.81	-	-	-	航空宇宙・防衛
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	1,686.76	2,302.12	393	57,415	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	544.87	677.14	639	93,230	水道
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	808.64	954.87	646	94,284	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	255.47	311.66	694	101,229	食品
PEARSON PLC	650.09	650.09	496	72,382	メディア
PERSIMMON PLC	260.85	281.26	765	111,661	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,049.4	2,268.96	3,013	439,472	保険
RIO TINTO PLC	874.36	1,010.08	5,993	874,197	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	20,437.18	24,232.37	3,244	473,241	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	544.64	645.58	4,071	593,759	家庭用品
RELX PLC	1,475.23	1,741.63	3,250	474,122	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,406.17	1,697.66	891	130,041	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,392.68	6,709.69	622	90,814	航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	3,974.34	4,230.54	724	105,696	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	376.85	497.89	609	88,956	資本市場
SSE PLC	746.84	886.46	1,260	183,850	電力
BP PLC	15,740.09	18,382.94	4,812	701,925	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	871.11	1,084.48	640	93,352	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	317.2	403.17	603	88,027	コンゴロマリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	55.18	65.74	773	112,804	機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,183.29	2,400.93	1,111	162,096	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	53,939.91	64,953.56	2,409	351,465	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	2,522.87	3,467.94	558	81,484	家庭用耐久財
TESCO PLC	7,573.16	8,605.34	2,070	301,974	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	766.43	886.51	1,016	148,304	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	680.27	769.28	1,209	176,433	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,862.19	4,499.85	5,750	838,755	医薬品
WEIR GROUP	191.61	-	-	-	機械
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	246.6	275.89	2,703	394,337	資本市場
WPP PLC	951.48	1,115.98	920	134,314	メディア

銘柄	期首(前期末)		当期末			業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
ASTRAZENECA PLC	1,015.56	1,175.51	8,782	1,280,889	医薬品	
WHITBREAD PLC	98.14	185.94	596	86,971	ホテル・レストラン・レジャー	
CARNIVAL PLC	133.5	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,767.3	—	—	—	複合小売り	
INTERTEK GROUP PLC	120.83	138.42	808	117,860	専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	316.86	389.5	696	101,573	繊維・アパレル・贅沢品	
INTERCONTINENTAL HOTELS	124.6	166.52	815	118,884	ホテル・レストラン・レジャー	
ITV PLC	2,543.08	—	—	—	メディア	
SAINSBURY (J) PLC	1,372.15	1,902.05	435	63,555	食品・生活必需品小売り	
G4S PLC	1,222.5	—	—	—	商業サービス・用品	
ADMIRAL GROUP PLC	158.93	158.93	476	69,470	保険	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	82.33	115.81	498	72,681	家庭用耐久財	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,336.87	3,777.76	5,130	748,349	石油・ガス・消耗燃料	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,863.67	3,238.58	4,212	614,334	石油・ガス・消耗燃料	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	182	429	62,645	医薬品	
TUI AG-DI	298.24	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
AVEVA GROUP PLC	57.04	104.08	397	57,911	ソフトウェア	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2,011.44	2,063.13	659	96,230	資本市場	
EXPERIAN PLC	698.42	803.76	2,120	309,248	専門サービス	
MONDI PLC	397.67	471.7	867	126,587	紙製品・林産品	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	209.27	280.11	461	67,245	資本市場	
FRESNILLO PLC NPR	—	173.85	177	25,875	金属・鉱業	
OCADO GROUP PLC	310.11	427.89	1,121	163,508	インターネット販売・通信販売	
INFORMA PLC	1,024.75	1,493.58	758	110,662	メディア	
GLENCORE PLC	8,664.21	8,804.08	2,366	345,159	金属・鉱業	
ENTAIN PLC	496.18	496.18	671	97,913	ホテル・レストラン・レジャー	
EVRAZ PLC	487.65	487.65	250	36,500	金属・鉱業	
NMC HEALTH PLC	81.49	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,126.94	1,126.94	345	50,344	保険	
COCA-COLA HBC AG	152.08	152.08	361	52,679	飲料	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	517.21	366	53,483	保険	
FERGUSON PLC	171.28	205.31	1,831	267,104	商社・流通業	
M&G PLC	2,049.4	2,049.4	384	56,104	各種金融サービス	
JD SPORTS FASHION PLC	320.86	320.86	258	37,634	専門小売り	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	261	—	—	—	ソフトウェア	
AUTO TRADER GROUP PLC	763.48	980.62	580	84,727	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,647.35	4,246.75	725	105,791	コンピュータソフト	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	232,616.39 93銘柄	266,360.93 85銘柄	146,478 —	21,363,882 <4.5%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シケル	千円		
BANK HAPOALIM BM	797.54	1,023.59	2,359	76,231	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,063.99	1,307.03	2,594	83,826	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	17.6	17.6	820	26,499	航空宇宙・防衛	
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,021.34	1,021.34	1,278	41,315	銀行	
ICL GROUP LTD	494.11	494.11	944	30,508	化学	
NICE LTD	49.02	55.35	4,964	160,415	ソフトウェア	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	104.44	104.44	803	25,946	銀行	
AZRIELI GROUP	22.91	44.14	898	29,022	不動産管理・開発	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,570.95 8銘柄	4,067.6 8銘柄	14,663 —	473,765 <0.1%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
CREDIT SUISSE GROUP AG	1,914.83	2,257.7	2,782	327,931	資本市場	
LOGITECH INTL-REG	—	144.29	1,512	178,207	コンピュータ・周辺機器	
NESTLE SA-REGISTERED	2,303.64	2,570.32	25,888	3,050,931	食品	
CIE FINANCIER RICHEMONT	409.15	474.14	4,162	490,491	繊維・アパレル・贅沢品	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	544.32	628.85	19,695	2,321,124	医薬品	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	28.96	34.67	870	102,555	機械	

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	株数			
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円			
SIKA INHABER	102.09	123.63	3,147	370,946			化学
SGS SA-REG	4.24	5.4	1,473	173,670			専門サービス
NOVARTIS AG-REG SHS	1,662.22	1,981.27	16,246	1,914,639			医薬品
BALOISE HOLDING AG -R	32.52	42.59	660	77,798			保険
BARRY CALLEBAUT AG	2.65	2.65	535	63,147			食品
CLARIANT AG-REG	122.82	199.79	371	43,794			化学
SWISSCOM AG-REG	19.6	24.89	1,156	136,339			各種電気通信サービス
ABB LTD	1,408.52	1,657.76	4,343	511,861			電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	129.44	129.44	738	87,011			専門サービス
GEBERIT AG	29.01	31.81	1,773	208,958			建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG	57.93	68.69	4,190	493,802			ライフサイエンス・ツール/サービス
LINDT & SPRUENGLI PART	0.79	0.95	779	91,861			食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.09	0.09	774	91,215			食品
GIVAUDAN-REG	7.42	8.12	2,967	349,762			化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	115.58	135.85	5,063	596,689			保険
LAFARGEHOLCIM LTD	379.97	478.95	2,392	281,939			建設資材
TEMENOS GROUP	47.3	57.23	600	70,784			ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG	45.84	46.98	1,122	132,269			ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG	40.18	45.18	942	111,015			海運業
STRAUMANN HOLDING AG	7.94	9.19	1,015	119,730			ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	21.34	24.41	646	76,233			繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	45.92	235	27,734			繊維・アパレル・贅沢品
SCHINDLER NAMEN	16.63	16.63	416	49,035			機械
SWISS LIFE HOLDING AG	24.58	27.61	1,204	141,964			保険
BANQUE CANTONALE VAUD	-	25	248	29,285			銀行
VIFOR PHARMA AG	34.65	46.45	548	64,594			医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING	6.33	8.27	740	87,228			化学
SWISS PRIME SITE AG	59.9	83.37	731	86,166			不動産管理・開発
PARGESA HOLDING PORTEUR	30	-	-	-			各種金融サービス
DUFREY GROUP	31.38	-	-	-			専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	15.05	16.58	1,852	218,354			資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD	178.49	201.18	1,098	129,451			資本市場
SWISS RE LTD	225.97	248.71	2,086	245,914			保険
ALCON INC	320.32	429.61	2,856	336,686			ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG	3,016.86	3,314.28	4,540	535,105			資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	122,411	14,426,235			<3.0%>
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円			
CARLSBERG AS-B	84.41	99.74	9,585	164,191			飲料
A P MOLLER A/S	4.91	5.68	7,196	123,277			海運業
AP MOLLER MAERSK A	2.73	2.55	2,996	51,325			海運業
DANSKE BANK A/S	510.34	593.05	6,505	111,443			銀行
GENMAB A/S	50.14	61.9	15,524	265,935			バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS	155.33	177.4	7,195	123,256			化学
ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	-	8.13	1,843	31,585			建設関連製品
NOVO NORDISK A/S-B	1,369.25	1,540.44	70,860	1,213,835			医薬品
GN STORE NORD A/S	-	128.95	7,110	121,799			ヘルスケア機器・用品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	139.63	181.27	23,583	403,980			電気設備
COLOPLAST-B	97.29	107.34	11,056	189,389			ヘルスケア機器・用品
DSV PANALPINA A S	176.26	190.49	21,353	365,792			航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S	72.44	107.39	2,849	48,804			ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S	48.4	48.4	1,235	21,158			医薬品
TRYG A/S	111.07	111.07	2,228	38,166			保険
PANDORA A/S	82.51	82.51	5,052	86,556			繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	75.39	93.36	5,355	91,733			化学
AMBU A/S B	-	141.56	4,675	80,095			ヘルスケア機器・用品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円	
ISS A/S	111.07	—	—	—	商業サービス・用品
ORSTED A/S	150.9	164.71	17,162	293,998	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	223,369	3,826,326	
	17銘柄	19銘柄	—	<0.8%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千円	千円	
MOWI ASA	351.83	435.37	8,374	104,176	食品
DNB ASA	713.52	807.09	13,280	165,211	銀行
NORSK HYDRO ASA	931.39	1,290.36	5,293	65,845	金属・鉱業
TELENOR ASA	547.66	630.38	8,945	111,276	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	—	75.37	2,713	33,753	メディア
ORKLA ASA	649.38	652.83	5,291	65,830	食品
EQUINOR ASA	810.22	831.49	12,555	156,190	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	121.71	151.93	6,285	78,189	化学
AKER BP ASA	85.52	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	166.83	166.83	3,403	42,337	保険
ADEVINTA ASA	—	222.65	2,996	37,281	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SCHIBSTED ASA	74.45	74.45	2,251	28,007	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	71,390	888,100	
	10銘柄	11銘柄	—	<0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	522.84	564.89	27,803	351,997	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	287.68	360.51	15,314	193,881	機械
ERICSSON LM-B SHS	2,361.6	2,649.68	30,100	381,070	通信機器
LUNDBERGS B	73.82	73.82	3,239	41,008	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	288.12	348.49	7,757	98,208	機械
SANDVIK AB	877.84	1,034	22,344	282,884	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,308.27	1,449.9	13,692	173,351	銀行
SKANSKA AB-B SHS	244	316.53	6,580	83,311	建設・土木
SWEDBANK AB	719.58	798.25	11,940	151,163	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	—	529.45	8,023	101,581	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,121.06	1,392.3	11,831	149,790	銀行
VOLVO AB-B SHS	1,192.27	1,305.9	27,450	347,517	機械
SWEDISH MATCH AB	129.41	138.45	8,525	107,936	タバコ
TELE2 AB-B SHS	346.18	470.55	5,187	65,677	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	—	119.55	3,498	44,285	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	114.03	114.03	3,183	40,305	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	191.91	4,055	51,337	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS	240.98	240.98	3,012	38,135	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	351.8	395.67	25,750	325,997	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	602.83	688.14	12,376	156,682	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	810.88	870.21	19,614	248,319	建設関連製品
TELIA CO AB	2,318.55	2,104.77	7,436	94,141	各種電気通信サービス
LUNDIN ENERGY AB	121.46	147.39	3,746	47,432	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB	218.55	283.76	8,816	111,615	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	233.43	283.92	7,072	89,537	機械
KINNEVIK AB-B	183.1	217.22	9,554	120,958	各種金融サービス
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	78.44	—	—	—	無線通信サービス
FASTIGHETS AB BALDER	—	89.67	3,753	47,520	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB	59.2	90.09	3,714	47,024	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	336.92	336.92	3,463	43,848	家庭用耐久財
NIBE INDUSTRIER AB	—	288.34	8,367	105,934	建設関連製品
HEXAGON AB	211.45	265.34	19,481	246,632	電子装置・機器・部品
EPIROC AB-A	489.55	607.5	10,409	131,784	機械
EPIROC AB-B	308.99	308.99	4,795	60,711	機械
ESSITY AB-B	466.4	521.43	13,739	173,944	家庭用品
EQT AB	—	209.34	5,442	68,906	資本市場
EVOLUTION GAMING GROUP AB	—	136.41	14,152	179,171	ホテル・レストラン・レジャー

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
NORDEA BANK ABP	2,592.68	2,957.52	21,193	268,310	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	-	149.45	3,036	38,446	コンプロマリット
小計	株数・金 銘柄 数<比 率>	19,403.82 32銘柄	23,051.27 38銘柄	419,459 -	5,310,363 <1.1%>
(ユーロ…イギリス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UNILEVER PLC	1,131.34	-	-	-	パーソナル用品
小計	株数・金 銘柄 数<比 率>	1,131.34 1銘柄	- -銘柄	- -	- <-%>
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	619.9	716.53	2,635	335,855	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	62.46	141.28	2,263	288,435	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	122.58	147.3	1,596	203,487	食品
KINGSPAN GROUP PLC	117.68	134.52	716	91,287	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	173.97	208.7	874	111,387	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	822.56	-	-	-	銀行
AIB GROUP PLC	413.52	-	-	-	銀行
小計	株数・金 銘柄 数<比 率>	2,332.67 7銘柄	1,348.33 5銘柄	8,085 -	1,030,453 <0.2%>
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	451.22	531.76	4,903	624,884	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV	137.16	152.1	2,210	281,740	化学
ING GROEP NV-CVA	3,045.08	3,448.92	2,879	366,963	銀行
RANDSTAD NV	90.74	126.01	681	86,845	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	890.26	992.8	2,334	297,454	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	195.82	226.83	1,951	248,717	飲料
AKZO NOBEL	174.91	179.59	1,530	195,042	化学
ASML HOLDING NV	330.53	380.98	18,848	2,402,114	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	1,503.49	1,503.49	561	71,602	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	719.25	829.19	3,976	506,802	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	206.87	257.15	1,811	230,905	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	556.11	541.76	1,912	243,717	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	179.74	207.63	936	119,309	ライフサイエンス・ツール/サービス
VOPAK (KON.)	53.64	53.64	234	29,879	石油・ガス・消耗燃料
KONINKLIJKE KPN NV	2,910.29	3,478.24	1,018	129,788	各種電気通信サービス
HEINEKEN HOLDING NV-A	97.91	100.04	743	94,789	飲料
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	397.52	553.04	540	68,928	飲料
FERRARI NV	89.34	115.42	1,947	248,216	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	779.51	893.78	1,083	138,050	機械
PROSUS NV	368.71	442.19	4,656	593,393	インターネット販売・通信販売
JDE PEET'S BV	-	73.08	235	30,044	食品
NN GROUP NV	217.2	252.74	900	114,793	保険
ARGENX SE	-	38.79	1,201	153,146	バイオテクノロジー
STELLANTIS NV	790.84	1,769.58	2,347	299,168	自動車
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	90	108.36	982	125,223	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV	342.51	342.51	300	38,280	銀行
EXOR NV	79.71	99.66	672	85,729	各種金融サービス
ALTICE EUROPE NV	567.63	-	-	-	各種電気通信サービス
ADYEN NV	8.18	15.89	3,479	443,479	情報技術サービス
小計	株数・金 銘柄 数<比 率>	15,274.17 27銘柄	17,715.17 28銘柄	64,885 -	8,269,017 <1.7%>
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	141.15	176.54	839	107,046	化学
KBC GROUPE	185.77	210.38	1,245	158,773	銀行
SOFINA	-	13.82	406	51,867	各種金融サービス
SOLVAY SA	55.63	71.83	687	87,622	化学
AGEAS	143.65	143.65	652	83,167	保険
UCB SA	90.95	105.71	927	118,173	医薬品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
COLRUYT NV	46.73	46.73	236	30,169	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	66.89	99.04	841	107,208	各種金融サービス
PROXIMUS	142.83	137.39	233	29,730	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV	34.26	34.26	242	30,859	バイオテクノロジー
ELIA GROUP	-	28.62	281	35,816	電力
TELENET GROUP HOLDING NV	36.34	-	-	-	メディア
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	587.31	663.27	3,488	444,612	飲料
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,531.51 11銘柄	1,731.24 12銘柄	10,083 -	1,285,048 <0.3%>
(ユーロ…ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELOR MITTAL (NL)	467.14	615.94	1,150	146,676	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	8.99	113.3	922	117,605	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	369.59	369.59	262	33,488	エネルギー設備・サービス
SES FDR	288.47	288.47	199	25,476	メディア
AROUNDTOWN SA	717.83	830.54	483	61,558	不動産管理・開発
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,852.02 5銘柄	2,217.84 5銘柄	3,019 -	384,805 <0.1%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	363.17	412	5,557	708,296	化学
AXA SA	1,481.6	1,694.93	3,240	412,909	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	444.49	507.07	1,140	145,332	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	1.63	2.95	270	34,512	航空宇宙・防衛
DANONE	488.33	543.15	2,928	373,229	食品
SAFRAN SA	258.98	280.36	3,053	389,089	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	122.77	173.8	519	66,247	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	175.72	214.17	718	91,570	建設・土木
BNP PARIBAS	864.34	1,019.91	4,731	602,949	銀行
THALES SA	85.49	105.13	818	104,368	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	125.15	149.12	2,017	257,122	情報技術サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	42.64	-	-	-	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	43.34	-	-	-	電子装置・機器・部品
NATIXIS	701.66	701.66	280	35,767	資本市場
EIFFAGE	64.61	84.65	690	87,942	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	151.98	185.95	873	111,378	メディア
FAURECIA	61.17	61.17	268	34,269	自動車部品
L'OREAL	195.54	224.47	7,144	910,543	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	214.86	248.73	13,165	1,677,783	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	713.47	713.47	258	32,951	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	124.22	148.02	1,727	220,139	自動車部品
PERNOD-RICARD	167.19	190.38	3,032	386,494	飲料
PEUGEOT SA	439.05	-	-	-	自動車
RENAULT SA	149.17	190.19	748	95,351	自動車
REMY COINTREAU	18.6	18.6	296	37,760	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	394.36	445.6	1,879	239,585	建設関連製品
SEB SA	15.51	22.18	371	47,374	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	611.81	695.95	1,236	157,623	銀行
VINCI S.A.	392.37	472.57	4,048	515,881	建設・土木
SODEXO	70.75	91.78	684	87,208	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	436.56	483.76	6,240	795,289	電気設備
VIVENDI SA	679.89	709.95	1,852	236,142	娯楽
TOTAL SE	1,860.2	2,258.11	7,897	1,006,487	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	196.53	196.53	635	81,048	自動車部品
ORANGE	1,512.46	1,840.93	1,794	228,649	各種電気通信サービス
HERMES INTL	24.83	28.8	2,662	339,279	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	99.53	121.83	2,317	295,382	ソフトウェア
KERING	58.3	68.27	3,740	476,691	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	139.87	187	23,921	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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CARREFOUR SA	510.94	499.26	721	91,907	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	73.04	89.72	592	75,463	情報技術サービス
SANOFI	871.69	1,014.54	7,929	1,010,553	医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	59.35	76.86	580	73,932	娯楽
TELEPERFORMANCE	43.83	53.12	1,567	199,703	専門サービス
EURAZEO	27.48	52.29	324	41,315	各種金融サービス
JC DECAUX SA	60.58	—	—	—	メディア
ESSILORLUXOTTICA	217.61	249.84	3,420	435,884	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	862.05	986.85	1,073	136,768	銀行
ORPEA	—	49.32	574	73,192	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WENDEL	22.2	22.2	216	27,570	各種金融サービス
ILIAD SA	21.02	10.46	160	20,401	各種電気通信サービス
BIOMERIEUX	32.48	32.48	407	51,988	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	18.84	23.87	969	123,504	ライフサイエンス・ツール/サービス
ENGIE	1,392.72	1,660.61	2,167	276,280	総合公益事業
ALSTOM	157.12	217.79	915	116,682	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	125.42	—	—	—	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	538	547.78	581	74,102	電力
IPSEN SA	36.46	36.46	271	34,569	医薬品
ARKEMA SA	50.33	63.93	571	72,820	化学
LEGRAND SA	206.73	238.06	1,798	229,176	電気設備
ADP	23.13	23.13	231	29,462	運送インフラ
SCOR SE	101.16	156.67	436	55,625	保険
BUREAU VERITAS SA	231.79	298.1	668	85,135	専門サービス
GETLINK	376.46	376.46	499	63,616	運送インフラ
SUEZ SA	266.2	266.2	454	57,875	総合公益事業
EDENRED	191.88	214.88	1,023	130,376	情報技術サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	80.92	312	39,764	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDLINE SA	77.58	223.86	1,762	224,578	情報技術サービス
AMUNDI SA	41.19	59.24	392	50,015	資本市場
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	20,629.42 67銘柄	23,068.91 64銘柄	119,655 —	15,248,842 <3.2%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	139	172.02	5,021	639,909	繊維・アパレル・贅沢品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	252.51	312.17	2,192	279,475	自動車
COMMERZBANK AG	831.18	831.18	425	54,233	銀行
FRESENIUS SE & CO KGAA	314.63	390.3	1,410	179,809	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET	98.82	98.82	374	47,717	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	55.46	55.46	267	34,137	化学
HANNOVER RUECK SE	48.68	48.68	691	88,093	保険
GEA GROUP AG	118.38	118.38	362	46,239	機械
CONTINENTAL AG	83.12	103.36	1,267	161,557	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	760.32	869.75	3,742	476,948	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	126.49	126.49	762	97,170	自動車
MERCK KGAA	98.5	118.74	1,697	216,390	医薬品
RWE AG	464.89	592.73	2,013	256,600	総合公益事業
SAP SE	760.71	934.54	10,145	1,292,925	ソフトウェア
E.ON SE	1,813.17	2,098.42	1,835	233,941	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	75.85	86.02	665	84,848	家庭用品
SIEMENS AG-REG	591.13	686.52	9,200	1,172,542	コンプロマリット
PUMA AG	73.51	92.39	789	100,622	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG	720.11	887.08	4,785	609,901	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	137.59	162.41	1,419	180,896	家庭用品
DAIMLER AG	694.81	780.56	5,047	643,202	自動車
BASF SE	705.54	832.15	5,560	708,620	化学
BEIERSDORF AG	83.71	83.71	770	98,209	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	17.07	17.07	130	16,587	建設・土木

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等			
	株数	株数	評価額					
			外貨建金額	邦貨換算金額				
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円				
HEIDELBERGCEMENT AG	120.31	145.71	932	118,880	建設資材			
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	162.14	201.91	1,239	157,939	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス			
ALLIANZ SE	329.44	375.04	7,333	934,585	保険			
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	160.96	279.9	298	38,042	旅客航空輸送業			
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	110.91	123.01	2,873	366,200	保険			
VOLKSWAGEN AG	26.45	27.58	499	63,617	自動車			
VOLKSWAGEN AG PFD	144.01	163.61	2,637	336,109	自動車			
NEMETSCHKE SE	-	50.95	295	37,659	ソフトウェア			
THYSSENKRUPP AG	271.1	-	-	-	金属・鉱業			
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,493.84	1,659.49	1,490	189,913	資本市場			
BMW VORZUG	41.16	41.16	225	28,771	自動車			
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,635.92	2,993.58	4,443	566,339	各種電気通信サービス			
SARTORIUS AG	27.12	30.44	1,464	186,593	ヘルスケア機器・用品			
INFINEON TECHNOLOGIES AG	990.68	1,188.79	4,227	538,731	半導体・半導体製造装置			
RATIONAL AG	-	4.79	397	50,696	機械			
CARL ZEISS MEDITEC AG	37.71	37.71	504	64,301	ヘルスケア機器・用品			
BECHTLE AG	-	25.11	425	54,272	情報技術サービス			
DEUTSCHE BOERSE AG	145.25	167.52	2,288	291,623	資本市場			
FRAPORT AG	31.49	-	-	-	運送インフラ			
WIRECARD AG	89.63	-	-	-	情報技術サービス			
LANXESS AG	68.56	68.56	416	53,105	化学			
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	41.68	48.73	947	120,756	航空宇宙・防衛			
DEUTSCHE WOHNEN	269.47	290.97	1,200	153,034	不動産管理・開発			
SYMRISE AG	99.88	113.08	1,179	150,377	化学			
BRENNTAG SE	123.53	140.44	921	117,408	商社・流通業			
EVONIK INDUSTRIES AG	171.16	171.16	474	60,464	化学			
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	615.41	983.85	225	28,712	各種電気通信サービス			
LEG IMMOBILIEN AG	-	59.34	700	89,265	不動産管理・開発			
KION GROUP AG	45.67	59.03	438	55,879	機械			
VONOVIA SE	386.17	454.51	2,508	319,733	不動産管理・開発			
KNORR-BREMSE AG	44.92	68.6	736	93,875	機械			
SIEMENS HEALTHINEERS AG	114.68	238.05	1,162	148,136	ヘルスケア機器・用品			
METRO AG	107.74	-	-	-	食品・生活必需品小売り			
TEAMVIEWER AG	-	136.68	624	79,567	ソフトウェア			
SIEMENS ENERGY AG	-	358.31	1,121	142,970	電気設備			
ZALANDO SE	99.64	147.56	1,473	187,787	インターネット販売・通信販売			
SCOUT24 AG	-	96.7	645	82,320	インタラクティブ・メディアおよびサービス			
COVESTRO AG	127.08	163.37	957	121,962	化学			
HELLOFRESH SE	-	128.38	984	125,486	インターネット販売・通信販売			
UNIPER SE	142.52	182.03	550	70,150	独立系発電事業者・エネルギー販売業者			
DELIVERY HERO SE	80.81	109.74	1,445	184,185	インターネット販売・通信販売			
小計	株数 銘柄数	金額 銘柄数	比率	18,422.22	22,034.34	110,876	14,130,044	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円				
JERONIMO MARTINS	195.17	195.17	246	31,463	食品・生活必需品小売り			
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,016.06	2,386.62	1,179	150,280	電力			
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	400.88	400.88	361	46,050	石油・ガス・消耗燃料			
小計	株数 銘柄数	金額 銘柄数	比率	2,612.11	2,982.67	1,787	227,795	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円				
IBERDROLA SA	4,772.67	5,508.72	5,952	758,544	電力			
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	158.85	212.06	714	91,046	電気設備			
REPSOL SA	1,149.98	1,359.9	1,206	153,791	石油・ガス・消耗燃料			
TELEFONICA S.A	3,677.55	4,558.87	1,715	218,623	各種電気通信サービス			
ENDESA S.A.	234.17	277.36	608	77,515	電力			
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	201.37	213.95	547	69,800	建設・土木			
BANKINTER S.A.	579.6	-	-	-	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		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,235.94	5,782.51	2,544	324,246	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	236.12	236.12	495	63,161	ガス	
BANCO SANTANDER SA	12,640.63	15,869.57	4,435	565,265	銀行	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	345.96	345.96	517	65,979	電力	
BANCO SABADELL	4,136.31	—	—	—	銀行	
INDITEX	838.83	1,004.23	2,581	329,034	専門小売り	
MAPFRE SA	844.74	—	—	—	保険	
ENAGAS	180.95	234.77	416	53,136	ガス	
GRIFOLS SA	235.18	235.18	534	68,154	バイオテクノロジー	
FERROVIAL SA	386.66	405.93	834	106,308	建設・土木	
CAIXABANK	2,972.24	3,073.31	692	88,241	銀行	
AMADEUS IT GROUP SA	338.91	411.18	2,226	283,802	情報技術サービス	
BANKIA SA	1,006.75	—	—	—	銀行	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	—	213.57	8	1,129	建設・土木	
AENA SME SA	53.38	62.56	822	104,840	運送インフラ	
CELLNEX TELECOM SAU	197.8	272.34	1,248	159,062	各種電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	40,424.59 22銘柄	40,278.09 19銘柄	28,104 <0.7%>	3,581,685	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ASSICURAZIONI GENERALI	870.3	975.69	1,528	194,781	保険	
INTESA SANPAOLO	11,576.31	15,123.69	3,169	403,975	銀行	
UNICREDIT SPA	1,557.18	1,939.1	1,628	207,481	銀行	
ENI SPA	1,978.38	2,193.31	1,947	248,181	石油・ガス・消耗燃料	
MEDIOBANCA SPA	416.39	574.42	510	65,049	銀行	
ENEL SPA	6,323.33	7,299.44	6,181	787,727	電力	
LEONARDO SPA	283.16	—	—	—	航空宇宙・防衛	
SNAM SPA	1,691.63	1,712.94	766	97,622	ガス	
TELECOM ITALIA SPA	7,626.75	7,626.75	289	36,934	各種電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC	4,975.96	4,975.96	213	27,204	各種電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	373.65	452.99	713	90,923	運送インフラ	
TERNA SPA	1,136.54	1,136.54	701	89,366	電力	
RECORDATI SPA	68.59	103.03	459	58,599	医薬品	
AMPLIFON SPA	—	113.72	426	54,332	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PRYSMIAN SPA	214.52	223.28	634	80,811	電気設備	
DIASORIN SPA	—	22.23	412	52,580	ヘルスケア機器・用品	
MONCLER SPA	143.53	175.67	900	114,712	繊維・アパレル・贅沢品	
NEXI SPA	—	430.97	698	89,029	情報技術サービス	
FINECOBANK SPA	450.48	538.18	810	103,324	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	400.15	400.15	387	49,353	保険	
INFRASTRUCTURE WIRELESS ITALIANE SPA	—	233.44	216	27,607	各種電気通信サービス	
PIRELLI & C SPA	340.86	—	—	—	自動車部品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	40,427.71 18銘柄	46,251.5 20銘柄	22,595 <0.6%>	2,879,599	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KESKO OYJ-B	—	240.85	518	66,053	食品・生活必需品小売り	
WARTSILA OYJ	349.35	349.35	298	38,021	機械	
NOKIAN RENKAAT OYJ	93.99	—	—	—	自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	399.09	448.29	1,441	183,673	紙製品・林産品	
STORA ENSO OYJ-R SHS	419.15	532.5	878	111,904	紙製品・林産品	
SAMPO OYJ-A SHS	361.41	448.22	1,653	210,777	保険	
FORTUM OYJ	374.52	394.09	857	109,284	電力	
NOKIA OYJ	4,308	5,185.32	1,802	229,700	通信機器	
ELISA OYJ	107.87	136.42	676	86,214	各種電気通信サービス	
NELES OYJ	85.85	—	—	—	機械	
NESTE OYJ	329.31	367.96	2,105	268,320	石油・ガス・消耗燃料	
KONE OYJ	265.02	298.9	2,070	263,900	機械	

銘	柄	期首(前期末)		当		期		業	種	等
		株	数	株	数	評 価 額				
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円					
ORION OYJ		80.51	80.51	288	36,741					医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 柄 数 < 比 率 >	7,174.07 12銘柄	8,482.41 11銘柄	12,590 -	1,604,590 <0.3%>					
(ユーロ…オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円					
OMV AG		128.17	128.17	451	57,528					石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG		49.08	69.24	482	61,458					電力
VOEST-ALPINE AG		98.75	98.75	306	39,113					金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		209.43	242.04	642	81,864					銀行
ANDRITZ AG		62.65	-	-	-					機械
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		96.41	179.11	299	38,119					銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 柄 数 < 比 率 >	644.49 6銘柄	717.31 5銘柄	2,182 -	278,083 <0.1%>					
合 計	株 数 ・ 金 額 柄 数 < 比 率 >	858,545.81 1,254銘柄	974,571.62 1,224銘柄	- -	455,954,801 <95.5%>					

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

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

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

(2) 外国新株予約権証券

銘	柄	期首(前期末)		当		期		業	種	等
		証	券	証	券	評 価 額				
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
(スイス)			証券		証券	千スイス・フラン	千円			
CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23			-		87,844	28	3,416			
合 計	証 券 数 ・ 金 額 柄 数 < 比 率 >		- 1銘柄		87,844 1銘柄	- -	3,416 <0.0%>			

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期			
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
不動産ファンド (アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8.646	12.006	2,077	218,413		0.0
BOSTON PROPERTIES INC	12.027	12.947	1,218	128,069		0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17.771	22.693	849	89,336		0.0
SL GREEN	7.097	—	—	—		—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108.247	127.559	1,081	113,708		0.0
PROLOGIS INC	56.079	66.35	7,143	750,967		0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	10.491	12.329	2,213	232,649		0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	8.062	9.643	1,027	107,996		0.0
EQUINIX INC	6.522	7.992	5,672	596,324		0.1
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13.649	—	—	—		—
DUKE REALTY TRUST	27.278	31.929	1,327	139,558		0.0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	31.583	38.831	6,386	671,311		0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5.075	5.504	1,482	155,840		0.0
EQUITY RESIDENTIAL	27.869	35.108	2,369	249,038		0.1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6	—	—	—		—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40.162	45.543	1,409	148,124		0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	8.778	9.838	2,596	272,958		0.1
WELLTOWER INC	32.099	38.411	2,593	272,589		0.1
KIMCO REALTY	32.98	—	—	—		—
IRON MOUNTAIN INC	23.977	24.591	815	85,744		0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13.626	16.087	1,009	106,165		0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	55.116	63.952	952	100,167		0.0
MID AMERICA	8.834	10.854	1,499	157,613		0.0
REALTY INCOME CORP	23.491	29.466	1,840	193,467		0.0
REGENCY CENTERS CORP	11.403	14.499	762	80,199		0.0
UDR INC	22.345	27.057	1,155	121,477		0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	23.306	28.083	3,068	322,544		0.1
PUBLIC STORAGE	12.188	13.834	3,207	337,177		0.1
SUN COMMUNITIES INC	7.418	9.67	1,438	151,246		0.0
VENTAS INC	29.505	35.021	1,776	186,720		0.0
VORNADO REALTY TRUST	12.472	12.714	488	51,308		0.0
WEYERHAEUSER CO	57.621	64.096	2,245	236,091		0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	9.261	12.385	1,447	152,167		0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	15.605	23.492	3,290	345,875		0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	39.953	53.911	1,212	127,510		0.0
AGNC INVESTMENT CORP	44.741	46.028	752	79,108		0.0
VEREIT INC	82.604	20.534	776	81,592		0.0
AMERICAN TOWER CORP	34.213	39.736	9,027	948,983		0.2
WP CAREY INC	13.039	15.529	1,093	114,905		0.0
INVITATION HOMES INC	42.384	50.475	1,564	164,483		0.0
VICI PROPERTIES INC	34.2	47.083	1,283	134,919		0.0
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	金額 80,159	金額 8,426,360	比率 —	率 1.8
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	3.067	—	—	—		—
CANADIAN APT PPTYS REIT	7.819	7.954	409	33,900		0.0
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10.748	—	—	—		—
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	17.676	—	—	—		—
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13.467	13.467	242	20,069		0.0
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	金額 651	金額 53,970	比率 —	率 0.0

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		%	
MIRVAC GROUP	329.418	329.418	764	62,362		0.0	
GPT GROUP	158.232	158.232	653	53,325		0.0	
STOCKLAND	194.018	194.018	909	74,251		0.0	
DEXUS	84.575	108.972	950	77,539		0.0	
GOODMAN GROUP	132.051	148.357	2,664	217,422		0.0	
VICINITY CENTRES	270.443	371.711	570	46,559		0.0	
SCENTRE GROUP	420.268	420.268	1,130	92,250		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	7,643 7銘柄<0.2%>	623,711 -	-	0.1	
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円		%	
LINK REIT	157.9	200.2	13,473	182,700		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	13,473 1銘柄<0.0%>	182,700 -	-	0.0	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	199	483.636	1,034	82,136		0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	200.806	292.606	898	71,289		0.0	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206.3	-	-	-		-	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	192.1	286	22,715		0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	-	270.1	521	41,369		0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192.3	192.3	399	31,742		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	3,140 5銘柄<0.1%>	249,252 -	-	0.1	
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		%	
BRITISH LAND CO PLC	69.819	69.819	321	46,842		0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	55.843	55.843	338	49,438		0.0	
SEGRO PLC	87.247	100.956	977	142,532		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	1,637 3銘柄<0.1%>	238,813 -	-	0.1	
(フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円		%	
GECINA SA	3.67	3.67	433	55,189		0.0	
ICADE	2.234	-	-	-		-	
KLEPIERRE	17.042	17.099	323	41,272		0.0	
COVIVIO	4.265	4.663	305	38,982		0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10.898	12.92	752	95,926		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	1,815 5銘柄<0.1%>	231,370 -	-	0.0	
合計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	4,118.923 67銘柄<2.7%>	4,784.089 -	10,006,178	2.1	

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期		末	
			買	建 額	売	建 額
外	S & P 5 0 0	E M I N I		百万円 8,863		百万円 -
	S & P / T S E	6 0		416		-
	S P I	2 0 0		275		-
国	FTSE	1 0 0		562		-
	D J	E U R O		1,936		-

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

■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

項	目	当 期		末	
		評 価	額	比	率
株	式		千円		%
			455,954,801		95.5
新 株 予 約 権 証 券			3,416		0.0
投 資 信 託 受 益 証 券、投 資 証 券			10,006,178		2.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等、そ の 他			11,688,217		2.4
投 資 信 託 財 産 総 額			477,652,614		100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、477,230,001千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.12円、1カナダ・ドル=82.84円、1オーストラリア・ドル=81.60円、1香港・ドル=13.56円、1シンガポール・ドル=79.36円、1ニュージーランド・ドル=75.90円、1イギリス・ポンド=145.85円、1イスラエル・シケル=32.31円、1スイス・フラン=117.85円、1デンマーク・クローネ=17.13円、1ノルウェー・クローネ=12.44円、1スウェーデン・クローナ=12.66円、1ユーロ=127.44円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

項 目	当 期 末		
(A) 資 産	478,371,556,028円		
一 般 株 券 (評 価 額)	7,543,114,076		
株 券 (評 価 額)	455,954,801,985		
株 券 (評 価 額)	3,416,297		
株 券 (評 価 額)	872,963,897		
株 券 (評 価 額)	9,133,215,008		
株 券 (評 価 額)	997,758,204		
株 券 (評 価 額)	327,168,116		
株 券 (評 価 額)	3,539,118,445		
(B) 負 債	805,612,996		
未 払 金	725,661,696		
未 払 金	79,951,300		
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	477,565,943,032		
元 本	101,430,005,374		
次 期 繰 越 損 益	376,135,937,658		
(D) 受 取 金 数	101,430,005,374円		
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	47,083円		
(注1) 期首元本額	88,590,932,378円	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	109,409,614円
追加設定元本額	45,119,031,395円	リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,213,146,637円
一部解約元本額	32,279,958,399円	ワールドアセットバランス (基本コース)	336,245,295円
(注2) 期末における元本の内訳		ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	982,171,507円
D I A M 外国株式パッシブ・ファンド	3,590,651,003円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	12,186,690円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,310,337円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	5,775,603円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	6,547,566円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	1,075,918円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	6,756,671円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	20,712,777円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,177,539円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	33,065,020円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	17,784,106円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	740,973,150円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	10,755,334円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	175,140,431円
たわらノーロード 先進国株式	19,446,068,276円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	6,120,622円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	221,026,311円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	3,347,358円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,352,778,639円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	3,322,497円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	410,571,761円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,214,984円
たわらノーロード バランス (堅実型)	46,019,112円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	117,075,833円
たわらノーロード バランス (標準型)	354,659,393円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	142,051,776円
たわらノーロード バランス (積極型)	417,152,173円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	6,645,402円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,077,196円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	72,091,910円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	132,195,005円	M S C I コアサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	257,923,303円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	345,649,070円	D I A M 外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	63,007,304円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	228,974,611円	D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	1,445,094,587円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	343,116,453円	D I A M 先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,156,121,882円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,447円	外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	862,725,175円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	628,040円	D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	11,658,494円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	2,639,134円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	190,209,441円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,984,548円	D I A M グローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	47,142,712円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	4,398,037円	D I A M グローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	83,869,902円
たわらノーロード 全世界株式	85,362,898円	D I A M 国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	5,197,402円
D I A M 外国株式インデックスファンド<DC年金>	46,681,552,310円	D I A M 国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	34,446,092円
O n e D C 先進国株式インデックスファンド	578,488,633円	D I A M 国内重複バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,743,840円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>1安定型	183,355,556円	D I A M 国内重複バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,557,070円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	935,988,345円	D I A M 世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	12,351,541円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,108,633,939円	D I A M 世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	42,816,355円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	112,383,572円	D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	298,196,031円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	336,515,401円	D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	415,545,865円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	294,455,629円	D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,340,967,617円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	26,718,430円	D I A M グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	497,122,927円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	815,556,610円	D I A M グローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	73,316,094円
マネックス資産設計ファンド エポリユーション	168,120,959円	D I A M アップ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	487,021,391円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	207,380,963円	D I A M 世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	21,947,333円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	175,357,524円	D I A M 世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	4,736,583円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	291,398,144円	D I A M 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	203,141,179円
投資のソムリエ	4,677,116,550円	D I A M 世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	15,672,025円
グルーズコントロール	247,166,541円	D I A M 世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	65,152,864円
投資のソムリエ<DC年金>	287,425,394円	D I A M 世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	103,614,222円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	195,280,389円	D I A M 世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	210,904,861円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	114,819,293円	期末元本合計	101,430,005,374円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	1,868,239円		
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	4,162,455円		

■損益の状況

当期 自2020年2月18日 至2021年2月15日

項	目	当	期
(A)	配当 受取 受取 の 支払 の 他 取 利 受 取 当 金		6,240,305,046円 6,234,830,400 332,462 5,507,444 △365,260
(B)	有価証券 売買 損益 買 損 益		50,582,940,100 87,299,316,083 △36,716,375,983
(C)	先物取引 取引 損益 取 引 損 益		1,388,470,803 4,988,951,090 △3,600,480,287
(D)	その他 費用 の 他 費 用		△87,341,531 △87,341,531
(E)	当期損益 金(A+B+C+D)		58,124,374,418
(F)	前期繰越 損益 金		281,829,514,820
(G)	解約差 損益 金		△91,806,425,185
(H)	追加信託 差損 益 金		127,988,473,605
(I)	合 計(E+F+G+H)		376,135,937,658
	次 期繰越 損益 金(I)		376,135,937,658

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第18期（決算日 2021年2月22日）

（計算期間 2020年2月22日～2021年2月22日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9	ポイント 108,792.68	% △2.7	% 97.9	% -	百万円 248,485
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

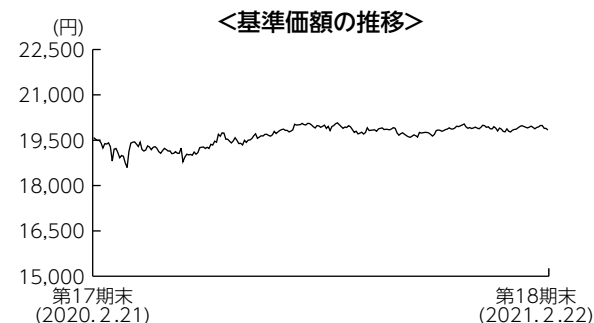
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 2 月 21 日	円 19,586	% -	ポイント 122,662.63	% -	% 97.8	% -
2 月 末	19,413	△0.9	121,401.29	△1.0	97.3	-
3 月 末	19,435	△0.8	121,796.59	△0.7	97.4	-
4 月 末	19,066	△2.7	119,329.72	△2.7	96.1	-
5 月 末	19,338	△1.3	120,973.12	△1.4	97.3	-
6 月 末	19,646	0.3	123,063.01	0.3	98.4	-
7 月 末	19,841	1.3	123,870.50	1.0	99.0	-
8 月 末	19,819	1.2	124,064.52	1.1	99.4	-
9 月 末	19,912	1.7	124,690.18	1.7	97.8	-
10 月 末	19,615	0.1	122,727.67	0.1	98.2	-
11 月 末	19,817	1.2	124,001.42	1.1	99.1	-
12 月 末	19,982	2.0	125,045.38	1.9	98.6	-
2021 年 1 月 末	19,954	1.9	125,100.34	2.0	98.6	-
(期 末) 2021 年 2 月 22 日	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月22日から2021年2月22日まで）

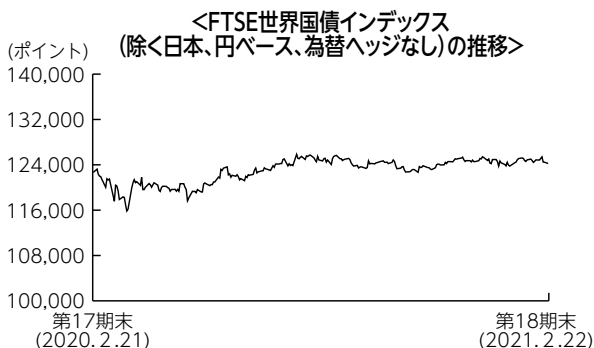


基準価額の推移

当期末の基準価額は19,836円となり、前期末比で1.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは低下（価格は上昇）しました。新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R B（米連邦準備理事会）が緊急利下げを行ったことや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。これらを主因に基準価額は上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債の利回りは低下しました。一方、ドイツ債の利回りは上昇（価格は低下）しました。米国債利回りは新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R Bが緊急利下げを行ったことや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。期末には新型コロナウイルスのワクチン期待を受けて利回りが上昇し始め、ドイツ債についても期待を受けて利回りは上昇しました。

為替市場ではドル／円は円高ドル安に、ユーロ／円は円安ユーロ高となりました。ドル／円は、F R Bによる緊急利下げや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続示唆、追加緩和期待から円高ドル安が進みました。ユーロ／円は、E C B（欧州中央銀行）の追加金融緩和策が域内景気を下支えるとの見方やユーロ圏経済指標の改善などから円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

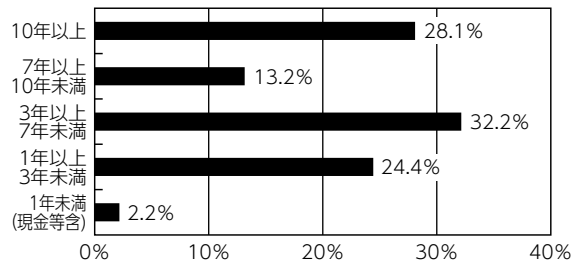
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

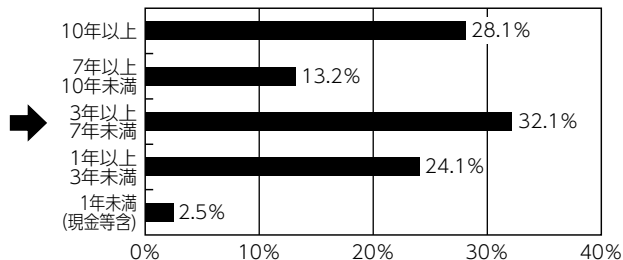
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	48.3%	48.8%	△0.5%
カナダ	1.8%	1.9%	△0.1%
計	50.1%	50.7%	△0.6%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.9%	△0.1%
計	0.7%	0.9%	△0.1%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	0.0%
ベルギー	2.3%	2.4%	△0.1%
フィンランド	0.5%	0.6%	△0.1%
フランス	9.5%	9.8%	△0.3%
ドイツ	5.7%	6.2%	△0.5%
アイルランド	0.7%	0.7%	0.0%
イタリア	8.9%	8.8%	0.1%
オランダ	1.8%	1.8%	0.0%
スペイン	5.3%	5.5%	△0.2%
ユーロ計	36.1%	37.2%	△1.1%
デンマーク	0.4%	0.5%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.3%	△0.1%
英国	6.2%	6.4%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.6%	△0.1%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.1%
計	43.7%	45.4%	△1.8%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.8%	1.9%	0.0%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.5%	0.1%
計	2.8%	2.8%	0.0%
アフリカ			
南アフリカ	0.5%	0.5%	0.0%
計	0.5%	0.5%	0.0%
現金など	1.6%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

期末

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

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.3%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) その他費用	2円	0.012%
（保管費用）	(2)	(0.011)
（その他）	(0)	(0.001)
合 計	2	0.012

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（19,648円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については11ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2020年2月22日から2021年2月22日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額	
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 204,013	千アメリカ・ドル 220,431	
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 12,919	千カナダ・ドル 8,752	
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 19,582	千オーストラリア・ドル 4,973	
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 1,694	千シンガポール・ドル 844	
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 22,124	千イギリス・ポンド 14,602	
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シケル 19,040	千イスラエル・シケル 567	
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 9,664	千デンマーク・クローネ 5,334	
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 6,951	千ノルウェー・クローネ 3,221	
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 15,553	千スウェーデン・クローナ 3,970	
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 64,559	千メキシコ・ペソ 27,641	
	マレーシア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 5,060	千マレーシア・リンギット 10,671	
	南アフリカ	国 債 証 券	千南アフリカ・ランド -	千南アフリカ・ランド 85,263	
	ポーランド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 10,959	千ポーランド・ズロチ 5,220	
国	ユ ー ロ	アイルランド	国 債 証 券	千ユーロ 3,473	千ユーロ 1,628
		オランダ	国 債 証 券	6,076	5,390
		ベルギー	国 債 証 券	8,408	6,178
		フランス	国 債 証 券	36,111	22,676
		ドイツ	国 債 証 券	43,157	22,151
		スペイン	国 債 証 券	22,043	12,904
		イタリア	国 債 証 券	32,711	28,279
		フィンランド	国 債 証 券	1,694	439
オーストリア	国 債 証 券	5,421	3,790		

(注) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等 (2020年2月22日から2021年2月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 519,140	千アメリカ・ドル 550,714	千円 58,100,386	% 42.4	% -	% 18.2	% 17.4	% 6.7
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 29,460	千カナダ・ドル 31,957	千円 2,675,453	2.0	-	0.9	0.7	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 41,700	千オーストラリア・ドル 45,344	千円 3,772,248	2.8	-	1.9	0.7	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 6,200	千シンガポール・ドル 6,929	千円 552,643	0.4	-	0.3	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 49,770	千イギリス・ポンド 61,565	千円 9,110,469	6.6	-	5.0	1.1	0.5
イスラエル	千イスラエル・シケル 15,670	千イスラエル・シケル 17,913	千円 577,359	0.4	-	0.2	0.2	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 30,780	千デンマーク・クローネ 38,545	千円 662,988	0.5	-	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 23,270	千ノルウェー・クローネ 24,312	千円 303,668	0.2	-	0.1	0.1	-
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 30,610	千スウェーデン・クローナ 33,818	千円 431,523	0.3	-	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 180,572	千メキシコ・ペソ 203,320	千円 1,047,101	0.8	-	0.5	0.3	0.0
マレーシア	千マレーシア・リンギット 21,930	千マレーシア・リンギット 23,693	千円 618,878	0.5	-	0.3	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 28,350	千ポーランド・ズロチ 30,882	千円 881,086	0.6	-	0.3	0.2	0.2
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	7,940	9,015	1,153,117	0.8	-	0.6	0.2	0.1
オランダ	16,600	19,801	2,532,858	1.8	-	1.2	0.5	0.1
ベルギー	21,530	26,470	3,385,814	2.5	-	1.9	0.4	0.2
フランス	95,020	113,104	14,467,133	10.6	-	7.1	2.7	0.7
ドイツ	68,530	80,607	10,310,448	7.5	-	4.5	2.4	0.6
スペイン	54,310	64,919	8,303,795	6.1	-	4.0	1.4	0.6
イタリア	85,840	102,183	13,070,282	9.5	-	6.1	2.6	0.8
フィンランド	5,900	6,530	835,308	0.6	-	0.4	0.2	0.0
オーストリア	13,180	15,826	2,024,348	1.5	-	1.0	0.4	0.1
合 計	-	-	千円 134,816,915	98.4	-	54.9	32.0	11.4

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当 種 類	利 率	額 面 金 額	期 評 価 額		末 償還年月日
				額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,180	2,396	252,827	2026/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	350	371	39,146	2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	4,980	5,138	542,095	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	3,890	4,151	438,000	2024/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24	国債証券	0.1250	7,000	6,983	736,769	2024/01/15
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	2,490	2,592	273,551	2027/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	3,280	3,407	359,530	2025/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	840	1,063	112,235	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	680	818	86,326	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,440	1,731	182,671	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,970	2,127	224,478	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	900	1,135	119,785	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	490	646	68,201	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	700	970	102,339	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	730	1,009	106,521	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,200	1,775	187,338	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	2,113	222,976	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,070	3,655	385,650	2049/02/15
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	8,470	8,630	910,479	2022/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	550	763	80,586	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	750	1,086	114,619	2040/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	4,180	4,394	463,590	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,080	2,249	237,286	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,640	1,942	204,893	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,540	3,013	317,963	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	5,320	5,721	603,661	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	5,300	5,642	595,232	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,110	4,586	483,909	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,370	4,900	517,043	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	4,370	4,532	478,215	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,550	3,857	406,915	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,300	1,374	145,014	2024/02/29
US T N/B 1.5 02/28/23	国債証券	1.5000	1,000	1,027	108,434	2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,550	2,789	294,267	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,660	1,816	191,616	2025/02/28
US T N/B 1.875 02/28/22	国債証券	1.8750	1,680	1,710	180,494	2022/02/28
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	1,800	1,890	199,484	2023/02/28
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,270	3,176	335,147	2050/02/15
US T N/B 1.375 02/15/23	国債証券	1.3750	4,000	4,099	432,533	2023/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,120	118,248	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	3,970	4,059	428,226	2030/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	1,000	1,029	108,566	2025/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	4,080	4,318	455,627	2024/03/31
US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	1.7500	6,990	7,118	751,041	2022/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	2,000	2,057	217,099	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	2,150	2,343	247,221	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	3,090	3,342	352,660	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	3,020	3,171	334,565	2023/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	1,800	1,779	187,711	2027/03/31

銘柄	柄	当期					末	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 0.375 03/31/22	国債証券	0.3750	1,500	1,504	158,756	2022/03/31		
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	800	802	84,693	2025/03/31		
US T N/B 0.5 03/15/23	国債証券	0.5000	2,000	2,015	212,648	2023/03/15		
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	3,000	3,097	326,786	2023/04/30		
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,760	1,917	202,260	2026/04/30		
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	2,490	2,632	277,697	2023/04/30		
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,510	370,317	2024/04/30		
US T N/B 0.125 04/30/22	国債証券	0.1250	1,000	1,000	105,555	2022/04/30		
US T N/B 0.25 04/15/23	国債証券	0.2500	2,000	2,005	211,560	2023/04/15		
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,000	1,959	206,730	2027/04/30		
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,000	1,995	210,480	2025/04/30		
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	710	1,024	108,108	2030/05/15		
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,200	1,690	178,367	2040/05/15		
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,040	1,474	155,562	2041/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	980	1,155	121,870	2042/05/15		
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	810	1,118	117,974	2039/05/15		
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,200	2,544	268,492	2043/05/15		
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	2,030	2,537	267,656	2044/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,630	1,921	202,703	2045/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,290	1,528	161,261	2047/05/15		
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,810	1,954	206,164	2046/05/15		
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,660	3,227	340,548	2048/05/15		
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	5,400	5,510	581,361	2022/05/15		
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	2,100	1,818	191,900	2040/05/15		
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,090	3,597	379,554	2049/05/15		
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	540	761	80,300	2038/05/15		
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	2,620	2,714	286,343	2023/05/15		
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	4,240	4,548	479,820	2024/05/15		
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	5,150	5,516	582,036	2025/05/15		
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,430	5,011	528,743	2028/05/15		
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	2,810	3,081	325,127	2029/05/15		
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	3,100	3,392	357,915	2027/05/15		
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	500	735	77,554	2037/05/15		
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	3,090	3,246	342,523	2026/05/15		
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	2,900	2,997	316,228	2023/05/31		
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	4,770	5,040	531,777	2024/05/31		
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	4,180	3,361	354,635	2050/05/15		
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,050	2,206	232,782	2026/05/31		
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,463	365,414	2023/05/31		
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	2,530	2,789	294,315	2025/05/31		
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,500	1,467	154,837	2027/05/31		
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	3,000	2,999	316,450	2023/05/15		
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	4,000	3,772	397,998	2030/05/15		
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	4,470	4,431	467,532	2025/05/31		
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	3,460	3,560	375,610	2023/06/30		
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	4,530	4,654	491,057	2022/06/30		
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	790	867	91,568	2025/06/30		
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	4,670	4,965	523,862	2026/06/30		
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	1,820	1,926	203,230	2023/06/30		
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,406	148,350	2024/06/30		
US T N/B 1.75 06/15/22	国債証券	1.7500	830	847	89,463	2022/06/15		
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	1,700	1,661	175,272	2027/06/30		

銘柄	柄	当期					末	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 0.25 06/15/23	国債証券	0.2500	2,800	2,807	296,150	2023/06/15		
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,972	313,557	2025/06/30		
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	1,860	2,056	216,926	2025/07/31		
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,370	2,520	265,877	2026/07/31		
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	3,690	3,875	408,881	2024/07/31		
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,477	366,869	2023/07/31		
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	1,600	1,599	168,727	2023/07/15		
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	2,000	1,936	204,257	2027/07/31		
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	1,000	989	104,403	2025/07/31		
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,151	121,518	2023/08/15		
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	710	930	98,172	2041/08/15		
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	650	860	90,749	2028/08/15		
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,110	1,473	155,401	2040/08/15		
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,430	1,621	171,019	2042/08/15		
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	1,750	2,104	222,011	2044/08/15		
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	790	1,124	118,603	2039/08/15		
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,670	2,163	228,297	2043/08/15		
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,890	2,183	230,394	2045/08/15		
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	5,180	5,532	583,676	2025/08/15		
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	1,880	2,130	224,744	2047/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	2,400	2,464	259,984	2049/08/15		
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	4,330	4,581	483,367	2023/08/15		
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	3,920	4,203	443,510	2024/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,370	2,440	257,496	2046/08/15		
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,210	3,812	402,258	2048/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,690	2,923	308,449	2027/08/15		
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,090	3,225	340,282	2026/08/15		
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	3,680	4,168	439,803	2028/08/15		
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	3,980	4,069	429,353	2022/08/15		
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,640	1,804	190,403	2025/08/31		
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	2,380	2,466	260,250	2029/08/15		
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	3,680	3,779	398,704	2022/08/31		
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	3,120	3,293	347,418	2024/08/31		
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	2,170	2,311	243,869	2023/08/31		
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	1,210	1,235	130,312	2022/08/15		
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	4,100	3,536	373,108	2040/08/15		
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,540	3,772	397,956	2050/08/15		
US T N/B 0.125 08/31/22	国債証券	0.1250	4,000	4,001	422,148	2022/08/31		
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	6,210	5,833	615,385	2030/08/15		
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	1,139	120,247	2026/08/31		
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,440	2,521	266,027	2024/08/31		
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	1,000	988	104,296	2025/08/31		
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,998	210,859	2023/08/15		
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,410	1,569	165,571	2025/09/30		
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,930	3,121	329,279	2024/09/30		
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	1,500	1,547	163,269	2023/09/30		
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	5,250	5,388	568,500	2022/09/30		
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	840	899	94,878	2023/09/30		
US T N/B 1.5 09/15/22	国債証券	1.5000	750	766	80,852	2022/09/15		
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,998	210,810	2023/09/15		
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	1,700	1,640	173,086	2027/09/30		
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,900	1,994	210,378	2026/09/30		

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,963	312,617	2025/09/30
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,920	2,138	225,648	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	4,000	4,156	438,484	2023/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	3,690	3,957	417,549	2023/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,350	2,467	260,301	2026/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,200	2,294	242,054	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,000	2,915	307,548	2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	2,000	1,973	208,164	2025/10/31
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	1,115	117,656	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	900	1,208	127,522	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,790	2,109	222,586	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	510	709	74,894	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,220	1,382	145,894	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	760	913	96,410	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,360	1,794	189,270	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,140	2,424	255,755	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	2,900	2,569	271,052	2050/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	1,240	1,464	154,500	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	2,020	2,336	246,475	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	4,690	5,023	529,933	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	910	1,277	134,819	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	2,660	3,377	356,378	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	2,922	308,330	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,190	5,609	591,776	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	4,840	5,575	588,210	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	5,620	5,766	608,404	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	5,520	5,907	623,261	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,640	2,826	298,190	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	6,590	6,810	718,492	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,555	375,063	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	2,000	2,107	222,390	2023/11/30
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	2,300	2,073	218,764	2040/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,020	1,070	112,898	2026/11/30
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	1,940	2,029	214,088	2029/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	6,400	6,137	647,506	2030/11/15
US T N/B 0.25 11/15/23	国債証券	0.2500	6,000	6,011	634,211	2023/11/15
US T N/B 0.125 11/30/22	国債証券	0.1250	5,340	5,341	563,524	2022/11/30
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	2,000	1,957	206,532	2027/11/30
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	2,000	2,086	220,099	2024/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	2,590	2,567	270,875	2025/11/30
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,272	345,226	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,515	265,433	2025/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	3,216	339,322	2024/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	5,520	5,726	604,107	2022/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	740	781	82,498	2026/12/31
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	1,000	998	105,314	2023/12/15
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,600	1,684	177,754	2024/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	1,000	990	104,502	2025/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	1,000	977	103,142	2027/12/31
小 計	-	-	519,140	550,714	58,100,386	-
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	560	46,922	2024/03/01

銘柄	種類	利率	額面金額	期		償還年月日
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	300	301	25,209	2022/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	3,160	3,257	272,751	2023/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	720	60,283	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	800	781	65,418	2026/03/01
CANADA 1.5 05/01/22	国債証券	1.5000	920	934	78,257	2022/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	800	831	69,616	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,000	1,375	115,123	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	720	1,077	90,199	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	390	586	49,096	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,600	1,709	143,158	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	680	956	80,070	2041/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	2,240	2,313	193,723	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,244	104,185	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	720	776	65,008	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,300	1,391	116,489	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	700	708	59,340	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	670	56,143	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	1,810	1,832	153,378	2030/06/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	920	959	80,358	2023/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	1,500	1,518	127,152	2022/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	2,350	2,336	195,571	2025/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	920	1,246	104,373	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	850	1,034	86,592	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	1,280	1,347	112,782	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	452	37,894	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,100	1,031	86,351	2030/12/01
小計	—	—	29,460	31,957	2,675,453	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	870	988	82,219	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	2,720	3,045	253,353	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	1,670	2,071	172,356	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	1,980	2,143	178,346	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	2,010	2,388	198,670	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	2,510	2,800	232,976	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	2,440	2,842	236,444	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	980	1,300	108,149	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	760	957	79,630	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	1,740	1,888	157,097	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	2,050	2,263	188,323	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	740	812	67,595	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	1,390	1,350	112,351	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	620	733	61,060	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	1,640	1,650	137,336	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	530	595	49,562	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	1,000	850	70,744	2051/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	680	733	61,040	2022/07/15
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	1,680	1,664	138,499	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	1,780	2,001	166,541	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,630	1,827	151,993	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,860	2,085	173,533	2029/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	2,190	2,271	189,002	2022/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	1,600	1,523	126,716	2031/11/21

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)						
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	千オーストラリア・ドル 1,450	千オーストラリア・ドル 1,434	千円 119,342	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	1,440	1,439	119,773	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,740	1,677	139,582	2030/12/21
小 計	—	—	41,700	45,344	3,772,248	—
(シンガポール)						
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 730	千シンガポール・ドル 843	千円 67,253	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	420	513	40,914	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	210	220	17,613	2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	380	454	36,250	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	130	144	11,552	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	340	366	29,194	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	310	332	26,509	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	200	228	18,215	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	100	112	8,978	2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	700	739	58,960	2023/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	480	528	42,154	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	550	598	47,716	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	800	834	66,544	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	370	426	33,998	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	480	586	46,786	2033/09/01
小 計	—	—	6,200	6,929	552,643	—
(イギリス)						
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	千イギリス・ポンド 1,310	千イギリス・ポンド 1,842	千円 272,723	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,280	1,882	278,641	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	870	1,631	241,423	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	890	997	147,593	2049/01/22
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	250	229	33,909	2046/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	500	500	73,991	2024/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,000	976	144,542	2028/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	1,500	1,502	222,361	2023/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,200	1,191	176,244	2026/01/30
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,410	1,684	249,239	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	1,330	1,931	285,773	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	1,120	1,152	170,511	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,210	1,659	245,552	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	1,250	1,273	188,463	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	910	963	142,551	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	940	1,556	230,311	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	910	1,055	156,180	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	980	1,430	211,723	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	960	1,781	263,612	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	900	959	141,928	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	1,260	1,328	196,608	2027/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	1,920	1,934	286,259	2022/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	1,560	1,587	234,847	2023/07/22
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	750	710	105,086	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	800	755	111,850	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	920	1,403	207,743	2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	1,180	1,246	184,385	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	480	524	77,655	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	790	854	126,416	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	760	1,105	163,582	2034/09/07

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,440	1,582	234,125	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	1,530	1,571	232,601	2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	520	575	85,205	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	470	367	54,449	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	580	701	103,738	2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	880	888	131,413	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	1,050	887	131,403	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	930	1,008	149,300	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	910	929	137,602	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	1,450	1,405	207,984	2030/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	760	1,076	159,354	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	880	1,403	207,676	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,280	2,094	309,883	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,060	1,765	261,246	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,020	1,895	280,491	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	780	980	145,163	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	960	1,486	220,009	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,140	1,578	233,628	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	990	1,712	253,474	2049/12/07
小計	—	—	49,770	61,565	9,110,469	—
(イスラエル)		%	千イスラエル・シユケル	千イスラエル・シユケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	1,500	2,457	79,193	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,260	1,669	53,806	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	2,610	2,830	91,218	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	2,600	2,881	92,859	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	950	947	30,529	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	2,920	3,169	102,152	2023/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	500	484	15,608	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 0.75 07/31/22	国債証券	0.7500	300	302	9,750	2022/07/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,030	2,153	69,393	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	国債証券	1.2500	1,000	1,019	32,846	2022/11/30
小計	—	—	15,670	17,913	577,359	—
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	1,650	1,599	27,514	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	8,050	14,548	250,227	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	5,320	5,884	101,211	2025/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	2,300	2,430	41,804	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	7,130	7,536	129,636	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	2,670	2,835	48,774	2029/11/15
DENMARK 0.25 11/15/22	国債証券	0.2500	3,660	3,710	63,820	2022/11/15
小計	—	—	30,780	38,545	662,988	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	3,770	3,891	48,598	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	1,000	1,044	13,042	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	6,200	6,658	83,169	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,800	3,955	49,405	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	2,198	27,457	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	1,000	1,034	12,923	2023/05/24
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	3,730	3,757	46,934	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	1,700	1,772	22,137	2029/09/06
小計	—	—	23,270	24,312	303,668	—

銘	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)			%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,270	4,838	61,740	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	1,540	1,613	20,589	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	6,180	6,890	87,926	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	2,200	2,155	27,505	2031/05/12	
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	3,000	3,146	40,153	2022/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	8,200	8,604	109,789	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	4,250	4,506	57,505	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	1,970	2,062	26,313	2029/11/12	
小計	—	—	30,610	33,818	431,523	—	
(メキシコ)			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	14,859	15,407	79,350	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	20,000	21,027	108,292	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	17,109	20,314	104,618	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	10,000	11,329	58,346	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	20,262	104,352	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	7,830	8,066	41,542	2022/06/09	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	10,000	11,134	57,343	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	13,643	14,895	76,713	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	9,254	10,313	53,112	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	8,125	9,596	49,422	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	8,085	10,834	55,799	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	7,000	7,917	40,776	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	22,596	26,847	138,264	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	15,372	79,167	2023/12/07	
小計	—	—	180,572	203,320	1,047,101	—	
(マレーシア)			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	858	22,423	2027/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,258	32,867	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,362	87,826	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	2,008	52,448	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,234	32,232	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,200	1,349	35,236	2037/04/07	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,133	55,725	2028/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,595	67,806	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	2,600	2,934	76,659	2048/07/06	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	600	605	15,815	2034/07/05	
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	3,000	3,067	80,122	2022/08/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,286	59,713	2043/09/30	
小計	—	—	21,930	23,693	618,878	—	
(ポーランド)			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	2,850	2,981	85,062	2023/01/25	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,968	56,166	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,010	3,373	96,231	2028/04/25	
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	1,500	1,539	43,927	2022/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,447	69,821	2024/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,080	2,277	64,976	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,662	75,948	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,280	2,511	71,645	2027/07/25	
POLAND 07/25/22	国債証券	—	1,200	1,199	34,226	2022/07/25	
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	1,720	1,876	53,528	2022/09/23	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	3,940	4,340	123,836	2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	210	236	6,758	2029/10/25	

銘柄	種別	利率	額面金額	期		償還年月日
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	600	639	18,255	2024/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,850	2,828	80,701	2030/10/25
小計	—	—	28,350	30,882	881,086	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	560	746	95,441	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	210	239	30,637	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	510	572	73,204	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	800	993	127,088	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	570	623	79,736	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0.8000	370	375	48,008	2022/03/15
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	400	487	62,335	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	340	389	49,840	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	630	776	99,305	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	430	466	59,681	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	380	419	53,719	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	980	1,053	134,768	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	400	488	62,484	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	240	246	31,485	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	280	289	37,051	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	360	358	45,872	2031/10/18
IRISH 10/18/22	国債証券	0.0000	220	222	28,416	2022/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	260	266	34,040	2030/10/18
小計	—	—	7,940	9,015	1,153,117	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,060	1,856	237,460	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	960	1,580	202,134	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	570	521	66,732	2052/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	390	422	54,100	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	850	1,204	154,070	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	950	1,556	199,028	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	780	1,027	131,440	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	590	634	81,131	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	830	846	108,247	2024/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	460	473	60,539	2027/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	2,110	2,233	285,722	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	940	992	127,004	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	980	1,019	130,462	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	820	894	114,426	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,020	1,058	135,379	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	850	923	118,071	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	700	755	96,602	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	790	828	105,927	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	950	972	124,375	2030/07/15
小計	—	—	16,600	19,801	2,532,858	—
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/22	国債証券	4.0000	420	441	56,473	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	1,240	1,760	225,203	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,060	1,827	233,799	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	820	1,031	131,896	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	530	766	98,035	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,090	1,826	233,596	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	710	811	103,806	2033/04/22

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	650	1,112	142,359	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	640	783	100,199	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	490	617	78,957	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	420	609	77,973	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	420	615	78,676	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,020	1,100	140,806	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	1,050	1,163	148,792	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	810	897	114,848	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	830	886	113,400	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	880	951	121,745	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	320	316	40,517	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,010	1,103	141,206	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	670	922	118,055	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	550	692	88,625	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,140	1,207	154,391	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	850	913	116,837	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	230	271	34,712	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	800	815	104,354	2030/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	1,190	1,284	164,250	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	530	551	70,513	2024/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	660	674	86,307	2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	500	511	65,471	2027/10/22
小計	—	—	21,530	26,470	3,385,814	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 02/25/22	国債証券	0.0000	690	694	88,821	2022/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	国債証券	0.0000	1,100	1,113	142,487	2023/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	1,500	1,535	196,426	2026/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	2,720	2,770	354,339	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	2,470	2,524	322,898	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	2,700	2,735	349,943	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,030	1,236	158,103	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	2,820	3,408	435,949	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,180	3,907	499,797	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,060	2,102	268,932	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,090	2,266	289,912	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	2,540	3,749	479,635	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	2,350	2,450	313,451	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,650	2,716	347,506	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	1,800	2,911	372,455	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,690	2,269	290,233	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	1,870	2,277	291,284	2050/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	1,380	1,387	177,469	2052/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	940	1,257	160,785	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	300	250	32,008	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	1,980	2,165	276,933	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	2,940	3,661	468,371	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	2,750	2,961	378,755	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,590	4,161	532,264	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	2,620	2,736	350,084	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	2,140	2,265	289,789	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,340	2,678	342,620	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	2,070	2,176	278,364	2026/05/25

銘	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	1,650	1,794	229,560	2027/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	700	708	90,570	2040/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	3,130	3,299	422,007	2023/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	2,190	2,515	321,805	2036/05/25	
FRANCE OAT 05/25/22	国債証券	0.0000	2,190	2,207	282,375	2022/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	1,990	2,477	316,939	2039/06/25	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	2,730	3,090	395,284	2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	1,800	2,358	301,617	2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	2,780	3,365	430,494	2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,520	2,486	318,067	2038/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,260	3,779	483,444	2032/10/25	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	2,030	2,128	272,281	2022/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,680	2,915	372,985	2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,220	2,380	304,526	2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	3,850	4,000	511,672	2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	2,340	2,524	322,868	2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	2,200	2,215	283,329	2030/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,450	2,483	317,675	2029/11/25	
小計	計	-	-	95,020	113,104	14,467,133	-
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	840	1,009	129,077	2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,160	1,663	212,761	2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	710	1,141	145,960	2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,240	1,974	252,550	2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,790	2,971	380,038	2037/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,860	1,948	249,230	2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	1,810	1,913	244,799	2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,900	2,009	257,043	2029/02/15	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	1,420	1,482	189,649	2023/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,430	1,534	196,261	2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,500	1,611	206,122	2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	1,960	2,059	263,449	2027/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	800	825	105,600	2031/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,690	1,749	223,796	2030/02/15	
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	1,030	1,045	133,747	2023/04/14	
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,540	1,574	201,335	2024/04/05	
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,250	1,284	164,339	2025/04/11	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,410	1,511	193,332	2024/05/15	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	1,650	1,731	221,527	2023/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,600	1,623	207,699	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	710	1,036	132,551	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	600	837	107,173	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,140	2,046	261,708	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,100	1,859	237,901	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	1,760	2,755	352,481	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,180	2,277	291,365	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	1,540	1,591	203,522	2022/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,420	2,378	304,297	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	1,750	2,801	358,330	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	1,620	2,091	267,533	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	1,770	1,903	243,435	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,300	2,461	314,801	2027/08/15	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,680	1,737	222,237	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,440	1,521	194,610	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	4,550	4,858	621,485	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,340	1,420	181,684	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,910	1,979	253,198	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,070	1,008	129,048	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,000	2,067	264,453	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	500	518	66,381	2030/08/15
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	1,650	1,705	218,190	2022/09/04
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,130	1,158	148,192	2024/10/18
BUNDESUBL 10/07/22	国債証券	0.0000	1,400	1,415	181,074	2022/10/07
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	1,280	1,304	166,811	2023/10/13
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,300	1,339	171,294	2025/10/10
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	300	309	39,592	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,500	1,553	198,764	2027/11/15
小計	—	—	68,530	80,607	10,310,448	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	1,810	1,918	245,400	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,580	2,319	296,634	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,130	1,305	167,019	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,380	2,112	270,198	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,460	1,627	208,161	2023/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,400	1,417	181,312	2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	500	505	64,681	2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,450	1,566	200,434	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,270	1,442	184,462	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,210	1,331	170,255	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,270	1,413	180,831	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,240	1,363	174,414	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,170	1,297	165,900	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	1,570	1,587	203,015	2022/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,150	1,178	150,752	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	600	584	74,788	2031/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	990	1,000	127,947	2023/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,170	1,559	199,413	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,170	2,018	258,214	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,270	2,167	277,244	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	960	1,568	200,686	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,370	1,672	213,954	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,460	1,692	216,473	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,520	2,428	310,616	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,240	1,515	193,803	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,210	1,333	170,511	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,290	1,503	192,345	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	940	960	122,873	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,420	1,448	185,248	2023/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,200	1,266	161,987	2027/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	1,540	1,717	219,729	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,180	1,640	209,797	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	830	1,552	198,523	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,180	1,659	212,220	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	860	1,178	150,763	2048/10/31

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	870	827	105,834	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,380	1,537	196,709	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,480	1,627	208,133	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,550	1,680	214,917	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,480	1,535	196,390	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	480	543	69,499	2023/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	1,340	1,361	174,183	2022/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	970	1,018	130,298	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,770	1,932	247,206	2030/10/31
小計	—	—	54,310	64,919	8,303,795	—
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,400	1,456	186,335	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	1,000	1,006	128,741	2024/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,280	2,008	256,884	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,660	2,373	303,632	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,390	1,554	198,774	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,080	1,099	140,671	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	300	306	39,255	2026/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,020	1,298	166,138	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,020	1,472	188,339	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,090	1,245	159,300	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	590	766	98,031	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,790	2,157	275,965	2025/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	1,700	1,793	229,406	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,630	1,994	255,091	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	2,490	2,742	350,735	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	810	1,067	136,523	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,090	1,435	183,565	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,540	1,947	249,140	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	1,070	1,098	140,476	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	920	943	120,718	2023/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,020	1,084	138,752	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	600	655	83,791	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	600	591	75,633	2037/03/01
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	980	999	127,816	2022/04/15
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	770	783	100,209	2022/04/01
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,510	1,623	207,690	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,000	1,027	131,490	2031/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	970	1,484	189,831	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,548	198,031	2023/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	810	863	110,393	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,340	1,425	182,335	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,100	1,188	152,055	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,690	1,802	230,610	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	920	1,034	132,351	2027/06/01
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,630	1,806	231,125	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,277	163,407	2024/07/01
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	900	974	124,616	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,610	2,448	313,227	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,330	2,175	278,248	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,136	273,237	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	940	1,049	134,278	2027/08/01

銘柄	種類	利率	額面金額	期		償還年月日
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,330	1,611	206,138	2029/08/01
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	980	997	127,633	2022/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,170	1,214	155,341	2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	1,000	1,014	129,739	2023/08/15
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	940	1,206	154,346	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	970	1,629	208,416	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	990	1,376	176,028	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,390	1,842	235,636	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,150	1,897	242,768	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	870	1,062	135,841	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	700	726	92,956	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,600	1,908	244,090	2033/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,010	1,148	146,940	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	840	1,299	166,197	2049/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	1,150	1,252	160,192	2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,020	1,201	153,665	2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	900	925	118,388	2022/09/15
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	600	627	80,222	2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	980	1,004	128,441	2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	930	996	127,430	2023/11/01
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,190	1,487	190,250	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	1,080	1,517	194,063	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,790	2,528	323,473	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	1,750	2,464	315,192	2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	1,960	2,153	275,399	2022/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	1,040	1,101	140,904	2024/11/15
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	1,250	1,398	178,894	2025/11/15
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	970	1,063	135,971	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,350	1,437	183,865	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	1,170	1,285	164,476	2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,200	1,422	181,987	2028/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,480	1,630	208,521	2030/12/01
小計	-	-	85,840	102,183	13,070,282	-
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	280	303	38,830	2024/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	380	414	52,981	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	130	163	20,898	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	430	452	57,907	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	290	330	42,293	2034/04/15
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	340	355	45,518	2023/04/15
FINLAND 04/15/22	国債証券	0.0000	120	120	15,463	2022/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	210	209	26,765	2036/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	430	517	66,188	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	380	468	59,870	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	350	521	66,657	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	570	606	77,525	2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	300	319	40,918	2025/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	240	254	32,613	2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	300	318	40,704	2027/09/15
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	400	414	53,013	2022/09/15
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	230	233	29,925	2023/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	170	169	21,636	2040/09/15

銘柄	柄	当期				期末	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.0 09/15/30		国債証券	0.0000	170	172	22,059	2030/09/15
FINLAND 0.0 09/15/24		国債証券	0.0000	180	184	23,536	2024/09/15
小計		—	—	5,900	6,530	835,308	—
(ユーロ…オーストリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62		国債証券	3.8000	210	457	58,552	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47		国債証券	1.5000	520	659	84,407	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29		国債証券	0.5000	340	361	46,200	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28		国債証券	0.7500	820	884	113,179	2028/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30		国債証券	0.0000	840	853	109,145	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26		国債証券	4.8500	590	753	96,360	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37		国債証券	4.1500	890	1,456	186,298	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51		国債証券	0.7500	180	193	24,758	2051/03/20
AUSTRIA 3.65 04/20/22		国債証券	3.6500	280	293	37,587	2022/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27		国債証券	0.5000	520	550	70,465	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/23		国債証券	0.0000	200	202	25,932	2023/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34		国債証券	2.4000	480	629	80,544	2034/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20		国債証券	0.8500	170	171	21,910	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44		国債証券	3.1500	470	770	98,504	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27		国債証券	6.2500	670	959	122,698	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23		国債証券	0.0000	650	659	84,363	2023/07/15
AUSTRIA 07/15/24		国債証券	0.0000	800	816	104,386	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17		国債証券	2.1000	380	684	87,492	2117/09/20
AUSTRIA 09/20/22		国債証券	0.0000	470	474	60,729	2022/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24		国債証券	1.6500	540	584	74,825	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26		国債証券	0.7500	680	727	93,079	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25		国債証券	1.2000	640	692	88,612	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23		国債証券	1.7500	750	797	102,015	2023/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40		国債証券	0.0000	200	188	24,080	2040/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86		国債証券	1.5000	150	209	26,841	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22		国債証券	3.4000	740	792	101,373	2022/11/22
小計		—	—	13,180	15,826	2,024,348	—
合計		—	—	—	—	134,816,915	—

■投資信託財産の構成

2021年2月22日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	率
公社債	千円		%
コール・ローン等、その他	134,816,915		97.7
投資信託財産総額	3,110,505		2.3
	137,927,421		100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、136,245,185千円、98.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.50円、1カナダ・ドル=83.72円、1オーストラリア・ドル=83.19円、1シンガポール・ドル=79.75円、1イギリス・ポンド=147.98円、1イスラエル・シケル=32.23円、1デンマーク・クローネ=17.20円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローナ=12.76円、1メキシコ・ペソ=5.15円、1マレーシア・リンギット=26.12円、1ポーランド・ズロチ=28.53円、1ユーロ=127.91円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	139,026,864,416円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,966,445,647
公 社 債(評価額)	134,816,915,952
未 収 入 金	1,420,260,588
未 収 入 息	784,425,849
前 払 費 用	38,816,380
(B) 負 債	1,989,330,062
未 払 金	1,924,681,062
未 払 解 約 金	64,649,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	137,037,534,354
元 本	69,085,269,493
次 期 繰 越 損 益 金	67,952,264,861
(D) 受 益 権 総 口 数	69,085,269,493口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	19,836円

(注1) 期首元本額	66,784,593,799円	グループコントロール	2,047,605,074円
追加設定元本額	22,324,176,727円	D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	112,880,979円
一部解約元本額	20,023,501,033円	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	216,614,702円
(注2) 期末における元本の内訳		D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	7,184,218円
D I AM外国債券パッシブ・ファンド	7,285,630,090円	D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	13,602,076円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	6,005,013円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	109,987,588円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	17,901,375円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	157,862,427円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	16,109,682円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,708,262円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	58,667,541円	D I AMパッシブ資産分散ファンド	1,153,273,300円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	49,579,939円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	288,411,930円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,987,271円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	353,533,881円
たわらノーロード 先進国債券	9,989,838,812円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	161,736,477円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	186,647,242円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	179,290,591円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	971,663,519円	D I AM海替フルハッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	6,015,406,638円
たわらノーロード バランス (堅実型)	26,728,812円	D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	3,819,894,345円
たわらノーロード バランス (標準型)	121,338,758円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,325,976,349円
たわらノーロード バランス (積極型)	25,135,439円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,699,054,337円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	4,073,309円	D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	61,358,370円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	220,889,452円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	471,072,165円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	214,665,752円	D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	503,573,522円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	46,211,416円	D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	298,873,925円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	2,643,196円	D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	27,070,483円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	275,405円	D I AM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	51,781,571円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,559,857円	D I AM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	12,259,425円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	3,960,740円	D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,487,646円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,185,878円	D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	41,773,382円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	1,140,370円	D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	62,816,454円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,996,521,601円	D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,343,965,366円
One D C 先進国債券インデックスファンド	286,853,098円	D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,733,964,005円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	632,089,833円	D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,001,729,443円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,830,048,277円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	553,039,600円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,993,683,959円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	192,002,729円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	361,021,755円	D I AMアクサグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,181,197,557円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	767,057,750円	D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家向け)	541,945,752円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	628,680,822円	D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,548,316円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	16,652,719円	D I AM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	456,033,204円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	516,637,062円	D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	467,152,429円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	28,446,399円	D I AM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	632,499,155円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	125,346,778円	D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	66,775,811円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	95,961,436円	期末元本合計	69,085,269,493円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	160,485,652円		

■損益の状況

当期 自2020年2月22日 至2021年2月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,666,161,128	円
	受取利息	2,666,403,831	
	支払利息	△242,703	
(B)	有価証券売買損益	△1,147,059,846	
	売却益	6,089,848,393	
	売却損	△7,236,908,239	
(C)	その他の費用	△15,375,562	
(D)	当期損益金(A+B+C)	1,503,725,720	
(E)	前期繰越損益金	64,019,323,522	
(F)	解約差損益金	△19,145,002,454	
(G)	追加信託差損益金	21,574,218,073	
(H)	計(D+E+F+G)	67,952,264,861	
	次期繰越損益金(H)	67,952,264,861	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第14期 (決算日 2021年6月22日)

(計算期間 2020年6月23日～2021年6月22日)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率	純資産 総額
	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
10期 (2017年6月22日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
11期 (2018年6月22日)	13,477	△1.1	387.96	△0.9	97.9	-	177,029
12期 (2019年6月24日)	13,246	△1.7	381.67	△1.6	98.0	-	290,732
13期 (2020年6月22日)	13,888	4.8	400.89	5.0	96.9	-	454,858
14期 (2021年6月22日)	14,658	5.5	424.77	6.0	100.6	-	337,333
	14,333	△2.2	415.85	△2.1	97.9	-	573,974

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

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

(注4) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

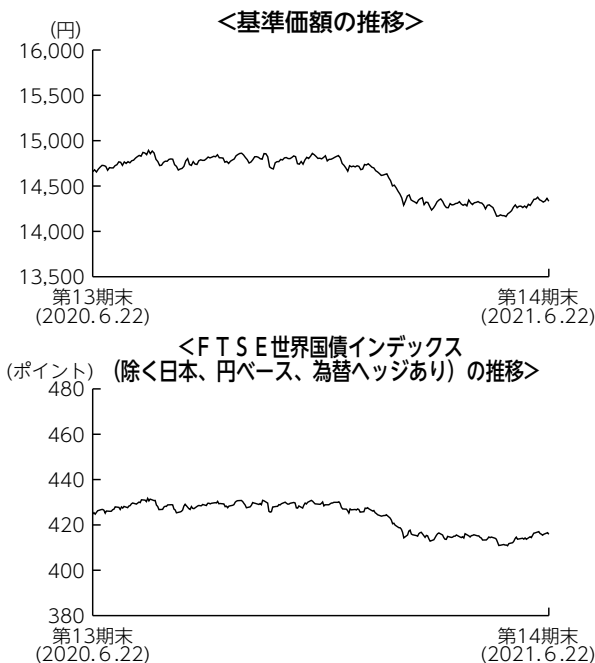
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債 イ ン デ ッ ク ス		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率		(除く日本、 円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 6 月 22 日	円 14,658	% -	ポイント 424.77	% -	% 100.6	% -
6 月 末	14,726	0.5	426.81	0.5	99.1	-
7 月 末	14,871	1.5	431.07	1.5	99.4	-
8 月 末	14,688	0.2	425.73	0.2	94.1	-
9 月 末	14,845	1.3	430.39	1.3	97.8	-
10 月 末	14,817	1.1	429.55	1.1	96.9	-
11 月 末	14,832	1.2	429.92	1.2	99.7	-
12 月 末	14,817	1.1	429.65	1.2	98.7	-
2021 年 1 月 末	14,727	0.5	427.12	0.6	99.2	-
2 月 末	14,289	△2.5	414.29	△2.5	100.9	-
3 月 末	14,263	△2.7	413.65	△2.6	100.1	-
4 月 末	14,248	△2.8	413.35	△2.7	98.6	-
5 月 末	14,277	△2.6	414.03	△2.5	98.6	-
(期 末) 2021 年 6 月 22 日	14,333	△2.2	415.85	△2.1	97.9	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年6月23日から2021年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は14,333円となり、前期末比で2.2%下落しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチンの普及や追加経済対策により米国の景気回復が加速するとの見方や、F R B（米連邦準備理事会）は金利上昇をさほど警戒していないとの見方、インフレ加速観測の高まりなどを背景に、米国債やドイツ国債の利回りが上昇（価格は下落）したことが基準価額の下落要因となりました。

投資環境

外国債券市場では、米国債やドイツ国債の利回りは上昇する展開となりました。米国債は、新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により米国の景気回復が加速するとの見方や、F R Bは金利上昇をさほど警戒していないとの見方、インフレ加速観測の高まりなどを背景に利回りは上昇しました。ドイツ国債についても、リスク選好の動きやイタリアの政局を巡る不透明感の後退、米金利上昇などを受けて利回りは上昇しました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.1%下落しました。

当ファンドはベンチマークを0.1%下回りました。債券時価の採用基準が異なることを除くと、概ねベンチマークに連動した結果となりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) その他費用 (保管費用)	2円	0.012%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(0)	(0.001)	
合 計	2	0.012	
期中の平均基準価額は14,607円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2020年6月23日から2021年6月22日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 3,251,768	千アメリカ・ドル 2,326,770 (-)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 186,546	千カナダ・ドル 135,120 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 244,837	千オーストラリア・ドル 194,652 (-)
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 36,086	千シンガポール・ドル 26,028 (-)
	イギリス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 360,190	千イギリス・ポンド 267,969 (-)
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シェケル 102,748	千イスラエル・シェケル 57,560 (-)
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 197,936	千デンマーク・クローネ 148,890 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 130,127	千ノルウェー・クローネ 81,868 (-)
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 187,335	千スウェーデン・クローナ 107,417 (-)
メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 1,013,645	千メキシコ・ペソ 732,853 (-)	

			買 付 額	売 付 額		
外	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リングgit 112,621	千マレーシア・リングgit 71,320 (-)		
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 162,423	千ポーランド・ズロチ 116,429 (-)		
国	ユ	アイルランド	千ユーロ 48,144	千ユーロ 33,160 (-)		
		オランダ	国債証券	112,226	81,970 (-)	
	ベルギー	国債証券	145,254	111,715 (-)		
	イ	フランス	国債証券	649,452	481,045 (-)	
		ドイツ	国債証券	480,601	356,831 (-)	
		スペイン	国債証券	371,387	278,485 (-)	
		ロ	イタリア	国債証券	584,798	440,118 (-)
			フィンランド	国債証券	35,123	24,494 (-)
			オーストリア	国債証券	85,246	62,339 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2020年6月23日から2021年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 2,200,010	千アメリカ・ドル 2,281,074	千円 251,556,942	% 43.8	% -	% 19.2	% 17.7	% 6.9	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 123,980	千カナダ・ドル 129,214	千円 11,506,558	2.0	-	0.9	0.6	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 134,710	千オーストラリア・ドル 143,827	千円 11,930,532	2.1	-	1.5	0.4	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 26,130	千シンガポール・ドル 28,519	千円 2,338,281	0.4	-	0.2	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 199,470	千イギリス・ポンド 241,090	千円 36,983,218	6.4	-	4.9	1.1	0.5	
イスラエル	千イスラエル・シケル 66,430	千イスラエル・シケル 74,122	千円 2,502,978	0.4	-	0.2	0.2	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 125,820	千デンマーク・クローネ 150,861	千円 2,664,210	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 104,570	千ノルウェー・クローネ 106,983	千円 1,373,665	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 136,140	千スウェーデン・クローナ 148,585	千円 1,918,241	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 755,616	千メキシコ・ペソ 803,301	千円 4,315,898	0.8	-	0.4	0.3	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 96,580	千マレーシア・リンギット 100,624	千円 2,678,100	0.5	-	0.3	0.1	0.1	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 114,790	千ポーランド・ズロチ 119,136	千円 3,453,567	0.6	-	0.3	0.2	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	32,020	35,650	4,680,950	0.8	-	0.6	0.2	0.1	
オランダ	71,370	83,111	10,912,566	1.9	-	1.4	0.5	0.0	
ベルギー	85,610	101,871	13,375,741	2.3	-	1.8	0.5	0.0	
フランス	377,300	436,996	57,377,617	10.0	-	6.4	2.6	1.0	
ドイツ	285,290	327,715	43,029,089	7.5	-	4.6	1.9	1.0	
スペイン	220,030	255,804	33,587,121	5.9	-	3.9	1.5	0.5	
イタリア	358,000	408,439	53,628,139	9.3	-	5.6	2.7	1.0	
フィンランド	24,760	26,709	3,507,000	0.6	-	0.3	0.2	0.0	
オーストリア	55,480	63,858	8,384,606	1.5	-	0.9	0.5	0.1	
合 計	-	-	千円 561,705,029	97.9	-	53.8	31.9	12.2	

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	7,280	7,874	868,413		2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	5,160	5,509	607,633		2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	8,160	8,556	943,578		2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	8,180	8,380	924,149		2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	10,820	11,417	1,259,136		2024/01/31
US T N/B 2.375 01/31/23	国債証券	2.3750	5,560	5,755	634,665		2023/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24	国債証券	0.1250	13,000	12,918	1,424,623		2024/01/15
US T N/B 1.5 01/15/23	国債証券	1.5000	8,000	8,165	900,470		2023/01/15
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	6,020	6,183	681,883		2027/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	7,340	7,540	831,525		2025/01/31
US T N/B 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	11,630	11,616	1,281,053		2023/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	15,270	14,847	1,637,337		2028/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	14,420	14,118	1,556,941		2026/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	1,810	2,238	246,841		2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	4,040	4,797	529,103		2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	4,760	5,654	623,562		2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	6,270	6,751	744,503		2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	2,390	2,976	328,267		2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	2,290	3,109	342,864		2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	1,910	2,614	288,322		2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	3,470	5,065	558,670		2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	5,280	6,786	748,455		2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	10,860	12,911	1,423,929		2049/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	1,890	2,592	285,857		2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	2,790	3,986	439,623		2040/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	20,240	19,171	2,114,186		2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	12,800	13,260	1,462,423		2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	9,670	10,398	1,146,721		2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	8,500	10,030	1,106,108		2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	10,760	12,737	1,404,699		2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	16,470	17,499	1,929,831		2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	11,220	11,780	1,299,160		2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	14,530	15,918	1,755,532		2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	15,000	16,515	1,821,300		2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	14,780	15,226	1,679,218		2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	13,150	14,049	1,549,372		2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	8,810	9,217	1,016,463		2024/02/29
US T N/B 1.5 02/28/23	国債証券	1.5000	7,620	7,781	858,157		2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	5,520	5,940	655,091		2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	6,290	6,777	747,419		2025/02/28
US T N/B 2.375 02/29/24	国債証券	2.3750	5,800	6,107	673,504		2024/02/29
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	5,370	5,585	615,961		2023/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	24,380	23,616	2,604,396		2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	16,620	16,175	1,783,810		2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	13,510	13,165	1,451,937		2050/02/15
US T N/B 1.375 02/15/23	国債証券	1.3750	7,680	7,829	863,426		2023/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	3,840	3,862	425,973		2027/02/28
US T N/B 0.125 02/28/23	国債証券	0.1250	20,510	20,481	2,258,662		2023/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	16,730	16,860	1,859,398		2030/02/15
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	16,350	16,238	1,790,822		2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	7,790	7,931	874,719		2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	14,380	14,315	1,578,702		2028/02/29

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	償還年月日	外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	16,930	16,658	1,837,138		2026/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	13,170	13,791	1,520,922		2024/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	7,740	7,910	872,405		2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	4,430	4,755	524,417		2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	7,630	8,130	896,655		2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	6,720	6,990	770,956		2023/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	6,260	6,118	674,711		2027/03/31
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	20,260	20,173	2,224,759		2024/03/15
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	11,090	11,031	1,216,555		2025/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	14,120	14,155	1,561,046		2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	16,930	16,844	1,857,632		2026/03/31
US T N/B 0.5 03/15/23	国債証券	0.5000	7,000	7,034	775,744		2023/03/15
US T N/B 0.125 03/31/23	国債証券	0.1250	15,000	14,972	1,651,162		2023/03/31
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	6,920	7,507	827,914		2025/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	6,860	7,164	790,150		2024/04/30
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	8,000	8,200	904,364		2023/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	4,280	4,585	505,665		2026/04/30
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	7,660	8,011	883,484		2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	8,000	8,412	927,730		2024/04/30
US T N/B 0.25 04/15/23	国債証券	0.2500	8,130	8,132	896,821		2023/04/15
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	8,000	8,016	884,066		2028/04/30
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	20,340	20,308	2,239,590		2024/04/15
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	7,490	7,254	800,055		2027/04/30
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	15,000	14,916	1,645,024		2026/04/30
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	11,870	11,738	1,294,501		2025/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	2,000	2,817	310,765		2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	2,770	3,854	425,052		2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	3,500	4,892	539,557		2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	3,270	3,808	419,948		2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	3,000	4,086	450,640		2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	9,540	10,905	1,202,689		2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	6,000	7,439	820,457		2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	4,120	4,829	532,605		2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	6,010	7,096	782,627		2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	6,280	6,765	746,069		2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	9,900	11,996	1,323,005		2048/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	12,110	10,385	1,145,339		2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	11,490	13,360	1,473,419		2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	2,140	2,976	328,250		2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	10,000	10,289	1,134,763		2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	15,300	16,211	1,787,796		2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	10,360	10,937	1,206,230		2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	17,170	19,058	2,101,719		2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	13,450	14,491	1,598,103		2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	15,900	17,093	1,885,029		2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	1,450	2,106	232,250		2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	13,210	13,685	1,509,209		2026/05/15
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	5,460	5,605	618,169		2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	8,440	8,822	972,938		2024/05/31
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	14,140	11,452	1,263,020		2050/05/15
US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	1.7500	2,220	2,255	248,685		2022/05/31
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	7,070	7,495	826,612		2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	6,000	6,078	670,390		2031/05/15
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	7,220	7,569	834,757		2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	4,550	4,939	544,718		2025/05/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	9,610	9,294	1,024,975		2027/05/31
US T N/B 0.125 05/31/22	国債証券	0.1250	8,000	8,002	882,532		2022/05/31
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	8,630	8,610	949,597		2023/05/15
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	5,000	4,971	548,233		2024/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	20,990	19,572	2,158,484		2030/05/15
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	8,970	8,816	972,248		2025/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	8,960	9,161	1,010,379		2023/06/30
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	6,710	7,018	774,000		2024/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	3,820	3,899	430,089		2022/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	5,150	5,567	613,976		2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	4,920	5,154	568,456		2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	8,780	9,197	1,014,326		2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	6,760	7,020	774,235		2024/06/30
US T N/B 1.75 06/30/22	国債証券	1.7500	5,160	5,247	578,669		2022/06/30
US T N/B 1.75 06/15/22	国債証券	1.7500	3,700	3,759	414,650		2022/06/15
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	10,800	10,434	1,150,687		2027/06/30
US T N/B 0.25 06/15/23	国債証券	0.2500	12,910	12,908	1,423,603		2023/06/15
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	8,990	8,826	973,331		2025/06/30
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	6,170	6,482	714,874		2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	8,400	8,573	945,458		2023/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	5,270	5,729	631,824		2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	5,000	5,238	577,720		2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	8,000	8,314	916,909		2024/07/31
US T N/B 1.875 07/31/22	国債証券	1.8750	3,950	4,026	444,088		2022/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	8,860	9,322	1,028,034		2023/07/31
US T N/B 1.75 07/15/22	国債証券	1.7500	2,940	2,991	329,903		2022/07/15
US T N/B 0.125 07/31/22	国債証券	0.1250	11,110	11,111	1,225,378		2022/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	9,000	8,973	989,612		2023/07/15
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	11,250	10,768	1,187,583		2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	8,980	8,807	971,320		2025/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	2,390	2,696	297,328		2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	3,000	3,877	427,584		2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	1,600	2,069	228,238		2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	2,580	3,376	372,324		2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	4,500	5,045	556,392		2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	7,650	9,128	1,006,702		2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	2,510	3,523	388,561		2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	5,050	6,465	713,045		2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	7,480	8,595	947,951		2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	14,040	14,765	1,628,287		2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	7,630	8,617	950,330		2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	12,260	12,603	1,389,953		2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	10,000	10,475	1,155,226		2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	15,210	16,108	1,776,427		2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	6,730	6,913	762,391		2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	11,340	13,450	1,483,348		2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	11,540	12,335	1,360,323		2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	11,430	11,753	1,296,198		2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	12,860	14,287	1,575,643		2028/08/15
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	2,920	2,971	327,665		2022/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	6,430	6,964	768,099		2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	7,880	8,067	889,645		2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	11,760	12,008	1,324,299		2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	8,000	8,164	900,367		2022/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	7,030	7,334	808,822		2024/08/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	7,030	7,407	816,908		2023/08/31
US T N/B 1.625 08/31/22	国債証券	1.6250	3,930	3,998	440,967		2022/08/31
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	4,680	4,754	524,335		2022/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	11,040	9,435	1,040,526		2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	14,630	12,232	1,348,950		2050/08/15
US T N/B 0.125 08/31/22	国債証券	0.1250	6,920	6,920	763,227		2022/08/31
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	29,840	27,730	3,058,088		2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	4,750	4,855	535,493		2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	8,400	8,597	948,171		2024/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	9,920	9,715	1,071,371		2025/08/31
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	8,310	8,282	913,383		2023/08/15
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	10,590	10,197	1,124,526		2027/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	6,360	6,963	767,902		2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	6,400	6,732	742,487		2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	9,820	10,058	1,109,304		2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	3,650	3,725	410,839		2022/09/30
US T N/B 1.875 09/30/22	国債証券	1.8750	3,270	3,342	368,630		2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	7,810	8,265	911,550		2023/09/30
US T N/B 1.5 09/15/22	国債証券	1.5000	8,410	8,551	943,069		2022/09/15
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	12,630	12,580	1,387,395		2023/09/15
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	13,470	12,846	1,416,710		2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	3,820	3,952	435,898		2026/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	13,480	13,190	1,454,694		2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	6,490	6,695	738,362		2024/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	6,560	6,929	764,186		2024/10/31
US T N/B 1.875 10/31/22	国債証券	1.8750	4,000	4,094	451,510		2022/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	5,620	6,155	678,845		2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	9,650	9,944	1,096,668		2023/10/31
US T N/B 2.0 10/31/22	国債証券	2.0000	2,720	2,788	307,484		2022/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	9,430	9,993	1,102,093		2023/10/31
US T N/B 1.375 10/15/22	国債証券	1.3750	5,500	5,588	616,348		2022/10/15
US T N/B 0.125 10/31/22	国債証券	0.1250	7,910	7,906	871,974		2022/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	5,100	5,277	582,025		2026/10/31
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	13,940	13,877	1,530,397		2023/10/15
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	8,000	8,255	910,361		2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	10,000	9,603	1,059,075		2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	13,510	13,200	1,455,720		2025/10/31
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,700	2,179	240,364		2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,050	2,685	296,103		2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	7,070	8,271	912,164		2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	3,320	4,555	502,369		2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	4,920	5,515	608,195		2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	3,780	4,481	494,205		2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	6,300	8,224	907,046		2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	9,540	10,784	1,189,292		2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	17,120	15,252	1,682,084		2050/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	3,370	3,959	436,681		2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	7,030	8,105	893,829		2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	14,440	15,259	1,682,764		2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	2,700	3,738	412,275		2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	10,850	13,765	1,518,107		2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	11,710	12,372	1,364,422		2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	15,100	16,053	1,770,410		2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	15,380	17,376	1,916,268		2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	8,330	8,504	937,902		2022/11/15

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額	
				千円	千円		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	19,530	20,657	2,278,114	2023/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	10,830	11,417	1,259,134	2026/11/15	
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	12,020	12,334	1,360,206	2022/11/30	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	12,650	13,522	1,491,223	2027/11/15	
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	8,000	8,346	920,493	2023/11/30	
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	6,670	7,021	774,299	2024/11/30	
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	6,140	6,697	738,641	2025/11/30	
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	8,670	9,203	1,014,951	2023/11/30	
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	20,540	18,340	2,022,620	2040/11/15	
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	5,310	5,492	605,739	2026/11/30	
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	6,900	7,111	784,265	2029/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	32,530	30,860	3,403,273	2030/11/15	
US T N/B 0.25 11/15/23	国債証券	0.2500	12,280	12,256	1,351,699	2023/11/15	
US T N/B 0.125 11/30/22	国債証券	0.1250	8,450	8,443	931,137	2022/11/30	
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	14,510	14,028	1,547,032	2027/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	9,140	9,431	1,040,127	2024/11/30	
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	15,540	15,251	1,681,953	2025/11/30	
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	8,000	8,373	923,422	2023/12/31	
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	7,320	7,736	853,161	2023/12/31	
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	6,300	6,809	750,942	2025/12/31	
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	7,210	7,626	841,024	2024/12/31	
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	10,620	10,928	1,205,165	2022/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	4,990	5,194	572,867	2026/12/31	
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	10,000	9,944	1,096,725	2023/12/15	
US T N/B 1.625 12/15/22	国債証券	1.6250	8,600	8,785	968,858	2022/12/15	
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	8,300	8,638	952,616	2024/12/31	
US T N/B 0.125 12/31/22	国債証券	0.1250	10,000	9,990	1,101,766	2022/12/31	
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	11,070	10,850	1,196,574	2025/12/31	
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	14,160	13,672	1,507,855	2027/12/31	
小計	—	—	2,200,010	2,281,074	251,556,942	—	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 0.25 02/01/23	国債証券	0.2500	5,650	5,637	502,044	2023/02/01	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	3,660	3,822	340,410	2024/03/01	
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	4,490	4,591	408,896	2023/03/01	
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	2,200	2,238	199,375	2025/03/01	
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	5,260	5,085	452,865	2026/03/01	
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	8,430	8,343	742,950	2024/04/01	
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	9,340	9,306	828,766	2023/05/01	
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,400	1,434	127,775	2026/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,440	1,926	171,516	2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	2,240	3,255	289,883	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	1,480	2,172	193,416	2037/06/01	
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	2,620	2,763	246,087	2024/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	1,960	2,701	240,528	2041/06/01	
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	2,950	3,019	268,897	2022/06/01	
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	3,110	3,173	282,612	2023/06/01	
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	2,370	2,500	222,642	2028/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	2,800	2,959	263,565	2025/06/01	
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	2,850	2,835	252,533	2027/06/01	
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	1,910	2,053	182,842	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	7,990	7,911	704,526	2030/06/01	
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,200	2,204	196,345	2031/06/01	
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	2,150	2,206	196,448	2024/09/01	
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	6,220	6,423	571,999	2023/09/01	
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	3,000	3,024	269,343	2022/09/01	

銘柄	当		期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	6,690	6,587	586,629	2025/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	3,410	3,400	302,855	2026/09/01
CANADA 0.25 11/01/22	国債証券	0.2500	2,450	2,446	217,877	2022/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	2,570	3,419	304,549	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	3,080	3,679	327,677	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	6,910	7,127	634,661	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	2,190	2,727	242,851	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	8,960	8,233	733,180	2030/12/01
小計	—	—	123,980	129,214	11,506,558	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	2,970	3,402	282,220	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	5,320	5,856	485,767	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	6,290	7,657	635,219	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	3,190	3,428	284,385	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	5,440	6,339	525,884	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	8,510	9,352	775,800	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	6,200	7,139	592,258	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	2,890	3,800	315,265	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	2,970	3,721	308,701	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	4,220	4,530	375,830	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	8,040	8,810	730,863	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	3,040	3,346	277,608	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	5,110	4,953	410,899	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	2,150	2,543	210,985	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	6,120	6,135	508,909	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	1,740	1,947	161,564	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	4,130	3,586	297,533	2051/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	2,540	2,694	223,533	2022/07/15
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	5,270	5,173	429,114	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	3,750	4,172	346,111	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	4,420	4,883	405,062	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	5,760	6,405	531,352	2029/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	4,270	4,404	365,315	2022/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	2,410	2,449	203,185	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	7,880	7,486	621,019	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	4,430	4,341	360,133	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	6,940	6,890	571,583	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	8,710	8,371	694,421	2030/12/21
小計	—	—	134,710	143,827	11,930,532	—
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	930	965	79,163	2024/02/01
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	1,810	1,849	151,633	2023/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	2,090	2,375	194,783	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	2,080	2,458	201,577	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	1,340	1,370	112,328	2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	1,280	1,480	121,423	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	1,250	1,370	112,326	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	1,230	1,311	107,503	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	1,450	1,539	126,236	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	1,530	1,707	139,996	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	780	848	69,539	2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	1,780	1,862	152,728	2023/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	1,500	1,590	130,402	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	1,790	1,926	157,916	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	820	847	69,450	2022/09/01

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額	
				千シンガポール・ドル	千円		
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	2,200	2,468	202,423	2030/09/01	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	1,540	1,824	149,623	2033/09/01	
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	730	722	59,224	2025/11/01	
小計	—	—	26,130	28,519	2,338,281	—	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	4,970	6,970	1,069,351	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	4,750	6,975	1,070,068	2045/01/22	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	2,990	5,664	868,864	2060/01/22	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	3,090	3,472	532,617	2049/01/22	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	2,240	2,063	316,556	2046/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	9,620	9,595	1,471,877	2024/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	4,870	4,728	725,428	2028/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	7,480	7,481	1,147,638	2023/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	5,610	5,542	850,161	2026/01/30	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	3,650	4,287	657,635	2025/03/07	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	4,190	6,015	922,753	2036/03/07	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	2,860	2,924	448,557	2024/04/22	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	4,910	6,632	1,017,475	2032/06/07	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	3,610	3,658	561,242	2025/06/07	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	5,480	5,813	891,826	2047/07/22	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	3,690	6,124	939,498	2052/07/22	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	5,170	6,064	930,240	2057/07/22	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	3,480	5,160	791,668	2065/07/22	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	4,690	8,841	1,356,258	2068/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	3,170	3,344	513,085	2026/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	3,760	3,930	602,946	2027/07/22	
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	5,230	5,254	806,061	2022/07/22	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	4,000	4,052	621,607	2023/07/22	
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	2,750	2,582	396,086	2031/07/31	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	6,520	6,122	939,207	2035/07/31	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	2,720	4,105	629,854	2039/09/07	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	4,920	5,149	789,884	2023/09/07	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	2,560	2,765	424,215	2024/09/07	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	2,750	2,945	451,763	2025/09/07	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	3,160	4,531	695,176	2034/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	5,560	6,069	931,040	2037/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	5,000	5,100	782,394	2022/09/07	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	3,460	3,860	592,215	2054/10/22	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	2,960	2,365	362,824	2061/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	1,420	1,742	267,288	2071/10/22	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	4,320	4,344	666,445	2041/10/22	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	3,970	3,385	519,365	2050/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	4,480	4,812	738,168	2028/10/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	3,840	3,890	596,819	2029/10/22	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	4,180	4,018	616,499	2030/10/22	
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	810	805	123,601	2026/10/22	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	1,450	2,017	309,444	2028/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	3,560	5,613	861,045	2038/12/07	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	4,510	7,328	1,124,201	2042/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	3,860	6,414	984,047	2046/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	3,520	6,589	1,010,787	2055/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	3,280	4,057	622,427	2027/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	3,190	4,899	751,619	2040/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	4,100	5,588	857,207	2030/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	3,110	5,385	826,162	2049/12/07	
小計	—	—	199,470	241,090	36,983,218	—	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨換算金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(イスラエル)		%	千イスラエル・シユケル	千イスラエル・シユケル	千円		
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	4,900	7,730	261,043	2042/01/31	
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	6,420	8,133	274,651	2047/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	4,340	4,666	157,565	2027/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	5,070	5,558	187,705	2024/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	4,560	4,493	151,728	2030/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	5,570	5,973	201,730	2023/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	4,270	4,285	144,700	2025/04/30	
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	3,710	3,494	117,999	2037/05/31	
ISRAEL FIXED BOND 0.15 07/31/23	国債証券	0.1500	6,060	6,052	204,370	2023/07/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	4,500	4,746	160,264	2025/08/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	4,620	5,049	170,513	2028/09/28	
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	4,450	5,779	195,150	2026/10/30	
ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	国債証券	1.5000	4,730	4,877	164,717	2023/11/30	
ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	国債証券	1.2500	3,230	3,282	110,837	2022/11/30	
小計	-	-	66,430	74,122	2,502,978	-	
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円		
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	10,300	9,249	163,344	2052/11/15	
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	28,760	50,439	890,755	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	16,950	18,576	328,052	2025/11/15	
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	15,600	16,367	289,044	2023/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	17,770	18,603	328,542	2027/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	25,320	26,529	468,518	2029/11/15	
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	6,420	6,350	112,153	2031/11/15	
DENMARK 0.25 11/15/22	国債証券	0.2500	4,700	4,745	83,798	2022/11/15	
小計	-	-	125,820	150,861	2,664,210	-	
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円		
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	10,870	11,052	141,912	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	9,840	10,105	129,756	2027/02/17	
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	12,640	13,367	171,637	2024/03/14	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	10,570	10,849	139,305	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	9,620	10,049	129,036	2028/04/26	
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	19,260	19,770	253,848	2023/05/24	
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	11,960	11,892	152,700	2030/08/19	
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	10,710	10,994	141,170	2029/09/06	
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	9,100	8,901	114,296	2031/09/17	
小計	-	-	104,570	106,983	1,373,665	-	
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円		
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	11,420	16,721	215,880	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	13,480	14,048	181,363	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	24,440	26,993	348,485	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	11,990	11,703	151,093	2031/05/12	
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	13,110	13,582	175,354	2022/06/01	
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	6,600	7,893	101,899	2032/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	21,900	22,824	294,670	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	18,290	19,283	248,945	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	14,910	15,534	200,548	2029/11/12	
小計	-	-	136,140	148,585	1,918,241	-	
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	74,714	73,068	392,572	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	66,830	68,555	368,327	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	67,501	74,970	402,792	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	52,700	56,121	301,523	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	69,445	72,913	391,741	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	24,139	24,501	131,636	2022/06/09	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	57,570	60,971	327,581	2024/09/05	

銘柄	当期						償還年月日	
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額		邦貨換算金額
				外貨建金額	邦貨換算金額			
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円			
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	41,418	42,878	230,373		2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	58,126	61,681	331,396		2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	48,613	54,045	290,372		2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	18,223	23,038	123,780		2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	19,311	20,581	110,576		2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	58,893	66,314	356,288		2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	98,133	103,659	556,933		2023/12/07	
小計	-	-	755,616	803,301	4,315,898		-	
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円			
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	1,370	1,445	38,482		2027/03/15	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	2,000	2,109	56,153		2046/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	5,610	5,758	153,272		2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,030	3,267	86,970		2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	3,050	3,322	88,425		2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	2,390	2,419	64,381		2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	3,730	4,078	108,546		2037/04/07	
MALAYSIA 3.757 04/20/23	国債証券	3.7570	3,160	3,263	86,850		2023/04/20	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	2,490	2,357	62,743		2031/04/15	
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	3,950	3,730	99,285		2040/05/22	
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	2,200	2,292	61,020		2035/05/31	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	3,590	3,758	100,019		2028/06/15	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	3,000	3,189	84,891		2031/06/30	
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	1,430	1,583	42,141		2038/06/08	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	3,330	3,445	91,693		2024/06/14	
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	4,320	4,187	111,449		2050/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,480	2,620	69,753		2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	3,400	3,679	97,918		2048/07/06	
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	2,130	2,250	59,902		2026/07/15	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	5,150	5,164	137,456		2034/07/05	
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	5,910	6,206	165,191		2029/08/15	
MALAYSIA 3.8 08/17/23	国債証券	3.8000	3,070	3,185	84,768		2023/08/17	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	7,840	8,288	220,599		2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,970	2,158	57,450		2043/09/30	
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	2,600	2,743	73,014		2024/09/30	
MALAYSIA 3.795 09/30/22	国債証券	3.7950	2,600	2,663	70,875		2022/09/30	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	4,140	4,372	116,384		2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	4,240	4,480	119,247		2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	2,400	2,600	69,208		2033/11/07	
小計	-	-	96,580	100,624	2,678,100		-	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円			
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	7,660	7,932	229,940		2023/01/25	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	120	156	4,550		2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	9,310	10,087	292,417		2028/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	10,950	11,529	334,211		2024/04/25	
POLAND 04/25/23	国債証券	0.0000	3,410	3,387	98,187		2023/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	7,980	7,941	230,206		2025/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	10,300	10,921	316,586		2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	9,190	10,006	290,069		2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	8,290	8,807	255,309		2027/07/25	
POLAND 07/25/22	国債証券	-	4,910	4,909	142,304		2022/07/25	
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	4,000	4,282	124,142		2022/09/23	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	7,940	8,601	249,347		2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	4,360	4,742	137,467		2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	6,870	7,207	208,928		2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	16,800	16,080	466,145		2030/10/25	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド) POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	% 0.2500	千ポーランド・ズロチ 2,700	千ポーランド・ズロチ 2,544	千円 73,752	2026/10/25
小計	-	-	114,790	119,136	3,453,567	-
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	2,060	2,631	345,483	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	1,420	1,592	209,031	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	2,290	2,537	333,224	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	2,730	3,329	437,157	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	2,320	2,501	328,461	2023/03/20
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	990	968	127,203	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	1,480	1,714	225,121	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	1,740	1,949	256,001	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	2,610	3,159	414,805	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	2,160	2,316	304,121	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	2,280	2,483	326,132	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	2,740	2,922	383,752	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	1,600	1,896	248,992	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	1,330	1,329	174,612	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	1,720	1,765	231,762	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	730	715	93,962	2031/10/18
IRISH 10/18/22	国債証券	0.0000	160	161	21,173	2022/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	1,660	1,675	219,950	2030/10/18
小計	-	-	32,020	35,650	4,680,950	-
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.5000	590	666	87,483	2023/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	3,900	6,668	875,519	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	3,920	6,299	827,119	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	2,130	1,894	248,775	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	2,670	3,715	487,854	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	4,220	6,737	884,653	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	3,620	4,676	614,082	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	2,970	3,116	409,193	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	9,280	9,441	1,239,707	2024/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	4,060	4,155	545,589	2027/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	5,010	5,264	691,174	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	6,450	6,775	889,568	2026/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	3,650	3,948	518,396	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	3,530	3,648	479,027	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	3,660	3,937	517,005	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	4,170	4,463	586,062	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	2,920	3,032	398,136	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	3,340	3,382	444,158	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,280	1,287	169,055	2031/07/15
小計	-	-	71,370	83,111	10,912,566	-
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	4,660	6,513	855,264	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	4,270	7,144	938,032	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	2,590	3,209	421,362	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	1,950	2,764	362,980	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	4,010	6,548	859,766	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	2,400	2,695	353,910	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	2,230	3,692	484,835	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	2,770	3,260	428,145	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	4,450	5,360	703,869	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	370	513	67,474	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	1,340	1,887	247,796	2066/06/22

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額	千円	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	1,420	1,175	154,341	2071/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	4,340	4,649	610,450	2026/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	4,100	4,497	590,477	2024/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	3,110	3,403	446,825	2031/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	5,250	5,557	729,678	2023/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	4,570	4,906	644,204	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	1,060	1,014	133,175	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	4,270	4,613	605,810	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	2,140	2,880	378,190	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	2,380	2,913	382,494	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	4,720	4,970	652,567	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	3,060	3,265	428,709	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	60	68	9,050	2037/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	3,100	3,129	410,937	2030/06/22	
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	1,380	1,466	192,575	2022/09/28	
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	2,820	2,922	383,787	2024/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	2,190	2,160	283,615	2031/10/22	
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	2,610	2,661	349,495	2023/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	1,990	2,025	265,917	2027/10/22	
小計	-	-	85,610	101,871	13,375,741	-	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	国債証券	0.0000	4,660	4,709	618,306	2023/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	2,000	2,031	266,793	2027/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	11,570	11,785	1,547,480	2026/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	5,490	5,575	732,066	2024/02/25	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	9,810	9,970	1,309,146	2024/03/25	
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	11,000	11,205	1,471,315	2025/03/25	
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	10,860	10,980	1,441,707	2023/03/25	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,480	1,730	227,228	2023/04/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	10,550	12,568	1,650,206	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	10,430	18,045	2,369,333	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	3,510	6,615	868,588	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	3,520	6,928	909,668	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	8,210	11,854	1,556,479	2029/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	6,130	9,813	1,288,574	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	6,450	10,018	1,315,483	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	6,760	8,666	1,137,905	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	9,140	10,577	1,388,766	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	6,860	6,516	855,665	2052/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	4,810	6,013	789,602	2066/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	2,000	1,532	201,216	2072/05/25	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	7,080	7,673	1,007,501	2024/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	11,550	14,135	1,855,927	2030/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	11,660	12,423	1,631,205	2028/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	12,910	14,703	1,930,536	2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	11,200	11,639	1,528,291	2025/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	12,050	12,605	1,655,142	2029/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	10,120	11,301	1,483,873	2034/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	9,150	9,556	1,254,706	2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	8,200	8,832	1,159,696	2027/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	3,370	3,292	432,325	2040/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	15,040	15,730	2,065,393	2023/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	10,080	11,253	1,477,559	2036/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	6,940	8,386	1,101,148	2039/06/25	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,360	1,294	170,004	2044/06/25	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額	千円	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	11,620	12,954	1,700,986	2023/10/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,220	2,852	374,527	2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	12,790	15,264	2,004,293	2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	6,160	9,758	1,281,304	2038/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	8,090	13,183	1,730,986	2032/10/25	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	9,150	9,509	1,248,588	2022/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	9,090	9,809	1,288,044	2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	9,000	9,580	1,257,874	2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	10,210	10,538	1,383,735	2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	9,680	10,326	1,355,885	2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	2,400	2,359	309,819	2031/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	11,680	11,607	1,524,083	2030/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	9,260	9,281	1,218,636	2029/11/25	
小計	-	-	377,300	436,996	57,377,617	-	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	1,180	1,389	182,485	2024/01/04	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	890	1,254	164,651	2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	1,400	2,208	289,961	2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	5,340	8,354	1,096,992	2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	7,380	11,999	1,575,539	2037/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	7,100	7,403	972,101	2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	8,490	8,927	1,172,201	2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	6,540	6,862	901,052	2029/02/15	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	5,050	5,232	687,073	2023/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	8,050	8,569	1,125,160	2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	9,570	10,194	1,338,525	2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	7,650	7,988	1,048,901	2027/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	4,670	4,770	626,366	2031/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	7,490	7,691	1,009,940	2030/02/15	
BUNDESSCHAT 0.0 03/10/23	国債証券	0.0000	5,570	5,632	739,601	2023/03/10	
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	5,060	5,122	672,602	2023/04/14	
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	6,080	6,194	813,330	2024/04/05	
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	4,910	5,029	660,365	2025/04/11	
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	4,100	4,212	553,128	2026/04/10	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	5,390	5,734	752,962	2024/05/15	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	7,790	8,115	1,065,543	2023/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	5,640	5,631	739,428	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	2,480	2,453	322,185	2036/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	1,670	2,392	314,134	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	2,380	3,272	429,666	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	4,590	8,072	1,059,916	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	4,020	6,648	872,934	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	7,690	11,778	1,546,451	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	4,980	9,412	1,235,880	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	5,280	5,412	710,677	2022/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	5,840	9,597	1,260,168	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	6,680	10,446	1,371,623	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	8,930	11,257	1,478,084	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/45	国債証券	1.0000	6,350	6,783	890,683	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	8,390	8,909	1,169,810	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	9,270	9,537	1,252,275	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	6,430	6,740	885,070	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	6,230	6,593	865,791	2023/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	4,400	4,635	608,584	2024/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	7,680	7,896	1,036,761	2029/08/15	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	5,510	5,058	664,184	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	9,110	9,335	1,225,711	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,320	2,388	313,602	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	4,600	4,721	619,945	2022/09/04	
BUNDESSCHAT 0.0 09/16/22	国債証券	0.0000	2,230	2,248	295,240	2022/09/16	
BUNDESOWL 10/18/24	国債証券	0.0000	5,540	5,661	743,412	2024/10/18	
BUNDESOWL 10/07/22	国債証券	0.0000	3,790	3,823	502,046	2022/10/07	
BUNDESOWL 10/13/23	国債証券	0.0000	3,940	4,003	525,723	2023/10/13	
BUNDESOWL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	6,960	7,143	937,927	2025/10/10	
BUNDESOWL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,000	1,027	134,917	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	6,660	6,854	899,983	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,000	2,056	269,978	2028/11/15	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/22	国債証券	0.0000	3,000	3,029	397,792	2022/12/15	
小計	—	—	285,290	327,715	43,029,089	—	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	820	1,184	155,582	2029/01/31	
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	3,840	4,371	574,006	2024/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	5,260	7,833	1,028,589	2037/01/31	
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	5,480	6,004	788,429	2023/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	5,920	5,998	787,556	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,400	1,396	183,296	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	2,200	2,222	291,877	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	5,130	5,521	724,930	2025/04/30	
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	5,470	6,137	805,796	2024/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	4,340	4,747	623,293	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	5,170	5,718	750,902	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	5,310	5,797	761,265	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	6,430	7,064	927,633	2029/04/30	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	5,040	5,124	672,783	2030/04/30	
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	4,890	4,723	620,207	2031/04/30	
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	9,700	9,776	1,283,646	2023/04/30	
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	3,200	3,238	425,182	2024/05/31	
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	5,900	7,341	963,882	2026/07/30	
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	4,720	7,865	1,032,790	2040/07/30	
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	4,850	8,002	1,050,744	2041/07/30	
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	3,750	5,772	757,908	2066/07/30	
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	5,310	6,406	841,148	2025/07/30	
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	5,660	6,482	851,199	2030/07/30	
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	5,510	8,621	1,131,983	2032/07/30	
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	4,660	5,573	731,782	2033/07/30	
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	6,200	6,771	889,116	2028/07/30	
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	4,900	5,582	733,033	2035/07/30	
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	4,190	4,277	561,607	2024/07/30	
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	5,050	5,141	675,110	2023/07/30	
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	390	382	50,264	2037/07/30	
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	5,720	6,016	789,939	2027/07/30	
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	5,470	6,056	795,200	2024/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	5,630	7,714	1,012,951	2028/10/31	
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	3,530	6,369	836,365	2044/10/31	
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	4,920	6,639	871,747	2046/10/31	
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	3,730	4,889	641,932	2048/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	1,460	1,286	168,978	2071/10/31	
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	4,820	4,350	571,279	2050/10/31	
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	5,460	6,047	794,001	2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	5,390	5,891	773,568	2027/10/31	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額	
				千ユーロ	千円		
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	6,490	7,005	919,873	2026/10/31	
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	7,030	7,235	949,973	2029/10/31	
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	4,600	5,136	674,393	2023/10/31	
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	4,320	4,379	575,007	2022/10/31	
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	4,110	4,158	546,062	2040/10/31	
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	6,970	7,542	990,295	2030/10/31	
小計	—	—	220,030	255,804	33,587,121	—	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	4,800	4,953	650,407	2027/01/15	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	4,750	4,777	627,292	2024/01/15	
ITALY BTPS 0.05 01/15/23	国債証券	0.0500	4,100	4,128	542,028	2023/01/15	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	3,690	5,603	735,757	2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	5,720	7,859	1,031,923	2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	5,660	6,240	819,429	2028/02/01	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	5,200	5,275	692,632	2025/02/01	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	4,100	4,173	547,939	2026/02/01	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	4,830	5,769	757,526	2047/03/01	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	4,000	5,424	712,239	2048/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	5,190	5,846	767,612	2024/03/01	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	2,400	2,840	372,944	2067/03/01	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	1,380	1,346	176,754	2072/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	3,820	4,532	595,059	2025/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	6,500	7,835	1,028,748	2026/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	6,410	6,882	903,686	2032/03/01	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	4,440	5,598	735,066	2040/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	4,170	5,304	696,441	2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	6,860	8,486	1,114,282	2030/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	4,210	4,304	565,133	2023/03/15	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	4,070	4,159	546,202	2023/03/01	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	8,000	8,212	1,078,235	2036/03/01	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	3,700	3,844	504,756	2041/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	3,450	3,268	429,203	2037/03/01	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	5,610	5,536	726,943	2028/03/15	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	2,130	2,056	269,964	2045/04/30	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	5,930	6,255	821,383	2030/04/01	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	5,770	5,812	763,185	2031/04/01	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国債証券	0.0000	3,350	3,365	441,922	2024/04/15	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	2,430	2,413	316,921	2026/04/01	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	4,300	6,415	842,368	2031/05/01	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	5,480	5,974	784,504	2023/05/01	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	3,100	3,282	431,044	2024/05/15	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	3,120	3,296	432,876	2025/05/15	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	5,790	6,197	813,670	2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	4,010	4,248	557,766	2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	3,450	3,831	503,039	2027/06/01	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	国債証券	0.6000	4,500	4,584	601,963	2023/06/15	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	4,540	4,979	653,835	2026/07/15	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	4,630	4,894	642,636	2024/07/01	
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	国債証券	1.0000	3,050	3,096	406,521	2022/07/15	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	4,670	5,010	657,932	2025/07/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	3,950	5,802	761,822	2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	4,220	6,616	868,806	2039/08/01	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	5,830	6,453	847,308	2023/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	5,980	6,593	865,774	2027/08/01	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	4,790	5,692	747,480	2029/08/01	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	2,500	2,536	333,058	2022/08/01	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	2,880	2,806	368,471	2031/08/01	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	4,750	4,835	634,901	2030/08/01	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	3,710	3,757	493,358	2023/08/15	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	5,030	6,208	815,113	2038/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	5,560	8,861	1,163,557	2044/09/01	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	3,980	5,203	683,239	2046/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	5,660	7,352	965,415	2028/09/01	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	3,020	4,770	626,392	2040/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	3,480	3,966	520,756	2050/09/01	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	2,000	1,930	253,490	2051/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	8,170	9,456	1,241,575	2033/09/01	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	5,300	5,956	782,099	2024/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	2,660	3,862	507,096	2049/09/01	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	2,960	3,167	415,915	2022/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	4,130	4,686	615,366	2036/09/01	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	4,140	4,233	555,845	2022/09/15	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	5,100	5,283	693,669	2027/09/15	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	3,340	3,411	447,970	2023/10/15	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	10,900	11,578	1,520,267	2023/10/01	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,700	2,071	271,981	2023/11/01	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	2,150	2,956	388,127	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	3,400	4,703	617,532	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	6,940	9,543	1,253,112	2029/11/01	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	5,560	6,003	788,247	2022/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	4,690	4,936	648,098	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	3,550	3,929	515,963	2025/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	5,610	6,089	799,487	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	6,030	6,360	835,193	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	5,790	6,303	827,640	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	5,660	6,594	865,871	2028/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	5,570	6,004	788,343	2030/12/01	
小計	—	—	358,000	408,439	53,628,139	—	
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券	0.1250	940	819	107,636	2052/04/15	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	1,220	1,311	172,161	2024/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	980	1,054	138,390	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	980	1,192	156,615	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	2,170	2,271	298,292	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	1,250	1,399	183,696	2034/04/15	
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	1,400	1,454	190,996	2023/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	770	750	98,517	2036/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	1,500	1,779	233,604	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	1,470	1,786	234,593	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	1,080	1,564	205,357	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	1,560	1,642	215,721	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	1,360	1,441	189,214	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	990	1,043	137,031	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	1,620	1,704	223,794	2027/09/15	
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	150	154	20,246	2022/09/15	
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	2,050	2,079	272,996	2023/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	1,030	997	131,031	2040/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	1,280	1,284	168,659	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	960	978	128,444	2024/09/15	
小計	—	—	24,760	26,709	3,507,000	—	

銘柄	当期						償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額	千円	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	980	2,030	266,592	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	2,420	2,956	388,241	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	2,740	2,881	378,317	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	3,340	3,569	468,637	2028/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	1,960	1,954	256,594	2031/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	2,420	2,433	319,456	2030/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	2,490	3,125	410,319	2026/03/15	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	3,260	5,189	681,436	2037/03/15	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	1,230	1,263	165,907	2051/03/20	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	2,630	2,763	362,830	2027/04/20	
AUSTRIA 0.0 04/20/23	国債証券	0.0000	2,800	2,831	371,814	2023/04/20	
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	1,700	1,733	227,600	2025/04/20	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	1,960	2,512	329,952	2034/05/23	
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	890	811	106,613	2120/06/30	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	1,700	2,698	354,297	2044/06/20	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	360	505	66,361	2027/07/15	
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	2,330	2,358	309,691	2023/07/15	
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	2,700	2,746	360,656	2024/07/15	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	1,290	2,116	277,924	2117/09/20	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	2,520	2,708	355,685	2024/10/21	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	3,830	4,068	534,130	2026/10/20	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	5,040	5,415	711,049	2025/10/20	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	3,720	3,925	515,479	2023/10/20	
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	670	609	80,088	2040/10/20	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	500	646	84,924	2086/11/02	
小計	—	—	55,480	63,858	8,384,606	—	
合計	—	—	—	—	561,705,029	—	

■投資信託財産の構成

2021年6月22日現在

項目	当期		末
	評価額	比率	
公社債	千円		%
コール・ローン等、その他	561,705,029		97.5
投資信託財産総額	14,623,069		2.5
	576,328,099		100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、568,693,101千円、98.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.28円、1カナダ・ドル=89.05円、1オーストラリア・ドル=82.95円、1シンガポール・ドル=81.99円、1イギリス・ポンド=153.40円、1イスラエル・シェケル=33.768円、1デンマーク・クローネ=17.66円、1ノルウェー・クローネ=12.84円、1スウェーデン・クローナ=12.91円、1メキシコ・ペソ=5.372円、1マレーシア・リンギット=26.614円、1ポーランド・ズロチ=28.988円、1ユーロ=131.30円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,140,589,337,359円
コ ー ル ・ ロ ー ド 等	5,982,134,647
公 社 債(評価額)	561,705,029,522
未 収 入 金	569,916,164,537
未 収 利 息	2,003,307,375
前 払 費 用	982,701,278
(B) 負 債	566,615,189,847
未 払 金	566,323,774,847
未 払 解 約 金	291,415,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	573,974,147,512
元 本	400,458,673,144
次 期 繰 越 損 益 金	173,515,474,368
(D) 受 益 権 総 口 数	400,458,673,144口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	14,333円

(注1) 期首元本額 230,136,350,831円
追加設定元本額 565,675,279,033円
一部解約元本額 395,352,956,720円

(注2) 期末における元本の内訳

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	6,788,674,964円
たわらノーロード バランス (堅実型)	528,563,003円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,306,760,517円
たわらノーロード バランス (積極型)	601,658,116円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	33,167,612円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	956,952,163円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	1,094,138,891円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	373,876,086円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	193,021,332円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	6,563,892円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	8,588,779円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	39,583,884円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	7,433,473円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	8,941,807円
投資のソムリエ	212,878,283,847円
投資のソムリエ<DC年金>	11,145,267,997円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,623,250,466円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	68,534,931,432円
ワールドアセットバランス (基本コース)	2,973,015,177円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	9,383,512,628円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	148,535,733円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	71,515,133円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	63,837,100円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	482,714,372円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	29,613,002,313円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,310,479,003円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	111,230,426円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	53,757,770円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	50,943,220円
外国債券パッシブファンド2 (為替フルヘッジ)	(適格機関投資家限定) 19,937,006,424円
先進国債券パッシブファンド (為替ヘッジあり)	(適格機関投資家限定) 6,547,069,933円

投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	5,277,272,203円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	619,835,953円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	51,516,049円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	390,453,672円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	775,672,614円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	1,069,300,883円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA (1212) (適格機関投資家限定)	2,117,710,070円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA (1303) (適格機関投資家限定)	2,222,164,083円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA (1306) (適格機関投資家限定)	2,940,401,092円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA (1309) (適格機関投資家限定)	118,069,032円
期末元本合計	400,458,673,144円

■損益の状況

当期 自2020年6月23日 至2021年6月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	8,654,809,203	円
	受取利息	8,655,895,204	
	その他の収益	749,230	
	支払利息	△1,835,231	
(B)	有価証券売買損益	△21,700,070,063	
	売却益	66,281,476,334	
	売却損	△87,981,546,397	
(C)	その他の費用	△55,445,069	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△13,100,705,929	
(E)	前期繰越損益金	107,196,961,518	
(F)	解約差損益金	△177,175,094,188	
(G)	追加信託差損益金	256,594,312,967	
(H)	計(D+E+F+G)	173,515,474,368	
	次期繰越損益金(H)	173,515,474,368	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

■信託金の限度額を1兆円から5兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年1月8日)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第13期 (決算日 2021年4月19日)

(計算期間 2020年4月21日～2021年4月19日)

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2008年2月20日から無期限です。
運用方針	主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	海外の証券取引所に上場している株式*を主要投資対象とします。 ※DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCIエマージング・マーケット・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	投資信託 受益証券・ 投資証券 組入比率	純資産 総額
	円	期中騰落率	(円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	期中騰落率				
9期(2017年4月18日)	10,121	17.7	224,042.80	18.1	95.8	3.2	0.9	40,863
10期(2018年4月18日)	12,241	20.9	273,007.15	21.9	92.1	7.1	0.7	66,443
11期(2019年4月18日)	12,260	0.2	276,323.22	1.2	94.4	4.4	0.6	61,535
12期(2020年4月20日)	9,723	△20.7	225,442.54	△18.4	64.7	34.8	0.4	41,166
13期(2021年4月19日)	14,848	52.7	347,921.32	54.3	93.2	6.1	0.7	58,156

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) ベンチマークはMSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています(以下同じ)。

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

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

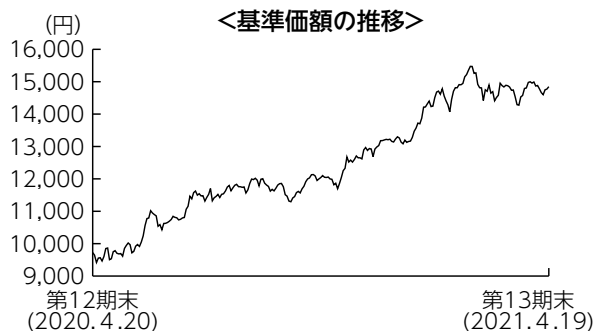
年 月 日	基 準 価 額		MSCIエマージング・ マーケット・インデックス (円換算ベース、 配当込み、 為替ハッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期 首) 2020年 4 月 20日	円 9,723	% -	ポイント 225,442.54	% -	% 64.7	% 34.8	% 0.4
4 月 末	9,849	1.3	227,970.80	1.1	81.4	18.0	0.6
5 月 末	9,914	2.0	231,228.40	2.6	80.9	18.6	0.5
6 月 末	10,751	10.6	249,884.32	10.8	81.8	17.6	0.6
7 月 末	11,425	17.5	265,622.22	17.8	86.3	13.2	0.6
8 月 末	11,961	23.0	277,724.79	23.2	78.8	21.3	0.5
9 月 末	11,453	17.8	266,257.94	18.1	88.4	11.3	0.5
10 月 末	11,865	22.0	276,133.80	22.5	86.6	10.9	0.5
11 月 末	12,924	32.9	301,472.79	33.7	88.8	11.2	0.6
12 月 末	13,281	36.6	309,849.39	37.4	88.8	11.1	0.6
2021年 1 月 末	14,286	46.9	333,543.05	48.0	87.4	11.5	0.5
2 月 末	14,808	52.3	348,027.62	54.4	90.2	9.4	0.6
3 月 末	14,790	52.1	346,561.35	53.7	90.6	8.8	0.7
(期 末) 2021年 4 月 19日	14,848	52.7	347,921.32	54.3	93.2	6.1	0.7

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年4月21日から2021年4月19日まで）

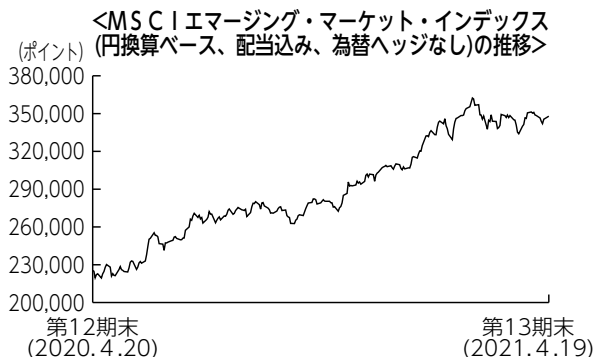


基準価額の推移

当期末の基準価額は14,848円となり、前期末比で52.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場ではブラジルレアルやトルコリラなど一部の通貨に対しては円高となったものの、経済活動正常化や米国などの金融緩和政策の長期化期待などから新興国株式市場が大きく上昇し、当ファンドの基準価額は大幅に上昇しました。



投資環境

新興国株式市場は大幅に上昇しました。前期後半には新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から急落しましたが、当期は中国の経済活動正常化に向けた動きや、米国の景気対策法案などへの期待などから上昇して始まりました。感染者数の急増や変異株の発生などから調整する局面もありましたが、ワクチン接種の進展や、米国などの金融緩和政策の長期化見通し、原油価格の上昇なども新興国市場の株価の押し上げに寄与しました。

為替市場では多くの通貨に対して円安となりました。米ドルは米国が金融緩和を積極的に進めたことが主な要因となり2020年は円高が進みましたが、米国の長期金利が上昇したことなどから期末にかけては反転し、前期末比では円安となり期末を迎えました。トルコやブラジルなど政権運営が不安視された通貨は売られた一方で、ワクチン接種の進展や経済活動再開への期待などによりリスク回避姿勢が後退したことで、多くの通貨は買われる展開となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	組入比率
1	銀行	9.9%
2	小売	7.2
3	メディア・娯楽	5.7
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.5
5	半導体・半導体製造装置	4.6
6	素材	4.4
7	エネルギー	3.8
8	電気通信サービス	2.8
9	保険	2.4
10	食品・飲料・タバコ	2.4

期末

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



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で54.3%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを1.6%下回りましたが、ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当課税の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券)	16円 (13) (0) (3) (0) (0)	0.129% (0.103) (0.000) (0.024) (0.001) (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (株 式) (新株予約権証券) (投資信託受益証券) (投資証券)	24 (24) (0) (0) (0)	0.189 (0.189) (0.000) (0.000) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	53 (20) (33)	0.422 (0.160) (0.263)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	92	0.740	
期中の平均基準価額は12,484円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2020年4月21日から2021年4月19日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 30,118.24 (986.04)	千アメリカ・ドル 109,114 (-)	百株 25,525.12	千アメリカ・ドル 88,941
	香 港	百株 833,381.5 (7,599.46)	千香港・ドル 1,158,175 (△453)	百株 776,777.28	千香港・ドル 1,028,621
	台 湾	百株 305,005.81 (2,051.47)	千台湾・ドル 2,200,153 (△703)	百株 275,527.49	千台湾・ドル 2,045,510
	イ ギ リ ス	百株 206.46 (-)	千イギリス・ポンド 354 (-)	百株 147.57	千イギリス・ポンド 240
	ト ル コ	百株 17,335.31 (113.61)	千トルコ・リラ 17,867 (-)	百株 12,882.33	千トルコ・リラ 15,046
	メ キ シ コ	百株 55,241.7 (2,817)	千メキシコ・ペソ 167,171 (-)	百株 52,011.5	千メキシコ・ペソ 151,205
	フ ィ リ ピ ン	百株 52,701.05 (98)	千フィリピン・ペソ 225,431 (-)	百株 37,520.2	千フィリピン・ペソ 188,928
チ リ	百株 403,132.31 (13.27)	千チリ・ペソ 2,509,611 (-)	百株 405,277.9	千チリ・ペソ 2,359,687	

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外	コ ロ ン ビ ア	百株 4,814.77 (-)	千コロンビア・ペソ 4,502,054 (-)	百株 6,468.93	千コロンビア・ペソ 4,217,249	
	ク ウ ェ ー ト	百株 17,130.65 (484.17)	千クウェート・ディナール 1,161 (-)	百株 6,290.66	千クウェート・ディナール 462	
	カ タ ー ル	百株 21,809.88 (-)	千カタール・リアル 15,567 (-)	百株 18,139.96	千カタール・リアル 12,770	
	サ ウ ジ ア ラ ビ ア	百株 17,724.81 (△21.21)	千サウジアラビア・リアル 64,847 (-)	百株 14,757.05	千サウジアラビア・リアル 51,001	
	イ ン ド	百株 75,353.25 (180.45)	千インド・ルピー 4,094,916 (-)	百株 55,579.7	千インド・ルピー 3,272,493	
	イ ン ド ネ シ ア	百株 300,530 (-)	千インドネシア・ルピア 128,240,205 (-)	百株 267,842.25	千インドネシア・ルピア 112,747,590	
	ア ラ ブ 首 長 国 連 邦	百株 19,617.86 (-)	千アラブ首長国連邦・ディルハム 11,982 (-)	百株 13,893.46	千アラブ首長国連邦・ディルハム 9,433	
	ブ ラ ジ ル	百株 59,872 (3,647.5)	千ブラジル・レアル 164,011 (-)	百株 53,899.85	千ブラジル・レアル 137,598	
	チ ェ コ	百株 970.34 (-)	千チェコ・コルナ 15,606 (-)	百株 875.68	千チェコ・コルナ 13,752	
	韓 国	百株 13,954.52 (327.42)	千韓国・ウォン 88,387,518 (-)	百株 12,506.12	千韓国・ウォン 81,184,557	
	中 国	百株 141,564 (790.3)	千オフショア・人民元 214,252 (-)	百株 129,404.7	千オフショア・人民元 187,189	
	マ レ ー シ ア	百株 68,756 (14,327.48)	千マレーシア・リンギット 42,923 (-)	百株 66,813.77	千マレーシア・リンギット 34,985	
	南 ア フ リ カ	百株 31,942.27 (686.25)	千南アフリカ・ランド 365,541 (△1,269)	百株 30,178.38	千南アフリカ・ランド 329,000	
	タ イ	百株 138,933 (311)	千タイ・バーツ 406,376 (△70)	百株 137,748	千タイ・バーツ 343,329	
	ポ ー ラ ン ド	百株 5,306.23 (-)	千ポーランド・ズロチ 17,734 (-)	百株 4,806.86	千ポーランド・ズロチ 14,622	
	ハ ン ガ リ ー	百株 718.7 (-)	千ハンガリー・フォリント 407,657 (-)	百株 559.96	千ハンガリー・フォリント 360,195	
	国	ユ ー	百株 -	千ユーロ -	百株 -	千ユーロ -
		ベ ル ギ ー	(-)	(△0.54)	27	33
		ギ リ シ ャ	百株 2,184.29 (-)	千ユーロ 652 (-)	百株 3,567.96	千ユーロ 701

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外国	イ	証券 -	千タイ・パーツ -	証券 7,030	千タイ・パーツ 54
		(7,030)	(70)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
メキシコ		千□	千メキシコ・ペソ	千□	千メキシコ・ペソ
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	196.6	(-)	27,388	170.9	24,472
GRUPO TELEVISIA SAB	267	(-)	7,841	228.9	6,365
CEMEX SAB DE CV	1,548.9	(-)	12,028	1,288.7	11,598
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	67.7	(-)	4,683	64.7	4,594
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	283.5	(-)	5,230	294.5	6,037
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	36.3	(-)	3,382	18.1	1,677
			(-)	(-)	(-)
ブラジル		千□	千ブラジル・レアル	千□	千ブラジル・レアル
SUL AMERICA SA	23.8	(1.387)	1,021	26.1	980
BANCO SANTANDER BRASIL SA	43.6	(-)	1,347	35.5	1,123
ENERGISA SA	24.8	(-)	1,150	13.4	552
KLABIN SA	62.5	(-)	1,301	39	926
BANCO INTER SA	6.7	(-)	1,041	-	-
BANCO BTG PACTUAL SA	20.2	(-)	1,243	14.6	983
			(-)	(-)	(-)
南アフリカ		千□	千南アフリカ・ランド	千□	千南アフリカ・ランド
REDEFINE PROPERTIES LTD	-	(-)	-	152.868	314
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	419.976	(-)	5,392	355.861	4,551
FORTRESS REIT LTD	-	(-)	-	54.518	626
			(-)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 94,579	百万円 108,526	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	126,856,147千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	47,327,953千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	2.68

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2020年4月21日から2021年4月19日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TRIP.COM GROUP LTD ADR	236.39	294.2	1,074	116,714	インターネット販売・通信販売
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	100.55	154.93	165	17,996	金属・鉱業
SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	242.1	242.1	134	14,652	石油・ガス・消耗燃料
CREDICORP LTD	34.47	43.46	612	66,604	銀行
SINA CORP	37.64	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	297.41	316.8	266	28,915	無線通信サービス
NETEASE INC-ADR	35.13	254.46	2,717	295,297	娯楽
GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	33.43	—	—	—	銀行
SOUTHERN COPPER CORP	42.94	45.18	344	37,408	金属・鉱業
TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	37.89	37.89	18	2,021	各種電気通信サービス
YPF SA ADR	15.94	42.48	16	1,827	石油・ガス・消耗燃料
LUKOIL SPON ADR	208.53	261.36	2,090	227,138	石油・ガス・消耗燃料
GAZPROM PAO ADR	2,639.51	3,686.81	2,271	246,775	石油・ガス・消耗燃料
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	787.21	893.51	318	34,563	銀行
INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	940	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	547.36	963.88	89	9,677	不動産管理・開発
SURGUTNEFTEGAZ ADR	432.84	550.84	254	27,664	石油・ガス・消耗燃料
51JOB INC ADR	15.26	21.3	134	14,576	専門サービス
X5 RETAIL GROUP NV GDR	68.74	70.85	223	24,242	食品・生活必需品小売り
NOVATEK PJSC GDR	46.01	58.75	1,130	122,887	石油・ガス・消耗燃料
BAIDU INC -SPON ADR	135.55	165.07	3,525	383,052	インタラクティブ・メディアおよびサービス
NOVOLIPETSK STEEL GDR	81.7	73.5	255	27,777	金属・鉱業
BANCO MACRO SA ADR	32.36	—	—	—	銀行
MMC NORILSK NICKEL ADR	315.94	410.9	1,383	150,375	金属・鉱業
ROSNEFT OIL CO GDR	615.61	678.41	491	53,444	石油・ガス・消耗燃料
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	70.71	947.65	1,422	154,560	各種消費者サービス
SEVERSTAL GDR	122.6	167.71	387	42,059	金属・鉱業
TATNEFT ADR	130.78	157.61	724	78,710	石油・ガス・消耗燃料
MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	147.36	—	—	—	金属・鉱業
VTB BANK OJSC GDR	820	1,120	135	14,676	銀行
DP WORLD PLC	60.42	—	—	—	運送インフラ
MAGNIT PJSC GDR	201.42	230.51	327	35,592	食品・生活必需品小売り
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	222.33	274.29	779	84,733	インターネット販売・通信販売
21VIANET GROUP INC ADR	—	41.06	114	12,452	情報技術サービス
TAL EDUCATION GROUP-ADR	190.58	234.7	1,393	151,382	各種消費者サービス
MAIL.RU GROUP LTD GDR	—	68.53	157	17,126	インタラクティブ・メディアおよびサービス
YANDEX NV	—	190.65	1,180	128,294	インタラクティブ・メディアおよびサービス
NOAH HOLDINGS LTD ADR	16.3	17.16	70	7,685	資本市場
SBERBANK ADR	1,341.38	1,688.88	2,567	279,032	銀行
PHOSAGRO PJSC GDR	92.54	83.08	153	16,628	化学
HUAZHU GROUP LTD ADR	55.08	88.28	505	54,974	ホテル・レストラン・レジャー
JOYY INC-ADR	31.62	36.17	352	38,307	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	—	35.01	245	26,728	半導体・半導体製造装置
GDS HOLDINGS LTD ADR	32.56	58.26	449	48,795	情報技術サービス
ZAI LAB LTD ADR	16.93	44.44	730	79,333	バイオテクノロジー
BEST INC ADR	85.74	—	—	—	航空貨物・物流サービス
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	—	79.99	486	52,828	銀行
HUYA INC ADR	15.6	42.04	76	8,300	娯楽
BILIBILI INC ADR	—	98.16	1,015	110,372	娯楽
NIO INC ADR	234.28	785.09	2,833	307,876	自動車
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	46.89	235.57	424	46,177	娯楽
58.COM INC ADR	51.12	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AUTOHOME INC ADR	30.96	37.89	355	38,655	インタラクティブ・メディアおよびサービス

銘柄	期首(前期末)		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	
DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR	—	73.6	74	8,125	娯楽
GSX TECHEDU INC ADR	—	42.75	109	11,845	各種消費者サービス
LUCKIN COFFEE INC ADR	30.29	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WEIBO CORP ADR	19.47	30.03	148	16,145	インタラクティブ・メディアおよびサービス
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	—	29.11	129	14,018	情報技術サービス
RLX TECHNOLOGY INC ADR	—	80	72	7,910	タバコ
KE HOLDINGS INC ADR	—	68.69	353	38,461	不動産管理・開発
JD.COM INC ADR	362.26	528.21	4,069	442,173	インターネット販売・通信販売
LI AUTO INC ADR	—	121.2	233	25,390	自動車
XPENG INC ADR	—	93.72	289	31,487	自動車
LUFAX HOLDING LTD ADR	—	112.72	155	16,902	消費者金融
GLOBANT SA	19.17	21.45	485	52,752	情報技術サービス
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	850.33	1,154.1	27,547	2,993,280	インターネット販売・通信販売
MOMO INC SPON ADR	63.37	77.93	115	12,566	インタラクティブ・メディアおよびサービス
BAOZUN INC-SPN ADR	20.7	41.12	145	15,861	インターネット販売・通信販売
PINDUODUO INC ADR	96.03	240.48	3,205	348,346	インターネット販売・通信販売
YUM CHINA HOLDINGS INC	176.25	244.85	1,471	159,898	ホテル・レストラン・レジャー
IQIYI INC ADR	69.53	154.4	234	25,534	娯楽
POLYUS PJSC GDR	25.09	39.46	389	42,341	金属・鉱業
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	37.6	37.61	110	11,953	医薬品
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	158.27	256.08	757	82,280	航空貨物・物流サービス
BEIGENE LTD ADR	—	28.31	864	93,989	バイオテクノロジー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,926.07 60銘柄	19,505.23 66銘柄	75,374 —	8,190,166 <14.1%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
JIANGXI COPPER CO LTD	380	670	1,183	16,541	金属・鉱業
JIANGSU EXPRESS	360	900	844	11,801	運送インフラ
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	580	1,620	905	12,660	旅客航空輸送業
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	—	64	686	9,596	飲料
CHINA MOBILE LIMITED	2,995	—	—	—	無線通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	615	785	3,795	53,060	建設資材
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	1,000	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BEIJING ENTERPRISES	190	215	567	7,935	ガス
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	2,500	1,800	491	6,869	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	1,820	2,580	5,740	80,252	ヘルスケア・テクノロジー
YANZHOU COAL MINING CO LTD	700	700	753	10,529	石油・ガス・消耗燃料
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	—	460	1,228	17,170	不動産管理・開発
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	365	405	2,083	29,130	パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H	380	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	800	—	—	—	旅客航空輸送業
CNOOC LTD	8,790	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,700	1,420	1,036	14,491	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	2,340	5,656	5,424	75,828	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	1,871.2	2,436.2	4,908	68,627	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,568.88	1,988.88	7,478	104,545	不動産管理・開発
CITIC LTD	2,800	3,470	2,737	38,274	コングロマリット
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	940	960	574	8,025	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	3,800	4,540	4,912	68,673	コンピュータ・周辺機器
PETRO CHINA CO LTD	10,700	11,200	3,169	44,311	石油・ガス・消耗燃料
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	2,567.42	—	—	—	各種電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	993.9	1,121.9	1,682	23,526	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	12,912	15,432	6,589	92,120	石油・ガス・消耗燃料
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	370	490	896	12,535	情報技術サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	1,010	1,530	3,771	52,724	ソフトウェア
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	396	501	6,663	93,152	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	1,700	2,080	1,807	25,269	ガス
TOWNGAS CHINA CO LTD	100	—	—	—	ガス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	800	1,520	948	13,259	運送インフラ
YUJEXIU PROPERTY CO LTD	4,200	3,160	578	8,084	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	880	1,140	1,461	20,431	運送インフラ
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD	1,460	1,460	553	7,735	金属・鉱業
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	610	870	2,001	27,973	不動産管理・開発
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	610	910	1,183	16,538	運送インフラ
CHINA EVERBRIGHT LTD	620	440	429	6,003	資本市場
CHINA GAS HOLDINGS LTD	922	1,654	5,483	76,652	ガス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	425	460	2,148	30,031	電子装置・機器・部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	2,600	3,680	8,022	112,153	自動車
SHENZHEN INVESTMENT LTD	1,480	2,160	635	8,877	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	440	560	2,304	32,215	ガス
BYD CO LTD	270	480	8,457	118,237	自動車
CHINA TELECOM CORP LTD	7,000	—	—	—	各種電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	580	1,180	933	13,048	エネルギー設備・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	9,100	5,400	572	8,002	娯楽
SINOTRANS LTD	2,480	—	—	—	航空貨物・物流サービス
MAANSHAN IRON & STEEL	160	—	—	—	金属・鉱業
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	1,925.92	2,525.92	1,288	18,009	商業サービス・用品
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	700	700	500	6,996	紙製品・林産品
CHINA YOUZAN LTD	—	8,800	2,226	31,125	ソフトウェア
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	3,477.88	4,337.88	2,984	41,722	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	1,580	1,350	710	9,927	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	1,012	912	926	12,953	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	1,190	1,795	4,397	61,480	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	3,560	4,600	7,240	101,220	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	3,070	3,390	3,606	50,425	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	1,040	1,520	2,337	32,681	ヘルスケア機器・用品
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,567	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD	814.4	1,354.4	2,660	37,187	機械
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	340	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	2,930	—	—	—	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL	170	—	—	—	コンプロマリット
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD	540	—	—	—	運送インフラ
TINGYI HOLDING CORP	860	1,060	1,539	21,516	食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	160	280	2,107	29,455	飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	1,300	1,780	2,153	30,110	水道
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	1,480	2,140	980	13,702	医薬品
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	733.33	913.33	5,854	81,845	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	740	680	497	6,958	運送インフラ
SINO BIOPHARMACEUTICAL	3,455	6,512.5	5,249	73,382	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,390	1,740	7,821	109,341	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	2,804	3,503	221,389	3,095,026	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2,695	3,635	32,751	457,863	保険
LI NING CO LTD	1,015	1,325	7,950	111,141	繊維・アパレル・贅沢品
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	3,280	2,600	806	11,267	水道
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	4,352.4	6,892.4	937	13,104	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,100	5,000	910	12,721	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	540	760	506	7,076	旅客航空輸送業
ZTE CORP	430.88	442.88	862	12,060	通信機器
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	1,260	—	—	—	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	1,750	1,965	3,261	45,601	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	690	1,855	2,240	31,326	海運業
BANK OF COMMUNICATIONS	3,792.05	5,752.05	2,881	40,287	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	1,162.5	1,102.5	587	8,215	建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	390	415	1,933	27,035	電子装置・機器・部品
CHINA CONSTRUCTION BANK	46,635.3	58,105.3	38,000	531,252	銀行

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	384	514	9,077	126,899	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,740	1,400	1,022	14,287	自動車
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	640	980	1,205	16,851	不動産管理・開発
MINTH GROUP LTD	—	460	1,449	20,257	自動車部品
SSY GROUP LTD	980	1,320	653	9,134	医薬品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	600	840	955	13,363	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	1,660	2,380	2,832	39,594	建設資材
BANK OF CHINA LTD	37,952	48,042	14,796	206,861	銀行
SHUI ON LAND LTD	3,880	—	—	—	不動産管理・開発
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	600	675	1,586	22,175	不動産管理・開発
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	—	600	580	8,119	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	804	992	992	13,868	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	1,824.7	2,399.7	14,254	199,273	銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H	31,332.35	36,942.35	20,096	280,951	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	355	495	375	5,252	金属・鉱業
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	565	535	985	13,776	電子装置・機器・部品
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	1,196	1,676	593	8,294	建設・土木
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	1,990	—	—	—	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	430	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	400	330	1,036	14,486	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	170	313	982	13,739	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	560	—	—	—	家庭用耐久財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	3,851.42	4,941.42	4,793	67,008	不動産管理・開発
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	1,320	2,400	1,250	17,480	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	3,848	5,968	2,506	35,041	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	445	650	855	11,958	不動産管理・開発
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	362	448	8,288	115,866	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	550	670	9,413	131,600	繊維・アパレル・贅沢品
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	200	525	7,339	家庭用品
FOSUN INTERNATIONAL	1,265.28	1,430.28	1,630	22,794	コンプロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	2,860	3,000	909	12,707	不動産管理・開発
CHINA AOYUAN GROUP LTD	410	850	699	9,779	不動産管理・開発
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	1,340	—	—	—	不動産管理・開発
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	1,500	1,620	626	8,764	繊維・アパレル・贅沢品
SOHO CHINA LTD	1,115	—	—	—	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	450	520	2,800	39,146	ソフトウェア
SINOTRUK HONG KONG LTD	385	350	749	10,471	機械
CHINA RAILWAY GROUP LTD	2,050	3,180	1,259	17,604	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	540	1,010	972	13,597	食品
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	250	425	1,870	26,142	通信機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	870	—	—	—	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	2,670	2,840	1,672	23,385	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	1,336	1,604	4,707	65,814	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	980	1,100	1,544	21,590	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD - H	1,934.5	—	—	—	機械
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	770	980	1,636	22,879	医薬品
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,260	835	587	8,206	食品・生活必需品小売り
BBMG CORP	460	—	—	—	建設資材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	236	—	—	—	金属・鉱業
SINOPHARM GROUP CO	616	760	1,683	23,533	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	1,340	1,120	992	13,872	建設資材
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	80	—	—	—	建設・土木
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	1,265.27	1,785.27	1,280	17,894	自動車
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	845	1,290	1,517	21,208	金属・鉱業
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	600	1,980	665	9,300	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	1,880	1,940	2,095	29,290	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	305	642	1,029	14,396	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・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	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,230	1,640	5,092	71,188	不動産管理・開発
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	860	—	—	—	不動産管理・開発
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	566	612	681	9,531	機械
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	885	1,020	5,283	73,864	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	353	603	1,781	24,910	保険
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	3,021.56	3,996.56	1,734	24,248	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1,260	1,250	472	6,605	不動産管理・開発
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	68	310	424	5,937	電気設備
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	680	790	1,493	20,873	建設関連製品
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	1,240	2,500	857	11,987	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	13,380	15,470	4,811	67,260	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	310	300	1,672	23,381	専門小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,450	1,030	942	13,175	各種金融サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	—	460	2,265	31,671	ヘルスケア機器・用品
CITIC SECURITIES CO LTD	915	1,305	2,516	35,174	資本市場
SEAZEN GROUP LIMITED	780	1,180	1,126	15,754	不動産管理・開発
HAITONG SECURITIES CO LTD	1,220	936	650	9,094	資本市場
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	4,610	4,610	1,170	16,369	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	320	255	930	13,011	医薬品
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	1,640	2,260	1,602	22,400	不動産管理・開発
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	1,235	—	—	—	建設・土木
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	1,955	1,065	508	7,101	資本市場
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	9,860	9,860	0	0	半導体・半導体製造装置
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	200	—	—	—	自動車部品
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	3,230	3,230	0	0	食品
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	720	720	853	11,937	商業サービス・用品
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	260	—	—	—	資本市場
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	3,700	5,370	2,953	41,289	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	200	260	1,986	27,769	食品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	320	780	1,232	17,228	ライフサイエンス・ツール/サービス
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	—	125	200	2,796	各種消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	630	900	6,939	97,007	商業サービス・用品
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	630	920	489	6,842	不動産管理・開発
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	167	283	2,696	37,703	ヘルスケア・テクノロジー
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	190	520	867	12,125	各種消費者サービス
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	—	375	561	7,853	金属・鉱業
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	—	200	189	2,653	ヘルスケア機器・用品
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	160	237.5	782	10,940	商業サービス・用品
CHINA TOWER CORP LTD	21,000	27,060	3,111	43,504	各種電気通信サービス
XIAOMI CORP	5,190	8,778	22,866	319,676	コンピュータ・周辺機器
WUXI APPTec CO LTD	96	165.6	2,601	36,370	ライフサイエンス・ツール/サービス
WEIMOB INC	—	1,070	1,806	25,250	ソフトウェア
MEITUAN	502	2,200	63,844	892,539	インターネット販売・通信販売
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	—	444	833	11,656	インターネット販売・通信販売
HAILILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	100	440	2,217	31,002	ホテル・レストラン・レジャー
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,200	2,340	3,093	43,246	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	400	620	4,650	65,007	バイオテクノロジー
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES GROUP LTD	—	420	757	10,592	商業サービス・用品
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,560	6,650	1,057	14,781	資本市場
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	—	420	1,465	20,491	専門小売り
LOGAN GROUP COMPANY LTD	640	1,110	1,387	19,397	不動産管理・開発
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	825	995	3,706	51,815	建設・土木
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	—	58	305	4,265	不動産管理・開発
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	—	780	1,425	19,933	ヘルスケア・アロパイダー/ヘルスケア・サービス
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	280	270	434	6,069	各種消費者サービス
CANSINO BIOLOGICS INC	—	40	1,071	14,975	医薬品
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	720	620	642	8,979	専門小売り

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
HANSON PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	160	660	2,362	33,031	医薬品
CHINA FEIHE LTD	—	830	1,859	25,991	食品
PHARMARON BEIJING CO LTD	—	77	1,114	15,576	ライフサイエンス・ツール/サービス
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	350	1,795	25,101	タバコ
JIJIAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	440	1,328	18,576	ホテル・レストラン・レジャー
KUAISHOU TECHNOLOGY	—	132	3,194	44,657	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HAIER SMART HOME CO LTD	—	1,226	4,143	57,931	家庭用耐久財
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	—	250	887	12,407	ソフトウェア
NONGFU SPRING CO LTD	—	190	759	10,611	飲料
CHINA BOHAI BANK CO LTD	—	2,220	752	10,521	銀行
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	—	180	1,926	26,925	インターネット販売・通信販売
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	—	80	1,071	14,975	ライフサイエンス・ツール/サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	645.61	926.61	2,617	36,595	不動産管理・開発
LUYE PHARMA GROUP LTD	530	—	—	—	医薬品
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	240	280	1,372	19,180	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD	5,450	4,500	819	11,449	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BAIC MOTOR CORP LTD	820	—	—	—	自動車
GF SECURITIES CO LTD	756	682	793	11,097	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	216	252	1,126	15,747	自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD	726	484	548	7,673	資本市場
3SBIO INC	780	905	631	8,831	バイオテクノロジー
LEGEND HOLDINGS CORP	135	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	1,040	940	476	6,662	医薬品
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	5,210	4,610	470	6,573	資本市場
CHINA LITERATURE LTD	60	162	1,282	17,925	メディア
DALI FOODS GROUP CO LTD	780	1,465	653	9,134	食品
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	270	—	—	—	電子装置・機器・部品
CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	—	640	405	5,672	各種消費者サービス
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	—	650	468	6,551	不動産管理・開発
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	4,850	—	—	—	保険
BOC AVIATION LTD	131	107	778	10,882	商社・流通業
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	87	262	1,222	17,086	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	—	540	941	13,165	自動車
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	768	688	1,318	18,428	資本市場
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	390	2,015	21,157	295,781	ライフサイエンス・ツール/サービス
小 計	株数 455,669.75	株数 519,873.43	839,112	11,730,787	
	銘柄数 <20.2%>	銘柄数 <20.2%>	—	<20.2%>	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	210	320	8,816	33,807	通信機器
ACER INC	1,405.32	2,065.32	7,053	27,047	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	365.54	445.54	17,286	66,292	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	256.16	266.16	13,281	50,931	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	939.28	1,319.28	6,457	24,764	建設資材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	170	190	4,683	17,960	電子装置・機器・部品
TAIWAN BUSINESS BANK	3,627.79	4,572.67	4,558	17,482	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	410	540	6,291	24,124	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	250	380	6,783	26,011	コンピュータ・周辺機器
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	—	770	6,937	26,604	電子装置・機器・部品
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	399.75	479.75	4,226	16,208	コンピュータ・周辺機器
QUANTA COMPUTER INC	1,358.58	1,818.58	17,803	68,274	コンピュータ・周辺機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	320.7	807.77	3,521	13,505	不動産管理・開発
EVA AIRWAYS CORP	841.25	—	—	—	旅客航空輸送業
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	337.6	437.6	9,080	34,820	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,347.71	2,447.61	4,356	16,707	銀行
CHINA AIRLINES	681.56	—	—	—	旅客航空輸送業
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	1,241.69	841.69	4,351	16,687	自動車部品
CHINA STEEL CORP	5,780.58	7,590.58	26,680	102,315	金属・鉱業

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	1,779.94	889.73	2,295	8,802	保険
ADVANTECH CO LTD	138.89	206.75	7,339	28,145	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS INC	2,393.04	2,133.04	5,791	22,208	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	966.63	1,206.63	35,776	137,196	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CORP	670	790	7,797	29,901	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,753.27	2,234.27	25,470	97,674	各種電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	3,911.94	5,371.94	13,886	53,251	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	778	958	9,503	36,443	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP	988.2	1,278.2	8,091	31,027	海運業
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,788.24	1,688.24	5,385	20,652	コンピュータ・周辺機器
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	203.07	217.68	4,538	17,404	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE CO LTD	73.22	113.22	5,830	22,360	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	242.85	352.85	21,559	82,674	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	2,166.33	2,426.33	26,446	101,418	化学
FORMOSA TAFFETA CO LTD	190	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	1,755.94	2,265.94	20,846	79,942	化学
GIANT MANUFACTURING	111.51	161.51	5,733	21,987	レジャー用品
MEDIATEK INC	745.07	915.07	89,219	342,138	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	3,249.36	4,169.36	25,016	95,931	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	3,994.59	4,669.44	8,988	34,469	銀行
HOTAI MOTOR CO LTD	150	190	11,286	43,279	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	690	890	5,856	22,457	無線通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,141.41	6,001.46	14,853	56,960	各種金融サービス
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	3,769.41	4,889.41	24,373	93,468	保険
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	7,584.03	7,274.03	8,183	31,381	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,255.45	7,084.48	19,092	73,216	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	6,082.25	7,622.25	94,134	360,988	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,214.95	6,164.95	19,758	75,770	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	52.2	62.2	19,530	74,896	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	4,285.93	5,280.58	7,234	27,742	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	4,830.61	7,910.61	7,515	28,818	保険
INVENTEC CO LTD	1,460.05	1,200.05	3,252	12,471	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	938.45	1,288.45	8,117	31,127	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	4,714.43	5,534.43	7,194	27,590	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,120.48	10,870.48	24,186	92,751	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,028.52	5,729.77	13,006	49,877	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	355.6	375.6	4,169	15,987	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	2,528.28	3,258.28	29,291	112,328	化学
WISTRON CORP	1,359.16	1,579.16	5,203	19,953	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP	1,459.9	1,789.9	6,336	24,298	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	2,402.97	3,052.97	22,347	85,699	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	293.92	373.92	10,245	39,289	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	484.8	644.8	6,576	25,221	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP	56.58	106.58	5,270	20,210	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	283.93	465.89	2,394	9,183	不動産管理・開発
RUENTEX INDUSTRIES LTD	118.29	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	455.88	435.88	3,125	11,984	電子装置・機器・部品
STANDARD FOODS CORP	256.39	-	-	-	食品
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	478.99	628.99	3,497	13,411	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT CORP	2,496.84	3,131.71	15,345	58,846	建設資材
TATUNG CO LTD	610	-	-	-	家庭用耐久財
TAIWAN SEMICONDUCTOR	12,020.83	14,990.83	914,440	3,506,696	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	5,665.25	7,285.25	39,340	150,862	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	2,170	1,800	6,444	24,711	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORP	131.6	201.6	11,108	42,597	電子装置・機器・部品
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,090	1,510	4,665	17,892	運送インフラ
INNOLUX CORPORATION	5,143.45	5,123.45	12,475	47,841	電子装置・機器・部品

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
WPG HOLDINGS CO LTD	722.03	1,242.03	5,936	22,766	電子装置・機器・部品
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	—	140	4,655	17,850	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	86.45	174.75	7,365	28,246	機械
PEGATRON CORP	1,025.54	1,035.54	7,611	29,187	コンピュータ・周辺機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	40	70	7,560	28,991	機械
WIN SEMICONDUCTORS CORP	140	220	8,426	32,312	半導体・半導体製造装置
CHAILLEASE HOLDING CO LTD	650.29	674.7	14,168	54,334	各種金融サービス
ONENESS BIOTECH CO LTD	—	160	3,864	14,817	医薬品
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	—	20	2,580	9,893	半導体・半導体製造装置
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	223.85	293.85	3,276	12,564	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	4,516.74	5,189.54	11,001	42,189	銀行
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	1,769.93	1,999.93	8,489	32,556	銀行
WIWYNN CORP	30	40	3,512	13,467	コンピュータ・周辺機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	1,779.03	2,049.03	23,154	88,791	半導体・半導体製造装置
SILERGY CORP	—	50	13,200	50,619	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	90	120	9,564	36,676	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	60	120	5,088	19,511	家庭用耐久財
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,010,996	7,711,771	
	164,158.29	195,688.08	—	<13.3%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	97.78	156.67	243	36,629	金属・鉱業
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	243	36,629	
	97.78	156.67	—	<0.1%>	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
AKBANK TAS	1,660.79	2,388.37	1,187	15,955	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	35.73	—	—	—	飲料
ARCELIK	8.01	—	—	—	家庭用耐久財
AELSAN ELEKTRONIK SANAYI	91.92	448.98	682	9,179	航空宇宙・防衛
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	887.23	961.86	1,764	23,711	金属・鉱業
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	46.68	46.68	864	11,620	自動車
KOC HOLDING AS	302.17	537.7	977	13,139	コングロマリット
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	—	900	661	8,891	コングロマリット
TURK HAVA YOLLARI	430.05	442.06	514	6,922	旅客航空輸送業
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	549.66	626.54	944	12,699	無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI AS	1,316.2	1,141.53	831	11,170	銀行
TURKIYE IS BANKASI	694.78	662.05	325	4,369	銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	72.64	62.01	553	7,438	石油・ガス・消耗燃料
YAPI VE KREDI BANKASI AS	—	2,392.3	516	6,945	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING AS	213.6	210.58	172	2,320	各種金融サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	191.76	277.55	1,906	25,629	食品・生活必需品小売り
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	30.4	—	—	—	運送インフラ
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	11,903	159,992	
	6,531.62	11,098.21	—	<0.3%>	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
ALFA SAB DE CV	861	—	—	—	コングロマリット
EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	106	—	—	—	複合小売り
GRUPO BIMBO SAB DE CV	720	850	3,542	19,331	食品
GRUMA SAB DE CV	103.85	106.15	2,668	14,560	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	77.6	164.6	2,584	14,103	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV	92	349	2,134	11,644	コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	1,332	1,621	19,722	107,616	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	327.25	530.25	2,776	15,152	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	75.55	76.35	2,167	11,828	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	910	863	3,105	16,947	家庭用品
ALSEA SAB DE CV	294	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	100.75	120.4	4,343	23,698	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV	1,747.52	1,939.52	20,107	109,713	金属・鉱業

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
AMERICA MOVIL SAB DE CV	16,379.78	21,166.78	30,649	167,238	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	1,521	966	1,863	10,167	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	258	231	2,406	13,131	飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	2,535	3,200	20,364	111,120	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	198.4	240.85	5,155	28,133	運送インフラ
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	187	292	2,491	13,594	ガス
TELESITES SAB DE CV	—	773	1,524	8,317	各種電気通信サービス
BECLE SAB DE CV	—	384	1,865	10,176	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	27,826.7 19銘柄	33,873.9 18銘柄	129,474 —	706,478 <1.2%>
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
AYALA LAND INC	3,801	4,255	14,147	31,771	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,096.3	943.3	3,301	7,414	Conglomerate
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	248.2	1,075.2	8,924	20,040	銀行
AYALA CORP	154.33	185.83	14,085	31,632	Conglomerate
GLOBE TELECOM INC	15.55	14.2	2,627	5,899	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	620.8	461.2	5,898	13,246	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,519.9	1,934.8	11,299	25,374	Conglomerate
JOLLIBEE FOODS CORP	289.3	325.9	5,849	13,137	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,186.75	615.75	2,752	6,181	銀行
BDO UNIBANK INC	912.73	1,222.33	12,810	28,767	銀行
MEGAWORLD CORP	1,980	8,790	2,971	6,672	不動産管理・開発
PLDT INC	47.05	52.6	6,601	14,824	無線通信サービス
ROBINSONS LAND CORP	940	—	—	—	不動産管理・開発
SECURITY BANK CORP	113.1	—	—	—	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC	4,911.75	6,363.75	22,814	51,233	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	414.9	548.4	7,046	15,825	食品
SM INVESTMENTS CORP	106.38	164.63	16,100	36,157	Conglomerate
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	3,529	9,019	3,652	8,202	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP	510	957	2,253	5,061	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MANILA ELECTRIC COMPANY	148	177.1	4,848	10,889	電力
PUREGOLD PRICE CLUB INC	—	676	2,467	5,541	食品・生活必需品小売り
GT CAPITAL HOLDINGS INC	24.11	66.01	3,541	7,953	Conglomerate
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,569.15 21銘柄	37,848 20銘柄	153,995 —	345,826 <0.6%>
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	27,996.58	36,313.83	164,138	25,331	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	33.79	27.73	107,866	16,646	銀行
BANCO DE CHILE	25,958.42	27,690.44	239,522	36,964	銀行
EMPRESAS CMPC SA	390.74	601.53	141,022	21,763	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	180.31	224.18	202,501	31,251	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	53.63	105.81	72,479	11,185	飲料
ENTEL CHILE SA	66.1	—	—	—	無線通信サービス
ENEL AMERICAS SA	19,544.64	19,059.81	215,375	33,238	電力
COLBUN SA	2,568.74	5,804.23	79,221	12,226	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AGUAS ANDINAS SA	868.53	—	—	—	水道
EMBOTELLADORA ANDINA SA	200.26	200.26	38,249	5,902	飲料
LATAM AIRLINES GROUP SA	38.99	—	—	—	旅客航空輸送業
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	40.1	74.92	290,315	44,803	化学
FALABELLA SA	514.1	561.57	193,741	29,899	複合小売り
ITAU CORPBANCA	12,369.77	—	—	—	銀行
CENCOSUD SA	732.05	811.21	136,372	21,045	食品・生活必需品小売り
CENCOSUD SHOPPING SA	—	292.31	45,541	7,028	不動産管理・開発
ENEL CHILE SA	17,039.55	14,696.15	82,445	12,723	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	108,596.3 17銘柄	106,463.98 14銘柄	2,008,795 —	310,011 <0.5%>

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	
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	216.75	231.25	523,550	15,789	電力
ECOPETROL SA	2,603.36	2,812.3	647,110	19,515	石油・ガス・消耗燃料
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	1,960.73	—	—	—	銀行
GRUPO ARGOS SA	148.97	—	—	—	建設資材
BANCOLOMBIA SA	67.47	129.5	392,903	11,849	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	275.34	309.57	943,878	28,465	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	92.36	228.2	467,810	14,108	各種金融サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	2,975,252	89,727	
	7銘柄	5銘柄	—	<0.2%>	
(クウェート)	百株	百株	千クウェート・ディナール	千円	
KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	—	2,546.84	183	66,219	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	—	1,262.48	76	27,491	無線通信サービス
GULF BANK KSCP	—	1,426.6	30	10,973	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	—	4,183.85	345	124,798	銀行
AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	—	532.37	40	14,572	航空貨物・物流サービス
MABANEE CO KPSC	—	532.93	37	13,587	不動産管理・開発
BOUBYAN BANK KSCP	—	839.09	52	19,089	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	11,324.16	276,731	
	—銘柄	7銘柄	—	<0.5%>	
(カタール)	百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR INSURANCE CO SAQ	822.82	—	—	—	保険
QATAR NATIONAL BANK	2,186.04	2,728.04	4,858	143,572	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	758.09	902.99	472	13,976	銀行
OOREDOO QSC	534.59	400.49	281	8,317	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	292.53	284.78	509	15,063	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	326.18	246.05	419	12,382	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	286.75	510.28	464	13,721	銀行
INDUSTRIES QATAR QSC	940.11	1,233.12	1,542	45,584	コンプロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ	589.69	758.19	1,357	40,104	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	—	1,389.61	445	13,160	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN	1,604.22	2,423.81	1,079	31,908	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	1,000.55	1,384.49	449	13,292	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	1,769.57	2,519.21	466	13,771	化学
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	11,111.14	364,855	
	12銘柄	12銘柄	12,347	<0.6%>	
(サウジアラビア)	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	124.66	154.78	1,105	32,059	化学
JARIR MARKETING CO	21.89	40.04	764	22,185	専門小売り
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	20.3	41.55	329	9,546	保険
ETIHAD ETISALAT CO	207.81	185	566	16,422	無線通信サービス
SAUDI BRITISH BANK	365.42	445.2	1,271	36,873	銀行
AL RAJHI BANK	578.93	746.13	7,050	204,547	銀行
ARAB NATIONAL BANK	303.9	344.64	743	21,575	銀行
BANK ALBILAD	210.92	264.91	943	27,358	銀行
BANK AL-JAZIRA	294.76	354.4	589	17,087	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	273.61	371.02	1,320	38,317	銀行
RIYAD BANK	594.73	739.24	1,840	53,398	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP	487.48	—	—	—	銀行
SAUDI TELECOM CO	190.84	362.86	4,455	129,266	各種電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	86.58	120.5	1,286	37,334	化学
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	353.28	551.48	6,452	187,181	化学
SAUDI CEMENT CO	27.73	64.77	414	12,025	建設資材
SAUDI ELECTRICITY CO	407.14	459.63	1,151	33,401	電力
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	76.5	186.28	642	18,643	化学
SAVOLA GROUP	140.14	145.38	610	17,713	食品
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	284.89	225.28	385	11,188	化学
ALMARAI CO JSC	130.48	165.75	860	24,955	食品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(サウジアラビア)	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
EMAAR ECONOMIC CITY	153.95	283.11	298	8,656	不動産管理・開発	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	249.29	162.78	388	11,257	化学	
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	37.51	83.95	675	19,604	化学	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	484.81	392.76	677	19,665	化学	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	208.3	310.11	305	8,861	不動産管理・開発	
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	60.66	107.17	197	5,720	石油・ガス・消耗燃料	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	—	218.18	333	9,683	無線通信サービス	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	7.18	29.68	338	9,815	保険	
ALINMA BANK	500.3	615.01	1,100	31,936	銀行	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	—	35.16	462	13,402	食品・生活必需品小売り	
SAUDI ARABIAN MINING CO	225.49	270.62	1,550	44,984	金属・鉱業	
SAUDI AIRLINES CATERING CO	31.19	30.88	235	6,835	ホテル・レストラン・レジャー	
SAUDI ARABIAN OIL CO	545.76	1,312.38	4,665	135,346	石油・ガス・消耗燃料	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	—	27.12	353	10,259	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
THE SAUDI NATIONAL BANK	573.06	1,358.29	7,416	215,145	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	33銘柄	35銘柄	51,784	1,502,259 <2.6%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,400.2	1,742.43	336,654	494,882	石油・ガス・消耗燃料	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	282.46	373.5	15,455	22,719	石油・ガス・消耗燃料	
ASIAN PAINTS LTD	144.6	242.86	64,690	95,095	化学	
EICHER MOTORS LTD	5.58	87.39	21,278	31,278	自動車	
GRASIM INDUSTRIES LTD	134.74	166.36	22,511	33,092	建設資材	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	405.49	517.85	42,549	62,547	自動車	
SHREE CEMENT LTD	5.11	5.81	17,907	26,323	建設資材	
ICICI BANK LTD	2,368.52	3,142.49	178,163	261,900	銀行	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	202.28	372.98	8,822	12,969	石油・ガス・消耗燃料	
STATE BANK OF INDIA LTD	945.52	1,136.74	38,637	56,797	銀行	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	66.92	206.08	11,705	17,206	陸運・鉄道	
LIC HOUSING FINANCE LTD	144.36	—	—	—	貯蓄・抵当・不動産金融	
TATA STEEL LTD	138.26	473.87	42,186	62,013	金属・鉱業	
TATA MOTORS LTD	581.68	929.53	28,815	42,358	自動車	
JSW STEEL LTD	381.77	519.94	32,205	47,341	金属・鉱業	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	—	370.48	24,870	36,559	食品	
TATA POWER CO LTD	371.95	—	—	—	電力	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	33.56	70.36	26,008	38,232	食品	
NESTLE INDIA LTD	11.92	18.49	31,899	46,891	食品	
GAIL INDIA LTD	979.27	834.49	11,649	17,124	ガス	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	—	345.09	60,877	89,489	銀行	
VEDANTA LTD	874.77	1,176.59	27,273	40,091	金属・鉱業	
AXIS BANK LTD	1,059.19	1,410.99	94,423	138,802	銀行	
TITAN COMPANY LTD	163.05	228.71	35,428	52,079	繊維・アパレル・贅沢品	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,078.1	1,391.96	14,935	21,955	石油・ガス・消耗燃料	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	20.97	65.31	10,259	15,081	パーソナル用品	
LUPIN LTD	123.45	127.8	13,493	19,835	医薬品	
ACC LTD	—	35.92	6,759	9,936	建設資材	
BAJAJ FINANCE LTD	94.3	167.57	77,360	113,719	消費者金融	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	808.64	1,046.63	269,407	396,029	貯蓄・抵当・不動産金融	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	311.62	465.43	9,027	13,269	メディア	
INFOSYS LTD	1,672.84	2,079	281,444	413,723	情報技術サービス	
WIPRO LTD	491.1	631.91	29,649	43,584	情報技術サービス	
MRF LTD	—	0.96	7,811	11,482	自動車部品	
INDIAN OIL CORP LTD	728.1	1,430.83	12,898	18,961	石油・ガス・消耗燃料	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	400.78	504.39	124,024	182,315	家庭用品	
TRENT LTD	—	93.85	6,979	10,259	複合小売り	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	—	47.7	14,600	21,463	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HCL TECHNOLOGIES LTD	551.59	677.21	68,584	100,819	情報技術サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
DABUR INDIA LTD	229.89	343.49	19,750	29,033		パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	41.43	77.01	22,293	32,771		自動車
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	-	70.63	11,917	17,519		自動車部品
DR REDDYS LABORATORIES LTD	58.8	75.27	36,831	54,142		医薬品
IPCA LABORATORIES LTD	-	57.43	12,301	18,082		医薬品
BHARTI AIRTEL LTD	1,217.56	1,524.71	82,448	121,199		無線通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	175.15	150.17	7,794	11,458		飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	362.94	542.74	35,063	51,543		医薬品
DIVI'S LABORATORIES LTD	43.4	72.41	27,674	40,680		ライフサイエンス・ツール/サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	54.52	86.24	57,333	84,279		自動車
AUROBINDO PHARMA LTD	114.18	178.68	17,028	25,031		医薬品
HAVELLS INDIA LTD	156.33	116.19	11,740	17,258		電気設備
INDRAPRASTHA GAS LTD	-	246.03	12,674	18,631		ガス
BIOCON LTD	-	219.17	9,048	13,301		バイオテクノロジー
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	426.76	676.1	14,329	21,065		自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	37.77	93.53	12,888	18,945		消費者金融
PETRONET LNG LTD	418.74	569.37	12,557	18,459		石油・ガス・消耗燃料
CIPLA LTD/INDIA	187.92	277.24	26,006	38,229		医薬品
LARSEN & TOUBRO LTD	262.27	446.07	60,627	89,122		建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	53.62	73.11	49,094	72,169		建設資材
ASHOK LEYLAND LTD	500.57	-	-	-		機械
BOSCH LTD	2.22	-	-	-		自動車部品
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	439.12	572.48	182,915	268,886		情報技術サービス
NTPC LTD	1,142.12	2,766.29	28,340	41,660		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	55.89	53.27	9,162	13,469		各種金融サービス
YES BANK LTD	-	7,148.5	10,436	15,342		銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	468.06	345.17	10,379	15,257		建設資材
BHARAT FORGE LTD	76.44	158.49	9,299	13,670		自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	561.31	967.13	35,783	52,602		金属・鋳業
ITC LTD	1,760.58	1,874.66	38,983	57,305		タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	71.98	86.76	15,822	23,258		化学
UNITED PHOSPHORUS LTD	301.31	297.92	18,225	26,791		化学
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	-	25.21	6,603	9,707		医薬品
SIEMENS INDIA LTD	26.78	36.37	6,720	9,878		コンピュータリット
INFO EDGE INDIA LTD	21.51	42.16	19,706	28,968		インタラクティブ・メディアおよびサービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	156.95	257.69	18,860	27,724		パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	204.62	406.6	41,078	60,385		情報技術サービス
MARICO LTD	282.57	266.96	11,317	16,637		パーソナル用品
PAGE INDUSTRIES LTD	1.91	3.78	11,422	16,790		繊維・アパレル・贅沢品
DLF LTD	240.13	337.09	8,509	12,509		不動産管理・開発
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	959.97	1,403.37	29,449	43,291		電力
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE REC LTD	354.33	317.46	23,984	35,256		運送インフラ
BAJAJ FINSERV LTD	21.74	24.28	23,854	35,066		各種金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	33.92	43.88	15,948	23,444		自動車
JUBILANT FOODWORKS LTD	-	57.44	16,201	23,814		ホテル・レストラン・レジャー
MUTHOOT FINANCE LTD	-	49.65	5,799	8,525		消費者金融
COAL INDIA LTD	544.64	994.58	12,715	18,692		石油・ガス・消耗燃料
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	86.21	-	-	-		消費者金融
INDUS TOWERS LTD	140.7	373.74	9,702	14,262		各種電気通信サービス
PI INDUSTRIES LTD	-	41.33	10,313	15,160		化学
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	23.33	-	-	-		金属・鋳業
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	-	27.48	11,239	16,521		情報技術サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	-	253.35	28,086	41,286		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	216.72	445.36	30,758	45,215		保険
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	25.14	24.25	7,104	10,444		資本市場
BANDHAN BANK LTD	99.23	389.9	12,580	18,492		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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
BERGER PAINTS INDIA LTD	79.54	125.56	9,232	13,571	化学
AVENUE SUPERMARTS LTD	65.1	88.1	25,724	37,814	食品・生活必需品小売り
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	79.31	115.17	16,321	23,992	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	115.66	190.44	8,589	12,627	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	36.35	48.93	7,745	11,385	旅客航空輸送業
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	149.7	240.46	21,982	32,314	保険
小計	株数・金 銘柄数<比率>	株数・金 銘柄数<比率>	3,477,282	5,111,604	
	85銘柄	96銘柄	-	<8.8%>	
(パキスタン)	百株	百株	千パキスタン・ルピー	千円	
MCB BANK LTD	124	124	2,154	1,529	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	218.68	218.68	2,166	1,538	石油・ガス・消耗燃料
HABIB BANK LTD	193	193	2,287	1,624	銀行
小計	株数・金 銘柄数<比率>	株数・金 銘柄数<比率>	6,608	4,691	
	3銘柄	3銘柄	-	<0.0%>	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
ANEKA TAMBANG TBK PT	-	5,717	1,366,363	10,247	金属・鉱業
BARITO PACIFIC TBK PT	14,625	14,709	1,434,127	10,755	化学
UNITED TRACTORS TBK PT	1,039.01	848.01	1,871,982	14,039	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	2,769	3,529	2,364,430	17,733	食品
UNILEVER INDONESIA TBK PT	3,608	4,805	3,039,162	22,793	家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	10,655	13,067	6,860,175	51,451	自動車
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	24,831	31,399	10,550,064	79,125	各種電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	2,440	3,868	2,988,030	22,410	食品
GUDANG GARAM TBK PT	158	324	1,179,360	8,845	タバコ
HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	4,563	-	-	-	タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	1,098	678	883,095	6,623	建設資材
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	1,428	1,908	1,893,690	14,202	紙製品・林産品
BUKIT ASAM TBK PT	2,300	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
BANK MANDIRI	9,617	11,831	7,453,530	55,901	銀行
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	868	-	-	-	紙製品・林産品
BANK RAKYAT INDONESIA	27,728	34,221	14,851,914	111,389	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	4,772	8,222	966,085	7,245	ガス
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	4,400	3,443	2,048,585	15,364	銀行
KALBE FARMA TBK PT	13,344	10,057	1,503,521	11,276	医薬品
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	1,009	1,498	1,595,370	11,965	建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,753	6,028	18,912,850	141,846	銀行
XL AXIATA TBK PT	355	-	-	-	無線通信サービス
JASA MARGA PERSERO TBK PT	416.25	-	-	-	運送インフラ
BUMI SERPONG DAMAI PT	6,631	-	-	-	不動産管理・開発
ADARO ENERGY PT	6,845	9,341	1,106,908	8,301	石油・ガス・消耗燃料
PAKUWON JATI TBK	2,185	-	-	-	不動産管理・開発
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	774	1,650	1,476,750	11,075	食品
BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	1,579	-	-	-	銀行
ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	1,104	-	-	-	専門小売り
SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	-	17,183	1,950,270	14,627	各種電気通信サービス
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	-	4,256	1,034,208	7,756	金属・鉱業
小計	株数・金 銘柄数<比率>	株数・金 銘柄数<比率>	87,330,471	654,978	
	28銘柄	22銘柄	-	<1.1%>	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千アラブ首長国連邦・ディルハム	千円	
ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	-	1,142.69	562	16,658	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	630.16	942.96	427	12,656	銀行
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	876.04	1,071.47	2,348	69,590	各種電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	1,545.32	1,764.04	1,102	32,667	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	1,363.91	1,680.85	2,430	72,015	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	2,271.65	1,873.97	740	21,932	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	1,419.95	2,243.84	816	24,200	不動産管理・開発
EMIRATES NBD BANK PJSC	-	1,385.97	1,621	48,047	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	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千円	千円	
EMAAR MALLS PJSC	953.55	2,679.19	506	15,003	不動産管理・開発
小計	9,060.58	14,784.98	10,555	312,773	
	7銘柄	9銘柄	-	<0.5%>	
(ブラジル)	百株	百株	千円	千円	
BRF SA	325.92	296.92	700	13,618	食品
VALE SA	1,557.21	2,252.21	24,474	475,870	金属・鉱業
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	-	790	516	10,045	電力
RAIA DROGASIL SA	120	635	1,571	30,557	食品・生活必需品小売り
TIM PARTICIPACOES SA	483	-	-	-	無線通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	94.5	112.5	408	7,946	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	178	197	700	13,616	電力
BANCO DO BRASIL SA	439	564	1,679	32,645	銀行
ITAU SA	2,183.6	2,433.6	2,506	48,736	銀行
LOJAS AMERICANAS SA	318.74	531.74	1,254	24,399	複合小売り
GERDAU SA	495.3	671.3	2,183	42,459	金属・鉱業
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	65.06	-	-	-	食品・生活必需品小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	1,839.1	2,230.1	5,051	98,211	石油・ガス・消耗燃料
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	382	392	846	16,463	専門小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,056.12	2,958.12	6,788	131,998	石油・ガス・消耗燃料
COGNA EDUCACAO	642.47	-	-	-	各種消費者サービス
CCR SA	539.2	653.2	801	15,583	運送インフラ
WEG SA	424.72	524.72	4,042	78,608	電気設備
BANCO BRADESCO SA PREF	2,168.85	2,820.85	7,362	143,149	銀行
BANCO BRADESCO SA	600.25	713.25	1,649	32,062	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	195.06	410.06	1,968	38,270	金属・鉱業
BRADESCAR SA	-	102	743	14,447	金属・鉱業
SUZANO SA	282.75	464.75	3,305	64,265	紙製品・林産品
CPFL ENERGIA SA	-	222	693	13,480	電力
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2,352.47	2,994.47	8,369	162,731	銀行
PORTO SEGURO SA	46	-	-	-	保険
B2W CIA DIGITAL	91	154	1,050	20,420	インターネット販売・通信販売
BRASKEM SA	103.3	-	-	-	化学
ENGIE BRASIL SA	110.87	179.87	754	14,667	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALPARGATAS SA	-	85	324	6,304	繊維・アパレル・贅沢品
LOCALIZA RENT A CAR	272.89	389.89	2,502	48,653	陸運・鉄道
TELEFONICA BRASIL S.A.	228.28	-	-	-	各種電気通信サービス
LOJAS RENNEN SA	433.37	450.37	2,112	41,068	複合小売り
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	442.04	379.04	799	15,542	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA	101	144	1,307	25,422	石油・ガス・消耗燃料
TOTVS SA	-	236	735	14,293	ソフトウェア
EQUATORIAL ENERGIA SA	417	685	1,708	33,216	電力
EMBRAER SA	211.6	-	-	-	航空宇宙・防衛
BR MALLS PARTICIPACOES SA	294.65	-	-	-	不動産管理・開発
JBS SA	453	695	2,321	45,147	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	549.49	508.69	656	12,758	電力
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	182.98	179.98	773	15,043	水道
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	206.4	-	-	-	不動産管理・開発
HYPERA SA	211	182	644	12,526	医薬品
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	1,013.16	1,271.16	7,042	136,924	資本市場
MAGAZINE LUIZA SA	375	1,810	3,967	77,141	複合小売り
CIELO SA	465.07	-	-	-	情報技術サービス
TELEFONICA BRASIL SA	-	322.28	1,422	27,658	各種電気通信サービス
VIA VAREJO S/A	-	683	870	16,931	専門小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	296	423	1,003	19,516	保険
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	251	342	2,828	54,992	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	122	591	906	17,627	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ATACADO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	163	299	693	13,481	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
AMBEV SA	2,326.95	2,925.95	4,623	89,886	飲料
NATURA & CO HOLDING SA	345	571	2,864	55,688	パーソナル用品
TIM SA	-	622	763	14,839	無線通信サービス
RUMO SA	571	797	1,674	32,557	陸運・鉄道
IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	250	-	-	-	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数 銘柄	121,969	2,371,483	
			-	<4.1%>	
(チェコ)	百株	百株	千チェコ・コルナ	千円	
KOMERCNI BANKA AS	46.48	62.5	4,237	21,257	銀行
CEZ	80.01	98.49	5,870	29,447	電力
MONETA MONEY BANK AS	209.73	269.89	2,163	10,851	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数 銘柄	12,270	61,557	
			-	<0.1%>	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
CHEIL WORLDWIDE INC	33.54	73	162,790	15,839	メディア
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	15.15	20.68	221,276	21,530	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	13.75	18.56	354,496	34,492	保険
DB INSURANCE CO LTD	16.28	38.43	174,664	16,994	保険
COWAY CO LTD	27.6	23.34	155,677	15,147	家庭用耐久財
KT&G CORP	59.33	64.55	534,474	52,004	タバコ
S-1 CORPORATION	4.87	7.94	64,790	6,304	商業サービス・用品
KOREA GAS CORP	26.07	13.03	43,324	4,215	ガス
CJ CORP	3.09	10.01	97,497	9,486	コングロマリット
KAKAO CORP	25.98	175.75	2,091,425	203,495	インタラクティブ・メディアおよびサービス
CJ ENM CO LTD	5.63	2.99	42,936	4,177	インターネット販売・通信販売
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	31.83	24.97	70,914	6,900	機械
KMW CO LTD	8.63	13.34	81,774	7,956	通信機器
SK TELECOM CO LTD	10.13	25.24	762,248	74,166	無線通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO	16.47	-	-	-	建設・土木
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	223.72	215.11	215,110	20,930	資本市場
NCSOFT CORPORATION	8.24	10.26	935,712	91,044	娯楽
LG UPLUS CORP	115.51	156.81	206,205	20,063	各種電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	-	152.61	213,654	20,788	電気設備
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	50.23	-	-	-	建設・土木
POSCO INTERNATIONAL CORP	16.34	-	-	-	商社・流通業
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	4.74	5.62	876,720	85,304	パーソナル用品
LG CHEM LTD	22.58	28.06	2,516,982	244,902	化学
LG CHEM LTD	3.54	4.99	202,344	19,688	化学
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	0.78	2.03	137,228	13,352	パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	225.41	273.94	1,010,838	98,354	銀行
S-OIL CORP	25.95	24.6	194,832	18,957	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	32.34	65.26	330,215	32,129	化学
MERITZ SECURITIES CO LTD	134.12	202.52	94,475	9,192	資本市場
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	25.6	52.63	218,940	21,302	資本市場
POSCO CHEMICAL CO LTD	6.83	13.38	227,460	22,131	建設資材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	8.37	10.44	298,584	29,052	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	10.53	16.75	140,700	13,690	専門小売り
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	18.35	22.28	305,236	29,699	機械
HYUNDAI MOBIS	32.73	41.29	1,263,474	122,936	自動車部品
SK HYNIX INC	267.27	333.67	4,587,962	446,408	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	42.68	45.34	213,778	20,800	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	7.44	15.15	168,922	16,436	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	76.24	92.1	2,132,115	207,454	自動車
HYUNDAI STEEL CO	44.76	45.33	222,117	21,611	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	158.08	211.14	193,193	18,797	銀行
KCC CORP	4.02	-	-	-	化学
KIA CORPORATION	132.1	163.27	1,418,816	138,050	自動車

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円		
KOREA ZINC CO LTD	4.27	4.65	195,997	19,070		金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER CORP	129.26	164.88	394,887	38,422		電力
HANWHA CORP	18.37	24.18	76,287	7,422		コングロマリット
KOREAN AIR CO LTD	8.79	97.24	257,686	25,072		旅客航空輸送業
OCI COMPANY LTD	5.28	—	—	—		化学
CJ LOGISTICS	4.33	4.51	80,954	7,876		陸運・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	12.71	10.93	273,250	26,587		化学
DOUZONE BIZON CO LTD	—	10.2	89,862	8,743		ソフトウェア
HLB INC	17.32	48.88	172,057	16,741		レジャー用品
LG ELECTRONICS INC	46.01	66.67	1,123,389	109,305		家庭用耐久財
LOTTE CORP	21.83	15.91	54,889	5,340		コングロマリット
LG CORP	46.92	52.51	577,610	56,201		コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	51.45	91.63	109,956	10,698		資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	25.23	47.63	213,620	20,785		建設・土木
NAVER CORP	68.85	75.17	2,942,905	286,344		インタラクティブ・メディアおよびサービス
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	2.34	—	—	—		複合小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	21.33	22.41	237,546	23,113		資本市場
OTTOGI CORP	1.21	0.66	37,620	3,660		食品
AMOREPACIFIC GROUP	8.4	20.01	140,070	13,628		パーソナル用品
KANGWON LAND INC	65.2	87.13	211,725	20,600		ホテル・レストラン・レジャー
POSCO	38.29	46.03	1,581,130	153,843		金属・鉱業
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	47.34	88.11	128,640	12,516		建設・土木
SAMSUNG SDI CO LTD	27.24	33.81	2,346,414	228,306		電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	28.89	35.6	688,860	67,026		電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,336.06	2,913	24,440,070	2,378,018		コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	242.94	267.7	197,830	19,248		機械
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	403.27	494.02	3,715,030	361,472		コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	4.13	5.13	142,357	13,851		複合小売り
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	—	15.63	140,357	13,656		医薬品
YUHAN CORP	27.09	37.2	249,240	24,251		医薬品
HANON SYSTEMS	110.87	101.46	181,106	17,621		自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	30.18	31.66	75,192	7,316		保険
GS HOLDINGS CORP	21.16	28.79	119,910	11,667		石油・ガス・消耗燃料
LG DISPLAY CO LTD	108.38	140.45	346,911	33,754		電子装置・機器・部品
CELLTRION INC	46.63	59.4	1,829,520	178,012		バイオテクノロジー
HELIXMITH CO LTD	9.58	—	—	—		バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL GROUP	154.1	190.41	780,681	75,960		銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	7.41	11.32	208,854	20,321		航空貨物・物流サービス
CELLTRION PHARM INC	—	9.88	154,128	14,996		医薬品
LOTTE SHOPPING CO	5.5	5.38	66,443	6,464		複合小売り
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	37.37	43.61	352,368	34,285		保険
AMOREPACIFIC CORP	16.57	17.7	465,510	45,294		パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	3.68	—	—	—		パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	8.75	30.26	104,397	10,157		消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	24.96	34.79	961,943	93,597		石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	4.84	4.66	195,487	19,020		食品
STX PAN OCEAN CO LTD	215.02	195.95	124,232	12,087		海運業
LG INNOTEK CO LTD	6.98	7.64	165,788	16,131		電子装置・機器・部品
SK HOLDINGS CO LTD	15.27	19.45	556,270	54,125		コングロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	196.69	245.61	1,294,364	125,941		銀行
MEDY-TOX INC	2.29	—	—	—		バイオテクノロジー
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	45.7	36.64	128,240	12,477		航空宇宙・防衛
BNK FINANCIAL GROUP INC	214.32	—	—	—		銀行
HANMI PHARM CO LTD	4.16	2.87	101,454	9,871		医薬品
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	113.69	—	—	—		保険
FILA HOLDINGS CORP	24.24	25.17	115,278	11,216		繊維・アパレル・贅沢品
SEEGENE INC	—	9.79	194,821	18,956		バイオテクノロジー

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
E-MART CO LTD	11.97	10.07	171,190	16,656	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	8.21	6.53	24,520	2,385	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	47.69	38.56	191,064	18,590	自動車部品
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	12.33	—	—	—	建設・土木
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	5.76	23.05	136,225	13,254	機械
BGF RETAIL CO LTD	2.53	3.44	54,868	5,338	食品・生活必需品小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	13.23	17.03	205,211	19,967	食品
SK CHEMICALS CO LTD	—	4.09	112,475	10,943	化学
NETMARBLE CORP	8.62	14.5	211,700	20,598	娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	246.32	299.5	306,987	29,869	銀行
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	—	11.69	130,343	12,682	医薬品
SAMSUNG SDS CO LTD	15.37	21.86	419,712	40,837	情報技術サービス
ALTEOGEN INC	—	23.29	216,597	21,074	バイオテクノロジー
SAMSUNG C&T CORP	41.71	54.59	758,801	73,831	コンプロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	8.24	10.33	858,423	83,524	ライフサイエンス・ツール/サービス
PEARL ABYSS CORP	3.14	20.8	139,360	13,559	娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	9.89	29.22	120,970	11,770	機械
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	27.41	38.5	510,510	49,672	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,601.96 110銘柄	9,377.78 106銘柄	77,096.014 —	7,501.442 <12.9%>
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
EVE ENERGY CO LTD	27	90.32	647	10,769	電気設備
LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	173	—	—	—	化学
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	54	54	87	1,449	電子装置・機器・部品
ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	—	58	135	2,251	電子装置・機器・部品
BEIJING THUNISOFT CORP LTD	—	64	118	1,971	ソフトウェア
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	30	30	146	2,444	飲料
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	—	120	148	2,470	半導体・半導体製造装置
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	35	18	171	2,851	金属・鉱業
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD	323	—	—	—	化学
UNISPLENDOR CORP LTD	56	75.4	145	2,427	電子装置・機器・部品
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	—	163	119	1,988	電子装置・機器・部品
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	—	191	282	4,704	紙製品・林産品
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	—	40	112	1,870	通信機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12	12	160	2,677	ライフサイエンス・ツール/サービス
JOYOUNG CO LTD	—	51	165	2,757	家庭用耐久財
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	—	164	353	5,884	電気設備
HUAGONG TECH CO LTD	—	75	156	2,601	電子装置・機器・部品
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	3	9	391	6,520	医薬品
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	81	103.3	221	3,687	機械
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	—	66	120	2,001	医薬品
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	52	53	311	5,185	娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	—	59	108	1,813	コンピュータ・周辺機器
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	—	191	356	5,940	電子装置・機器・部品
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	238	238	98	1,631	保険
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	66	66	215	3,592	家庭用耐久財
BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	103	66.5	353	5,875	建設資材
GEM CO LTD	291	291	245	4,082	金属・鉱業
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	—	44	526	8,763	ソフトウェア
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	69	69	347	5,775	バイオテクノロジー
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	—	186	130	2,179	娯楽
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	—	24	158	2,638	電気設備
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	36	61.2	204	3,406	電子装置・機器・部品
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	59.04	59.04	209	3,487	家庭用耐久財
ZHEJIANG NHU CO LTD	42	58	211	3,515	医薬品
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	19	19	49	816	医薬品
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	18	27	203	3,394	電子装置・機器・部品

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	—	66	168	2,806	食品
CHINA NATIONAL ACCORD MEDICINES CORP LTD	—	39	168	2,805	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	—	34	149	2,491	機械
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	—	51	225	3,746	建設関連製品
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	142	15	24	415	情報技術サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	154	26	44	745	情報技術サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	37	46	344	5,735	食品
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD	—	124	428	7,127	電気設備
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	—	110	109	1,815	航空宇宙・防衛
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	84	207	3,458	自動車部品
VENUSTECH GROUP INC	95	—	—	—	ソフトウェア
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	76	120	1,212	20,173	食品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	37	48	842	14,017	バイオテクノロジー
GLODON CO LTD	23	—	—	—	ソフトウェア
ADDSINO CO LTD	—	102	179	2,980	通信機器
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	112	112	143	2,385	コンピュータ・周辺機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	—	314	200	3,338	化学
NAVINFO CO LTD	218	56	84	1,413	家庭用耐久財
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	143	143	102	1,706	不動産管理・開発
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	27.3	47	782	ヘルスケア・テクノロジー
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	120	26	54	906	医薬品
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	60	78	333	5,552	バイオテクノロジー
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	96	259	712	11,857	化学
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	—	60	144	2,405	医薬品
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	53	32	339	5,644	半導体・半導体製造装置
INSUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	35.7	35.7	96	1,614	コンピュータ・周辺機器
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	—	149	236	3,937	医薬品
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	127	127	155	2,593	コンピュータ・周辺機器
O-FILM TECH CO LTD	86	86	74	1,245	電子装置・機器・部品
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	—	500	319	5,308	金属・鉱業
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	86	124.8	741	12,336	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	184	139	578	9,627	電子装置・機器・部品
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	—	48	542	9,026	飲料
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	69	69	191	3,190	ヘルスケア機器・用品
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	382	382	285	4,754	機械
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	67	13	26	438	医薬品
DONG-E-E-JIAO CO LTD	—	49	176	2,935	医薬品
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	153	153	155	2,584	通信機器
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	—	210	234	3,907	繊維・アパレル・贅沢品
HUADONG MEDICINE CO LTD	—	75	312	5,204	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	50	50	168	2,802	エネルギー設備・サービス
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	66	66	143	2,394	娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	68	48	1,136	18,907	飲料
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	74	74	589	9,815	機械
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	149.5	149.5	120	2,007	食品
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	177	177	149	2,480	資本市場
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	213	178	499	8,314	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	33	59.4	119	1,984	ホテル・レストラン・レジャー
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	38	38	117	1,960	ソフトウェア
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	160	160	104	1,730	不動産管理・開発
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	21	21	249	4,154	資本市場
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	—	364.8	342	5,700	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	—	143	168	2,805	娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	198.5	291.54	970	16,146	電子装置・機器・部品
SHANXI SECURITIES CO LTD	—	275	192	3,198	資本市場
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	269	445	408	6,798	メディア
NEW HOPE LIUHE CO LTD	111	199	352	5,861	食品

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	65	—	—	—	電子装置・機器・部品
DHC SOFTWARE CO LTD	262	38	28	474	情報技術サービス
IFLYTEK CO LTD	75	113	523	8,706	ソフトウェア
HESTEEL CO LTD	—	1,047	279	4,652	金属・鉱業
GOERTEK INC	105	87	256	4,269	電子装置・機器・部品
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	—	213	163	2,718	資本市場
BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD	374	575	442	7,367	商業サービス・用品
BANK OF NINGBO CO LTD	126	191	721	12,001	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD	43	146	376	6,270	電子装置・機器・部品
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	474	474	427	7,107	家庭用耐久財
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	568	283	205	3,414	資本市場
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	376	376	382	6,363	ホテル・レストラン・レジャー
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	122	124	196	3,262	自動車
WESTERN SECURITIES CO LTD	423	227	194	3,237	資本市場
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	79	82	324	5,403	食品
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	30	38	428	7,124	医薬品
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUTRY GROUP	107	107	260	4,334	航空宇宙・防衛
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	202	278.4	795	13,236	資本市場
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	30	48	766	12,756	飲料
WULIANGYE YIBIN CO LTD	123	146	3,822	63,607	飲料
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	208	208	153	2,551	バイオテクノロジー
SUNING.COM CO LTD	291	237	169	2,823	専門小売り
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	791	1,256	874	14,547	電子装置・機器・部品
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	192	499	607	10,114	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	107	—	—	—	家庭用耐久財
MIDEA GROUP CO LTD	—	136	1,086	18,082	家庭用耐久財
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	322	—	—	—	電子装置・機器・部品
GUOSEN SECURITIES CO LTD	170	170	188	3,137	資本市場
PING AN BANK CO LTD	670	614	1,243	20,701	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	121	302.8	475	7,906	食品
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	657	1,287	588	9,787	資本市場
CHINA VANKE CO LTD	373	374	1,079	17,968	不動産管理・開発
ZTE CORP	97	216	612	10,193	通信機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	405	285	351	5,843	機械
WEICHAI POWER CO LTD	220	170	320	5,341	機械
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	—	42	176	2,934	医薬品
GF SECURITIES CO LTD	183	391	584	9,734	資本市場
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	62	211	277	4,617	電気設備
BYD CO LTD	100	71	1,173	19,530	自動車
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	—	341	287	4,783	電子装置・機器・部品
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	—	39	343	5,724	化学
LOMON BILLIONS GROUP CO LTD	110	110	317	5,275	化学
NANJI E-COMMERCE CO LTD	129	129	115	1,921	メディア
CHACHA FOOD CO LTD	—	29	149	2,495	食品
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	—	80	225	3,751	医薬品
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	12	15	226	3,772	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGGBANG TECHNOLOGY CO LTD	—	36	48	811	食品
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	—	494	381	6,354	金属・鉱業
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	37	55.5	119	1,983	娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12	12	281	4,692	飲料
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	120	156	202	3,377	化学
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	—	66	220	3,672	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	42	6	43	722	家庭用耐久財
NINESTAR CORP	—	57	141	2,354	コンピュータ・周辺機器
YUNDA HOLDING CO LTD	54	70.2	89	1,491	航空貨物・物流サービス
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	338	338	112	1,867	半導体・半導体製造装置
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	—	120	171	2,857	娯楽

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	—	42	344	5,738	電子装置・機器・部品
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	—	16	156	2,608	医薬品
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	—	5	143	2,382	医薬品
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	151	151	172	2,869	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	—	53	99	1,659	電気設備
SF HOLDING CO LTD	50	150	955	15,903	航空貨物・物流サービス
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	—	236	161	2,682	資本市場
SHANDONG SINOCCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	65	65	285	4,747	化学
BANK OF SHANGHAI CO LTD	655.9	637.9	529	8,810	銀行
CSC FINANCIAL CO LTD	63	136	407	6,787	資本市場
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	—	50	314	5,226	航空宇宙・防衛
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	—	21	226	3,775	化学
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	171	164	478	7,966	化学
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	—	31	325	5,421	飲料
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	—	225	267	4,451	資本市場
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	—	13	93	1,552	食品・生活必需品小売り
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	—	52	198	3,305	食品
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	—	31.5	218	3,642	通信機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	—	33	374	6,226	容器・包装
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	—	27	382	6,365	電子装置・機器・部品
JUEWEI FOOD CO LTD	—	31	240	4,004	食品
OPPEIN HOME GROUP INC	—	21	325	5,417	家庭用耐久財
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	236	236	172	2,863	銀行
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	43.2	43.2	301	5,017	金属・鉱業
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	95	95	146	2,440	食品
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	—	30	102	1,697	通信機器
C&S PAPER CO LTD	—	78	222	3,699	家庭用品
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	5	8.4	66	1,103	電子装置・機器・部品
ZHEJIANG WOLVO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	—	27	179	2,983	医薬品
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	—	16	137	2,294	ヘルスケア機器・用品
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	29	13.3	115	1,924	ヘルスケア機器・用品
BGI GENOMICS CO LTD	—	13	164	2,744	バイオテクノロジー
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	—	30	198	3,310	化学
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	16	20	257	4,286	バイオテクノロジー
CAITONG SECURITIES CO LTD	127	127	135	2,246	資本市場
BANK OF CHENGDU CO LTD	270	270	284	4,731	銀行
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	—	19	248	4,143	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD	98	98	92	1,541	資本市場
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	144	144	207	3,450	電子装置・機器・部品
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	34	36	1,447	24,095	ヘルスケア機器・用品
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	—	53	133	2,222	各種消費者サービス
HUAXI SECURITIES CO LTD	155	155	154	2,576	資本市場
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	11	12	307	5,122	ソフトウェア
OVCTEK CHINA INC	—	29	281	4,692	ヘルスケア機器・用品
SG MICRO CORP	—	6	150	2,502	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	41	77	2,570	42,777	電気設備
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	6	24.4	424	7,065	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTTEC CO LTD	32	55.6	748	12,458	ライフサイエンス・ツール/サービス
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	25	35	337	5,610	電子装置・機器・部品
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	—	10	710	11,830	電子装置・機器・部品
WILL SEMICONDUCTOR LTD	14	37	1,035	17,227	半導体・半導体製造装置
TIANFENG SECURITIES CO LTD	—	967	482	8,029	資本市場
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	—	817	192	3,208	金属・鉱業
PROYA COSMETICS CO LTD	—	9	153	2,552	パーソナル用品
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	—	609	353	5,888	陸運・鉄道
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	—	1,077	591	9,839	銀行
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	—	61	440	7,329	食品

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	—	8	119	1,981	ヘルスケア機器・用品
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	—	6	141	2,359	食品
PETROCHINA CO LTD	128	1,109	477	7,954	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	1,633	2,118	1,150	19,138	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	2,306	2,744	919	15,297	銀行
BANK OF CHINA LTD	840	840	278	4,640	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	351	421	187	3,117	石油・ガス・消耗燃料
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	100	100	306	5,097	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	61	155	307	5,112	石油・ガス・消耗燃料
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	647	736	3,660	60,921	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	339	377	2,853	47,492	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD	653	688	1,437	23,917	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	948	978	1,030	17,153	銀行
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	1,399	1,382	682	11,361	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD	175	239	489	8,145	自動車
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	37	46	—	157,307	飲料
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	1,232	1,265	618	10,293	銀行
CITIC SECURITIES CO LTD	404	466	1,103	18,355	資本市場
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	165	325	1,129	18,788	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	383	383	177	2,950	運送インフラ
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	628	758	1,551	25,820	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DAQIN RAILWAY CO LTD	661	977	675	11,234	陸運・鉄道
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	1,598	1,097	428	7,137	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	1,467	—	—	—	建設・土木
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	736	—	—	—	機械
HAITONG SECURITIES CO LTD	242	661	719	11,967	資本市場
HUAXIA BANK CO LTD	229	1,129	709	11,798	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	228	163	636	10,584	食品
BANK OF BEIJING CO LTD	880	879	416	6,933	銀行
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	795	—	—	—	無線通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	407	705	583	9,702	金属・鉱業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	107	140	705	11,739	建設資材
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	157	335	619	10,302	資本市場
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	—	78	32	536	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR CO LTD	—	165	540	9,000	自動車
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	246	451	653	10,875	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD	1,101	—	—	—	機械
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	138	196.6	1,584	26,376	医薬品
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	366	—	—	—	金属・鉱業
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	298	—	—	—	建設・土木
HUATAI SECURITIES CO LTD	197	461	774	12,880	資本市場
CHINA RAILWAY GROUP LTD	497	—	—	—	建設・土木
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	71	120	561	9,349	保険
HAIER SMART HOME CO LTD	286	317	997	16,601	家庭用耐久財
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	333	270	859	14,306	機械
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	618	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	—	766	556	9,254	銀行
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	36	79	339	5,643	医薬品
GEMDALE CORP	106	106	127	2,116	不動産管理・開発
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	75	221	518	8,624	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	71	103	1,066	17,748	化学
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	99	—	—	—	不動産管理・開発
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GROUP CO LTD	384	—	—	—	メディア
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	700	935	956	15,917	金属・鉱業
FOUNDER SECURITIES CO LTD	159	580	503	8,377	資本市場
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	120	316	315	5,248	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NARI TECHNOLOGY CO LTD	145	243	733	12,212	電気設備

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	298	298	132	2,206	エネルギー設備・サービス
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	82	67	1,915	31,871	専門小売り
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	1,739	—	—	—	金属・鉱業
TSINGTAO BREWERY CO LTD	73	6	52	877	飲料
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LTD	669	—	—	—	運送インフラ
AVIC CAPITAL CO LTD	322	250	99	1,651	各種金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	658	951	402	6,694	金属・鉱業
AIR CHINA LTD	284	284	260	4,329	旅客航空輸送業
TBEA CO LTD	457	267	299	4,989	電気設備
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	425	314	206	3,443	建設・土木
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	336	—	—	—	建設・土木
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	264	843	332	5,527	建設・土木
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	33	33	184	3,071	運送インフラ
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	69	69	189	3,158	医薬品
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	—	343	159	2,659	資本市場
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	84	83	228	3,795	自動車部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD	148	148	187	3,113	資本市場
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	48	48	67	1,119	化学
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	237	237	288	4,799	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	187	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AECC AVIATION POWER CO LTD	93	—	—	—	航空宇宙・防衛
BANK OF NANJING CO LTD	156	291	269	4,479	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	76	76	131	2,191	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	—	22	33	549	海運業
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	618	602	336	5,600	金属・鉱業
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	—	327	279	4,658	金属・鉱業
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	282	282	244	4,073	資本市場
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	106	—	—	—	医薬品
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	68	95.2	192	3,195	金属・鉱業
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	76	76	255	4,252	電気設備
BBMG CORP	542	542	156	2,606	建設資材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	294	294	187	3,121	食品・生活必需品小売り
YANZHOU COAL MINING CO LTD	186	186	278	4,633	石油・ガス・消耗燃料
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO LTD	—	125	183	3,057	機械
SHENERGY CO LTD	464	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	882	386	220	3,667	旅客航空輸送業
LIAONING CHENG DA CO LTD	—	16	35	585	販売
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	150.19	150.19	181	3,016	電気設備
AISINO CORP	103	—	—	—	ソフトウェア
SHANXI LUJIAN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	—	77	49	830	石油・ガス・消耗燃料
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	18	56.4	464	7,724	ソフトウェア
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	65	162.5	584	9,724	ソフトウェア
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	327	327	223	3,716	旅客航空輸送業
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	1,068	590	175	2,916	建設・土木
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	17	126	567	9,450	自動車部品
XIAMEN C & D INC	304	189	165	2,748	商社・流通業
YOUNGOR GROUP CO LTD	—	256	201	3,352	不動産管理・開発
AVIC HELICOPTER CO LTD	46	46	236	3,933	航空宇宙・防衛
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	168	168	147	2,460	資本市場
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	—	147	482	8,021	医薬品
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	850	394	224	3,737	化学
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	140	196	178	2,977	電気設備
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	17	18	556	9,255	医薬品
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	—	90	109	1,824	医薬品
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	—	266	129	2,160	金属・鉱業
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	17	27	947	15,770	飲料
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	114	12	22	369	通信機器

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	—	263	129	2,162	石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD	157	—	—	—	各種金融サービス
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	—	250	305	5,079	専門小売り
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD	—	259	183	3,047	航空宇宙・防衛
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	—	31	159	2,655	ソフトウェア
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	—	226	199	3,324	化学
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	1,602	262	96	1,613	金属・鉱業
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	—	54	195	3,257	バイオテクノロジー
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	129	129	94	1,573	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	126	126	135	2,258	電気設備
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	—	300	195	3,250	石油・ガス・消耗燃料
JIANGSU HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	—	42	214	3,574	食品
INNER MONGOLIA FIRST MACHINERY GROUP CO LTD	—	199	203	3,391	機械
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LTD	—	64	129	2,157	バイオテクノロジー
ZHEJIANG HUAIHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	—	58.3	109	1,825	医薬品
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	119	119	153	2,554	運送インフラ
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	—	118	158	2,639	医薬品
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	45	45	107	1,788	電子装置・機器・部品
TONGWEI CO LTD	116	103	326	5,428	食品
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	—	11	68	1,134	ソフトウェア
CHONGQING BREWERY CO LTD	—	25	306	5,100	飲料
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	53	53	291	4,848	ホテル・レストラン・レジャー
HUAXIN CEMENT CO LTD	—	56	130	2,178	建設資材
CHINA RAILWAY HI-TECH INDUSTRY CO LTD	228	—	—	—	建設・土木
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	—	93	334	5,571	化学
CHINA JUSHI CO LTD	234	234	428	7,126	建設資材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	53	22.24	185	3,094	機械
HENG TONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	67	40	48	810	通信機器
TONGKUN GROUP CO LTD	—	157	321	5,355	化学
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	—	17	201	3,347	化学
ANGEL YEAST CO LTD	—	49	287	4,783	食品
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	65	128	1,092	18,180	半導体・半導体製造装置
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	—	18	337	5,613	自動車部品
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	—	68	134	2,233	医薬品
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	323.51	323.51	367	6,110	石油・ガス・消耗燃料
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	74	102.8	1,716	28,568	食品
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	—	50	263	4,384	飲料
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	124	12	22	379	自動車部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	58	58	294	4,899	電気設備
DONGXING SECURITIES CO LTD	132	132	144	2,409	資本市場
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	128	—	—	—	旅客航空輸送業
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	215	506	810	13,481	資本市場
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	214	597	318	5,295	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	—	34	215	3,587	飲料
HUAAN SECURITIES CO LTD	165	165	102	1,707	資本市場
BANK OF JIANGSU CO LTD	218	1,173	726	12,082	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD	236	236	355	5,910	銀行
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	—	90	481	8,005	自動車部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	—	11	125	2,086	ヘルスケア機器・用品
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	—	20	43	727	医薬品
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	12	12	126	2,099	半導体・半導体製造装置
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	—	15	122	2,046	家庭用耐久財
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	—	392	392	6,529	資本市場
SDIC CAPITAL CO LTD	65	433	558	9,288	資本市場
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SERVICES CO LTD	351	—	—	—	専門小売り
TOPCHOICE MEDICAL CORP	—	8	223	3,720	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	—	48	378	6,294	半導体・半導体製造装置

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
TOLY BREAD CO LTD	—	36	181	3,015	食品
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	—	22	185	3,088	食品・生活必需品小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	21	29.4	256	4,270	機械
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	449	194	171	2,847	資本市場
SPRING AIRLINES CO LTD	75	42	250	4,168	旅客航空輸送業
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	160	160	252	4,193	資本市場
DAWNING INFORMATION INDUSTRY CO LTD	75	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	—	63	574	9,560	商業サービス・用品
GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	292	292	162	2,711	不動産管理・開発
FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	106	107	508	8,456	不動産管理・開発
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	64,044.54 259銘柄	76,994.14 358銘柄	143,687 —	2,391,132 <4.1%>
(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	844	814	246	6,491	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	141	141	125	3,314	食品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	2,774	3,589	1,539	40,525	銀行
DIGI.COM BHD	1,208	2,353	1,000	26,321	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	588.2	897.2	567	14,948	運送インフラ
RHB BANK BHD	577.8	834.8	442	11,645	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	344	317	262	6,900	コングロマリット
TOP GLOVE CORP BHD	563	2,627	1,463	38,513	ヘルスケア機器・用品
GAMUDA BHD	696	1,002	352	9,283	建設・土木
GENTING BHD	1,367	1,072	523	13,769	ホテル・レストラン・レジャー
YTL CORP BHD	1,070.1	—	—	—	総合公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	87.56	252.56	422	11,128	銀行
HONG LEONG BANK BHD	237.08	349.08	629	16,556	銀行
IJM CORP BHD	1,080.6	—	—	—	建設・土木
IOI CORP BHD	1,222.13	1,908.13	776	20,440	食品
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	265	226	500	13,181	食品
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	88	116	348	9,159	飲料
MALAYAN BANKING BHD	1,785.75	2,543.75	2,106	55,437	銀行
MISC BHD	561.8	1,008.8	688	18,108	海運業
NESTLE MALAYSIA BHD	29	41	559	14,730	食品
PPB GROUP BHD	262.6	462.6	859	22,623	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	208	223	451	11,891	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	394	396	625	16,468	ガス
GENTING MALAYSIA BHD	1,396	2,198	641	16,893	ホテル・レストラン・レジャー
TELEKOM MALAYSIA BHD	567	595	351	9,239	各種電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	1,524.5	1,396.5	1,407	37,051	電力
QL RESOURCES BHD	372	509.5	308	8,126	食品
DIALOG GROUP BHD	1,504.44	2,339.44	725	19,088	エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,545.3	8,914.5	3,744	98,547	銀行
AIRASIA GROUP BHD	555	—	—	—	旅客航空輸送業
CARLSBERG BREWERY-MALAY BHD	70	—	—	—	飲料
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	—	828	318	8,390	ヘルスケア機器・用品
SUPERMAX CORP BHD	—	745.71	395	10,422	ヘルスケア機器・用品
SIME DARBY BERHAD	1,531	1,395	326	8,591	コングロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	765	1,072	1,084	28,554	ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD	1,528	1,701	646	17,013	無線通信サービス
MAXIS BHD	910	1,308	614	16,180	無線通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,323	1,362	1,080	28,428	化学
IHH HEALTHCARE BHD	1,148	1,687	909	23,933	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	145	357	144	3,805	運送インフラ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	880	788	851	22,400	金属・鋳業
SIME DARBY PLANTATION BHD	876	934	418	11,013	食品
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	33,034.86 40銘柄	49,304.57 38銘柄	28,461 —	749,121 <1.3%>

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円		
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	—	71.63	2,005	15,225	金属・鉱業	
BIDVEST GROUP LTD	159.91	162	2,869	21,775	コングロマリット	
CLICKS GROUP LTD	108.58	155.31	3,834	29,105	食品・生活必需品小売り	
DISCOVERY LTD	226.58	211.37	2,972	22,559	保険	
GOLD FIELDS LTD	437.64	557.34	7,972	60,508	金属・鉱業	
REMGRO LTD	228.62	260	2,896	21,987	各種金融サービス	
THE FOSCHINI GROUP LTD	75.72	—	—	—	専門小売り	
NORTHAM PLATINUM LTD	126.32	236.02	6,510	49,415	金属・鉱業	
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	395.05	—	—	—	保険	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	—	285.37	1,892	14,360	金属・鉱業	
EXXARO RESOURCES LTD	79.98	141.15	2,544	19,316	石油・ガス・消耗燃料	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	26.28	38.02	5,327	40,435	銀行	
LIBERTY HOLDINGS LTD	54.22	—	—	—	保険	
MTN GROUP LTD	867.7	1,063.52	9,867	74,893	無線通信サービス	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	216.67	265.08	8,488	64,430	金属・鉱業	
TELKOM SA SOC LTD	74.7	—	—	—	各種電気通信サービス	
FIRSTRAND LTD	1,694.08	3,039.68	15,946	121,031	各種金融サービス	
PSG GROUP LTD	49.09	—	—	—	コングロマリット	
NASPERS LTD	217.22	265.6	94,288	715,645	インターネット販売・通信販売	
NEDBANK GROUP LTD	213.34	234.74	3,481	26,422	銀行	
PICK'N PAY STORES LTD	149.15	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
RMB HOLDINGS LTD	412	—	—	—	各種金融サービス	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	30.72	29.67	6,188	46,967	金属・鉱業	
SASOL LTD	228.48	312.58	7,299	55,399	化学	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	192.18	325.94	4,835	36,700	食品・生活必需品小売り	
MR PRICE GROUP LTD	148.01	182.1	3,596	27,294	専門小売り	
STANDARD BANK GROUP LTD	649.38	842.71	10,372	78,724	銀行	
SPAR GROUP LTD/THE	80.76	94.14	1,806	13,713	食品・生活必需品小売り	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	611.53	542.19	2,877	21,843	複合小売り	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	206.4	241.12	3,563	27,047	医薬品	
ABSA GROUP LTD	307.37	391.86	5,009	38,019	銀行	
TIGER BRANDS LTD	72.48	118.03	2,438	18,510	食品	
SANLAM LTD	960.98	1,195.61	6,813	51,716	保険	
INVESTEC LTD	252.13	—	—	—	資本市場	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	412.26	489.66	14,002	106,281	金属・鉱業	
KUMBA IRON ORE LTD	30.74	31.73	2,044	15,514	金属・鉱業	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	806.61	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
RMI HOLDINGS	482.13	358.36	1,110	8,426	保険	
VODACOM GROUP PTY LTD	323.22	432.18	5,502	41,760	無線通信サービス	
NEPI ROCKCASTLE PLC	151.82	221.85	2,120	16,097	不動産管理・開発	
OLD MUTUAL LTD	2,218.19	2,929.73	3,937	29,886	保険	
REINET INVESTMENTS SCA	80.54	77.43	2,241	17,011	資本市場	
PEPKOR HOLDINGS LTD	166.33	—	—	—	専門小売り	
MULTICHOICE GROUP LTD	249.88	272.58	3,489	26,481	メディア	
SIBANYE STILLWATER LTD	912.18	1,755.33	12,799	97,150	金属・鉱業	
BID CORP LTD	175.18	180.86	5,363	40,706	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	44銘柄	36銘柄	278,309	2,112,368	<3.6%>
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円		
BANGKOK BANK PCL	235	277	3,420	11,904	銀行	
BERLI JUCKER PCL NVDR	779	1,011	3,740	13,017	食品・生活必需品小売り	
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	1,462	1,036	1,181	4,110	銀行	
RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	236	342	1,701	5,921	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	297	432	4,514	15,710	銀行	
TRUE CORP PCL NVDR	5,859.55	5,093.55	1,660	5,778	各種電気通信サービス	
KASIKORNBANK PCL NVDR	352	267	3,591	12,497	銀行	
TMB BANK PCL -NVDR	13,362	—	—	—	銀行	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
IRPC PCL NVDR	3,796	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	2,119	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	164	124	2,170	7,551	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHIN CORP PCL	1,002	1,366	7,991	27,809	無線通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	2,092	2,497	7,366	25,634	食品
ADVANCED INFO SERVICE PCL	585	664	11,155	38,820	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	3,186.2	4,308.2	6,031	20,989	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	—	208	7,737	26,926	電子装置・機器・部品
PTT PCL	5,678	7,056	28,047	97,605	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,464	1,471	2,147	7,473	食品
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	—	656	4,952	17,235	消費者金融
LAND AND HOUSES PCL NVDR	3,678	6,511	5,404	18,806	不動産管理・開発
SIAM CEMENT PCL NVDR	386.5	489.5	20,069	69,841	建設資材
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	2,107	2,345	15,359	53,451	運送インフラ
KASIKORN BANK PCL - FOREIGN	566	686	9,261	32,228	銀行
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	1,178	1,328	7,005	24,378	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	4,221	5,106	11,182	38,913	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	239	415	5,727	19,929	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,265.1	1,695.1	5,127	17,844	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL NVDR	813	858	4,783	16,646	石油・ガス・消耗燃料
CP ALL PCL NVDR	2,843	3,704	23,705	82,495	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL	4,168	3,561	3,204	11,153	陸運・鉄道
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	728.45	706.45	8,194	28,517	石油・ガス・消耗燃料
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	132	292	919	3,200	無線通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	536.22	1,234.22	5,677	19,757	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,246.08	1,452.08	9,075	31,582	化学
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	934	760	4,465	15,538	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	4,208	6,136	4,908	17,082	運送インフラ
B GRIMM POWER PCL NVDR	481	566	2,447	8,518	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	1,220	2,077	6,802	23,671	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
OSOTSPA PCL NVDR	267	237	799	2,783	飲料
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	—	1,053	2,148	7,475	資本市場
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	—	3,536	1,676	5,832	ホテル・レストラン・レジャー
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	614.33	919.33	3,125	10,877	複合小売り
SRI SAWAD POWER 1979 PCL NVDR	460	568	4,671	16,257	消費者金融
SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	—	906	4,009	13,951	ヘルスケア機器・用品
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	—	1,966	5,996	20,867	専門小売り
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	307	611	4,002	13,927	消費者金融
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	255	491	3,559	12,387	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	75,522.43 41銘柄	77,018.43 44銘柄	280,720 —	976,906 <1.7%>
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
BANK MILLENNIUM SA	55.36	—	—	—	銀行
MBANK	6.68	—	—	—	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	82.1	97.85	1,952	55,801	金属・鉱業
BANK PEKAO SA	68.11	97.3	741	21,204	銀行
ORANGE POLSKA SA	297.77	307.83	220	6,313	各種電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	157.33	164.47	1,104	31,574	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA	0.57	0.67	582	16,652	繊維・アパレル・贅沢品
SANTANDER BANK POLSKA SA	24.25	16	338	9,686	銀行
CD PROJEKT RED SA	34.22	42.92	758	21,686	娯楽
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	440.83	578.12	1,916	54,782	銀行
CCC SA	20.25	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
GRUPA LOTOS SA	39.78	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	821.78	885.35	617	17,654	石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA	124.85	122.39	373	10,670	メディア
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	416.93	521.92	443	12,681	電力

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
(ポーランド) POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA DINO POLSKA SA AMREST HOLDINGS SE ALLEGRO.EU SA	百株 309.05 17.97 44 -	百株 363.09 34.34 -	千ポーランド・ズロチ 1,178 900 -	千円 33,679 25,728 -	保険 食品・生活必需品小売り ホテル・レストラン・レジャー インターネット販売・通信販売	
小計	株数・金額 2,961.83 銘柄数<比率> 18銘柄	株数 3,461.2	外貨建金額 12,437	邦貨換算金額 355,526 <0.6%>		
(ハンガリー) RICHTER GEDEON NYRT MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT OTP BANK NYRT	百株 75.42 179.55 115.07	百株 83.93 307.03 137.82	千ハンガリー・フォリント 72,725 63,616 181,853	千円 26,184 22,904 65,474	医薬品 石油・ガス・消耗燃料 銀行	
小計	株数・金額 370.04 銘柄数<比率> 3銘柄	株数 528.78	外貨建金額 318,195	邦貨換算金額 114,563 <0.2%>		
(ユーロ圏・ベルギー) TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA	百株 27	百株 -	千ユーロ -	千円 -	建設資材	
小計	株数・金額 27 銘柄数<比率> 1銘柄	株数 -	外貨建金額 -	邦貨換算金額 -<-%>		
(ユーロ圏・ギリシャ) ALPHA BANK A.E. NATIONAL BANK OF GREECE HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA FF GROUP EUROBANK ERGASIAS SERVICES MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN OPAP SA JUMBO SA	百株 383.28 263.48 145.18 31.3 748.45 22.65 91.84 54.3	百株 - 131.62 31.3 - - 112.46 81.43	千ユーロ - 186 0 - - 139 125	千円 - - 24,295 0 - - 18,068 16,311	銀行 銀行 各種電気通信サービス 繊維・アパレル・贅沢品 銀行 石油・ガス・消耗燃料 ホテル・レストラン・レジャー 専門小売り	
小計	株数・金額 1,740.48 銘柄数<比率> 8銘柄	株数 356.81	外貨建金額 451	邦貨換算金額 58,675 <0.1%>		
合計	株数・金額 1,249,512.59 銘柄数<比率> 1,180銘柄	株数 1,493,200.07	外貨建金額 -	邦貨換算金額 54,202,063 <93.2%>		

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

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

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

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

(2) 外国新株予約権証券

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
		証 券 数	証 券 数	評 価 額
				外 貨 建 金 額
(タイ) MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	証券 9,465	証券 9,465	千タイ・パーツ 6	千円 22
合 計	証 券 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率> 9,465 1銘柄	証 券 数 9,465 1銘柄	-	22 <0.0%>

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額
(メキシコ) FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D GRUPO TELEvisa SAB CEMEX SAB DE CV MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV FIBRA UNO ADMINISTRACION SA COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	千□ 96.1 103.8 688.475 25 184.9 23.3	千□ 121.8 141.9 948.675 28 173.9 41.5	千メキシコ・ペソ 19,446 7,394 14,268 2,182 4,345 3,907	千円 106,110 40,347 77,853 11,906 23,712 21,322
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率> 1,121,575 6銘柄<0.3%>	1,455,775 6銘柄<0.5%>	51,544	281,252 -
(ブラジル) SUL AMERICA SA BANCO SANTANDER BRASIL SA ENERGISA SA KLABIN SA BANCO INTER SA BANCO BTG PACTUAL SA	千□ 16.269 13.6 6.1 25.2 - 7.2	千□ 15.356 21.7 17.5 48.7 6.7 12.8	千ブラジル・レアル 495 840 759 1,434 1,283 1,294	千円 9,637 16,349 14,773 27,885 24,954 25,171
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率> 68,369 5銘柄<0.1%>	122,756 6銘柄<0.2%>	6,108	118,772 -
(南アフリカ) REDEFINE PROPERTIES LTD GROWTHPOINT PROPERTIES LTD FORTRESS REIT LTD	千□ 152.868 195.763 54.518	千□ - 259.878 -	千南アフリカ・ランド - 3,513 -	千円 - 26,667 -
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率> 403,149 3銘柄<0.1%>	259,878 1銘柄<0.0%>	3,513	26,667 -
合 計	□ 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率> 1,593,093 14銘柄<0.4%>	1,838,409 13銘柄<0.7%>	-	426,693 -

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期		末
			買 建 額	売 建 額	額
外国	MINI	MSCI	EMG	MKT	
			百万円		百万円
			3,529		-

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

■投資信託財産の構成

2021年4月19日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	率
株 式	千円		%
株 式	54,202,064		93.2
新 株 予 約 権 証 券	22		0.0
投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券	426,693		0.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,557,058		6.1
投 資 信 託 財 産 総 額	58,185,838		100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、57,732,994千円、99.2%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年4月19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1香港・ドル=13.98円、1台湾・ドル=3.834円、1イギリス・ポンド=150.16円、1トルコ・リラ=13.441円、1メキシコ・ペソ=5.456円、1フィリピン・ペソ=2.245円、100チリ・ペソ=15.432円、100コロンビア・ペソ=3.015円、1クウェート・ディナール=361.12円、1カタール・リアル=29.55円、1サウジアラビア・リアル=29.01円、1インド・ルピー=1.47円、1パキスタン・ルピー=0.71円、100インドネシア・ルピア=0.75円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=29.63円、1ブラジル・レアル=19.443円、1チェコ・コルナ=5.016円、100韓国・ウォン=9.73円、1オフショア・人民元=16.641円、1マレーシア・リンギット=26.32円、1南アフリカ・ランド=7.59円、1タイ・バーツ=3.48円、1ポーランド・ズロチ=28.585円、100ハンガリー・フォリント=36.004円、1ユーロ=129.99円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年4月19日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	58,509,394,890円
コ ー ル ・ オ ー ン 等	1,276,474,139
株 式(評価額)	54,202,064,012
新 株 予 約 権 証 券(評価額)	22,727
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	376,312,788
投 資 証 券(評価額)	50,380,494
未 収 入 金	373,640,526
未 収 配 当 金	165,569,137
差 入 委 託 証 拠 金	2,064,931,067
(B) 負 債	352,908,406
未 払 金	323,744,406
未 払 解 約 金	29,164,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	58,156,486,484
元 本	39,168,921,759
次 期 繰 越 損 益 金	18,987,564,725
(D) 受 益 権 総 口 数	39,168,921,759口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	14,848円

(注1) 期首元本額 42,338,367,514円
追加設定元本額 58,867,382,355円
一部解約元本額 62,036,828,110円

(注2) 期末における元本の内訳
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金> 7,303,162,651円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ) 185,855,235円
M I T O ラップ型ファンド (安定型) 2,697,665円
M I T O ラップ型ファンド (中立型) 7,179,516円
M I T O ラップ型ファンド (積極型) 8,468,656円
グローバル8資産ラップファンド (安定型) 26,478,400円
グローバル8資産ラップファンド (中立型) 17,278,421円
グローバル8資産ラップファンド (積極型) 12,542,068円
たわらノーロード 新興国株式 7,174,858,507円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け> 1,931,172,828円
たわらノーロード バランス (8資産均等型) 1,470,308,318円
たわらノーロード バランス (堅実型) 13,218,963円
たわらノーロード バランス (標準型) 47,765,417円
たわらノーロード バランス (積極型) 75,926,200円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) 820,678円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) 88,359,021円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) 183,683,859円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) 118,365,981円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) 197,378,656円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 241,783円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 1,840,624円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 979,657円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 2,408,534円

たわらノーロード 全世界株式 53,106,539円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド 164,452,087円
マネックス資産設計ファンド エボリューション 394,963,051円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) 329,145,943円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) 368,217,240円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) 734,808,944円
投資のソムリエ 6,896,439,394円
クルーズコントロール 568,471,089円
投資のソムリエ<DC年金> 379,244,915円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 320,081,299円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) 10,065,760円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) 21,890,292円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 279,169,620円
リスク抑制世界8資産バランスファンド 2,945,535,376円
ワールドアセットバランス (基本コース) 923,919,156円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 3,075,512,899円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) 9,417,970円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) 4,450,393円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 2,736,375円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) 22,664,724円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 1,870,907,574円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 278,541,972円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) 5,321,207円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) 2,715,829円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) 2,737,979円
エマージング株式パッシブファンドV A (適格機関投資家専用) 16,310,910円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 158,553,968円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定) 301,892,339円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定) 156,655,277円
期末元本合計 39,168,921,759円

■損益の状況

当期 自2020年4月21日 至2021年4月19日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	846,342,300円	
	受取配当金	844,040,668	
	受取利息	1,509,514	
	その他の収益	958,033	
	支払利息	△165,915	
(B)	有価証券売買損益	18,837,435,578	
	売却益	21,609,017,908	
	売却損	△2,771,582,330	
(C)	先物取引等取引損益	3,036,790,791	
	取引益	3,424,054,030	
	取引損	△387,263,239	
(D)	その他の費用	△229,252,031	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	22,491,316,638	
(F)	前期繰越損益金	△1,171,540,034	
(G)	解約差損益金	△17,439,135,474	
(H)	追加信託差損益金	15,106,923,595	
(I)	合計(E+F+G+H)	18,987,564,725	
	次期繰越損益金(I)	18,987,564,725	

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第13期 (決算日 2021年4月19日)

(計算期間 2020年4月21日～2021年4月19日)

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2008年3月6日から無期限です。
運用方針	主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率			
9期 (2017年4月18日)	17,917	4.7%	88,609.40	8.4%	96.8%	-	80,269 百万円
10期 (2018年4月18日)	17,815	△0.6	87,698.99	△1.0	96.4%	-	111,615
11期 (2019年4月18日)	19,206	7.8	93,647.60	6.8	97.5%	-	108,066
12期 (2020年4月20日)	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5%	-	78,076
13期 (2021年4月19日)	21,087	8.5	98,265.18	10.5	98.4%	-	152,776

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

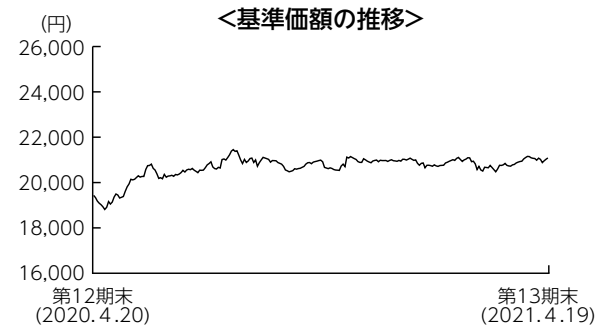
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		JPモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 4 月 20 日	円 19,435	% -	ポイント 88,952.63	% -	% 96.5	% -
4 月 末	18,910	△2.7	87,054.07	△2.1	98.8	-
5 月 末	20,242	4.2	93,802.25	5.5	97.4	-
6 月 末	20,439	5.2	95,583.81	7.5	97.2	-
7 月 末	20,642	6.2	95,671.24	7.6	97.4	-
8 月 末	20,718	6.6	96,896.67	8.9	98.4	-
9 月 末	20,610	6.0	95,218.27	7.0	98.2	-
10 月 末	20,553	5.8	94,180.51	5.9	88.4	-
11 月 末	20,873	7.4	97,409.57	9.5	102.4	-
12 月 末	21,026	8.2	98,538.93	10.8	97.4	-
2021 年 1 月 末	20,895	7.5	97,840.34	10.0	105.2	-
2 月 末	20,553	5.8	96,320.68	8.3	93.8	-
3 月 末	21,040	8.3	97,550.06	9.7	97.9	-
(期 末) 2021 年 4 月 19 日	21,087	8.5	98,265.18	10.5	98.4	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年4月21日から2021年4月19日まで）



基準価額の推移

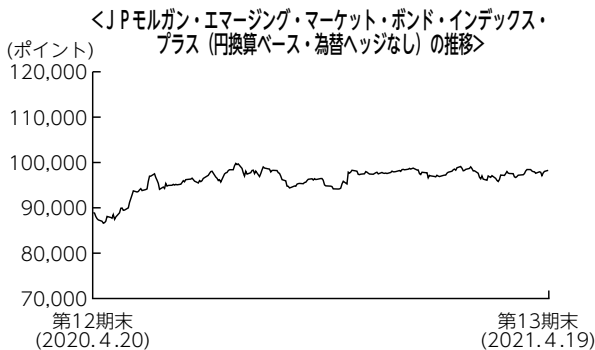
当期末の基準価額は21,087円となり、前期末比で8.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

新興国債券市場は上昇しました。期初から2020年8月にかけては、欧米での経済活動再開に伴う景気回復期待や、欧州復興基金の創設でEU（欧州連合）首脳が合意したことなどが上昇要因となりました。その後は新型コロナウイルスの感染再拡大、米国大統領選挙でのバイデン氏勝利や新型コロナウイルスのワクチンへの期待感などにより一進一退の展開となりました。2021年2月中旬以降は、財政出動や景気回復によって過度なインフレが生じるとの懸念が台頭し弱含みましたが、期を通じては上昇しました。



為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。期初から一進一退で推移した後、2020年7月には米金融緩和の長期化観測や景気先行きの不透明感などから下落しました。その後も年内は軟調に推移しましたが、年明け以降は追加経済対策への期待感や新型コロナウイルスワクチン接種の進行などを好感し、大幅に上昇しました。期末にかけては米金利上昇の一服などから下落しましたが、期を通じては上昇しました。

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○国別構成比

期首 (前期末)

国	ファンド	ベンチマーク	差	
中南米	アルゼンチン	0.0%	4.9%	△4.9%
	ブラジル	10.0%	8.6%	1.4%
	メキシコ	15.3%	13.4%	1.9%
	パナマ	5.7%	3.9%	1.8%
	ペルー	4.6%	2.9%	1.7%
	コロンビア	9.2%	8.4%	0.8%
計	44.7%	42.1%	2.7%	
欧州	ハンガリー	4.1%	2.5%	1.6%
	ロシア	14.2%	11.6%	2.6%
	トルコ	0.0%	12.6%	△12.6%
	ウクライナ	0.0%	4.3%	△4.3%
	クロアチア	1.8%	1.1%	0.7%
	ルーマニア	3.5%	2.3%	1.2%
計	23.6%	34.4%	△10.8%	
アジア・オセアニア	インドネシア	13.8%	11.8%	2.1%
	フィリピン	8.8%	8.0%	0.8%
	計	22.6%	19.7%	2.9%
アフリカ	南アフリカ	5.6%	3.8%	1.8%
	計	5.6%	3.8%	1.8%
現金など	3.5%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	

期末

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



(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で10.5%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを2.0%下回りました。これは、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	2円	0.010%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	2	0.010	
期中の平均基準価額は20,679円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2020年4月21日から2021年4月19日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	2,511,941	1,836,789 (4,612)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年4月21日から2021年4月19日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 1,211,303	千アメリカ・ドル 1,383,333	千円 150,313,001	% 98.4	% 16.7	% 75.2	% 20.3	% 2.9	
合 計	-	-	150,313,001	98.4	16.7	75.2	20.3	2.9	

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

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

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末								
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額				
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円				
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	6.0500	16,900	20,798	2,259,991	2040/01/11			
BRAZIL 5.625 01/07/41	国債証券	5.6250	12,100	12,928	1,404,848	2041/01/07			
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	国債証券	4.6000	11,000	11,538	1,253,762	2046/01/23			
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	6,800	8,480	921,445	2026/01/29			
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国債証券	7.7500	8,100	11,924	1,295,729	2031/01/14			
ROMANIA 6.125 01/22/44	国債証券	6.1250	8,400	10,904	1,184,929	2044/01/22			
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	国債証券	5.5500	14,400	16,957	1,842,548	2045/01/21			
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	国債証券	6.3750	5,600	7,612	827,140	2032/01/15			
COLOMBIA 6.125 01/18/41	国債証券	6.1250	13,000	15,863	1,723,714	2041/01/18			
INDONESIA 5.25 01/17/42	国債証券	5.2500	10,300	12,694	1,379,429	2042/01/17			
INDONESIA 6.75 01/15/44	国債証券	6.7500	8,500	12,337	1,340,558	2044/01/15			
BRAZIL 5.0 01/27/45	国債証券	5.0000	14,800	14,507	1,576,334	2045/01/27			
INDONESIA 5.125 01/15/45	国債証券	5.1250	9,400	11,470	1,246,332	2045/01/15			
INDONESIA 4.35 01/11/48	国債証券	4.3500	7,000	7,855	853,622	2048/01/11			
BRAZIL 8.25 01/20/34	国債証券	8.2500	9,200	12,500	1,358,254	2034/01/20			
PANAMA 6.7 01/26/36	国債証券	6.7000	12,900	17,467	1,898,060	2036/01/26			
BRAZIL 7.125 01/20/37	国債証券	7.1250	8,300	10,456	1,136,253	2037/01/20			
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	10,500	15,718	1,707,929	2038/01/17			
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	国債証券	3.9500	8,800	9,703	1,054,386	2040/01/20			
INDONESIA 5.95 01/08/46	国債証券	5.9500	6,200	8,371	909,644	2046/01/08			
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	3.6000	9,200	10,080	1,095,340	2025/01/30			
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	国債証券	5.0000	6,800	8,530	926,929	2037/01/13			
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	10,800	11,887	1,291,713	2025/01/15			
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	5,000	5,647	613,659	2027/01/08			
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	国債証券	3.7500	10,000	11,242	1,221,651	2029/01/14			
ROMANIA 4.875 01/22/24	国債証券	4.8750	5,600	6,224	676,379	2024/01/22			
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国債証券	4.5000	10,000	11,073	1,203,251	2026/01/28			
CROATIA 6.0 01/26/24	国債証券	6.0000	13,400	15,327	1,665,532	2024/01/26			
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	国債証券	4.1250	10,000	11,208	1,217,883	2026/01/21			
INDONESIA 5.875 01/15/24	国債証券	5.8750	9,200	10,437	1,134,143	2024/01/15			
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	11,800	13,472	1,463,895	2026/01/08			
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	国債証券	4.2000	7,800	8,575	931,843	2024/01/21			
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	13,800	14,799	1,608,139	2028/01/13			

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	国債証券	3.7500	10,200	11,050	1,200,783	2028/01/11
INDONESIA 3.5 01/11/28	国債証券	3.5000	7,200	7,823	850,048	2028/01/11
PANAMA 3.16 01/23/30	国債証券	3.1600	9,000	9,420	1,023,609	2030/01/23
BRAZIL 4.75 01/14/50	国債証券	4.7500	13,000	12,175	1,323,008	2050/01/14
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国債証券	4.5000	10,000	10,440	1,134,410	2050/01/31
PERU 2.783 01/23/31	国債証券	2.7830	17,000	17,140	1,862,478	2031/01/23
COLOMBIA 3.0 01/30/30	国債証券	3.0000	9,000	9,023	980,526	2030/01/30
PERU 2.392 01/23/26	国債証券	2.3920	9,000	9,294	1,009,947	2026/01/23
BRAZIL 8.75 02/04/25	国債証券	8.7500	5,800	7,079	769,256	2025/02/04
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国債証券	3.7000	9,000	9,649	1,048,546	2042/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	国債証券	4.6000	10,400	10,934	1,188,109	2048/02/10
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国債証券	9.5000	7,800	12,240	1,330,105	2030/02/02
COLOMBIA 5.625 02/26/44	国債証券	5.6250	11,000	12,825	1,393,613	2044/02/26
INDONESIA 5.35 02/11/49	国債証券	5.3500	4,000	5,106	554,863	2049/02/11
ROMANIA 4.0 02/14/51	国債証券	4.0000	10,000	9,977	1,084,133	2051/02/14
BRAZIL 5.625 02/21/47	国債証券	5.6250	11,600	12,170	1,322,489	2047/02/21
COLOMBIA 4.0 02/26/24	国債証券	4.0000	9,100	9,731	1,057,404	2024/02/26
INDONESIA 4.75 02/11/29	国債証券	4.7500	7,000	8,205	891,562	2029/02/11
HUNGARY 5.375 02/21/23	国債証券	5.3750	10,358	11,298	1,227,701	2023/02/21
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	国債証券	3.0000	10,000	10,725	1,165,383	2028/02/01
ROMANIA 3.0 02/14/31	国債証券	3.0000	13,000	13,211	1,435,534	2031/02/14
INDONESIA 2.85 02/14/30	国債証券	2.8500	6,000	6,228	676,773	2030/02/14
PANAMA 3.875 03/17/28	国債証券	3.8750	8,100	8,939	971,333	2028/03/17
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	7.5000	9,765	11,262	1,223,832	2030/03/31
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	国債証券	4.3750	16,400	18,242	1,982,234	2029/03/21
COLOMBIA 4.5 03/15/29	国債証券	4.5000	10,000	11,095	1,205,669	2029/03/15
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	国債証券	5.5000	7,600	9,223	1,002,267	2026/03/30
PERU 6.55 03/14/37	国債証券	6.5500	8,000	10,967	1,191,695	2037/03/14
HUNGARY 7.625 03/29/41	国債証券	7.6250	10,000	16,346	1,776,168	2041/03/29
HUNGARY 5.375 03/25/24	国債証券	5.3750	16,380	18,613	2,022,569	2024/03/25
PANAMA 3.75 03/16/25	国債証券	3.7500	7,200	7,874	855,623	2025/03/16
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	国債証券	4.1500	12,400	13,898	1,510,262	2027/03/28
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	5.1000	22,000	25,951	2,819,866	2035/03/28
PANAMA 4.5 04/16/50	国債証券	4.5000	10,300	11,611	1,261,660	2050/04/16
PANAMA 4.5 04/01/56	国債証券	4.5000	11,000	12,303	1,336,922	2056/04/01
INDONESIA 4.45 04/15/70	国債証券	4.4500	5,000	5,641	613,018	2070/04/15
PANAMA 9.375 04/01/29	国債証券	9.3750	4,900	7,233	786,042	2029/04/01
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	5.6250	16,000	20,304	2,206,336	2042/04/04
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	国債証券	5.0000	10,000	11,165	1,213,243	2051/04/27
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	国債証券	4.5000	17,000	19,148	2,080,680	2029/04/22
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	国債証券	4.5000	5,800	5,999	651,907	2022/04/04
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	国債証券	4.7500	14,000	15,848	1,722,043	2032/04/27
CROATIA 5.5 04/04/23	国債証券	5.5000	12,400	13,583	1,476,020	2023/04/04
INDONESIA 3.375 04/15/23	国債証券	3.3750	6,700	7,062	767,385	2023/04/15
INDONESIA 4.1 04/24/28	国債証券	4.1000	5,000	5,613	609,949	2028/04/24
BRAZIL 6.0 04/07/26	国債証券	6.0000	10,800	12,534	1,362,002	2026/04/07
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	11,400	12,226	1,328,531	2026/04/14
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	国債証券	3.2500	11,000	11,279	1,225,607	2030/04/16
COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	3.1250	16,000	16,040	1,742,993	2031/04/15
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	国債証券	3.9000	7,000	7,752	842,371	2025/04/27
COLOMBIA 4.125 05/15/51	国債証券	4.1250	7,000	6,882	747,833	2051/05/15
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	国債証券	5.8750	3,000	3,171	344,614	2022/05/30
COLOMBIA 5.2 05/15/49	国債証券	5.2000	8,000	9,063	984,807	2049/05/15

銘柄	当 期				末	
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	4.7500	16,400	18,444	2,004,153	2026/05/27
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	国債証券	2.9500	6,000	5,799	630,211	2045/05/05
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	11,000	11,518	1,251,556	2029/05/30
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	国債証券	2.4570	8,000	8,187	889,668	2030/05/05
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	8,400	9,372	1,018,445	2030/06/22
COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	5.0000	18,000	19,845	2,156,357	2045/06/15
ROMANIA 5.125 06/15/48	国債証券	5.1250	8,600	9,976	1,084,066	2048/06/15
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	国債証券	6.3000	4,000	4,172	453,338	2048/06/22
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	5.2500	29,000	36,000	3,911,822	2047/06/23
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	国債証券	4.2500	13,400	14,838	1,612,388	2027/06/23
PERU 2.844 06/20/30	国債証券	2.8440	5,000	5,128	557,300	2030/06/20
BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	3.8750	16,000	15,855	1,722,860	2030/06/12
BRAZIL 2.875 06/06/25	国債証券	2.8750	9,000	9,199	999,660	2025/06/06
PERU 7.35 07/21/25	国債証券	7.3500	9,300	11,498	1,249,429	2025/07/21
INDONESIA 3.85 07/18/27	国債証券	3.8500	5,600	6,195	673,179	2027/07/18
PERU 4.125 08/25/27	国債証券	4.1250	6,300	7,062	767,437	2027/08/25
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	国債証券	5.8750	16,200	18,121	1,969,133	2025/09/16
COLOMBIA 7.375 09/18/37	国債証券	7.3750	8,400	11,369	1,235,399	2037/09/18
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	国債証券	6.7500	10,200	13,173	1,431,410	2034/09/27
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	国債証券	5.6500	7,200	7,086	770,029	2047/09/27
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	国債証券	5.8750	8,200	10,754	1,168,611	2043/09/16
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	国債証券	4.8750	18,400	20,082	2,182,164	2023/09/16
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	6,000	6,459	701,912	2029/09/18
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	5.7500	12,000	11,714	1,272,886	2049/09/30
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	国債証券	4.8500	11,000	11,502	1,249,890	2029/09/30
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	国債証券	5.7500	9,800	11,325	1,230,598	2110/10/12
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債証券	6.3750	9,000	12,540	1,362,602	2034/10/23
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	国債証券	4.3000	11,200	11,374	1,235,952	2028/10/12
INDONESIA 4.2 10/15/50	国債証券	4.2000	7,000	7,854	853,509	2050/10/15
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	国債証券	4.0000	12,500	13,585	1,476,152	2023/10/02
INDONESIA 3.7 10/30/49	国債証券	3.7000	4,000	4,163	452,388	2049/10/30
INDONESIA 3.85 10/15/30	国債証券	3.8500	8,000	8,922	969,571	2030/10/15
PERU 5.625 11/18/50	国債証券	5.6250	13,000	17,648	1,917,683	2050/11/18
HUNGARY 5.75 11/22/23	国債証券	5.7500	10,000	11,321	1,230,159	2023/11/22
合 計	-	-	1,211,303	1,383,333	150,313,001	-

■投資信託財産の構成

2021年4月19日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
公 社 債	150,313,001		98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,111,370		2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	153,424,372		100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、151,969,377千円、99.1%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年4月19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年4月19日)現在

項	目	当	期	末
(A)	資 産	153,874,159,660	円	
	コ ー プ	1,721,510,452		
	社 債(評価額)	150,313,001,877		
	未 収 入 金	449,787,645		
	未 収 利 息	944,560,040		
	前 払 費 用	445,299,646		
(B)	負 債	1,097,433,577		
	未 払 金	1,079,463,577		
	未 払 解 約 金	17,970,000		
(C)	純 資 産 総 額(A-B)	152,776,726,083		
	元 本	72,451,871,684		
	次 期 繰 越 損 益 金	80,324,854,399		
(D)	受 益 権 総 口 数	72,451,871,684		
	1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	21,087		円

(注1) 期首元本額 40,172,815,072円
追加設定元本額 132,587,338,214円
一部解約元本額 100,308,281,602円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM新興国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	109,169,616円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,029,331,801円
たわらノーロード バランス(堅実型)	75,372,953円
たわらノーロード バランス(標準型)	201,288,849円
たわらノーロード バランス(積極型)	80,498,643円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	721,873円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,437,876円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,895,559円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	921,239円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,273,850円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,470,886円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10)	202,138,086円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20)	251,403,543円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30)	513,559,739円
投資のソムリエ	16,959,937,084円
グルーズコントロール	404,057,660円
投資のソムリエ<DC年金>	932,236,669円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	183,350,267円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,849,283円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	6,148,787円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	637,131,511円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,883,910,522円
ワールドアセットバランス(基本コース)	669,422,645円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,191,812,586円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	16,532,675円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,813,459円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,238,125円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	37,137,407円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,339,044,090円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	194,682,417円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,262,711円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,755,318円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,789,602円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	24,501,127,196円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	387,668,845円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,950,327,719円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2(適格機関投資家限定)	1,054,444,736円
エマージング債券バックスアップファンドVA(適格機関投資家専用)	11,621,866円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	216,802,719円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	111,545,581円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,343,676,386円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	854,059,305円
期末元本合計	72,451,871,684円

■損益の状況

当期 自2020年4月21日 至2021年4月19日

項	目	当	期
(A)	配 当 等 収 益	5,556,665,779	円
	受 取 利 息	5,557,323,992	
	支 払 利 息	△658,213	
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益	3,739,982,844	
	売 買 益	13,133,820,690	
	売 買 損	△9,393,837,846	
(C)	そ の 他 費 用	△13,426,667	
(D)	当 期 損 益 金(A+B+C)	9,283,221,956	
(E)	前 期 繰 越 損 益 金	37,903,682,683	
(F)	解 約 差 損 益 金	△106,290,754,926	
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金	139,428,704,686	
(H)	合 計(D+E+F+G)	80,324,854,399	
	次 期 繰 越 損 益 金(H)	80,324,854,399	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

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

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第15期 (決算日 2021年6月7日)

(計算期間 2020年6月9日~2021年6月7日)

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2006年8月4日から無期限です。
運用方針	東証R E I T指数 (配当込み) の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている (または採用予定の) 不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証R E I T指数		投資証券 組入比率	不動産 投信先物 指数比率	純資産 総額
	期 騰 落 率	中 率	(配当込み) ベンチマーク	期 騰 落 率			
11期 (2017年6月6日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
12期 (2018年6月6日)	17,626	△3.6	3,285.51	△3.8	98.3	1.5	29,280
13期 (2019年6月6日)	18,181	3.1	3,386.35	3.1	97.8	1.7	35,462
14期 (2020年6月8日)	20,819	14.5	3,880.89	14.6	97.4	2.0	33,154
15期 (2021年6月7日)	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2	41,885
	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2	88,531

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) 東証R E I T指数 (配当込み) は、株式会社東京証券取引所 (㈩東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証R E I T指数の商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

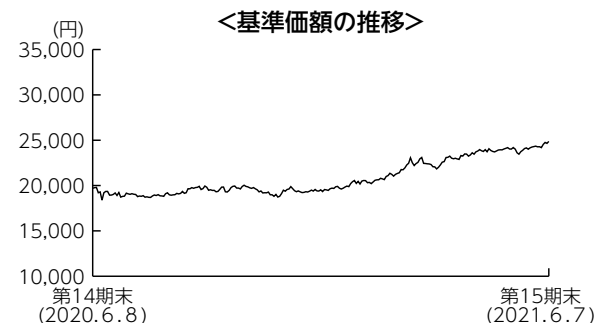
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配 当 込 み) (ベ ン チ マ ー ク)	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 6 月 8 日	円	%	ポ イ ン ト	%	%	%
	19,706	—	3,696.98	—	97.4	2.2
6 月 末	18,802	△4.6	3,525.99	△4.6	97.4	2.1
7 月 末	18,855	△4.3	3,535.10	△4.4	97.8	2.0
8 月 末	19,918	1.1	3,735.15	1.0	97.5	2.2
9 月 末	19,726	0.1	3,698.94	0.1	97.4	2.3
10 月 末	18,737	△4.9	3,512.43	△5.0	96.9	2.6
11 月 末	19,393	△1.6	3,635.82	△1.7	97.6	2.1
12 月 末	20,558	4.3	3,854.76	4.3	97.5	2.2
2021 年 1 月 末	21,354	8.4	4,004.00	8.3	97.3	2.5
2 月 末	22,451	13.9	4,207.24	13.8	97.4	2.4
3 月 末	23,468	19.1	4,399.26	19.0	97.8	2.2
4 月 末	24,106	22.3	4,518.99	22.2	97.6	2.2
5 月 末	24,284	23.2	4,551.00	23.1	97.7	2.2
(期 末) 2021 年 6 月 7 日	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年6月9日から2021年6月7日まで）

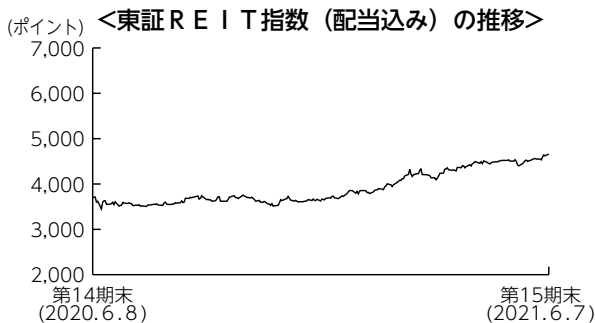


基準価額の推移

当期末の基準価額は24,869円となり、前期末比で26.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

欧米での新型コロナウイルスのワクチン接種進展を背景に景気回復期待が高まり、東証REIT指数（配当込み）が上昇したことにより当ファンドの基準価額も上昇しました。



投資環境

リート市場は上昇しました。期の前半は新型コロナウイルスのワクチンへの期待などがプラス要因となる一方、相次ぐ公募増資の発表による需給悪化懸念や不動産市況の先行き不透明感などがマイナス要因となり、方向感の定まらない展開となりました。後半に入ると、決算でリート各社の底堅い業績が確認できたことや、欧米でのワクチン接種進展を背景とした景気回復期待などにより上昇基調となりました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で26.1%上昇しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、リーートの組入比率を高め、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持するよう努めます。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(投資証券)	(0)	(0.001)	
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は20,817円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2020年6月9日から2021年6月7日まで)

(1) 投資証券

	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
		千口		千円		千口		千円
国内								
エスコンジャパンリート投資法人		1.82		218,315		1.136		135,907
		(-)		(-)		(-)		(-)
サンケイリアルエステート投資法人		2.886		305,490		1.695		183,412
		(-)		(-)		(-)		(-)
S O S I L A 物流リート投資法人		2.753		373,847		1.774		240,901
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本アコモデーションファンド投資法人		3.49		2,140,566		2.389		1,446,998
		(-)		(-)		(-)		(-)
MCUBS MidCity投資法人		5.636		468,036		3.093		246,384
		(△8.322)		(-)		(-)		(-)
森ヒルズリート投資法人		11.894		1,743,930		8.222		1,201,899
		(-)		(-)		(-)		(-)
産業ファンド投資法人		14.707		2,747,827		9.853		1,812,555
		(-)		(-)		(-)		(-)
アドバンス・レジデンス投資法人		9.543		3,125,584		6.655		2,152,600
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		6.91		1,373,500		4.712		933,600
		(-)		(-)		(-)		(-)
アクティブア・プロパティーズ投資法人		5.033		2,264,531		3.513		1,589,952
		(-)		(-)		(-)		(-)
GLP投資法人		33.669		5,724,570		21.333		3,586,817
		(-)		(-)		(-)		(-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		4.539		1,456,560		3.111		995,139
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プロロジスリート投資法人		15.987		5,391,422		10.848		3,594,072
		(-)		(-)		(-)		(-)
星野リゾート・リート投資法人		1.53		869,077		1.068		617,126
		(-)		(-)		(-)		(-)
Oneリート投資法人		1.566		434,147		1.093		302,741
		(-)		(-)		(-)		(-)
イオンリート投資法人		10.226		1,403,055		7.442		1,014,535
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヒューリックリート投資法人		8.359		1,337,119		5.941		943,979
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本リート投資法人		3.262		1,269,238		2.277		885,386
		(-)		(-)		(-)		(-)
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		64.327		1,082,559		45.364		788,947
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
積水ハウス・リート投資法人	29.611	2,437,169	20.611	1,705,857
	(-)	(-)	(-)	(-)
トーセイ・リート投資法人	2.239	271,609	1.551	190,597
	(-)	(-)	(-)	(-)
ケネディクス商業リート投資法人	4.005	1,002,333	2.747	684,561
	(-)	(-)	(-)	(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人	2.14	283,886	1.493	196,044
	(-)	(-)	(-)	(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人	1.937	214,479	1.388	151,558
	(-)	(-)	(-)	(-)
野村不動産マスターファンド投資法人	32.49	5,089,564	22.656	3,535,315
	(-)	(-)	(-)	(-)
いちごホテルリート投資法人	1.794	141,849	1.222	97,152
	(-)	(-)	(-)	(-)
ラサールロジポート投資法人	12.747	2,159,771	7.817	1,285,247
	(-)	(-)	(-)	(-)
スターアジア不動産投資法人	9.881	523,026	7.20962	372,541
	(3.57862)	(-)	(-)	(-)
マリモ地方創生リート投資法人	0.949	113,528	0.687	80,765
	(-)	(-)	(-)	(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3.731	1,956,437	2.382	1,226,096
	(-)	(-)	(-)	(-)
大江戸温泉リート投資法人	1.63	123,759	1.178	88,073
	(-)	(-)	(-)	(-)
さくら総合リート投資法人	0.138	11,229	0.034	2,784
	(△1.079)	(-)	(-)	(-)
投資法人みらい	10.885	474,241	7.866	341,145
	(-)	(-)	(-)	(-)
森トラスト・ホテルリート投資法人	2.19	270,580	1.615	195,818
	(-)	(-)	(-)	(-)
三菱地所物流リート投資法人	2.694	1,151,341	1.685	709,152
	(-)	(-)	(-)	(-)
C R E ロジスティクスファンド投資法人	3.686	592,672	2.121	340,241
	(-)	(-)	(-)	(-)
ザイマックス・リート投資法人	1.569	162,140	1.068	110,920
	(-)	(-)	(-)	(-)
タカラレーベン不動産投資法人	3.093	316,023	2.106	217,645
	(-)	(-)	(-)	(-)
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	4.567	640,817	2.58	346,412
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本ビルファンド投資法人	11.804	7,539,423	7.683	4,939,198
	(-)	(-)	(-)	(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人	10.044	6,232,251	7.01	4,346,223
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本都市ファンド投資法人	35.84	4,369,477	27.908	3,212,119
	(21.1)	(-)	(-)	(-)
オリックス不動産投資法人	20.015	3,524,671	13.971	2,446,975
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本プライムリアルティ投資法人	6.278	2,323,472	4.545	1,692,549
	(-)	(-)	(-)	(-)
N T T 都市開発リート投資法人	9.076	1,264,853	6.336	894,848
	(-)	(-)	(-)	(-)
東急リアル・エステート投資法人	6.732	1,137,484	4.698	796,055
	(-)	(-)	(-)	(-)
グローバル・ワン不動産投資法人	6.971	789,624	4.865	549,607
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ユナイテッド・アーバン投資法人	21.551 (-)	3,032,504 (-)	15.544 (-)	2,192,163 (-)
森トラスト総合リート投資法人	7.179 (-)	1,037,538 (-)	5.011 (-)	726,138 (-)
インヴィンシブル投資法人	42.132 (-)	1,610,132 (-)	30.371 (-)	1,162,356 (-)
フロンティア不動産投資法人	3.342 (-)	1,434,764 (-)	2.441 (-)	1,045,298 (-)
平和不動産リート投資法人	6.408 (-)	905,417 (-)	4.342 (-)	617,749 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	6.561 (-)	2,007,386 (-)	4.579 (-)	1,378,720 (-)
福岡リート投資法人	5.193 (-)	821,047 (-)	3.624 (-)	574,815 (-)
ケネディクス・オフィス投資法人	3.103 (-)	2,220,907 (-)	2.164 (-)	1,551,811 (-)
いちごオフィスリート投資法人	8.572 (-)	711,475 (-)	5.884 (-)	497,940 (-)
大和証券オフィス投資法人	2.151 (-)	1,498,257 (-)	1.585 (-)	1,099,311 (-)
阪急阪神リート投資法人	4.538 (-)	630,874 (-)	3.167 (-)	442,528 (-)
スターツプロシード投資法人	1.562 (-)	331,889 (-)	1.089 (-)	231,105 (-)
大和ハウスリート投資法人	14.329 (-)	3,991,529 (-)	10.001 (-)	2,784,523 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	32.359 (-)	1,894,989 (-)	22.586 (-)	1,341,805 (-)
大和証券リビング投資法人	13.398 (-)	1,410,087 (-)	9.0687 (-)	959,763 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	9.33 (-)	1,263,813 (-)	6.502 (-)	878,524 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 6,166	百万円 5,456	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2020年6月9日から2021年6月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 103,649	百万円 748	% 0.7	百万円 70,913	百万円 7	% 0.0

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当	期
	買	付 額
投 資 証 券		百万円 3,000

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当	期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)		771千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)		1千円
(B)/(A)		0.2%

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

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

銘	柄	期首(前期末)		当 期		末	
		□	数	□	数	評 価 額	比 率
不動産ファンド			千□		千□	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人			0.548		1.232	167,428	0.2
サンケイリアルエステート投資法人			0.653		1.844	235,294	0.3
S O S I L A 物流リート投資法人			1.003		1.982	289,768	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人			1.497		2.598	1,680,906	1.9
MCUBS MidCity 投資法人			5.779		-	-	-
森ヒルズリート投資法人			5.182		8.854	1,439,660	1.6
産業ファンド投資法人			5.801		10.655	2,109,690	2.4
アドバンス・レジデンス投資法人			4.272		7.16	2,595,500	2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人			2.939		5.137	1,188,701	1.3
アクティビア・プロパティーズ投資法人			2.257		3.777	1,903,608	2.2
GLP 投資法人			11.218		23.554	4,404,598	5.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人			1.961		3.389	1,192,928	1.3
日本プロロジスリート投資法人			6.778		11.917	4,093,489	4.6
星野リゾート・リート投資法人			0.685		1.147	754,726	0.9
One リート投資法人			0.702		1.175	371,887	0.4
イオンリート投資法人			4.861		7.645	1,194,913	1.3
ヒューリックリート投資法人			3.831		6.249	1,144,191	1.3
日本リート投資法人			1.463		2.448	1,113,840	1.3
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人			28.937		47.9	1,082,540	1.2
積水ハウス・リート投資法人			13.17		22.17	2,030,772	2.3
トーセイ・リート投資法人			0.98		1.668	230,851	0.3
ケネディクス商業リート投資法人			1.74		2.998	877,514	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人			0.961		1.608	229,300	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人			0.902		1.451	178,908	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人			14.541		24.375	4,463,062	5.0
いちごホテルリート投資法人			0.746		1.318	124,155	0.1
ラサールロジポート投資法人			4.188		9.118	1,629,386	1.8
スターアジア不動産投資法人			1.495		7.745	470,121	0.5
マリモ地方創生リート投資法人			0.444		0.706	97,710	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人			1.282		2.631	1,507,563	1.7
大江戸温泉リート投資法人			0.765		1.217	101,619	0.1
さくら総合リート投資法人			0.975		-	-	-
投資法人みらい			5.122		8.141	418,447	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人			1.057		1.632	228,153	0.3
三菱地所物流リート投資法人			0.887		1.896	892,068	1.0
CRE ロジスティクスファンド投資法人			0.847		2.412	440,672	0.5
ザイマックス・リート投資法人			0.654		1.155	142,642	0.2

銘 柄	期首(前期末)		当 期		末	
	□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率	比 率
不動産ファンド	千□	千□	千□	千円		%
タカラレーベン不動産投資法人	1.278	2.265	2.265	277,689		0.3
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.937	2.924	2.924	428,366		0.5
日本ビルファンド投資法人	4.362	8.483	8.483	5,955,066		6.7
ジャパンリアルエステイト投資法人	4.504	7.538	7.538	5,080,612		5.7
日本都市ファンド投資法人	8.513	37.545	37.545	4,317,675		4.9
オリックス不動産投資法人	8.975	15.019	15.019	3,152,488		3.6
日本プライムリアルティ投資法人	2.96	4.693	4.693	2,069,613		2.3
N T T都市開発リート投資法人	4.068	6.808	6.808	1,120,596		1.3
東急リアル・エステート投資法人	3.02	5.054	5.054	1,007,767		1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	3.128	5.234	5.234	659,484		0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	10.113	16.12	16.12	2,603,380		2.9
森トラスト総合リート投資法人	3.219	5.387	5.387	848,452		1.0
インヴィンシブル投資法人	19.757	31.518	31.518	1,451,403		1.6
フロンティア不動産投資法人	1.6	2.501	2.501	1,268,007		1.4
平和不動産リート投資法人	2.805	4.871	4.871	835,863		0.9
日本ロジスティクスファンド投資法人	2.943	4.925	4.925	1,548,912		1.7
福岡リート投資法人	2.329	3.898	3.898	712,164		0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	1.393	2.332	2.332	1,900,580		2.1
いちごオフィスリート投資法人	3.488	6.176	6.176	616,364		0.7
大和証券オフィス投資法人	1.04	1.606	1.606	1,270,346		1.4
阪急阪神リート投資法人	2.034	3.405	3.405	535,266		0.6
スターツプロシード投資法人	0.701	1.174	1.174	273,776		0.3
大和ハウスリート投資法人	6.427	10.755	10.755	3,500,752		4.0
ジャパン・ホテル・リート投資法人	14.51	24.283	24.283	1,660,957		1.9
大和証券リビング投資法人	5.5137	9.843	9.843	1,165,411		1.3
ジャパンエクセレント投資法人	4.166	6.994	6.994	1,114,843		1.3
合 計	□ 数	□ 数	□ 数	金額		—
	銘 柄 数<比率>	63銘柄<97.4%>	61銘柄<97.6%>	264,9067	472,255	86,402,461
						—
						97.6

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	東 証 R E I T	百万円 1,985		百万円 -

■投資信託財産の構成

2021年6月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
投 資 証 券	千円 86,402,461		% 95.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,014,673		4.4
投 資 信 託 財 産 総 額	90,417,135		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	90,417,135,541円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	3,405,911,232
投 資 証 券(評価額)	86,402,461,800
未 収 入 金	183,819,520
未 収 配 当 金	490,120,359
差 入 委 託 証 拠 金	△65,177,370
(B) 負 債	1,885,627,936
未 払 金	1,698,686,936
未 払 解 約 金	186,941,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	88,531,507,605
元 本	35,599,014,873
次 期 繰 越 損 益 金	52,932,492,732
(D) 受 益 権 総 口 数	35,599,014,873口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	24,869円

(注1) 期首元本額 21,254,723,982円
 追加設定元本額 54,318,328,453円
 一部解約元本額 39,974,037,562円

(注2) 期末における元本の内訳

M I T O ラップ型ファンド (安定型)	265,723円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	755,477円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	888,298円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	2,775,508円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	1,719,811円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	1,206,984円
たわらノーロード 国内リート	4,396,786,108円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	932,624,822円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	969,244,891円
たわらノーロード バランス (堅実型)	18,479,692円
たわらノーロード バランス (標準型)	328,301,241円
たわらノーロード バランス (積極型)	344,504,015円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	112,884,187円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	298,496,743円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	184,755,065円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	240,465,240円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,362,352円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	9,267,569円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,306,792円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	6,344,196円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	12,109,534円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	387,435,662円
マネックス資産設計ファンド エポリレーション	3,701,541円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	130,509,613円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	147,057,515円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	282,884,029円
投資のソムリエ	10,024,620,942円
投資のソムリエ<DC年金>	535,068,021円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	118,464,447円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	398,097,751円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,120,726,367円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	11,396,430円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	5,368,611円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	3,754,462円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	25,873,028円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,267,692,515円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	101,490,373円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	8,346,602円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	4,119,891円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	3,902,574円
Jリートインデックスファンド (DC)	42,526,034円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定)	82,505,379円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定)	742,059,473円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	933,075円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4	266,775,224円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	1,238,110円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	104,218,702円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	765,304円
固定比率マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定)	212,081,935円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定)	83,568,801円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03	125,593,501円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	1,120,375円
インカム重視マルチアセット運用ファンド I 2021-04 (適格機関投資家限定)	5,043,105円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05	166,112,957円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け)	3,849,271,455円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	253,271,282円
日本資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	616,049,902円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	1,693,642円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,597,095,834円
期末元本合計	35,599,014,873円

■損益の状況

当期 自2020年6月9日 至2021年6月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,307,938,669	円
	受取配当金	2,308,456,061	
	受取利息	915	
	その他の収益	1,000	
	支払利息	△519,307	
(B)	有価証券売買損益	12,848,827,761	
	売却益	14,036,651,903	
	売却損	△1,187,824,142	
(C)	先物取引等取引損益	356,830,240	
	取引益	367,459,860	
	取引損	△10,629,620	
(D)	当期損益金(A+B+C)	15,513,596,670	
(E)	前期繰越損益金	20,630,700,953	
(F)	解約差損益金	△46,304,004,438	
(G)	追加信託差損益金	63,092,199,547	
(H)	計(D+E+F+G)	52,932,492,732	
	次期繰越損益金(H)	52,932,492,732	

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

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

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

《お知らせ》

■信託金の限度額を2,000億円から5,000億円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年6月2日)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第14期（決算日 2021年6月22日）

（対象期間 2020年6月23日～2021年6月22日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国 REIT インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産額 総
	円	期中騰落率	ポイント	期中騰落率		
10期(2017年6月22日)	11,770	7.9	117,262.55	8.5	99.7	百万円 43,023
11期(2018年6月22日)	11,979	1.8	120,101.82	2.4	99.3	53,148
12期(2019年6月24日)	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2	47,410
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	34,753
14期(2021年6月22日)	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4	78,959

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

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

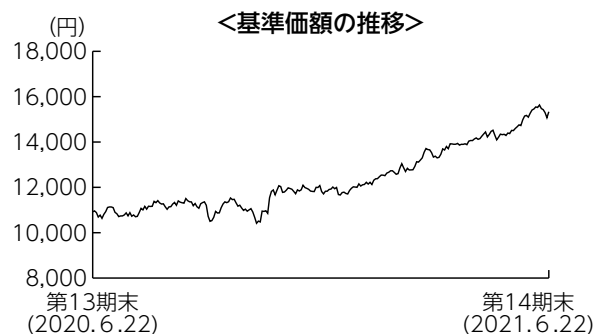
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰 落 率	期 騰 落	中 率	
(期 首) 2020年 6 月 22 日	円 10,922	% -	ポイント 111,241.50	% -	% 99.7
6 月 末	10,809	△1.0	110,069.47	△1.1	99.3
7 月 末	11,008	0.8	112,029.46	0.7	99.7
8 月 末	11,349	3.9	115,692.61	4.0	99.6
9 月 末	10,869	△0.5	110,930.39	△0.3	97.4
10 月 末	10,511	△3.8	107,293.68	△3.5	98.8
11 月 末	11,822	8.2	120,978.81	8.8	100.4
12 月 末	11,940	9.3	122,315.74	10.0	99.6
2021年 1 月 末	12,223	11.9	125,429.06	12.8	100.1
2 月 末	12,864	17.8	132,415.62	19.0	99.6
3 月 末	13,803	26.4	141,813.22	27.5	99.4
4 月 末	14,442	32.2	148,529.64	33.5	99.6
5 月 末	14,756	35.1	151,940.99	36.6	99.7
(期 末) 2021年 6 月 22 日	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2020年6月23日から2021年6月22日まで）

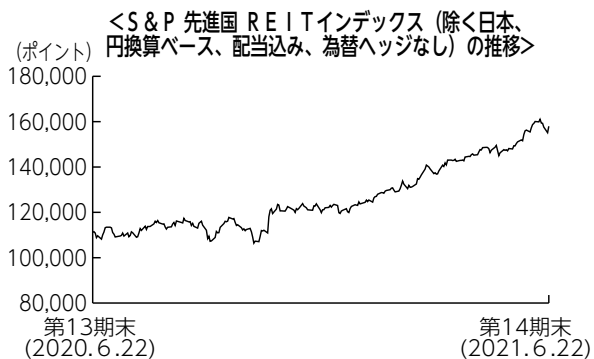


基準価額の推移

当期末の基準価額は15,336円となり、前期末比で40.4%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

外国リート市場は新型コロナウイルスの感染拡大や変異株の増加などから弱含む局面もありましたが、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や経済活動正常化への期待などから、多くの市場が上昇しました。為替市場においても多くの通貨が対円で上昇し円安となったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。



投資環境

外国リート市場は大幅に上昇しました。米国リート市場では新型コロナウイルスのワクチン接種の進展、金融緩和政策の長期化見通し、経済活動正常化への期待などから上昇しました。欧州リート市場では感染拡大や変異株の発生などから2020年11月頃まで下落する市場もありましたが、その後は反発し上昇する展開となりました。オーストラリアリート市場ではロックダウンにより下落する局面もありましたが、その後は好調な経済指標の発表などから上昇に転じました。

為替市場では多くの通貨に対して円安となりました。米ドルは米国が金融緩和を積極的に進めたことが主な要因となり2020年は円高が進みましたが、米国の長期金利が上昇したことなどから2021年に入ると反転し、前期末比では円安水準で期末を迎えました。ユーロなど他の通貨に対しても円安となりました。新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や経済活動再開への期待などによりリスク回避姿勢が後退し、安全資産と見られた円が売られたことが主な要因です。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で42.0%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを1.6%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	4円 (0) (1) (3)	0.033% (0.000) (0.005) (0.028)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	12 (1) (11)	0.096 (0.007) (0.089)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他)	15 (7) (8)	0.124 (0.057) (0.067)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	31	0.253	
期中の平均基準価額は12,344円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2020年6月23日から2021年6月22日まで)

投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	110.955	18,619	83.828	13,836
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER'S INC.	1.045	286	0.714	188
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	117.963	11,608	94.312	9,254
	(-)	(-)	(-)	(-)
CEDAR REALTY TRUST INC	24.856	24	38.635	31
	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	191.497	6,778	149.121	5,224
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	108.41	1,766	80.857	1,001
	(△3.147)	(326)	(-)	(-)
AGREE REALTY CORP	50.115	3,344	36.393	2,408
	(-)	(-)	(-)	(-)
SL GREEN	60.388	3,908	49.896	3,245
	(△0.088)	(46)	(-)	(-)
EPR PROPERTIES	57.934	2,349	45.759	1,877
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	613.831	63,942	485.681	49,977
	(-)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	117.157	20,552	93.182	16,214
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
LEXINGTON REALTY TRUST	215.591	2,408	167.955	1,858
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	81.571	8,559	64.507	6,739
	(-)	(-)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES	55.891	11	70.576	12
	(-)	(-)	(-)	(-)
MACK CALI	62.671	875	50.446	732
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	73.976	53,155	58.189	40,438
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	146.073	6,009	114.457	4,682
	(-)	(-)	(-)	(-)
CTO REALTY GROUTH INC	4.656	218	1.691	87
	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	121.376	4,042	94.397	3,140
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	15.282	209	10.4	154
	(-)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	138.089	1,623	102.413	1,219
	(-)	(-)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	312.707	12,758	246.639	9,938
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	-	-	0.908	1
	(△8.175)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	54.325	14,027	43.137	10,993
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	285.969	18,676	228.377	14,919
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	58.294	5,623	46.246	4,454
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	104.125	4,598	81.096	3,581
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	448.772	13,616	354.783	10,711
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	93.145	2,642	72.169	2,000
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	110.414	3,322	85.218	2,535
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	82.4	3,291	64.905	2,608
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	124.758	1,394	98.562	1,100
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	349.563	23,151	276.887	18,426
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	32.283	4,573	25.073	3,510
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	358.539	6,004	280.112	4,800
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	88.581	5,505	69.901	4,334
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
LTC PROPERTIES INC	27.592	1,083	21.613	860
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	135.997	588	95.837	416
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	73.691	1,246	54.737	926
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	140.097	1,704	106.761	1,301
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	240.657	8,102	190.534	6,576
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	97.397	1,262	53.439	612
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	143.513	9,220	117.607	7,408
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	56.778	948	39.342	665
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	594.104	8,815	470.886	7,087
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	94.367	12,762	74.735	10,085
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.174	35	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	34.255	2,319	25.808	1,738
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTERSPACE	7.768	554	5.267	369
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7.745	169	5.072	112
	(0.086)	(1)	(-)	(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	45.612	96	24.87	10
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	22.569	646	15.998	457
	(-)	(-)	(-)	(-)
PS BUSINESS PARKS	15.626	2,236	12.082	1,721
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	61.298	585	48.894	483
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	306.116	19,171	232.168	14,328
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	134.757	6,932	110.005	5,726
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	245.5	10,086	193.137	7,895
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	85.52	2,243	65.727	1,717
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORECIVIC INC	27.418	217	63.211	421
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	4.559	157	2.149	91
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	274.972	26,839	211.542	21,119
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
LIFE STORAGE INC	52.188 (9.804)	4,990 (-)	40.315 (-)	3,808 (-)
PUBLIC STORAGE	127.911 (-)	30,329 (-)	101.076 (-)	24,382 (-)
SUN COMMUNITIES INC	93.136 (-)	13,993 (-)	69.88 (-)	10,371 (-)
TAUBMAN CENTERS INC	17.062 (-)	644 (-)	34.802 (-)	1,427 (-)
TANGER FACTORY OUTLET	71.465 (-)	899 (-)	52.696 (-)	660 (-)
UMH PROPERTIES INC	23.776 (-)	406 (-)	17.114 (-)	312 (-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	22.796 (-)	439 (-)	16.452 (-)	313 (-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	8.054 (-)	538 (-)	5.872 (-)	380 (-)
VENTAS INC	313.759 (-)	15,541 (-)	248.73 (-)	12,559 (-)
VORNADO REALTY TRUST	133.257 (-)	5,506 (-)	106.394 (-)	4,459 (-)
WASHINGTON REIT	66.111 (-)	1,498 (-)	48.894 (-)	1,080 (-)
GEO GROUP INC	86.5 (-)	763 (-)	65.851 (-)	530 (-)
WEINGARTEN REALTY INVST	96.481 (-)	2,364 (-)	75.395 (-)	1,884 (-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	114.558 (-)	4,774 (-)	90.633 (-)	3,794 (-)
KITE REALTY GROUP TRUST	65.403 (-)	1,072 (-)	50.154 (-)	850 (-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	110.153 (-)	13,559 (-)	85.731 (-)	10,769 (-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	72.38 (-)	376 (-)	58.856 (-)	294 (-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	179.464 (-)	1,988 (-)	144.323 (-)	1,613 (-)
CUBESMART	163.684 (-)	5,903 (-)	127.064 (-)	4,641 (-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	235.042 (-)	33,562 (-)	182.522 (-)	25,861 (-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	170.504 (-)	1,468 (-)	128.417 (-)	1,120 (-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	479.782 (-)	9,914 (-)	358.894 (-)	7,333 (-)
DOUGLAS EMMETT INC	133.386 (-)	4,113 (-)	104.81 (-)	3,189 (-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	90.984 (-)	1,338 (-)	68.328 (-)	1,020 (-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	102.304 (-)	1,707 (-)	81.38 (-)	1,352 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	76.394	655	58.833	509
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	56.238	3,314	43.608	2,527
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	39.997	1,195	30.694	932
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	138.035	1,851	109.904	1,480
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	205.295	7,536	145.23	5,273
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORESITE REALTY CORP	35.686	4,352	27.254	3,239
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	453.253	7,220	317.247	5,460
	(△346.802)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	104.49	2,067	81.003	1,684
	(-)	(-)	(-)	(-)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	31.775	789	24.13	600
	(-)	(-)	(-)	(-)
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	20.044	167	10.675	101
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	29.228	349	22.11	276
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	169.943	2,850	131.132	2,176
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	9.906	66	5.471	34
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	124.175	3,189	98.7	2,531
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	126.984	4,153	96.854	3,174
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	178.403	1,677	138.584	1,320
	(-)	(-)	(-)	(-)
CYRUSONE INC	101.07	7,275	77.856	5,389
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	145.942	10,186	113.024	7,755
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	59.301	923	26.081	462
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	11.793	217	6.505	129
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	183.103	5,034	144.568	3,886
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	43.138	2,798	33.761	2,273
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	12.639	141	28.41	422
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	46.296	511	18.422	246
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	94.57	3,843	70.283	2,829
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
PHYSICIANS REALTY TRUST	167.642	3,014	129.284	2,282
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	107.612	5,350	81.852	4,019
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	227.14	7,169	176.07	5,541
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	66.782	945	45.859	651
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	19.924	3,276	14.251	2,323
	(-)	(-)	(-)	(-)
JBG SMITH PROPERTIES	88.795	2,738	71.487	2,183
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN FINANCE TRUST INC	71.875	607	54.134	467
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL VALUE INC	5.726	87	2.272	30
	(0.336)	(5)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	478.21	14,636	372.084	11,321
	(-)	(-)	(-)	(-)
QTS REALTY TRUST INC	53.808	3,434	39.318	2,443
	(-)	(-)	(-)	(-)
COREPOINT LODGING INC	14.453	126	8.995	93
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	719.6	516	365.2	254
	(-)	(△2)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	109.747	1,043	87.084	831
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10.794	149	2.734	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	8.948	612	6.341	439
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	98.973	2,127	72.351	1,551
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	47.62	1,074	37.302	841
	(-)	(-)	(-)	(-)
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	93.556	1,369	72.487	1,078
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	183.791	7,736	143.608	5,952
	(2.508)	(100)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	245.333	4,354	193.409	3,527
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8.056	22	13.391	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	37.354	589	36.549	584
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	371.2	301	303.4	244
	(-)	(△2)	(-)	(-)
ARA US HOSPITALITY TRUST	42.4	15	197.5	61
	(-)	(-)	(-)	(-)
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	12.476	132	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	2.541	27	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
FARMLAND PARTNERS INC	4.82	53	3.022	41
	(—)	(—)	(—)	(—)
CITY OFFICE REIT INC	25.759	250	18.121	176
	(—)	(—)	(—)	(—)
NETSTREIT CORP	10.996	216	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
WASHINGTON PRIME GROUP INC	40.053	24	9.926	18
	(△79.4)	(—)	(—)	(—)
CARETRUST REIT INC	77.978	1,699	59.797	1,283
	(—)	(—)	(—)	(—)
APARTMENT INCOME REIT CORP	81.617	3,533	70.035	2,970
	(62.174)	(—)	(—)	(—)
BROADSTONE NET LEASE INC	75.559	1,735	6.983	140
	(—)	(—)	(—)	(—)
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34.72	201	25.202	142
	(—)	(—)	(—)	(—)
STORE CAPITAL CORP	197.895	6,267	150.39	4,717
	(—)	(—)	(—)	(—)
PARAMOUNT GROUP INC	129.796	1,151	104.552	921
	(—)	(—)	(—)	(—)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	21.594	302	8.051	109
	(—)	(—)	(—)	(—)
URBAN EDGE PROPERTIES	87.924	1,323	66.193	1,015
	(—)	(—)	(—)	(—)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	63.539	1,393	47.25	1,000
	(—)	(—)	(—)	(—)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	96.335	1,526	77.994	1,285
	(—)	(—)	(—)	(—)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	14.983	665	11.479	529
	(—)	(—)	(—)	(—)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	52.808	2,060	38.174	1,479
	(—)	(—)	(—)	(—)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	13.617	628	9.326	443
	(—)	(—)	(—)	(—)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	161.5	2,153	125.605	1,687
	(—)	(—)	(—)	(—)
GLOBAL NET LEASE INC	67.743	1,175	53.161	923
	(—)	(—)	(—)	(—)
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,187.6	881	951.3	684
	(—)	(△8)	(—)	(—)
PARK HOTELS & RESORTS INC	190.22	3,371	148.94	2,734
	(—)	(—)	(—)	(—)
VICI PROPERTIES INC	463.276	12,455	348.152	9,456
	(—)	(—)	(—)	(—)
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	15.938	249	9.706	151
	(—)	(—)	(—)	(—)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	56.394	1,551	39.877	1,072
	(—)	(—)	(—)	(—)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
COLONY CAPITAL INC	389.126	2,032	289.658	1,581
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	64.667	1,616	51.366	1,300
	(-)	(-)	(-)	(-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	74.876	3,867	59.233	3,061
	(-)	(-)	(-)	(-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	130.933	1,742	103.689	1,405
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	69.508	1,101	47.408	781
	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	132.859	2,410	106.957	1,968
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALLIED PROPERTIES REIT	54.719	2,192	43.752	1,743
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMINAR REAL ESTATE INVNT TR	82.534	724	63.029	554
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	20.124	412	15.885	316
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHVIEW APARTMENT REIT	6.455	222	16.452	591
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	16.236	563	12.456	430
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40.38	404	30.455	304
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	36.382	534	28.574	427
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	63.35	893	50.078	694
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	81.702	1,033	61.954	781
	(-)	(-)	(-)	(-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	4.712	70	2.131	31
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	63.315	814	42.925	550
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	71.588	1,002	54.582	772
	(-)	(-)	(-)	(-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26.954	2,080	20.881	1,596
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	36.323	239	26.718	171
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHOICE PROPERTIES REIT	137.653	1,838	109.158	1,462
	(-)	(-)	(-)	(-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.257	150	3.429	73
	(-)	(-)	(-)	(-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37.226	573	27.11	425
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLAZA RETAIL REIT	30.759	112	10.148	33
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28.277 (-)	529 (-)	21.219 (-)	395 (-)
SLATE GROCERY REIT	16.175 (-)	182 (-)	11.141 (-)	121 (-)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11.824 (-)	123 (-)	4.736 (-)	48 (-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	34.635 (-)	630 (-)	24.623 (-)	449 (-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	400.076 (-)	1,645 (-)	321.248 (-)	1,300 (-)
MIRVAC GROUP	3,340.585 (-)	8,245 (-)	2,675.213 (-)	6,532 (-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,351.602 (-)	1,177 (-)	1,056.859 (-)	885 (-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	433.207 (-)	1,586 (-)	333.977 (-)	1,225 (-)
GPT GROUP	1,645.239 (-)	7,294 (-)	1,310.039 (-)	5,830 (-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	478.84 (-)	1,117 (-)	249.712 (-)	604 (-)
ABACUS PROPERTY GROUP	297.815 (-)	861 (-)	201.422 (-)	563 (-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	221.401 (-)	669 (-)	142.208 (-)	432 (-)
STOCKLAND	1,992.086 (-)	8,608 (-)	1,590.344 (-)	6,859 (-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	199.425 (-)	1,003 (-)	133.442 (-)	674 (-)
DEXUS	950.177 (-)	8,958 (-)	766.973 (-)	7,215 (-)
GOODMAN GROUP	1,420.64 (-)	25,629 (-)	1,109.628 (-)	19,853 (-)
VICINITY CENTRES	3,334.19 (-)	5,243 (-)	2,705.043 (-)	4,206 (-)
CHARTER HALL GROUP	380.505 (-)	4,955 (-)	296.319 (-)	3,790 (-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	209.892 (-)	731 (-)	159.678 (-)	547 (-)
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	919.023 (-)	2,200 (-)	706.805 (-)	1,682 (-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	430.095 (-)	1,378 (-)	217.121 (-)	695 (-)
ARENA REIT	198.806 (-)	589 (-)	133.033 (-)	400 (-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	470.705 (-)	2,230 (-)	332.916 (-)	1,579 (-)
APN INDUSTRIA REIT	96.073 (-)	285 (-)	64.835 (-)	191 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
NATIONAL STORAGE REIT	843.968	1,643	608.162	1,163
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	32.489	105	9.185	28
	(-)	(-)	(-)	(-)
GDI PROPERTY GROUP	236.815	267	126.789	135
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME CONSORTIUM LTD	133.803	549	47.823	196
	(-)	(-)	(-)	(-)
RURAL FUNDS GROUP	231.597	558	173.393	408
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRONGATE GROUP	479.341	657	223.193	301
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	4,384.993	11,752	3,491.308	9,302
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME CO DAILY NEEDS REIT	229.327	308	46.547	61
	(30.33)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA OFFICE REIT	298.744	638	235.378	491
	(-)	(-)	(-)	(-)
AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	364.512	983	188.049	521
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAYPOINT REIT LTD	671.797	1,730	497.872	1,263
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	1,715.3	119,146	1,345.6	92,987
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROSPERITY REIT	791	1,970	555	1,381
	(-)	(-)	(-)	(-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,040	3,993	727	2,784
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHAMPION REIT	1,496	6,593	1,161	5,036
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	737	2,906	599	2,373
	(-)	(-)	(-)	(-)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,193	8,695	918	6,726
	(-)	(-)	(-)	(-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	3,541.1	7,366	2,946.7	6,038
	(735.249)	(1,493)	(-)	(-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	2,855	8,720	2,191.9	6,566
	(-)	(△52)	(-)	(-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	460	785	279.8	479
	(△1,021.179)	(△1,757)	(-)	(-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,785	2,661	1,476.6	2,212
	(-)	(-)	(-)	(-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,606.5	5,110	2,116	4,080
	(-)	(△11)	(-)	(-)
STARHILL GLOBAL REIT	1,199.3	596	916.7	455
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASCOTT TRUST	1,595.5	1,624	1,234	1,233
	(-)	(△6)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
KEPPEL REIT	1,741	1,977	1,343.1	1,526
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	1,208	2,987	793.4	1,893
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESR REIT	1,765.3	687	1,253.1	476
	(-)	(-)	(-)	(-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	584.2	712	469.9	556
	(-)	(△5)	(-)	(-)
CAPITALAND CHINA TRUST	729.9	963	512.3	669
	(-)	(△6)	(-)	(-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	554.9	192	126.2	53
	(-)	(△11)	(-)	(-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	462.1	595	385.8	492
	(-)	(△1)	(-)	(-)
PARKWAY LIFE REIT	339	1,377	279.3	1,130
	(-)	(△3)	(-)	(-)
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	3,757.7	277	1,613.6	108
	(-)	(△4)	(-)	(-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,625.5	4,650	1,168.2	3,260
	(-)	(△0.81437)	(-)	(-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,857	3,797	1,473.4	2,961
	(-)	(△8)	(-)	(-)
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	1,070.7	740	793.6	541
	(-)	(△0.60706)	(-)	(-)
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	364.1	133	337.1	120
	(-)	(-)	(-)	(-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,562.4	1,534	1,157.6	1,125
	(-)	(△20)	(-)	(-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	761.4	454	541.2	311
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPH REIT	712.8	601	477.9	391
	(-)	(-)	(-)	(-)
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	659.9	339	934.9	489
	(-)	(△1)	(-)	(-)
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	169.5	118	42.1	29
	(-)	(△1)	(-)	(-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	325.1	266	282.2	235
	(-)	(-)	(-)	(-)
OUÉ COMMERCIAL REIT	1,496.3	568	1,149	414
	(-)	(△0.35666)	(-)	(-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	783.9	570	565.3	422
	(-)	(△1)	(-)	(-)
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST-RTS	-	-	3,422.4	-
	(3,422.4)	(-)	(-)	(-)
IREIT GLOBAL-RTS	-	-	98.926	11
	(98.926)	(-)	(-)	(-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	-	-	596.624	0.59609
	(596.624)	(-)	(-)	(-)
FRASERS HOSPITALITY TRUST	400.4	196	259	119
	(-)	(△0.72217)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
IREIT GLOBAL	355.6	241	141.1	85
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL DC REIT	1,050.6	2,906	818.8	2,212
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	2,329.8	3,237	1,738	2,399
	(-)	(△25)	(-)	(-)
ニュージーランド	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	818.851	1,369	634.984	1,044
	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	326.559	997	253.05	752
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	955.298	2,179	763.949	1,734
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,275.587	1,541	980.325	1,174
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	480.741	704	339.798	492
	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	809.176	3,771	648.99	3,069
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAPITAL & REGIONAL PLC	-	-	9.186	4
	(-)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	98.214	3,129	76.905	2,431
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	135.61	1,541	106.284	1,201
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	4,457.433	1,893	2,508.405	724
	(△206.045)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	647.307	4,259	513.372	3,373
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	100.7	766	76.048	576
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	350.775	3,565	271.617	2,731
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	1,083.806	1,627	821.88	1,213
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY PLC	269.444	1,562	188.826	1,118
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	1,030.372	9,810	793.102	7,430
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	196.688	1,322	151.001	1,011
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	2,162.775	1,628	1,708.072	1,267
	(-)	(-)	(-)	(-)
STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	179.591	99	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	126.599	43	59.156	19
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	423.894	337	336.768	262
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	499.046 (-)	355 (-)	405.154 (-)	288 (-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	172.095 (-)	1,406 (-)	134.653 (-)	1,079 (-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	722.168 (-)	1,628 (-)	567.785 (-)	1,241 (-)
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	588.23 (-)	433 (-)	462.843 (-)	334 (-)
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	731.393 (-)	1,120 (-)	580.621 (-)	896 (-)
GCP STUDENT LIVING PLC	484.173 (-)	688 (-)	273.977 (-)	396 (-)
RDI REIT PLC	171.611 (-)	179 (-)	245.662 (-)	280 (-)
NEWRIVER REIT PLC	172.393 (-)	146 (-)	134.927 (-)	116 (-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	420.594 (-)	467 (-)	316.392 (-)	343 (-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	285.966 (-)	306 (-)	218.614 (-)	230 (-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	750.126 (-)	819 (-)	378.359 (-)	410 (-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,443.65 (-)	2,536 (-)	1,145.637 (-)	2,002 (-)
CUSTODIAN REIT PLC	376.931 (-)	350 (-)	174.011 (-)	156 (-)
HOME REIT PLC	134.476 (-)	154 (-)	33.663 (-)	38 (-)
HAMMERSON PLC-RTS	- (7,236.264)	- (-)	7,236.264 (-)	496 (-)
ELITE COMMERCIAL REIT	112 (-)	74 (-)	112 (-)	68 (-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	391.663 (-)	287 (-)	296.627 (-)	210 (-)
AEW UK REIT PLC	74.995 (-)	67 (-)	45.965 (-)	45 (-)
LXI REIT PLC	452.547 (-)	566 (-)	320.025 (-)	387 (-)
REGIONAL REIT LTD	234.481 (-)	183 (-)	157.884 (-)	119 (-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	327.512 (-)	358 (-)	174.095 (-)	188 (-)
イスラエル	千□	千イスラエル・シュケル	千□	千イスラエル・シュケル
REIT 1 LTD	103.154 (-)	1,603 (-)	70.342 (-)	1,057 (-)
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	82.061 (-)	340,087 (-)	42.218 (-)	180,520 (-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	31.802 (-)	229,457 (-)	23.061 (-)	167,543 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9.958	47,204	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
LOTTE REIT CO LTD	119.571	626,223	90.462	470,659
	(-)	(26)	(-)	(-)
LOTTE REIT CO LTD RTS	-	-	20.343	2,443
	(20.343)	(△26)	(-)	(-)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	27.582	145,503	9.722	58,867
	(-)	(-)	(-)	(-)
JR REIT XXVII	98.87	519,809	42.648	220,349
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	46.423	354,574	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (シンガポール)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	1,296.1	608	529	290
	(△635.36)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (アイルランド)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HIBERNIA REIT PLC	518.752	597	420.108	466
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	297.438	461	202.808	311
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	28.976	485	23.192	384
	(0.958)	(-)	(-)	(-)
VASTNED RETAIL	14.275	344	11.302	270
	(-)	(-)	(-)	(-)
WERELDHAVE NV	23.656	296	16.76	224
	(-)	(-)	(-)	(-)
NSI NV	13.815	453	10.836	352
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
BEFIMMO	20.334	738	14.982	530
	(-)	(-)	(-)	(-)
COFINIMMO SA	23.405	2,939	16.927	2,108
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL ESTATES	8.705	522	6.848	400
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	16.202	357	12.566	271
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	119.698	3,444	93.353	2,646
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	7.779	745	6.313	588
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	26.131	2,595	18.409	1,811
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV	19.974	527	7.94	200
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA SA-RTS	-	-	10.417	8
	(10.417)	(-)	(-)	(-)
XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS	-	-	6.997	2
	(6.997)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
XIOR STUDENT HOUSING NV	13.746 (-)	670 (-)	5.507 (-)	257 (-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	45.846 (-)	5,543 (-)	36.902 (-)	4,373 (-)
ICADE	25.127 (-)	1,557 (-)	18.718 (-)	1,146 (-)
ALTAREA	2.295 (-)	324 (△10)	1.629 (-)	227 (-)
KLEPIERRE	165.257 (-)	3,136 (△151)	132.011 (-)	2,498 (-)
COVIVIO	41.233 (-)	2,908 (-)	32.657 (-)	2,280 (-)
MERCIALYS	26.14 (-)	203 (-)	14.283 (-)	134 (-)
CARMILA SA	38.138 (-)	389 (△7)	16.285 (-)	221 (-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	115.654 (-)	6,959 (-)	91.353 (-)	5,538 (-)
ユーロ (ドイツ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	44.28 (-)	395 (-)	33.716 (-)	296 (-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	145.224 (-)	1,997 (△80)	107.058 (-)	1,450 (-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	212.459 (-)	1,719 (△3)	165.535 (-)	1,329 (-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	22.988 (-)	107 (△3)	13.966 (-)	68 (-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	271.462 (-)	2,223 (△43)	222.224 (-)	1,818 (-)
ユーロ (イタリア)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	27.255 (-)	94 (-)	16.303 (-)	54 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

■利害関係人との取引状況等 (2020年6月23日から2021年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

銘	柄	期首(前期末)		当期		期末	
		□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比	率
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
不動産ファンド (アメリカ)							
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	—	354.4	269	29,703		0.0
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72.7	72.7	0	0		0.0
	PRIME US REIT	143.6	211.4	182	20,165		0.0
	ARA US HOSPITALITY TRUST	155.1	—	—	—		—
	MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME	422.1	658.4	506	55,908		0.1
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	37.388	64.515	12,029	1,326,609		1.7
	ALEXANDER'S INC.	0.658	0.989	272	30,066		0.0
	BOSTON PROPERTIES INC	42.842	66.493	7,954	877,228		1.1
	CEDAR REALTY TRUST INC	13.779	—	—	—		—
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	67.224	109.6	4,022	443,581		0.6
	APARTMENT INVT & MGMT CO-A	44.475	68.881	515	56,819		0.1
	AGREE REALTY CORP	15.954	29.676	2,087	230,199		0.3
	BRT APARTMENTS CORP	3.832	3.832	68	7,593		0.0
	SL GREEN	22.676	33.08	2,646	291,881		0.4
	EPR PROPERTIES	22.743	34.918	1,857	204,821		0.3
	PROLOGIS INC	218.819	346.969	42,534	4,690,752		5.9
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	41.682	65.657	13,925	1,535,742		1.9
	LEXINGTON REALTY TRUST	81.846	129.482	1,615	178,205		0.2
	CAMDEN PROPERTY TRUST	28.877	45.941	6,222	686,189		0.9
	CBL & ASSOCIATES	14.685	—	—	—		—
	MACK CALI	27.227	39.452	668	73,701		0.1
	EQUINIX INC	26.224	42.011	34,554	3,810,620		4.8
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	51.259	82.875	3,971	437,962		0.6
	CTO REALTY GROUTH INC	—	2.965	157	17,388		0.0
	COUSINS PROPERTIES INC	43.872	70.851	2,696	297,379		0.4
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	9.558	14.44	283	31,307		0.0
	SITE CENTERS CORP	45.456	81.132	1,225	135,103		0.2
	DUKE REALTY TRUST	109.515	175.583	8,559	943,960		1.2
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9.083	—	—	—		—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	19.381	30.569	9,420	1,038,887		1.3
	EQUITY RESIDENTIAL	103.634	161.226	12,794	1,411,021		1.8
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	20.972	33.02	3,953	435,990		0.6
	FIRST INDUSTRIAL RT	37.957	60.986	3,257	359,210		0.5
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	159.473	253.462	8,577	945,888		1.2
	EQUITY COMMONWEALTH	35.738	56.714	1,577	173,935		0.2
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	40.136	65.332	2,015	222,268		0.3
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	31.134	48.629	2,274	250,818		0.3
	SERVICE PROPERTIES TRUST	49.829	76.025	1,036	114,274		0.1
	WELLTOWER INC	123.686	196.362	15,822	1,744,943		2.2
	EAST GROUP	11.518	18.728	3,177	350,361		0.4
	KIMCO REALTY	126.14	204.567	4,299	474,203		0.6
	KILROY REALTY CORP	31.365	50.045	3,615	398,689		0.5
	LTC PROPERTIES INC	11.953	17.932	687	75,779		0.1
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	72.676	112.836	454	50,147		0.1
	MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	29.217	48.171	919	101,358		0.1
	BRANDYWINE REALTY TRUST	49.719	83.055	1,200	132,351		0.2
	IRON MOUNTAIN INC	85.668	135.791	6,159	679,267		0.9
	THE MACERICH COMPANY	34.714	78.672	1,398	154,171		0.2
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53.835	79.741	6,120	674,927		0.9
	ACADIA REALTY TRUST	24.839	42.275	919	101,447		0.1
	HOST HOTELS & RESORTS INC	208.857	332.075	5,854	645,632		0.8

銘柄	期首(前期末)		当		期		末
	□	数	□	数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(アメリカ)		千口		千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MID AMERICA		33.983		53.615	9,167	1,010,946	1.3
HERSHA HOSPITALITY TRUST		12.444		16.618	193	21,313	0.0
NATIONAL HEALTH INVS INC		12.733		21.18	1,397	154,111	0.2
CENTERSPACE		3.559		6.06	470	51,913	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC		5.097		7.856	226	24,959	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST		8.333		29.075	72	8,015	0.0
GETTY REALTY CORP		10.38		16.951	555	61,296	0.1
PS BUSINESS PARKS		5.805		9.349	1,429	157,641	0.2
RPT REALTY		25.39		37.794	503	55,558	0.1
REALTY INCOME CORP		101.743		175.691	11,957	1,318,676	1.7
REGENCY CENTERS CORP		49.99		74.742	4,891	539,474	0.7
UDR INC		87.344		139.707	6,922	763,411	1.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES		32.504		52.297	1,527	168,405	0.2
CORECIVIC INC		35.793		—	—	—	—
SAUL CENTERS INC		3.788		6.198	291	32,125	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		90.583		154.013	20,252	2,233,468	2.8
LIFE STORAGE INC		13.99		35.667	3,867	426,454	0.5
PUBLIC STORAGE		44.536		71.371	21,664	2,389,179	3.0
SUN COMMUNITIES INC		29.114		52.37	9,227	1,017,561	1.3
TAUBMAN CENTERS INC		17.74		—	—	—	—
TANGER FACTORY OUTLET		28.639		47.408	876	96,616	0.1
UMH PROPERTIES INC		11.534		18.196	401	44,246	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		10.478		16.822	381	42,111	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME		3.813		5.995	374	41,274	0.1
VENTAS INC		110.685		175.714	10,124	1,116,545	1.4
VORNADO REALTY TRUST		47.3		74.163	3,569	393,640	0.5
WASHINGTON REIT		24.141		41.358	953	105,130	0.1
GEO GROUP INC		36.455		57.104	446	49,245	0.1
WEINGARTEN REALTY INVST		35.001		56.087	1,803	198,856	0.3
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES		41.075		65	3,172	349,879	0.4
KITE REALTY GROUP TRUST		25.625		40.874	901	99,437	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC		38.157		62.579	10,241	1,129,452	1.4
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		33.124		46.648	247	27,316	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		64.963		100.104	1,307	144,175	0.2
CUBESMART		57.831		94.451	4,459	491,742	0.6
DIGITAL REALTY TRUST INC		79.493		132.013	20,551	2,266,450	2.9
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		60.643		102.73	1,047	115,556	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST		156.528		277.416	5,623	620,128	0.8
DOUGLAS EMMETT INC		49.264		77.84	2,777	306,284	0.4
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C		35.098		57.754	1,038	114,580	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC		36.359		57.283	1,114	122,932	0.2
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC		31.285		48.846	477	52,628	0.1
TERRENO REALTY CORP		19.467		32.097	2,134	235,422	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC		14.433		23.736	899	99,154	0.1
RLJ LODGING TRUST		48.111		76.242	1,191	131,416	0.2
AMERICOLD REALTY TRUST		59.337		119.402	4,532	499,844	0.6
CORESITE REALTY CORP		11.921		20.353	2,694	297,153	0.4
VEREIT INC		318.763		107.967	5,090	561,396	0.7
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		37.688		61.175	1,444	159,349	0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST		14.519		22.164	656	72,423	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES		14.783		24.152	252	27,860	0.0
CHATHAM LODGING TRUST		15.244		22.362	301	33,292	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC		59.548		98.359	1,751	193,185	0.2
WHITESTONE REIT		13.415		17.85	148	16,397	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC		45.098		70.573	2,040	225,000	0.3

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		
	□	数	□	数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(アメリカ)		千口		千口	千アメリカ・ドル	千円	%
STAG INDUSTRIAL INC		44.62		74.75	2,916	321,658	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC		64.534		104.353	1,241	136,945	0.2
CYRUSONE INC		33.769		56.983	3,979	438,817	0.6
WP CAREY INC		50.961		83.879	6,449	711,246	0.9
ALEXANDER & BALDWIN INC		—		33.22	633	69,826	0.1
GLADSTONE LAND CORP		6.064		11.352	281	31,047	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC		64.729		103.264	2,943	324,556	0.4
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		16.325		25.702	2,128	234,774	0.3
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP		15.771		—	—	—	—
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC		—		27.874	391	43,158	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		30.498		54.785	2,662	293,626	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST		60.012		98.37	1,876	206,984	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC		36.348		62.108	3,656	403,285	0.5
AMERICAN HOMES 4 RENT		76.081		127.151	4,986	549,951	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC		25.835		46.758	863	95,188	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES		5.514		11.187	2,109	232,688	0.3
JBG SMITH PROPERTIES		34.3		51.608	1,743	192,253	0.2
AMERICAN FINANCE TRUST INC		32.571		50.312	424	46,828	0.1
RETAIL VALUE INC		5.004		8.794	189	20,860	0.0
INVITATION HOMES INC		160.366		266.492	10,001	1,102,959	1.4
QTS REALTY TRUST INC		17.856		32.346	2,497	275,381	0.3
COREPOINT LODGING INC		13.648		19.106	197	21,828	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC		45.046		67.709	838	92,515	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		4.986		13.046	263	29,004	0.0
SAFEHOLD INC		4.045		6.652	521	57,527	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS		26.537		53.159	1,467	161,801	0.2
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES		19.666		29.984	787	86,865	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC		35.108		56.177	989	109,097	0.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN		60.857		103.548	4,826	532,252	0.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		88.264		140.188	3,259	359,443	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC		5.335		—	—	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC		16.848		17.653	328	36,190	0.0
CIM COMMERCIAL TRUST CORP		—		12.476	114	12,657	0.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT		8.102		10.643	105	11,643	0.0
FARMLAND PARTNERS INC		9.378		11.176	139	15,430	0.0
CITY OFFICE REIT INC		13.297		20.935	264	29,159	0.0
NETSTREIT CORP		—		10.996	259	28,630	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC		49.273		—	—	—	—
CARETRUST REIT INC		28.677		46.858	1,087	119,937	0.2
APARTMENT INCOME REIT CORP		—		73.756	3,571	393,839	0.5
BROADSTONE NET LEASE INC		—		68.576	1,710	188,610	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC		27.59		37.108	257	28,441	0.0
STORE CAPITAL CORP		65.92		113.425	3,965	437,297	0.6
PARAMOUNT GROUP INC		55.473		80.717	874	96,402	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC		12.189		25.732	392	43,303	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES		32.034		53.765	1,059	116,805	0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I		21.404		37.693	811	89,495	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC		34.147		52.488	1,027	113,278	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC		6.893		10.397	582	64,254	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS		17.791		32.425	1,634	180,293	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC		6.19		10.481	508	56,116	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC		60.884		96.779	1,546	170,551	0.2
GLOBAL NET LEASE INC		26.964		41.546	766	84,486	0.1
CLIPPER REALTY INC		5.086		5.086	38	4,206	0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC		69.339		110.619	2,372	261,669	0.3

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	金額	比率	率
(アメリカ)	千口	千円	千口	千円		%
VICI PROPERTIES INC	137.449	252,573	8,089	892,155		1.1
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	9.418	15.65	294	32,429		0.0
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	20.693	37.21	1,080	119,166		0.2
COLONY CAPITAL INC	139.081	238,549	2,027	223,611		0.3
小計	7,409.052	11,651.995	534.054	58,895.551		-
	157銘柄<74.6%>	156銘柄<74.6%>	-	-		74.6
(カナダ)	千口	千円	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	20.064	33.365	996	88,778		0.1
CANADIAN APT PPTYS REIT	24.536	40.179	2,380	211,992		0.3
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	39.965	67.209	1,102	98,213		0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	30.633	52.733	942	83,915		0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	46.927	72.829	1,610	143,392		0.2
ALLIED PROPERTIES REIT	18.176	29.143	1,344	119,741		0.2
COMINAR REAL ESTATE INVNT TR	24.741	44.246	477	42,513		0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	8.627	12.866	308	27,439		0.0
NORTHVIEW APARTMENT REIT	9.997	-	-	-		-
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7.095	10.875	457	40,751		0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	21.186	31.111	364	32,497		0.0
CROMBIE REAL ESTATE INV	13.784	21.592	387	34,513		0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	18.272	31.544	542	48,286		0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	24.249	43.997	568	50,658		0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	6.002	8.583	144	12,871		0.0
DREAM INDUSTRIAL REIT	22.509	42.899	650	57,951		0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	20.873	37.879	669	59,603		0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	8.495	14.568	1,238	110,268		0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	12.414	22.019	164	14,666		0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	46.042	74.537	1,092	97,306		0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	4.997	8.825	211	18,860		0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14.064	24.18	410	36,518		0.0
PLAZA RETAIL REIT	-	20.611	96	8,608		0.0
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES	12.087	19.145	438	39,075		0.0
SLATE GROCERY REIT	5.623	10.657	137	12,270		0.0
SLATE OFFICE REIT	11.634	11.634	62	5,584		0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT	-	7.088	87	7,807		0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	14.74	24.752	513	45,736		0.1
小計	487.732	819.066	17,403	1,549,824		-
	26銘柄<1.9%>	27銘柄<2.0%>	-	-		2.0
(オーストラリア)	千口	千円	千オーストラリア・ドル	千円		%
BWP TRUST	145.963	224.791	973	80,738		0.1
MIRVAC GROUP	1,181.612	1,846.984	5,393	447,365		0.6
CROMWELL PROPERTY GROUP	570.442	865.185	787	65,308		0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	136.991	236.221	921	76,418		0.1
GPT GROUP	575.807	911.007	4,391	364,237		0.5
CENTURIA CAPITAL GROUP	-	229.128	607	50,366		0.1
ABACUS PROPERTY GROUP	100.258	196.651	619	51,383		0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	75.176	154.369	534	44,304		0.1
STOCKLAND	727.078	1,128.82	5,260	436,341		0.6
INGENIA COMMUNITIES GROUP	68.692	134.675	816	67,698		0.1
DEXUS	321.924	505.128	5,435	450,847		0.6
GOODMAN GROUP	478.528	789.54	16,517	1,370,099		1.7
VICINITY CENTRES	1,197.4	1,826.547	2,986	247,722		0.3
CHARTER HALL GROUP	136.701	220.887	3,339	277,037		0.4
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	86.456	136.67	552	45,800		0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	301.574	513.792	1,310	108,678		0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	-	212.974	796	66,071		0.1

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	□	数	□	数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(オーストラリア)		千口		千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
ARENA REIT		93.469		159.242		45,439	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		123.086		260.875	1,254	104,086	0.1
APN INDUSTRIA REIT		41.907		73.145	234	19,415	0.0
NATIONAL STORAGE REIT		280.409		516.215	1,047	86,924	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD		50.661		73.965	241	20,062	0.0
GDI PROPERTY GROUP		137.85		247.876	280	23,234	0.0
HOME CONSORTIUM LTD		-		85.98	498	41,365	0.1
RURAL FUNDS GROUP		101.989		160.193	397	32,954	0.0
IRONGATE GROUP		-		256.148	371	30,808	0.0
SCENTRE GROUP		1,543.922		2,437.607	6,874	570,202	0.7
HOMECO DAILY NEEDS REIT		-		213.11	303	25,190	0.0
CENTURIA OFFICE REIT		115.908		179.274	419	34,797	0.0
AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD		-		176.463	538	44,644	0.1
WAYPOINT REIT LTD		208.852		382.777	1,014	84,141	0.1
小計	□	数	□	数	金額	金額	比率
	銘	柄	銘	柄	<比	<比	>
		8,802.655		15,356.239	65,264	5,413,690	-
		25銘柄<6.6%>		31銘柄<6.9%>	-	-	6.9
(香港)		千口		千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT		608.02		977.72	76,066	1,080,145	1.4
PROSPERITY REIT		361		597	1,779	25,262	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR		448		761	3,135	44,521	0.1
CHAMPION REIT		602.07		937.07	4,216	59,878	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		313		451	2,056	29,203	0.0
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T		405		680	5,712	81,110	0.1
小計	□	数	□	数	金額	金額	比率
	銘	柄	銘	柄	<比	<比	>
		2,737.09		4,403.79	92,966	1,320,122	-
		6銘柄<1.9%>		6銘柄<1.7%>	-	-	1.7
(シンガポール)		千口		千口	千シンガポール・ドル	千円	%
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		839.66		2,169.309	4,555	373,509	0.5
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT		881.66		1,544.76	4,526	371,098	0.5
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		840.979		-	-	-	-
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		698.59		1,006.99	1,470	120,542	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		880.12		1,370.62	2,768	227,001	0.3
STARHILL GLOBAL REIT		374.2		656.8	361	29,618	0.0
ASCOTT TRUST		530.116		891.616	891	73,103	0.1
KEPPEL REIT		553.6		951.5	1,094	89,715	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		208.3		622.9	1,501	123,082	0.2
ESR REIT		636.53		1,148.73	470	38,615	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		250.9		365.2	452	37,129	0.0
CAPITALAND CHINA TRUST		232.58		450.18	621	50,936	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU		180.1		608.8	167	13,726	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		140.595		216.895	307	25,252	0.0
PARKWAY LIFE REIT		119.3		179	789	64,722	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU		615		2,759.1	176	14,477	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		455.82		913.12	2,556	209,626	0.3
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		644.6		1,028.2	2,200	180,406	0.2
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST		310.78		587.88	485	39,765	0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		286.2		313.2	134	11,042	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		614.2		1,019	1,080	88,560	0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		271.3		491.5	289	23,775	0.0
SPH REIT		237		471.9	410	33,661	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT		275		-	-	-	-
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT		-		127.4	102	8,408	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T		165.2		208.1	193	15,867	0.0
QUE COMMERCIAL REIT		773.055		1,120.355	448	36,743	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT		203.6		422.2	339	27,866	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		235.7		377.1	197	16,232	0.0

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(シンガポール)	千□	千円	千□	千シンガポール・ドル	千円	%
IREIT GLOBAL	-	-	214.5	140	11,519	0.0
KEPPEL DC REIT	359.7	-	591.5	1,520	124,637	0.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	723.164	-	1,314.964	1,814	148,783	0.2
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	13,537.549 30銘柄<4.1%>	24,143.319 30銘柄<3.3%>	32,070	2,629,427	- 3.3
(ニュージーランド)	千□	千円	千□	千ニュージーランド・ドル	千円	%
PRECINCT PROPERTIES	326.171	-	510.038	790	60,833	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	106.603	-	180.112	545	41,994	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	328.996	-	520.345	1,194	91,893	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	447.199	-	742.461	864	66,559	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	247.066	-	388.009	601	46,278	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,456.035 5銘柄<0.4%>	2,340.965 5銘柄<0.4%>	3,996	307,559	- 0.4
(イギリス)	千□	千円	千□	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC	277.336	-	437.522	2,159	331,216	0.4
CAPITAL & REGIONAL PLC	9.186	-	-	-	-	-
DERWENT LONDON PLC	31.508	-	52.817	1,827	280,333	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC	48.36	-	77.686	995	152,776	0.2
HAMMERSON PLC	233.838	-	1,976.821	778	119,478	0.2
LAND SECURITIES GROUP PLC	221.691	-	355.626	2,409	369,651	0.5
WORKSPACE GROUP PLC	38.577	-	63.229	543	83,365	0.1
INTU PROPERTIES PLC	231.04	-	231.04	1	283	0.0
UNITE GROUP PLC	106.992	-	186.15	2,068	317,250	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	355.593	-	617.519	959	147,206	0.2
SHAFTESBURY PLC	63.788	-	144.406	862	132,357	0.2
SEGRO PLC	327.645	-	564.915	6,174	947,171	1.2
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	73.391	-	119.078	878	134,715	0.2
ASSURA PLC	788.073	-	1,242.776	945	145,078	0.2
STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERT	-	-	179.591	131	20,110	0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	187.713	-	255.156	120	18,474	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	170.446	-	257.572	225	34,533	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	254.022	-	347.914	271	41,681	0.1
SAFESTORE HOLDINGS LTD	60.379	-	97.821	924	141,804	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	269.096	-	423.479	1,006	154,348	0.2
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT	245.021	-	370.408	325	50,002	0.1
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL	247.221	-	397.993	673	103,361	0.1
GCP STUDENT LIVING PLC	-	-	210.196	348	53,396	0.1
RDI REIT PLC	74.051	-	-	-	-	-
NEWRIVER REIT PLC	102.138	-	139.604	118	18,224	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	189.831	-	294.033	345	53,043	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	110.038	-	177.39	186	28,572	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	-	-	371.767	438	67,294	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	512.115	-	810.128	1,598	245,191	0.3
CUSTODIAN REIT PLC	-	-	202.92	199	30,629	0.0
HOME REIT PLC	-	-	100.813	114	17,629	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	186.961	-	281.997	243	37,288	0.0
AEW UK REIT PLC	54.933	-	83.963	78	12,081	0.0
LXI REIT PLC	159.926	-	292.448	414	63,523	0.1
REGIONAL REIT LTD	129.74	-	206.337	179	27,537	0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	-	-	153.417	169	25,934	0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	5,760.649 30銘柄<5.3%>	11,724.532 34銘柄<5.6%>	28,719	4,405,550	- 5.6
(イスラエル)	千□	千円	千□	千イスラエル・シェケル	千円	%
REIT 1 LTD	52.551	-	85.363	1,515	51,165	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	52.551 1銘柄<0.1%>	85.363 1銘柄<0.1%>	1,515	51,165	- 0.1

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	口数	金額	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
(韓国)	千口	千円	千口	千韓国・ウォン	千円		%
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE	-	-	39,843	195,230	19,015		0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	10.894	-	19,635	162,774	15,854		0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	-	-	9,958	54,769	5,334		0.0
LOTTE REIT CO LTD	25.4	-	54,509	332,504	32,385		0.0
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	-	-	17,86	108,053	10,524		0.0
JR REIT XXVII	-	-	56,222	295,165	28,749		0.0
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	-	-	46,423	335,174	32,645		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	36,294	244.45	1,483,671	144,509		-
(ユーロ…シンガポール)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円		%
CROMWELL REIT EUR	-	-	131.74	309	40,649		0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	-	131.74	309	40,649		-
(ユーロ…アイルランド)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円		%
HIBERNIA REIT PLC	208.204	-	306,848	382	50,200		0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	119.677	-	214,307	327	42,995		0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	327,881	521,155	709	93,195		-
(ユーロ…オランダ)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円		%
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11.468	-	18.21	398	52,266		0.1
VASTNED RETAIL	5.849	-	8,822	227	29,826		0.0
WERELDHAVE NV	11.998	-	18,894	287	37,782		0.0
NSI NV	5.133	-	8,112	280	36,852		0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	34,448	54,038	1,193	156,728		-
(ユーロ…ベルギー)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円		%
BEFIMMO	6.929	-	12,281	421	55,389		0.1
COFINIMMO SA	7.256	-	13,734	1,801	236,589		0.3
RETAIL ESTATES	3.188	-	5,045	353	46,368		0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6.779	-	10,415	242	31,794		0.0
WAREHOUSES DE PAUW	38.064	-	64,409	2,111	277,217		0.4
MONTEA SCA	3.259	-	4,725	481	63,280		0.1
AEDIFICA	7.985	-	15,707	1,782	234,074		0.3
CARE PROPERTY INVEST NV	-	-	12,034	323	42,424		0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV	-	-	8,239	418	54,954		0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	73.46	146,589	7,936	1,042,092		-
(ユーロ…フランス)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円		%
GECINA SA	16.655	-	25,599	3,403	446,864		0.6
ICADE	8.117	-	14,526	1,077	141,518		0.2
ALTAREA	0.977	-	1,643	298	39,175		0.0
KLEPIERRE	60.564	-	93,81	2,133	280,094		0.4
COVIVIO	14.277	-	22,853	1,732	227,445		0.3
MERCIALYS	7.165	-	19,022	196	25,775		0.0
CARMILA SA	-	-	21,853	274	36,095		0.0
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	40.645	-	64,946	5,106	670,510		0.8
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	148.4	264,252	14,223	1,867,480		-
(ユーロ…ドイツ)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円		%
HAMBORNER REIT AG	21.542	-	32,106	290	38,201		0.0
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	46.459	-	84,625	1,331	174,891		0.2
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	68,001	116,731	1,622	213,092		-
(ユーロ…スペイン)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円		%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	72.211	-	119,135	1,060	139,295		0.2

銘柄	柄	期 首(前期末)				当 期				末	
		□ 数		□ 数		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率			
(ユーロ…スペイン)		千口		千口		千ユーロ	千円			%	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		18.634		27.656		141	18,519			0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		109.392		158.63		1,451	190,618			0.2	
小 計	□ 数	200.237		305.421		2,653	348,434			-	
	銘 柄 数<比 率>	3銘柄<0.5%>		3銘柄<0.4%>		-	-			0.4	
(ユーロ…イタリア)		千口		千口		千ユーロ	千円			%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		14.335		25.287		112	14,725			0.0	
小 計	□ 数	14.335		25.287		112	14,725			-	
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<0.0%>		1銘柄<0.0%>		-	-			0.0	
合 計	□ 数	41,146.369		72,334.932		-	78,493,798			-	
	銘 柄 数<比 率>	308銘柄<99.7%>		327銘柄<99.4%>		-	-			99.4	

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

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

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

■投資信託財産の構成

2021年6月22日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
投資信託受益証券、投資証券	千円	%	
	78,493,798	98.9	
コール・ローン等、その他	899,846	1.1	
投資信託財産総額	79,393,645	100.0	

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、78,945,132千円、99.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.28円、1カナダ・ドル=89.05円、1オーストラリア・ドル=82.95円、1香港・ドル=14.20円、1シンガポール・ドル=81.99円、1ニュージーランド・ドル=76.95円、1イギリス・ポンド=153.40円、1イスラエル・シェケル=33.768円、100韓国・ウォン=9.74円、1ユーロ=131.30円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	79,603,209,961円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	287,731,720
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	8,270,655,187
投 資 証 券(評価額)	70,223,143,733
未 収 入 金	695,464,237
未 収 配 当 金	126,215,084
(B) 負 債	643,996,315
未 払 金	639,224,315
未 払 解 約 金	4,772,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	78,959,213,646
元 本	51,487,595,373
次 期 繰 越 損 益 金	27,471,618,273
(D) 受 益 権 総 口 数	51,487,595,373口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	15,336円

(注1) 期首元本額 31,818,365,833円
 追加設定元本額 95,515,055,545円
 一部解約元本額 75,845,826,005円

(注2) 期末における元本の内訳

先進国REITインデックスF<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	77,345,015円
先進国REITインデックスF<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	47,730,002円
MITOラップ型ファンド (安定型)	4,079,406円
MITOラップ型ファンド (中立型)	12,324,186円
MITOラップ型ファンド (積極型)	15,806,473円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	44,427,031円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	26,820,444円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	21,242,218円
たわらノーロード 先進国リート	9,199,470,870円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,456,488,233円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	343,415,664円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,594,089,364円
たわらノーロード バランス (堅実型)	15,021,163円
たわらノーロード バランス (標準型)	269,589,574円
たわらノーロード バランス (積極型)	517,947,206円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	2,849,915円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	50,517,227円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	103,606,640円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	217,909,913円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	3,199,102円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,537,823円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	7,804,829円
One DC先進国リートインデックスファンド	668,657,524円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	18,528,218円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	584,044,636円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	49,505,985円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10)	214,771,724円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20)	257,640,235円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30)	473,479,123円
投資のソムリエ	14,503,667,660円
投資のソムリエ<DC年金>	770,759,716円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	208,590,169円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	506,580,878円

リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,243,003,250円
ワールドアセットバランス (基本コース)	631,670,857円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	2,025,831,537円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	18,688,512円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	8,934,114円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,780,454円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	47,479,777円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,857,665,588円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	160,502,360円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	13,778,837円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	6,843,270円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	6,456,862円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	477,053,365円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	157,404,304円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	152,689,863円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4	136,134,551円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	186,993,439円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	136,201,588円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	94,419,783円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03	14,584,701円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	149,262,841円
インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定)	551,341,810円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	365,019,674円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	249,192,963円
DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	128,259,992円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	300,203,577円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	4,176,747,403円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	340,995,307円
DIAM海外リートインデックスファンド (適格機関投資家限定)	554,879,654円
期末元本合計	51,487,595,373円

■損益の状況

当期 自2020年6月23日 至2021年6月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	1,789,006,467円	
	受取配当金	1,788,122,236	
	受取利息	24,391	
	その他の収益	1,015,455	
	支払利息	△155,615	
(B)	有価証券売買損益	18,149,662,918	
	売買益	20,186,684,133	
	売買損	△2,037,021,215	
(C)	その他の費用	△58,742,592	
(D)	当期損益金(A+B+C)	19,879,926,793	
(E)	前期繰越損益金	2,935,062,020	
(F)	解約差損益金	△20,082,050,995	
(G)	追加信託差損益金	24,738,680,455	
(H)	計(D+E+F+G)	27,471,618,273	
	次期繰越損益金(H)	27,471,618,273	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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