

運用報告書 (全体版)

第21期<決算日2022年7月11日>

投資のソムリエ

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|---|---|
| 商品分類 | 追加型投資 / 内外 / 資産複合 | |
| 信託期間 | 2012年10月26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 | 投資のソムリエ | 以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、短期金融資産に投資する場合もあります。 |
| | 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。 |
| | 国内株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。 |
| | 海外パッシブ・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。 |
| | 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。 |
| | 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。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。 |
| | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | ※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 | E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。 |
| | E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。 |
| | 国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）に実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。外貨連資産は投資環境に応じて弾力的に対円で為替ヘッジを行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。基準価額の変動リスクを年率4%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率4%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。基本配分戦略（月次）では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。機動的配分戦略（日次）では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率（0%～100%）を変更します。 | |
| | 各マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨連資産への実質投資割合には制限を設けません。 | |
| 組入制限 | | |
| 分配方針 | 決算日（原則として1月、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の配当等収益および売却益（評価益を含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。 | |

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「投資のソムリエ」は、2022年7月11日に第21期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

投資のソムリエ

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | | | 株式組 入率 | 株式先 物率 | 債券組 入率 | 新株予約権 付社債 (転換社債) 比率 | 債券先 物率 | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|------------------|---------------|----|------|-----------|-----------|-----------|------------------------------|-----------|-------------------------------|----------------|
| | 円 | 円 | % | | | | | | | |
| 17期 (2020年7月13日) | 12,217 | 80 | 2.3 | 8.0 | 0.5 | 73.6 | — | — | 5.3 | 百万円 227,606 |
| 18期 (2021年1月12日) | 12,341 | 80 | 1.7 | 21.5 | 1.3 | 68.5 | — | — | 6.5 | 397,433 |
| 19期 (2021年7月12日) | 12,382 | 80 | 1.0 | 16.7 | 0.5 | 68.4 | — | — | 9.2 | 570,151 |
| 20期 (2022年1月11日) | 12,091 | 80 | △1.7 | 18.8 | 0.9 | 54.9 | — | — | 6.9 | 642,046 |
| 21期 (2022年7月11日) | 10,938 | 80 | △8.9 | 19.5 | 0.8 | 56.8 | — | — | 7.0 | 575,829 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(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。

(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) 比率 | 債券先 物率 | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 |
|--------------------|--------|------|-----------|-----------|-----------|------------------------------|-----------|-------------------------------|
| | 円 | % | | | | | | |
| (期首) 2022年1月11日 | 12,091 | — | 18.8 | 0.9 | 54.9 | — | — | 6.9 |
| 1月末 | 11,938 | △1.3 | 11.8 | △1.6 | 63.6 | — | — | 3.4 |
| 2月末 | 11,714 | △3.1 | 12.5 | △1.6 | 68.0 | — | — | 2.8 |
| 3月末 | 11,479 | △5.1 | 19.3 | 0.9 | 38.0 | — | — | 6.2 |
| 4月末 | 11,341 | △6.2 | 11.0 | △2.9 | 63.0 | — | — | 7.3 |
| 5月末 | 11,243 | △7.0 | 7.8 | 0.4 | 76.8 | — | — | 4.1 |
| 6月末 | 10,949 | △9.4 | 15.7 | 0.7 | 56.3 | — | — | 5.8 |
| (期末) 2022年7月11日 | 11,018 | △8.9 | 19.5 | 0.8 | 56.8 | — | — | 7.0 |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

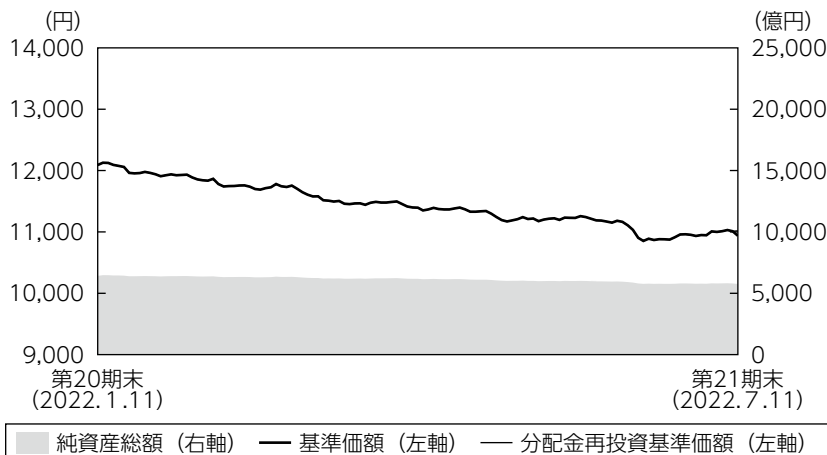
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年1月12日から2022年7月11日まで）

基準価額等の推移



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

今期は欧米各国の金融緩和の縮小や地政学リスクの高まりを受け、株式市場・債券市場ともに下落する展開となりました。為替市場では、米国の金利の上昇などを背景に、主要通貨に対して前期末対比で大幅な円安となりました。当ファンドは日次戦略を活用した積極的な資産配分調整を行いました。市場全体が下落する中で、基準価額も下落しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|------------------------------|--------|
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △2.5% |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | △2.3% |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △10.0% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | △1.6% |
| J-REITインデックスファンド・マザーファンド | △0.6% |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | △1.9% |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | △9.1% |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | △2.8% |

投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初は、欧米中央銀行の金融政策引き締め観測などを受けて利回りは上昇しました。2022年2月はウクライナ情勢の深刻化への懸念などから利回りは低下したものの、3月は欧米中央銀行の金融正常化のペースが加速するとの見方が強まり利回りは上昇しました。4月から期末にかけて、日銀が長期国債を固定利回りで無制限に買い入れる指値オペ（公開市場操作）を継続したことなどを受けて利回りは概ね横ばいで推移しました。

国内株式市場は、期初から2022年3月半ばまでは、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻を要因として下落しました。その後も、米国での金融引き締めへの警戒感、円安ドル高の進行、インフレ動向、新型コロナウイルスの感染状況やウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式は一進一退の展開となりました。

先進国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りはともに上昇（債券価格は下落）しました。米国債は、堅調な米雇用統計や、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めに積極的に行けるとの見方、米インフレ率の上振れなどを背景に利回りは上昇しました。ドイツ債についてもロシアのウクライナへの侵攻や米国長期金利の上昇、E C B（欧州中央銀行）が金融引き締めに急ぐとの見方などを受けて利回りは上昇しました。

先進国株式市場は下落しました。期初、米国の金融緩和策の急速な転換が懸念され下落した後、2022年3月上旬にかけてロシアのウクライナ侵攻が嫌気され下落しました。その後は和平交渉の進展期待から反発しましたが、中国における新型コロナウイルスの感染拡大などから不安定な展開となり、6月に入ると米国の物価上昇から金融引き締めの加速を嫌気し下落する中、期末を迎えました。

国内リート市場は下落しました。期初、米国金利の上昇懸念などからリスク回避的な動きが強まって下落し、その後はウクライナ情勢の緊迫化などが上値を抑える展開となりました。期の半ばには新型コロナウイルスのまん延防止等重点措置の解除や日銀の金融緩和姿勢などを受けて値を戻しましたが、期の後半には欧米での金融引き締め進展懸念などを背景に再び下落しました。期末にかけては値ごろ感などからやや値を戻しました。

外国リート市場は下落しました。米国リート市場はウクライナ情勢の緊迫化やインフレ加速懸念、F R Bの金融引き締めに対する警戒感から下落しました。欧州リート市場は地理的に隣接しているウクライナ情勢の緊迫化に加えて、E C Bのタカ派的な政策決定が嫌気され下落しました。オーストラリアリート市場はR B A（オーストラリア準備銀行）による利上げ姿勢の強まり等を背景に下落しました。

新興国債券市場は大幅に下落しました。2022年2月後半にロシアがウクライナに軍事侵攻したことで急落しました。その後も経済・金融面での対ロシア制裁や、インフレ懸念による米長期金利の上昇により、下落基調で推移しました。期末にかけても、金融政策の急速な引き締めによる景気減速懸念が高まり軟調となりました。対米国債スプレッド（利回り格差）は3月にかけて急拡大しましたが、その後はテクニカル要因で縮小し、期を通じては小幅な拡大にとどまりました。

新興国株式市場は下落しました。2022年2月下旬のロシアによるウクライナ侵攻を受け、米欧などが制裁を強化したことでロシア株を中心に下落しました。3月中旬以降は和平交渉の進展期待から反発しましたが、その後は中国における新型コロナウイルスの感染拡大や米国金利が上昇する一方、中国の景気刺激策など好悪材料が交錯する不安定な展開の中、期末を迎えました。

為替市場では、ドル／円相場は、米国の金利が上昇し内外金利差が拡大したことや、日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示す中で日米の金融政策の方向性の違いが意識されたことなどを材料に前期末対比で円安ドル高となりました。ユーロはウクライナ情勢等を受けて対ドルで下落しましたが、ユーロ圏のインフレ率の高まり等により対円では上昇しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

【基本配分戦略（月次）】

8つのマザーファンドおよび為替ヘッジに関する基本配分比率を月次で決定し、リバランスを行いました。期を通じ、安定資産へ60～65％程度、リスク性資産へ30～35％程度配分しました。

【機動的配分戦略（日次）】

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

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるS&P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

【運用状況】

○資産配分

期首（前期末）

| 資 産 | | 比 率 | |
|--------|------------|-------|-------|
| 安定資産 | 国内債券 | 6.1% | 48.5% |
| | 為替ヘッジ先進国債券 | 42.4% | |
| リスク性資産 | 新興国債券 | 7.0% | 33.6% |
| | 国内株式 | 13.2% | |
| | 先進国株式 | 3.4% | |
| | 新興国株式 | 3.2% | |
| | 国内リート | 3.5% | |
| | 先進国リート | 3.4% | |
| 現金等 | | 17.9% | |

期末

| 資 産 | | 比 率 | |
|--------|------------|-------|-------|
| 安定資産 | 国内債券 | 16.9% | 50.6% |
| | 為替ヘッジ先進国債券 | 33.7% | |
| リスク性資産 | 新興国債券 | 7.1% | 34.4% |
| | 国内株式 | 12.8% | |
| | 先進国株式 | 5.1% | |
| | 新興国株式 | 2.5% | |
| | 国内リート | 4.0% | |
| | 先進国リート | 3.0% | |
| 現金等 | | 15.0% | |



※1 比率は純資産総額に対する割合です。

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

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通り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 |
|------------|---------------------------|
| | 2022年1月12日 ～2022年7月11日 |
| 当期分配金（税引前） | 80円 |
| 対基準価額比率 | 0.73% |
| 当期の収益 | －円 |
| 当期の収益以外 | 80円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,101円 |

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

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

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

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を概ね一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

●J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第21期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------------------------|---------|--|
| | (2022年1月12日 ～2022年7月11日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 87円 | 0.763% | (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11,436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) | (41) | (0.354) | |
| (販売会社) | (44) | (0.382) | |
| (受託会社) | (3) | (0.027) | |
| (b) 売買委託手数料 | 1 | 0.005 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.002) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.002) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.001) | |
| (c) 有価証券取引税 | 1 | 0.006 | (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) | (0.004) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.002) | |
| (d) その他費用 | 2 | 0.015 | (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) | (0.000) | |
| (その他) | (1) | (0.008) | |
| 合計 | 90 | 0.789 | |

(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。

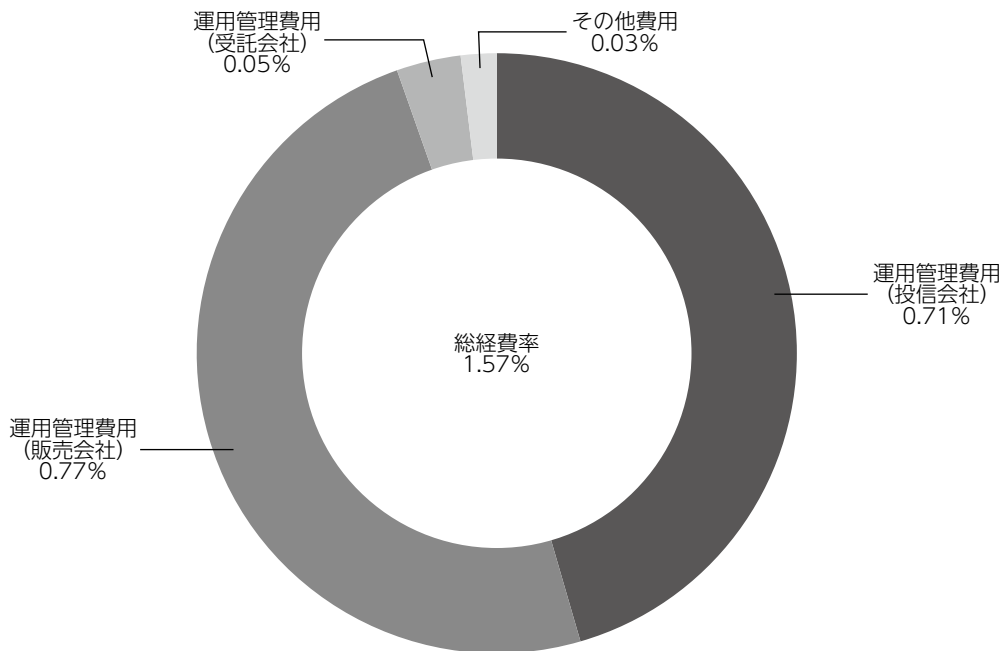
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.57%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。

■売買及び取引の状況 (2022年1月12日から2022年7月11日まで)

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|-----------|----------|----------|---------------|---------------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 株式先物取引 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 92,459 | 百万円 91,759 |

(注) 金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2022年1月12日から2022年7月11日まで)

| | 当 期 | | | |
|------------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 284,440,951 | 365,966,670 | 237,530,386 | 304,860,000 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 63,151,960 | 202,578,550 | 66,019,144 | 206,460,593 |
| 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 | 390,061,446 | 527,465,000 | 430,350,470 | 578,680,000 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 17,644,421 | 103,475,000 | 16,308,480 | 92,269,856 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 29,823,438 | 71,697,500 | 29,381,367 | 67,608,643 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 37,211,725 | 64,945,860 | 39,844,758 | 68,074,546 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 52,365,989 | 104,724,460 | 52,198,316 | 103,136,357 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 13,834,571 | 20,115,500 | 17,620,057 | 24,165,900 |

■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 | 623,078,679千円 | 326,860,157千円 | 83,736,267千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 371,724,107千円 | 661,625,154千円 | 63,705,011千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 1.67 | 0.49 | 1.31 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年1月12日から2022年7月11日まで）

【投資のソムリエ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) | 30,089千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 26千円 |
| (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。

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

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 | 当 期 | | | 期 | | |
|-------|----------------|--------------------|-----------|----------------|--------------------|-----------|
| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 公 社 債 | 百万円 605,716 | 百万円 63,742 | % 10.5 | 百万円 522,981 | 百万円 64,559 | % 12.3 |

平均保有割合 19.3%

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

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 | 当 期 | | | 期 | | |
|-------|----------------|--------------------|-----------|----------------|--------------------|-----------|
| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 株 式 | 百万円 311,089 | 百万円 219,520 | % 70.6 | 百万円 311,989 | 百万円 144,177 | % 46.2 |

平均保有割合 10.5%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | 期 |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
| 株 式 | 百万円 2,389 | 百万円 2,402 | 百万円 3,451 |

(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 3 |

【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】
 期中の利害関係人との取引等はありません。

【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。

【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 128,207 | 百万円 257 | % 0.2 | 百万円 120,973 | 百万円 16,568 | % 13.7 |

平均保有割合 7.6%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|---------|--------------|
| | 買 付 額 |
| 投 資 証 券 | 百万円 1,978 |

【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。

【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。

【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。

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。

■組入資産の明細

親投資信託残高

| | 期首 (前期末) | 当期 | |
|-------------------------------|-------------|-------------|-------------|
| | □ 数 | □ 数 | 評価額 |
| | 千□ | 千□ | 千円 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 29,896,768 | 76,807,333 | 97,368,656 |
| 国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド | 25,720,898 | 22,853,714 | 73,486,117 |
| 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 | 192,627,163 | 152,338,139 | 193,926,451 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 3,623,423 | 4,959,364 | 29,129,819 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 9,219,995 | 9,662,065 | 23,138,715 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 12,655,584 | 10,022,551 | 17,179,655 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 20,330,796 | 20,498,469 | 40,929,293 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 13,971,286 | 10,185,800 | 14,428,186 |

■投資信託財産の構成

2022年7月11日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 97,368,656 | 16.6 |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 73,486,117 | 12.5 |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 193,926,451 | 33.0 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 29,129,819 | 5.0 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 23,138,715 | 3.9 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 17,179,655 | 2.9 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 40,929,293 | 7.0 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 14,428,186 | 2.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 98,437,990 | 16.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 588,024,886 | 100.0 |

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2022年7月11日現在、14,042,475千円、2.4%、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379,154,616千円、98.5%、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは731,514,845千円、99.9%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは70,417,069千円、99.6%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは135,787,199千円、85.4%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは64,585,659千円、99.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年7月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.47円、1カナダ・ドル=105.35円、1オーストラリア・ドル=93.35円、1香港・ドル=17.39円、1シンガポール・ドル=97.49円、1ニュージーランド・ドル=84.31円、1台湾・ドル=4.579円、1イギリス・ポンド=163.89円、1イスラエル・シェケル=39.323円、1スイス・フラン=139.47円、1トルコ・リラ=7.91円、1デンマーク・クローネ=18.62円、1ノルウェー・クローネ=13.51円、1スウェーデン・クローナ=12.92円、1メキシコ・ペソ=6.67円、1フィリピン・ペソ=2.438円、100チリ・ペソ=14.058円、100コロンビア・ペソ=3.10円、1クウェート・ディナール=444.67円、1カタール・リアル=37.22円、1サウジアラビア・リアル=36.41円、1インド・ルピー=1.73円、100インドネシア・ルピア=0.91円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=37.22円、1ブラジル・レアル=25.957円、1チェコ・コルナ=5.628円、100韓国・ウォン=10.53円、1オフショア・人民元=20.391円、1マレーシア・リンギット=30.83円、1南アフリカ・ランド=8.10円、1タイ・バーツ=3.80円、1ポーランド・ズロチ=29.052円、100ハンガリー・フォリント=34.178円、1ユーロ=138.59円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年7月11日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 821,901,716,867円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 81,773,367,004 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 97,368,656,694 |
| 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) | 73,486,117,916 |
| 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) | 193,926,451,864 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 29,129,819,310 |
| 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) | 23,138,715,343 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 17,179,655,548 |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額) | 40,929,293,297 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額) | 14,428,186,253 |
| 未 収 入 金 | 236,498,978,418 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 14,042,475,220 |
| (B) 負 債 | 246,072,083,554 |
| 未 払 金 | 236,357,335,246 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 4,211,558,752 |
| 未 払 解 約 金 | 813,445,413 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 4,687,608,162 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 2,135,981 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 575,829,633,313 |
| 元 本 | 526,444,844,067 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 49,384,789,246 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 526,444,844,067口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,938円 |

(注) 期首における元本額は530,990,926,107円、当中における追加設定元本額は37,500,036,301円、同解約元本額は42,046,118,341円です。

■損益の状況

当期 自2022年1月12日 至2022年7月11日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 5,741,397円 |
| 受 取 利 息 | 342,333 |
| そ の 他 収 益 金 | 14,984,020 |
| 支 払 利 息 | △9,584,956 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △51,734,916,812 |
| 売 買 益 | 25,403,758,644 |
| 売 買 損 | △77,138,675,456 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | 1,622,757,113 |
| 取 引 益 | 3,754,034,917 |
| 取 引 損 | △2,131,277,804 |
| (D) 信 託 報 酬 等 | △4,696,967,511 |
| (E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D) | △54,803,385,813 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | △2,995,887,170 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 111,395,620,981 |
| (配 当 等 相 当 額) | (107,364,306,114) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (4,031,314,867) |
| (H) 合 計(E+F+G) | 53,596,347,998 |
| (I) 収 益 分 配 金 | △4,211,558,752 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H+I) | 49,384,789,246 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 111,395,620,981 |
| (配 当 等 相 当 額) | (107,395,309,486) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (4,000,311,495) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 3,224,591,735 |
| 繰 越 損 益 金 | △65,235,423,470 |

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

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

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

(注4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------|-----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 107,395,309,486 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 7,436,150,487 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d) | 114,831,459,973 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額 | 2,181.26 |
| (g) 分 配 金 | 4,211,558,752 |
| (h) 1万口当たり分配金 | 80 |

■分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金

80円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

《お知らせ》

- 当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」および「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円とする約款変更を行いました。

(2022年3月15日)

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

(2022年4月4日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第19期 (決算日 2022年2月14日)

(計算期間 2021年2月16日～2022年2月14日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

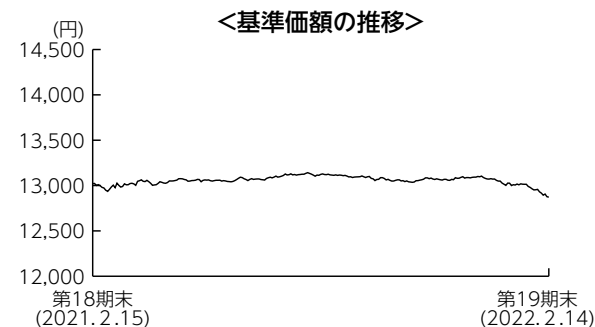
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月16日から2022年2月14日まで）

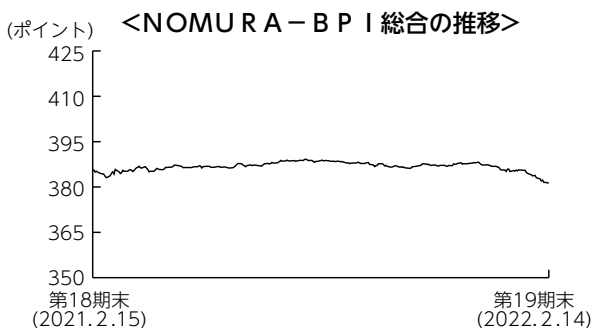


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,872円となり、前期末比で1.2%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

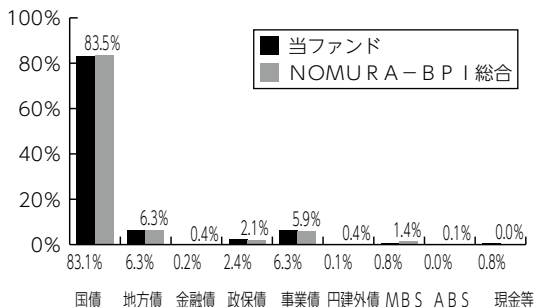
ポートフォリオについて

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

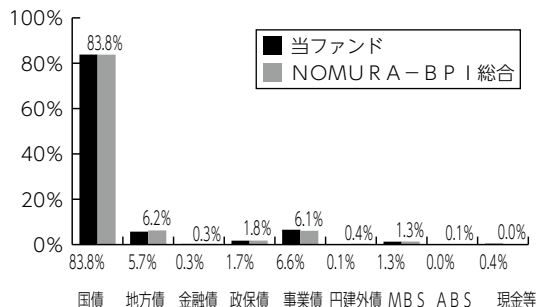
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

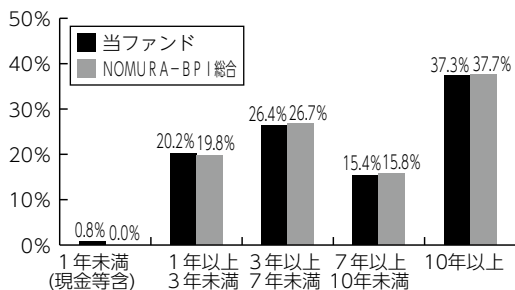


期末

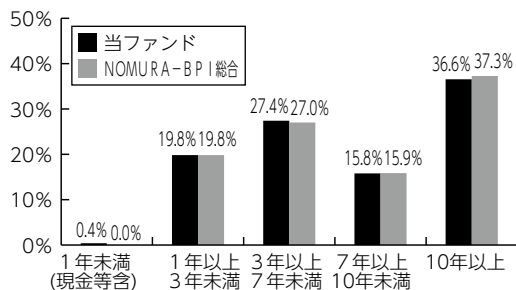


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



ベンチマークとの差異について

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

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

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

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|--------------|----------------|--------------------|-----------|----------------|--------------------|-----------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 公 社 債 | 百万円 770,671 | 百万円 100,563 | % 13.0 | 百万円 480,119 | 百万円 73,234 | % 15.3 |

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 | 期 |
|-------|---|------------|
| | 買 | 付 額 |
| 公 社 債 | | 百万円 304 |

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 | | | | 末 | | |
|-------------|-------------|-------------|---------|--------------------|-------------------|---------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うち B B 格 以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国 債 証 券 | 447,045,000 | 463,797,306 | 83.8 | — | 53.6 | 19.7 | 10.5 |
| 地 方 債 証 券 | 30,445,330 | 31,523,404 | 5.7 | 4.7 | 3.6 | 1.4 | 0.7 |
| 特 殊 債 証 券 | 25,151,985 | 26,325,307 | 4.8 | 0.0 | 3.3 | 0.8 | 0.6 |
| 金 融 債 証 券 | 1,800,000 | 1,796,652 | 0.3 | — | — | 0.3 | 0.0 |
| 普 通 社 債 証 券 | 27,481,000 | 27,644,946 | 5.0 | 0.1 | 2.4 | 1.9 | 0.7 |
| 合 計 | 531,923,315 | 551,087,616 | 99.6 | 4.8 | 63.0 | 24.2 | 12.5 |

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

(注2) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 4 2 3 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 3,000,000 | 3,002,670 | 2023/04/01 |
| 4 2 4 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 3,100,000 | 3,102,976 | 2023/05/01 |
| 4 2 5 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 2,000,000 | 2,002,060 | 2023/06/01 |
| 1 3 6 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 4,850,000 | 4,861,058 | 2023/06/20 |
| 3 2 9 回 利付国庫債券 (10年) | 0.8000 | 8,350,000 | 8,447,027 | 2023/06/20 |
| 4 2 6 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 2,100,000 | 2,102,163 | 2023/07/01 |
| 4 2 7 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 2,400,000 | 2,402,448 | 2023/08/01 |
| 4 2 8 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 2,500,000 | 2,502,500 | 2023/09/01 |
| 1 3 7 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 3,610,000 | 3,619,205 | 2023/09/20 |
| 3 3 0 回 利付国庫債券 (10年) | 0.8000 | 3,460,000 | 3,507,194 | 2023/09/20 |
| 3 3 1 回 利付国庫債券 (10年) | 0.6000 | 1,950,000 | 1,970,377 | 2023/09/20 |
| 6 4 回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 30,000 | 30,936 | 2023/09/20 |
| 4 2 9 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 2,000,000 | 2,002,100 | 2023/10/01 |
| 4 3 0 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 2,000,000 | 2,002,040 | 2023/11/01 |
| 4 3 1 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 4,000,000 | 4,003,920 | 2023/12/01 |
| 1 3 8 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 5,000,000 | 5,013,800 | 2023/12/20 |
| 3 3 2 回 利付国庫債券 (10年) | 0.6000 | 3,880,000 | 3,926,172 | 2023/12/20 |
| 6 5 回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 60,000 | 62,153 | 2023/12/20 |
| 4 3 2 回 利付国庫債券 (2年) | 0.0050 | 3,400,000 | 3,403,162 | 2024/01/01 |
| 1 3 9 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 3,750,000 | 3,760,950 | 2024/03/20 |
| 3 3 3 回 利付国庫債券 (10年) | 0.6000 | 3,630,000 | 3,678,206 | 2024/03/20 |
| 6 7 回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 50,000 | 52,023 | 2024/03/20 |
| 1 4 0 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 3,490,000 | 3,500,609 | 2024/06/20 |
| 3 3 4 回 利付国庫債券 (10年) | 0.6000 | 4,240,000 | 4,302,582 | 2024/06/20 |
| 7 0 回 利付国庫債券 (20年) | 2.4000 | 50,000 | 52,841 | 2024/06/20 |

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 7 1 回 利付国庫債券 (20年) | 2.2000 | 40,000 | 42,086 | 2024/06/20 |
| 1 4 1 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 3,610,000 | 3,621,227 | 2024/09/20 |
| 3 3 5 回 利付国庫債券 (10年) | 0.5000 | 4,700,000 | 4,763,403 | 2024/09/20 |
| 7 2 回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 460,000 | 485,313 | 2024/09/20 |
| 1 4 2 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 3,530,000 | 3,541,543 | 2024/12/20 |
| 3 3 6 回 利付国庫債券 (10年) | 0.5000 | 2,100,000 | 2,130,765 | 2024/12/20 |
| 3 3 7 回 利付国庫債券 (10年) | 0.3000 | 3,010,000 | 3,036,969 | 2024/12/20 |
| 7 3 回 利付国庫債券 (20年) | 2.0000 | 380,000 | 401,724 | 2024/12/20 |
| 7 4 回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 40,000 | 42,400 | 2024/12/20 |
| 1 4 3 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 3,200,000 | 3,210,880 | 2025/03/20 |
| 3 3 8 回 利付国庫債券 (10年) | 0.4000 | 6,030,000 | 6,106,400 | 2025/03/20 |
| 7 5 回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 180,000 | 191,710 | 2025/03/20 |
| 7 6 回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 70,000 | 74,121 | 2025/03/20 |
| 7 7 回 利付国庫債券 (20年) | 2.0000 | 40,000 | 42,478 | 2025/03/20 |
| 1 4 4 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 5,400,000 | 5,418,954 | 2025/06/20 |
| 3 3 9 回 利付国庫債券 (10年) | 0.4000 | 6,510,000 | 6,598,080 | 2025/06/20 |
| 7 8 回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 250,000 | 265,830 | 2025/06/20 |
| 7 9 回 利付国庫債券 (20年) | 2.0000 | 50,000 | 53,333 | 2025/06/20 |
| 8 0 回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 90,000 | 96,300 | 2025/06/20 |
| 1 4 5 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 4,350,000 | 4,365,616 | 2025/09/20 |
| 3 4 0 回 利付国庫債券 (10年) | 0.4000 | 4,410,000 | 4,473,371 | 2025/09/20 |
| 8 1 回 利付国庫債券 (20年) | 2.0000 | 400,000 | 428,676 | 2025/09/20 |
| 8 2 回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 140,000 | 150,540 | 2025/09/20 |
| 1 4 6 回 利付国庫債券 (5年) | 0.1000 | 3,900,000 | 3,914,235 | 2025/12/20 |
| 3 4 1 回 利付国庫債券 (10年) | 0.3000 | 3,820,000 | 3,863,280 | 2025/12/20 |

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

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

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

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

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | |
|----------------|--------------|--------|-------------|----------------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評 価 額 償還年月日 |
| (国債証券) | | % | 千円 | 千円 |
| 8回 | 利付国庫債券(40年) | 1.4000 | 1,310,000 | 1,505,792 2055/03/20 |
| 9回 | 利付国庫債券(40年) | 0.4000 | 1,950,000 | 1,675,966 2056/03/20 |
| 10回 | 利付国庫債券(40年) | 0.9000 | 1,820,000 | 1,829,755 2057/03/20 |
| 11回 | 利付国庫債券(40年) | 0.8000 | 1,480,000 | 1,441,638 2058/03/20 |
| 12回 | 利付国庫債券(40年) | 0.5000 | 1,400,000 | 1,228,892 2059/03/20 |
| 13回 | 利付国庫債券(40年) | 0.5000 | 1,730,000 | 1,512,244 2060/03/20 |
| 14回 | 利付国庫債券(40年) | 0.7000 | 1,700,000 | 1,585,624 2061/03/20 |
| 小 計 | | - | 447,045,000 | 463,797,306 - |
| (地方債証券) | | % | 千円 | 千円 |
| 7 1 9回 | 東京都公募公債 | 0.8600 | 200,000 | 201,858 2023/03/20 |
| 12 1回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.5700 | 500,000 | 503,335 2023/04/25 |
| 2 5年度4回 | 愛知県公募公債 | 0.8560 | 300,000 | 303,270 2023/05/30 |
| 7 2 0回 | 東京都公募公債 | 0.8700 | 300,000 | 303,474 2023/06/20 |
| 1回 | 東京都公募公債 20年 | 1.5400 | 100,000 | 102,059 2023/06/20 |
| 2 5年度4回 | 札幌市公募公債 | 0.8000 | 200,000 | 202,128 2023/06/20 |
| 2 5年度2回 | 横浜市公募公債 | 0.8880 | 400,000 | 404,956 2023/07/14 |
| 3 7 4回 | 大阪府公募公債 | 0.9380 | 300,000 | 304,038 2023/07/28 |
| 2 5年度5回 | 千葉県公募公債 | 0.8400 | 200,000 | 202,532 2023/08/25 |
| 2 5年度6回 | 千葉県公募公債 | 0.8000 | 100,000 | 101,271 2023/09/25 |
| 29回1号 | 宮城県公募公債 10年 | 0.6800 | 100,000 | 101,134 2023/10/25 |
| 1 2 7回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.6800 | 100,000 | 101,134 2023/10/25 |
| 1 2 8回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.6600 | 300,000 | 303,459 2023/11/24 |
| 2 5年度2回 | 島根県公募公債 | 0.6700 | 106,000 | 107,246 2023/11/27 |
| 7 2 6回 | 東京都公募公債 | 0.7300 | 400,000 | 405,316 2023/12/20 |
| 2 5年度8回 | 埼玉県公募公債 | 0.7030 | 100,000 | 101,289 2023/12/25 |
| 2 5年度11回 | 福岡県公募公債 | 0.6940 | 200,000 | 202,736 2024/02/26 |
| 2 5年度2回 | 新潟県公募公債 | 0.6700 | 100,000 | 101,322 2024/02/28 |
| 1 3 2回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.6600 | 100,000 | 101,345 2024/03/25 |
| 2 0 8回 | 神奈川県公募公債 | 0.5510 | 300,000 | 303,732 2024/06/20 |
| 2 6年度4回 | 札幌市公募公債 10年 | 0.5400 | 100,000 | 101,219 2024/06/20 |
| 1回 | 兵庫県公募公債(12年) | 1.1000 | 300,000 | 307,608 2024/06/26 |
| 2 6年度4回 | 神戸市公募公債 | 0.6060 | 100,000 | 101,402 2024/07/18 |
| 2 6年度5回 | 埼玉県公募公債 | 0.6110 | 400,000 | 405,720 2024/07/29 |
| 4 8 8回 | 名古屋市公募公債 10年 | 0.5980 | 450,000 | 456,633 2024/09/20 |
| 2 6年度1回 | 相模原市公募公債 | 0.5290 | 100,000 | 101,295 2024/09/20 |
| 2 6年度1回 | 長崎県公募公債 | 0.5540 | 100,000 | 101,361 2024/09/30 |
| 2 6年度1回 | 静岡市公募公債 | 0.5150 | 100,000 | 101,332 2024/11/25 |
| 2 6年度11回 | 京都府公募公債 | 0.4760 | 350,000 | 354,382 2024/12/19 |
| 2 6年度1回 | 三重県公募公債 | 0.4560 | 100,000 | 101,188 2024/12/25 |
| 2 6年度1回 | 浜松市公募公債 | 0.3350 | 100,000 | 100,866 2025/01/23 |
| 1 4 2回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.3450 | 500,000 | 504,480 2025/01/24 |
| 2 6年度3回 | 広島市公募公債 | 0.4290 | 100,000 | 101,177 2025/02/25 |
| 2 6年度17回 | 兵庫県公募公債 | 0.4600 | 200,000 | 202,544 2025/02/26 |
| 5回 | 東京都公募公債 20年 | 2.1100 | 100,000 | 106,390 2025/03/19 |
| 2 1 3回 | 神奈川県公募公債 | 0.5340 | 100,000 | 101,524 2025/03/19 |
| 1 4 4回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.4700 | 400,000 | 405,336 2025/03/25 |
| 1 4 6回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.5530 | 600,000 | 610,044 2025/05/23 |
| 1 4 8回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.5530 | 500,000 | 508,730 2025/07/25 |
| 7回 | 東京都公募公債 20年 | 2.1600 | 100,000 | 107,575 2025/09/19 |
| 1回 | 静岡県公募公債 20年 | 2.1800 | 100,000 | 107,627 2025/09/19 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | |
|----------------|----------------|--------|---------|--------------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評 価 額 償還年月日 |
| (地方債証券) | | % | 千円 | 千円 |
| 27年度15回 | 愛知県公募公債 10年 | 0.4710 | 100,000 | 101,571 2025/11/27 |
| 1 5 3回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.4690 | 100,000 | 101,575 2025/12/25 |
| 2 7年度9回 | 千葉県公募公債 | 0.0950 | 100,000 | 100,122 2026/03/25 |
| 1 5 7回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.0800 | 120,000 | 120,074 2026/04/24 |
| 9回 | 東京都公募公債 20年 | 2.4400 | 200,000 | 220,570 2026/06/19 |
| 1 5 9回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.0700 | 200,000 | 199,998 2026/06/25 |
| 1回 | 兵庫県公募公債 15年 | 1.6600 | 200,000 | 214,114 2026/07/29 |
| 2 8年度6回 | 北海道公募公債 | 0.0700 | 100,000 | 99,977 2026/08/31 |
| 7 6 0回 | 東京都公募公債 | 0.0450 | 100,000 | 99,862 2026/09/18 |
| 1 0回 | 東京都公募公債 20年 | 2.3300 | 300,000 | 330,960 2026/09/18 |
| 4回 | 京都市公募公債 20年 | 2.5100 | 100,000 | 111,143 2026/09/18 |
| 4 1 3回 | 共同発行市場公募公債 10年 | 0.0210 | 100,000 | 99,723 2026/10/28 |
| 1 6 6回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.1800 | 500,000 | 502,335 2027/01/25 |
| 2 8年度8回 | 福岡県公募公債 | 0.2400 | 100,000 | 100,725 2027/02/24 |
| 4 1 9回 | 大阪府公募公債 10年 | 0.1960 | 100,000 | 100,392 2027/04/27 |
| 2回 | 静岡県公募公債 15年 | 1.4060 | 100,000 | 106,848 2027/06/25 |
| 5回 | 兵庫県公募公債 12年 | 0.6870 | 100,000 | 103,010 2027/07/07 |
| 2 9年度4回 | 大阪府公募公債 | 0.1500 | 200,000 | 199,998 2027/09/21 |
| 1 7 4回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.1450 | 100,000 | 99,972 2027/09/24 |
| 2 4年度1回 | 福岡県公募公債 15年 | 1.3290 | 100,000 | 106,797 2027/11/29 |
| 1 7 8回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.2300 | 100,000 | 100,471 2028/01/25 |
| 1 7 9回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.2400 | 500,000 | 502,535 2028/02/25 |
| 2 9年度6回 | 広島市公募公債 | 0.2300 | 300,000 | 301,341 2028/02/25 |
| 2 9年度13回 | 京都府公募公債 | 0.2000 | 109,330 | 109,626 2028/03/16 |
| 5回 | 兵庫県公募公債 15年 | 1.3100 | 300,000 | 321,342 2028/05/26 |
| 7 8 3回 | 東京都公募公債 | 0.2200 | 110,000 | 110,413 2028/06/20 |
| 4回 | 静岡県公募公債 15年 | 1.3380 | 100,000 | 107,343 2028/06/23 |
| 3 0年度7回 | 神戸市公募公債 30年 | 0.2540 | 300,000 | 301,740 2028/09/20 |
| 第 9 1回 | 川崎市公募公債 | 0.1850 | 200,000 | 200,260 2028/09/20 |
| 7回 | 静岡県公募公債 20年 | 2.3200 | 300,000 | 342,096 2028/09/21 |
| 3 0年度3回 | 広島県公募公債 | 0.2540 | 100,000 | 100,581 2028/09/25 |
| 3 0年度3回 | 堺市公募公債 | 0.1950 | 100,000 | 100,067 2028/12/19 |
| 2 3 7回 | 神奈川県公募公債 | 0.1350 | 200,000 | 199,458 2028/12/20 |
| 2 0回2号 | 福岡県公募公債 | 2.0500 | 100,000 | 112,685 2028/12/20 |
| 6回 | 大阪府公募公債 20年 | 2.2100 | 200,000 | 227,612 2028/12/20 |
| 1 7回 | 横浜市公募公債 20年 | 2.0700 | 100,000 | 112,820 2028/12/20 |
| 6回 | 北九州市公募公債 20年 | 2.0300 | 100,000 | 112,474 2028/12/20 |
| 3 0年度6回 | 福岡県公募公債 | 0.2000 | 200,000 | 200,406 2028/12/21 |
| 1 8 9回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.2100 | 100,000 | 100,237 2028/12/25 |
| 3 0年度14回 | 北海道公募公債 | 0.1950 | 400,000 | 400,132 2028/12/28 |
| 1 8回 | 東京都公募公債 20年 | 2.2200 | 100,000 | 114,282 2029/03/19 |
| 3 0年度19回 | 愛知県公募公債 | 0.1150 | 200,000 | 199,016 2029/03/28 |
| 3 0年度3回 | 岡山県公募公債 10年 | 0.1500 | 200,000 | 199,508 2029/03/29 |
| 1 9 4回 | 共同発行市場公募地方債 | 0.1100 | 300,000 | 298,275 2029/05/25 |
| 6回 | 川崎市公募公債 20年 | 2.2100 | 200,000 | 228,986 2029/05/25 |
| 令和元年度1回 | 福岡県公募公債 | 0.0290 | 200,000 | 197,594 2029/06/21 |
| 9回 | 兵庫県公募公債 15年 | 1.0200 | 100,000 | 105,986 2029/07/13 |
| 11回 | 神奈川県公募公債 20年 | 2.0800 | 100,000 | 113,800 2029/07/20 |
| 7 9 6回 | 東京都公募公債 | 0.0400 | 200,000 | 197,530 2029/09/20 |
| 令和元年度 9回 | 静岡県公募公債 | 0.0500 | 200,000 | 197,680 2029/09/20 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---------------------|--------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (地方債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 令和元年度3回 横浜市公募債 | 0.0500 | 400,000 | 395,316 | 2029/10/16 |
| 令和元年度16回 兵庫県公募債 | 0.0500 | 200,000 | 197,652 | 2029/10/23 |
| 21回 東京都公募債 20年 | 2.1900 | 100,000 | 115,284 | 2029/12/20 |
| 17回 さいたま市公募債 | 0.1100 | 200,000 | 198,376 | 2029/12/25 |
| 令和元年度第8回 埼玉県公募債 | 0.1350 | 200,000 | 198,670 | 2030/01/30 |
| 21年度2回 福岡県公募債 (20年) | 2.2300 | 100,000 | 115,890 | 2030/02/22 |
| 203回 共同発行市場公募地方債 | 0.0950 | 100,000 | 99,013 | 2030/02/25 |
| 802回 東京都公募債 | 0.1300 | 400,000 | 396,980 | 2030/03/19 |
| 511回 名古屋市長公募債 10年 | 0.0750 | 200,000 | 197,608 | 2030/03/27 |
| 令和2年度1回 京都府公募債 | 0.1350 | 400,000 | 397,116 | 2030/04/12 |
| 令和2年2回 大阪府公募債 | 0.1310 | 300,000 | 297,588 | 2030/05/22 |
| 9回 埼玉県公募債 20年 | 2.1500 | 100,000 | 115,631 | 2030/05/24 |
| 8回 静岡県公募債 15年 | 0.8280 | 200,000 | 209,836 | 2030/06/07 |
| 令和2年度10回 静岡県公募債 | 0.1350 | 100,000 | 99,073 | 2030/09/20 |
| 令和2年5回 福岡県公募債 | 0.1350 | 100,000 | 99,522 | 2030/10/23 |
| 36回2号 宮城県公募債 10年 | 0.1350 | 250,000 | 247,500 | 2030/10/28 |
| 令和2年度1回 福島県公募債 | 0.1350 | 200,000 | 197,936 | 2030/11/27 |
| 令和2年度1回 高知県公募債 | 0.1350 | 200,000 | 197,936 | 2030/11/27 |
| 22年度14回 愛知県公募債 | 2.0870 | 300,000 | 347,595 | 2030/12/13 |
| 9回 京都市公募債 20年 | 2.1430 | 200,000 | 232,738 | 2030/12/17 |
| 813回 東京都公募債 | 0.1790 | 300,000 | 297,897 | 2030/12/20 |
| 16回 神奈川県公募債 20年 | 2.0900 | 300,000 | 348,129 | 2031/01/24 |
| 464回 大阪府公募債 10年 | 0.0720 | 200,000 | 196,622 | 2031/01/28 |
| 令和2年度19回 北海道公募債 | 0.1450 | 100,000 | 98,897 | 2031/02/26 |
| 令和2年度14回 京都府公募債 | 0.2140 | 200,000 | 199,184 | 2031/03/12 |
| 令和2年7回 広島県公募債 | 0.2140 | 200,000 | 199,182 | 2031/03/19 |
| 251回 神奈川県公募債 10年 | 0.1990 | 200,000 | 198,826 | 2031/03/20 |
| 令和2年度14回 静岡県公募債 | 0.1400 | 200,000 | 197,780 | 2031/03/20 |
| 令和3年度1回 長野県公募債 10年 | 0.1900 | 200,000 | 198,682 | 2031/04/16 |
| 令和3年度2回 兵庫県公募債 | 0.1750 | 100,000 | 99,165 | 2031/04/25 |
| 467回 大阪府公募債 10年 | 0.1640 | 200,000 | 197,956 | 2031/04/28 |
| 469回 大阪府公募債 10年 | 0.1280 | 200,000 | 197,136 | 2031/06/27 |
| 令和3年5回 千葉県公募債 | 0.1050 | 200,000 | 196,712 | 2031/09/25 |
| 472回 大阪府公募債 10年 | 0.1000 | 200,000 | 196,436 | 2031/09/29 |
| 19回 神奈川県公募債 20年 | 1.8180 | 100,000 | 114,954 | 2032/01/30 |
| 24年度2回 福岡県公募債 (20年) | 1.6350 | 300,000 | 340,239 | 2032/08/16 |
| 10回 大阪府公募債 20年 | 1.7200 | 200,000 | 228,482 | 2032/09/24 |
| 24年度12回 神戸市公募債 | 1.7110 | 200,000 | 228,902 | 2032/12/17 |
| 14回 千葉県公募債 20年 | 1.1370 | 100,000 | 108,398 | 2033/04/15 |
| 13回 埼玉県公募債 20年 | 1.5990 | 100,000 | 113,533 | 2033/05/20 |
| 1回 東京都公募債 30年 | 2.2100 | 200,000 | 240,730 | 2033/06/20 |
| 14回 埼玉県公募債 20年 | 1.5460 | 300,000 | 340,266 | 2034/05/08 |
| 29回 横浜市公募債 20年 | 1.5280 | 100,000 | 113,263 | 2034/05/26 |
| 16回 名古屋市公募債 20年 | 1.5200 | 100,000 | 113,143 | 2034/06/09 |
| 5回 群馬県公募債 20年 | 1.5290 | 100,000 | 113,268 | 2034/06/16 |
| 17回 北九州市公募債 20年 | 1.5290 | 100,000 | 113,146 | 2034/06/20 |
| 15回 埼玉県公募債 20年 | 1.1660 | 100,000 | 108,996 | 2035/02/16 |
| 2回 横浜市公募債 30年 | 2.4900 | 100,000 | 125,684 | 2035/03/20 |
| 18回 千葉県公募債 20年 | 1.1380 | 100,000 | 108,681 | 2035/04/13 |
| 17回 名古屋市公募債 20年 | 1.2030 | 100,000 | 109,504 | 2035/05/28 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|-------------------------|--------|------------|------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (地方債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 13回 大阪府公募債 20年 | 1.2030 | 100,000 | 109,382 | 2035/09/28 |
| 14回 大阪府公募債 20年 | 0.5400 | 100,000 | 100,067 | 2036/09/29 |
| 21回 千葉県公募債 20年 | 0.4240 | 100,000 | 98,557 | 2036/10/15 |
| 3回 神奈川県公募債 30年 | 2.6200 | 100,000 | 129,747 | 2037/03/19 |
| 29年度2回 広島市公募債 | 0.6160 | 200,000 | 201,596 | 2037/08/18 |
| 29年度5回 札幌市公募債 20年 | 0.5970 | 300,000 | 301,374 | 2037/09/18 |
| 30年度2回 仙台市公募債 20年 | 0.7290 | 100,000 | 101,875 | 2038/10/18 |
| 30年度7回 福岡市公募債 | 0.7010 | 200,000 | 202,748 | 2038/10/19 |
| 2019年度5回 福岡市公募債 20年 | 0.2860 | 100,000 | 94,215 | 2039/07/29 |
| 2回 兵庫県公募債 30年 | 2.3600 | 100,000 | 128,860 | 2040/03/19 |
| 22年度8回 福岡市公募債 | 2.2800 | 100,000 | 127,719 | 2040/09/20 |
| 令和2年2回 広島県公募債 | 0.4640 | 100,000 | 96,353 | 2040/09/21 |
| 23年度7回 札幌市公募債 30年 | 2.0970 | 100,000 | 125,408 | 2041/09/20 |
| 5回 川崎市公募債 30年 | 2.0970 | 100,000 | 125,839 | 2042/03/20 |
| 24年度12回 愛知県公募債 30年 | 2.1200 | 100,000 | 126,252 | 2042/09/19 |
| 14回 東京都公募債 30年 | 2.0500 | 100,000 | 125,309 | 2043/06/19 |
| 27年度8回 愛知県公募債 30年 | 1.5790 | 150,000 | 174,357 | 2045/06/20 |
| 27年度2回 広島県公募債 30年 | 0.7110 | 100,000 | 97,493 | 2046/03/22 |
| 6回 埼玉県公募債 30年 | 0.9570 | 200,000 | 204,822 | 2046/12/20 |
| 令和元年度1回 島根県公募債 | 0.2900 | 200,000 | 189,308 | 2049/09/17 |
| 5回 京都市公募債 30年定時償還 | 0.2900 | 200,000 | 189,826 | 2049/09/17 |
| 令和3年度6回 神戸市公募債 30年 | 0.7130 | 200,000 | 189,564 | 2051/06/20 |
| 小計 | - | 30,445,330 | 31,523,404 | - |
| (特殊債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 19回 政保日本政策投資銀行社債 | 0.6680 | 100,000 | 100,742 | 2023/03/15 |
| 55回 鉄道建設運輸施設債 | 0.8420 | 500,000 | 504,550 | 2023/03/20 |
| 189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.5410 | 500,000 | 503,365 | 2023/04/28 |
| 18回 国際協力機構債券 | 0.8680 | 100,000 | 101,155 | 2023/06/20 |
| 193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.8820 | 500,000 | 506,195 | 2023/06/30 |
| 50回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.9110 | 500,000 | 506,570 | 2023/07/14 |
| 195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.9110 | 430,000 | 435,835 | 2023/07/31 |
| 116回 高速道路機構債 | 0.7220 | 100,000 | 101,136 | 2023/09/20 |
| 202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.6990 | 105,000 | 106,289 | 2023/10/31 |
| 56回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.7470 | 542,000 | 550,010 | 2024/01/19 |
| 7回 広島県・広島市折半保証広島高速道路債券 | 0.6940 | 100,000 | 101,052 | 2024/02/28 |
| 211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.6600 | 100,000 | 101,364 | 2024/02/29 |
| 218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.6600 | 100,000 | 101,533 | 2024/05/31 |
| 220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.6440 | 200,000 | 203,092 | 2024/06/28 |
| 64回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.5440 | 300,000 | 304,170 | 2024/09/13 |
| 139回 日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.5000 | 100,000 | 101,219 | 2024/09/20 |
| 71回 鉄道建設運輸施設債 | 0.5250 | 100,000 | 101,362 | 2024/11/27 |
| 21回 政保中部国際空港債券 | 0.4500 | 100,000 | 101,357 | 2025/03/17 |
| 241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.4500 | 500,000 | 506,870 | 2025/03/31 |
| 71回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.3910 | 100,000 | 101,199 | 2025/04/25 |
| 21回 沖縄振興開発金融公庫債券 | 0.6210 | 100,000 | 101,941 | 2025/06/20 |
| 254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債 | 0.4400 | 100,000 | 101,487 | 2025/08/29 |
| 127回 日本政策投資銀行債券 | 0.0400 | 100,000 | 99,949 | 2025/09/19 |
| 85回 中日日本高速道路債券 | 0.0700 | 300,000 | 299,841 | 2025/10/21 |
| 172回 住宅金融支援機構債券 | 0.5010 | 100,000 | 101,676 | 2025/11/20 |
| 23回 国際協力銀行債券 | 2.0900 | 100,000 | 107,806 | 2025/12/19 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---------------------------|--------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (特殊債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 6 1 回 住宅金融支援機構債券 | 1.8300 | 100,000 | 106,809 | 2025/12/19 |
| 4 0 回 政保日本政策金融公庫債券 | 0.0200 | 103,000 | 102,957 | 2026/03/13 |
| 1 1 回 独立行政法人福祉医療機構 | 2.5700 | 100,000 | 110,249 | 2026/03/20 |
| 1 8 7 回 住宅金融支援機構債券 | 0.0900 | 100,000 | 100,104 | 2026/04/20 |
| 8 3 回 地方公共団体金融機構債券 10年 | 0.0900 | 400,000 | 400,416 | 2026/04/28 |
| 8 0 回 住宅金融支援機構債券 | 1.5890 | 100,000 | 106,928 | 2026/09/18 |
| 3 2 1 回 住宅金融支援機構債券 | 0.0100 | 500,000 | 498,510 | 2026/09/18 |
| 7 9 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 1.5070 | 300,000 | 320,157 | 2026/11/06 |
| 9 1 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.0850 | 100,000 | 100,168 | 2026/12/14 |
| 3 0 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.1150 | 100,000 | 100,296 | 2027/01/29 |
| F 1 4 7 回 地方公共団体金融機構債券 | 1.2910 | 200,000 | 211,904 | 2027/03/19 |
| 7 8 回 日本政策投資銀行債券 | 0.2250 | 300,000 | 301,767 | 2027/04/13 |
| 3 0 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.1400 | 800,000 | 801,656 | 2027/04/30 |
| 7 2 回 東日本高速道路社債 | 0.1200 | 200,000 | 199,734 | 2027/06/18 |
| 9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.1600 | 100,000 | 100,269 | 2027/07/16 |
| 2 2 2 回 住宅金融支援機構債券 | 0.2100 | 300,000 | 301,113 | 2027/11/19 |
| 1 0 3 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.1550 | 100,000 | 100,231 | 2027/12/17 |
| 1 2 4 回 住宅金融支援機構債券 | 1.4280 | 100,000 | 107,376 | 2027/12/20 |
| 7 7 回 東日本高速道路社債 | 0.1100 | 300,000 | 299,130 | 2027/12/20 |
| 2 3 0 回 住宅金融支援機構債券 | 0.2600 | 300,000 | 301,425 | 2028/02/18 |
| 1 1 3 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.2190 | 100,000 | 100,521 | 2028/10/16 |
| 9 回 新関西国際空港社債 | 1.2310 | 200,000 | 213,926 | 2028/12/20 |
| 1 回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 2.0700 | 200,000 | 225,488 | 2028/12/20 |
| 9 3 回 都市再生債券 | 1.1020 | 100,000 | 106,336 | 2029/06/20 |
| 1 回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 2.2660 | 300,000 | 344,622 | 2029/06/28 |
| 2 回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 2.2660 | 300,000 | 345,489 | 2029/08/28 |
| 1 2 回 新関西国際空港社債 | 1.0670 | 200,000 | 212,340 | 2029/09/20 |
| 3 9 回 住宅金融支援機構債券 | 2.1500 | 200,000 | 228,672 | 2029/09/20 |
| 9 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 2.1000 | 100,000 | 114,896 | 2029/12/28 |
| 7 8 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 0.8010 | 100,000 | 104,386 | 2030/05/28 |
| 1 0 9 回 都市再生機構債券 | 0.9180 | 200,000 | 210,748 | 2030/06/20 |
| 1 5 回 日本政策金融公庫債券 | 1.9110 | 200,000 | 228,104 | 2030/10/29 |
| 1 2 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.8000 | 500,000 | 567,995 | 2030/10/31 |
| 1 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 2.1320 | 100,000 | 116,328 | 2031/01/28 |
| 9 0 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 0.2000 | 200,000 | 198,172 | 2031/05/30 |
| 7 5 回 住宅金融支援機構債券 | 2.0660 | 350,000 | 406,605 | 2031/06/13 |
| 7 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.9600 | 100,000 | 115,414 | 2031/09/19 |
| 1 5 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.8000 | 100,000 | 114,749 | 2031/12/26 |
| 1 9 回 地方公共団体金融機構債券 | 1.8400 | 200,000 | 229,494 | 2031/12/26 |
| 2 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 1.6800 | 100,000 | 113,574 | 2032/07/28 |
| 1 1 5 回 住宅金融支援機構債券 | 1.8110 | 100,000 | 114,784 | 2032/09/14 |
| 1 5 回 国際協力機構債券 | 1.7240 | 100,000 | 113,908 | 2032/09/17 |
| 2 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 1.7020 | 200,000 | 227,792 | 2032/09/28 |
| 1 8 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.4000 | 100,000 | 111,437 | 2033/04/28 |
| 2 8 回 日本道路・機構承継債 | 2.8300 | 500,000 | 637,360 | 2033/12/20 |
| 1 2 4 回 日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.5500 | 100,000 | 112,737 | 2034/03/17 |
| 3 6 回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 1.5660 | 100,000 | 113,297 | 2034/04/28 |
| 2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.1600 | 300,000 | 327,033 | 2035/02/28 |
| 1 5 9 回 住宅金融支援機構債券 | 1.1250 | 100,000 | 107,835 | 2035/05/18 |
| 1 5 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.3000 | 100,000 | 110,076 | 2035/06/20 |

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

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|----------------------------------|--------|------------|------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (特殊債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4700 | 77,103 | 77,288 | 2052/03/10 |
| 119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4600 | 77,191 | 77,317 | 2052/04/10 |
| 120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4300 | 241,122 | 240,948 | 2052/11/10 |
| 128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4200 | 241,002 | 240,671 | 2053/01/10 |
| 130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4200 | 163,316 | 163,084 | 2053/03/10 |
| 131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4000 | 245,409 | 244,643 | 2053/04/10 |
| 132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4000 | 245,211 | 244,521 | 2053/05/10 |
| 137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4700 | 424,330 | 425,004 | 2053/10/10 |
| 139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4600 | 84,346 | 84,415 | 2053/12/10 |
| 142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3200 | 87,002 | 86,223 | 2054/03/10 |
| 154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3000 | 276,159 | 273,005 | 2055/03/10 |
| 162回 日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.8610 | 100,000 | 122,990 | 2055/03/19 |
| 156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3500 | 369,132 | 366,160 | 2055/05/10 |
| 160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3700 | 283,044 | 281,119 | 2055/09/10 |
| 168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4000 | 290,907 | 289,478 | 2056/05/10 |
| 170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3600 | 881,010 | 873,486 | 2056/07/10 |
| 413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.6880 | 200,000 | 183,480 | 2061/02/28 |
| 小計 | - | 25,151,985 | 26,325,307 | - |
| (金融債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 342回 利付信金中金債(5年) | 0.1100 | 100,000 | 100,077 | 2023/05/26 |
| い第828号 利付商工債 | 0.1400 | 100,000 | 100,101 | 2024/05/27 |
| い第843号 利付商工債 | 0.1200 | 100,000 | 100,002 | 2025/08/27 |
| 369回 利付信金中金債(5年) | 0.0600 | 400,000 | 399,584 | 2025/08/27 |
| い第851号 利付商工債 | 0.0900 | 300,000 | 299,247 | 2026/04/27 |
| 377回 利付信金中金債(5年) | 0.0400 | 300,000 | 299,247 | 2026/04/27 |
| い第854号 利付商工債 | 0.0800 | 300,000 | 299,070 | 2026/07/27 |
| い第855号 利付商工債 | 0.0800 | 200,000 | 199,324 | 2026/08/27 |
| 小計 | - | 1,800,000 | 1,796,652 | - |
| (普通社債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 14回 トヨタ自動車社債 | 0.9630 | 200,000 | 201,960 | 2023/03/20 |
| 10回 セブン銀行社債 | 0.8030 | 100,000 | 100,813 | 2023/03/20 |
| 47回 日立キャピタル社債 | 0.8740 | 200,000 | 201,714 | 2023/03/20 |
| 301回 北陸電力社債 | 1.1580 | 100,000 | 101,144 | 2023/03/24 |
| 5回 ファーストリテイリング社債 | 0.1100 | 100,000 | 100,014 | 2023/06/06 |
| 23回 東京瓦斯社債 | 1.0100 | 300,000 | 303,507 | 2023/06/09 |
| 27回 NTTデータ社債 | 0.9000 | 200,000 | 202,124 | 2023/06/20 |
| 253回 四国電力社債 | 1.0000 | 200,000 | 202,312 | 2023/06/23 |
| 6回 JXホールディングス社債 | 1.1190 | 100,000 | 101,399 | 2023/07/19 |
| 377回 中国電力社債 | 1.1210 | 400,000 | 406,036 | 2023/08/25 |
| 10回 西日本旅客鉄道社債 | 2.0400 | 300,000 | 309,228 | 2023/09/20 |
| 26回 フランス銀行東京支店発行(BFCM)円建て債(2018) | 0.4430 | 100,000 | 100,225 | 2023/10/12 |
| 48回 クレディ・アグリコル社債 | 1.0380 | 100,000 | 101,521 | 2023/10/20 |
| 47回 住友商事社債 | 0.8580 | 100,000 | 101,166 | 2023/10/23 |
| 424回 九州電力社債 | 1.2330 | 200,000 | 203,762 | 2023/11/24 |
| 56回 中日本高速道路社債 | 0.7590 | 100,000 | 101,345 | 2023/12/20 |
| 13回 東海旅客鉄道社債 | 2.0150 | 200,000 | 206,906 | 2023/12/20 |
| 38回 電源開発社債 | 0.9780 | 300,000 | 304,485 | 2023/12/20 |
| 471回 東北電力社債 | 1.1680 | 400,000 | 407,364 | 2023/12/25 |
| 426回 九州電力社債 | 1.0640 | 400,000 | 407,084 | 2024/02/23 |
| 13回 新生銀行社債 | 0.1500 | 200,000 | 199,664 | 2024/03/12 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|--------------------------------|--------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (普通社債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 16回 トヨタ自動車社債 | 0.6450 | 200,000 | 202,226 | 2024/03/19 |
| 14回 東海旅客鉄道社債 | 2.2000 | 100,000 | 104,259 | 2024/03/19 |
| 49回 住友化学社債 | 0.9440 | 100,000 | 101,598 | 2024/04/25 |
| 2回 BPCE SA円貸社債(ソーシャルボンド) | 0.3670 | 100,000 | 99,964 | 2024/06/28 |
| 428回 九州電力社債 | 0.9360 | 100,000 | 101,795 | 2024/07/25 |
| 29回 三菱重工業社債 | 0.6620 | 100,000 | 101,123 | 2024/09/03 |
| 25回 首都高速道路社債 | 0.0300 | 100,000 | 99,909 | 2024/09/20 |
| 72回 三菱地所社債 | 2.2800 | 100,000 | 105,384 | 2024/09/20 |
| 16回 成田国際空港社債 | 0.5700 | 100,000 | 101,361 | 2024/10/28 |
| 10回 三井住友信託銀行社債 | 0.5850 | 200,000 | 202,522 | 2024/10/28 |
| 4回 住友三井オートサービス社債 | 0.1500 | 100,000 | 99,794 | 2024/10/31 |
| 6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貸社債 | 0.8650 | 200,000 | 202,624 | 2024/11/28 |
| 25回 西日本高速道路社債 | 0.5240 | 200,000 | 202,578 | 2024/12/20 |
| 11回 セブン銀行社債 | 0.5360 | 200,000 | 202,466 | 2024/12/20 |
| 321回 北海道電力社債 | 0.8860 | 261,000 | 265,865 | 2024/12/25 |
| 10回 キリンホールディングス社債 | 0.6030 | 100,000 | 101,257 | 2025/02/28 |
| 26回 西日本高速道路社債 | 0.6040 | 100,000 | 101,738 | 2025/05/21 |
| 29回 三井住友ファイナンス&リース社債 | 0.1900 | 200,000 | 199,822 | 2025/06/11 |
| 12回 セン&アイ・ホールディングス社債 | 0.7810 | 100,000 | 101,975 | 2025/06/20 |
| 39回 東日本旅客鉄道社債 | 2.0500 | 300,000 | 318,549 | 2025/06/20 |
| 497回 関西電力社債 | 1.0020 | 100,000 | 102,562 | 2025/06/20 |
| 13回 電源開発社債 | 2.0400 | 200,000 | 212,108 | 2025/06/20 |
| 12回 新生銀行社債 | 0.3600 | 400,000 | 400,780 | 2025/07/09 |
| 27回 東日本旅客鉄道社債 | 2.1100 | 200,000 | 213,564 | 2025/09/19 |
| 42回 首都高速道路社債 | 0.0600 | 400,000 | 399,540 | 2025/12/19 |
| 14回 セン&アイ・ホールディングス社債 | 0.1900 | 200,000 | 199,792 | 2025/12/19 |
| 26回 トヨタ自動車社債 | 0.0500 | 200,000 | 199,146 | 2026/03/18 |
| 42回 王子ホールディングス社債 | 0.0800 | 200,000 | 198,840 | 2026/03/24 |
| 96回 トヨタファイナンス社債 | 0.0600 | 100,000 | 99,565 | 2026/04/15 |
| 163回 東日本旅客鉄道社債 | 0.0500 | 300,000 | 297,954 | 2026/04/15 |
| 28回 芙蓉総合リース社債 | 0.1400 | 300,000 | 298,170 | 2026/04/21 |
| 493回 九州電力社債 | 0.1000 | 200,000 | 198,520 | 2026/05/25 |
| 106回 住友不動産社債 | 0.4000 | 100,000 | 100,410 | 2026/05/26 |
| 24回 大和ハウス工業社債 | 0.0800 | 200,000 | 198,954 | 2026/06/03 |
| 40回 三菱ケミカルホールディングス社債 | 0.0900 | 100,000 | 99,434 | 2026/06/03 |
| 35回 三菱マテリアル社債 | 0.1100 | 300,000 | 298,050 | 2026/06/05 |
| 11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貸社債(2016) | 0.4000 | 100,000 | 99,418 | 2026/06/10 |
| 57回 東日本高速道路社債 | 0.1100 | 100,000 | 100,064 | 2026/06/19 |
| 79回 東日本高速道路社債 | 0.0500 | 300,000 | 299,349 | 2026/06/19 |
| 83回 東日本高速道路社債 | 0.0500 | 200,000 | 199,566 | 2026/06/19 |
| 69回 ホンダファイナンス社債 | 0.0900 | 300,000 | 298,221 | 2026/06/19 |
| 4回 東京地下鉄社債 | 2.3800 | 120,000 | 131,178 | 2026/06/19 |
| 307回 北陸電力社債 | 1.0550 | 100,000 | 103,449 | 2026/06/25 |
| 90回 中日本高速道路債 | 0.0500 | 200,000 | 199,556 | 2026/07/27 |
| 20回 三井住友信託銀行社債 | 0.1300 | 300,000 | 299,763 | 2026/07/27 |
| 91回 中日本高速道路債 | 0.0400 | 500,000 | 498,510 | 2026/09/17 |
| 62回 西日本高速道路債 | 0.0400 | 500,000 | 498,510 | 2026/09/18 |
| 17回 パナソニック社債 | 0.4700 | 100,000 | 100,801 | 2026/09/18 |
| 488回 東北電力社債 | 0.2900 | 100,000 | 99,999 | 2026/10/23 |
| 33回 西日本高速道路債 | 0.2700 | 300,000 | 302,304 | 2026/12/14 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | |
|------------------------------------|--------|---------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 |
| (普通社債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 3 4 回 西日本高速道路債券 | 0.3350 | 200,000 | 201,988 | 2027/02/16 |
| 1 2 回 りそな銀行劣後社債 | 2.4640 | 100,000 | 109,385 | 2027/03/15 |
| 8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債 | 2.3400 | 100,000 | 110,997 | 2027/04/20 |
| 5 0 8 回 関西電力社債 | 0.4550 | 300,000 | 302,142 | 2027/04/23 |
| 3 4 0 回 北海道電力社債 | 0.4800 | 300,000 | 301,983 | 2027/04/23 |
| 1 0 8 回 住友不動産社債 | 0.4000 | 200,000 | 200,320 | 2027/05/07 |
| 3 0 回 東レ社債 | 0.3750 | 300,000 | 299,919 | 2027/07/16 |
| 3 2 回 東海旅客鉄道社債 | 2.3100 | 100,000 | 111,110 | 2027/09/17 |
| 3 1 1 回 北陸電力社債 | 0.8470 | 100,000 | 102,875 | 2027/09/24 |
| 25回 フランス相互証券銀行 (BF CMI) 円社債 (2017) | 0.5100 | 300,000 | 300,165 | 2027/10/12 |
| 8 1 回 トヨタファイナンス社債 | 0.2650 | 100,000 | 99,776 | 2027/10/22 |
| 5 2 5 回 東北電力社債 | 0.2200 | 200,000 | 198,714 | 2027/10/25 |
| 5 4 回 電源開発社債 | 0.3800 | 100,000 | 100,062 | 2027/11/19 |
| 17回 NTTファイナンス社債 | 0.2800 | 300,000 | 300,276 | 2027/12/20 |
| 5 6 回 三菱UFJリース社債 | 0.4550 | 300,000 | 301,581 | 2028/01/18 |
| 1 2 回 ソフトバンク社債 | 0.4200 | 400,000 | 396,368 | 2028/06/02 |
| 7回 ファーストリテイリング社債 | 0.4050 | 200,000 | 200,934 | 2028/06/06 |
| 5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債 | 0.4940 | 100,000 | 100,028 | 2028/10/25 |
| 2 1 回 西日本旅客鉄道社債 | 2.2470 | 100,000 | 113,448 | 2029/03/21 |
| 23回 三井住友ファイナンス&リース社債 | 0.3900 | 100,000 | 99,654 | 2029/04/12 |
| 1 4 回 プリダストーン社債 | 0.3750 | 300,000 | 299,688 | 2029/04/19 |
| 8 0 回 東京急行電鉄社債 | 1.2110 | 100,000 | 106,046 | 2029/04/27 |
| 5 3 0 回 関西電力社債 | 0.4050 | 400,000 | 398,716 | 2029/06/20 |
| 7 3 回 三井物産社債 | 0.2900 | 400,000 | 397,692 | 2029/07/11 |
| 5 3 2 回 中部電力社債 | 0.2240 | 200,000 | 197,242 | 2029/07/25 |
| 8 0 回 日立キャピタル社債 | 0.2800 | 200,000 | 197,254 | 2029/10/19 |
| 6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債 | 2.1490 | 100,000 | 114,048 | 2029/12/21 |
| 6 7 回 東日本高速道路社債 | 0.2200 | 200,000 | 199,608 | 2030/01/31 |
| 1 9 回 パナソニック社債 | 0.3700 | 100,000 | 99,336 | 2030/03/05 |
| 1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債 | 0.2650 | 100,000 | 99,442 | 2030/04/22 |
| 6 0 回 西日本旅客鉄道社債 | 0.2550 | 200,000 | 198,552 | 2030/05/21 |
| 5 2 1 回 東北電力社債 | 0.4500 | 400,000 | 400,636 | 2030/05/24 |
| 4 2 5 回 中国電力社債 | 0.3700 | 100,000 | 99,435 | 2030/06/25 |
| 31回 三井住友ファイナンス&リース社債 | 0.3900 | 200,000 | 198,448 | 2030/08/09 |
| 1 8 回 NTTファイナンス社債 | 0.3800 | 400,000 | 399,996 | 2030/09/20 |
| 7 1 回 東日本旅客鉄道社債 | 1.9050 | 100,000 | 113,148 | 2030/09/27 |
| 1 7 回 ダイセル社債 | 0.5000 | 300,000 | 300,510 | 2030/12/13 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | |
|----------------------|--------|-------------|-------------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 |
| (普通社債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 8 6 回 日立キャピタル社債 | 0.4000 | 300,000 | 297,459 | 2030/12/20 |
| 7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債 | 2.0980 | 200,000 | 230,196 | 2030/12/20 |
| 2 3 回 パナソニック社債 | 0.3900 | 200,000 | 198,218 | 2030/12/24 |
| 3 0 回 光通信社債 | 0.9800 | 200,000 | 201,078 | 2031/01/31 |
| 7 4 回 西日本旅客鉄道社債 | 0.2300 | 100,000 | 98,948 | 2031/04/22 |
| 4 9 1 回 九州電力社債 | 0.3400 | 300,000 | 296,484 | 2031/04/25 |
| 5 4 1 回 関西電力社債 | 0.3700 | 300,000 | 296,946 | 2031/09/19 |
| 1 6 回 武田薬品工業社債 | 0.4000 | 500,000 | 493,755 | 2031/10/14 |
| 7 5 回 電源開発社債 | 0.3500 | 200,000 | 197,668 | 2031/10/20 |
| 3 9 6 回 中国電力社債 | 0.5540 | 200,000 | 201,890 | 2032/01/23 |
| 9回 野村不動産ホールディングス社債 | 0.9900 | 100,000 | 99,513 | 2036/06/02 |
| 23回 三菱ケミカルホールディングス社債 | 0.8500 | 200,000 | 202,224 | 2036/06/09 |
| 4 1 回 東京瓦斯社債 | 0.5700 | 200,000 | 197,974 | 2036/11/28 |
| 5 2 7 回 中部電力社債 | 0.8060 | 100,000 | 101,283 | 2037/10/23 |
| 1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債 | 0.6750 | 100,000 | 99,688 | 2038/01/26 |
| 2 6 回 豊田通商社債 | 0.8970 | 100,000 | 100,776 | 2038/03/05 |
| 3 5 0 回 北海道電力社債 | 0.7540 | 200,000 | 198,848 | 2038/03/25 |
| 4 6 3 回 九州電力社債 | 0.7920 | 100,000 | 100,101 | 2038/05/25 |
| 8回 ファーストリテイリング社債 | 0.8800 | 200,000 | 200,640 | 2038/06/04 |
| 4 3 回 京浜急行電鉄社債 | 0.6760 | 100,000 | 97,663 | 2038/07/12 |
| 4 6 6 回 九州電力社債 | 0.7200 | 100,000 | 98,977 | 2038/07/23 |
| 5 2 回 東京瓦斯社債 | 0.4860 | 100,000 | 95,902 | 2039/05/23 |
| 5 3 1 回 関西電力社債 | 0.6720 | 200,000 | 193,860 | 2039/06/20 |
| 5 5 回 東京瓦斯社債 | 0.2800 | 100,000 | 92,270 | 2039/09/13 |
| 3 7 回 成田国際空港社債 | 0.4240 | 100,000 | 94,387 | 2040/01/27 |
| 1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債 | 0.5960 | 200,000 | 193,374 | 2041/04/15 |
| 7 5 回 西日本旅客鉄道社債 | 0.5820 | 200,000 | 192,742 | 2041/04/22 |
| 4 9 2 回 九州電力社債 | 0.6500 | 100,000 | 96,298 | 2041/04/25 |
| 1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債 | 1.4150 | 100,000 | 109,475 | 2045/01/27 |
| 1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債 | 1.1330 | 100,000 | 103,649 | 2047/07/26 |
| 7 0 回 西日本旅客鉄道社債 | 0.7980 | 100,000 | 93,961 | 2049/12/24 |
| 1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債 | 0.8080 | 200,000 | 189,550 | 2051/07/14 |
| 7 1 回 西日本旅客鉄道社債 | 0.9560 | 100,000 | 93,754 | 2059/12/24 |
| 4 7 回 東京地下鉄社債 | 0.9090 | 100,000 | 91,698 | 2060/09/17 |
| 1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債 | 0.9700 | 100,000 | 93,516 | 2060/12/17 |
| 小 計 | - | 27,481,000 | 27,644,946 | - |
| 合 計 | - | 531,923,315 | 551,087,616 | - |

■投資信託財産の構成

2022年2月14日現在

| 項 目 | 当 | 期 | 末 |
|-------------------------|-------------|---|-------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 公 社 債 | 551,087,616 | | 91.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 50,748,215 | | 8.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 601,835,832 | | 100.0 |

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月14日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|---|---|
| (A) 資 産 | 601,835,832,511円 |
| コ ー ル ・ 公 司 未 前 負 未 純 資 産 元 次 受 取 払 解 約 総 額(A-B) 期 繰 越 損 益 総 額(C/D) | 49,696,366,967 551,087,616,706 809,631,617 242,217,221 48,532,656,000 48,532,656,000 553,303,176,511 429,840,166,151 123,463,010,360 429,840,166,151円 12,872円 |

| | | | |
|--------------------------------|------------------|--|------------------|
| (注1) 期首元本額 | 209,919,027,595円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) | 37,377,953円 |
| 追加設定元本額 | 611,239,283,321円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) | 15,418,280円 |
| 一部解約元本額 | 391,318,144,765円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) | 12,877,158円 |
| (注2) 期末における元本の内訳 | | 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> | 327,852,051円 |
| DIAM国内債券パッシブ・ファンド | 23,682,506,030円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065) | 851,076円 |
| MITO ラップ型ファンド (安定型) | 83,095,931円 | DIAMエマージング債券ファンド | 9,450,010円 |
| MITO ラップ型ファンド (中立型) | 153,860,446円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 1,570,192,380円 |
| MITO ラップ型ファンド (積極型) | 119,506,919円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 1,607,821,940円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 687,384,295円 | マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) | 1,368,128,834円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 133,587,952円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 982,094,880円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 23,730,893円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 1,551,466,786円 |
| たわらノーロード 国内債券 | 15,834,399,947円 | インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定) | 2,239,773,338円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 2,521,507,162円 | マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06 | 1,216,964,056円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 886,604,365円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 1,398,783,514円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 1,507,222,733円 | DIAM国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け) | 8,901,727,961円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 189,908,936円 | Oneコポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 463,351,202円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) | 74,774,735円 | 投資のソムリエ・私費 (適格機関投資家限定) | 2,068,944,514円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) | 1,322,091,006円 | Oneコポートフォリオ・プラス戦略 (債券動的アロケーション) | 379,250,637円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 1,225,069,364円 | DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) | 276,996,912円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) | 327,185,576円 | One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI (適格機関投資家限定) | 3,244,504,751円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) | 22,506,242円 | One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家限定) | 3,251,938,545円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 17,145,320円 | One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定) | 3,223,328,742円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 13,611,444円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 2,685,868,185円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 90,707,115円 | リスクコントロール世界8資産(バランスファンド) (FoF 用) (適格機関投資家専用) | 51,300,165円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 5,060,786円 | DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 165,802,939円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 414,272円 | DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 98,585,137円 |
| DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金> | 14,277,651,015円 | DIAM国際分散(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定) | 27,788,034円 |
| Oneグローバルバランス | 8,911,633円 | DIAM国際分散(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定) | 97,096,530円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 8,982,923,753円 | DIAM国内重視(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定) | 34,365,367円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 12,483,500,015円 | DIAM国内重視(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定) | 4,318,042円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 5,178,995,984円 | DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 25,972,068円 |
| DIAM DCバランス30インデックスファンド | 2,189,166,701円 | DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 126,573,725円 |
| DIAM DCバランス50インデックスファンド | 2,329,357,704円 | DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 3,587,635,563円 |
| DIAM DCバランス70インデックスファンド | 390,282,840円 | DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) | 2,301,884,615円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 87,660,620円 | DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 4,374,149,034円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 3,040,981,442円 | DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) | 113,717,437円 |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション | 11,707,847円 | DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) | 190,263,848円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 4,303,883,102円 | DIAM アスク グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 2,187,734,764円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 1,576,117,456円 | DIAM世界アセット(バランス)ファンドVA (適格機関投資家向け) | 180,904,488円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 340,130,669円 | DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 10,231,460円 |
| 投資のソムリエ | 86,470,476,048円 | DIAM世界アセット(バランス)ファンド2VA (適格機関投資家限定) | 2,254,611,473円 |
| クルーズコントロール | 331,216,116円 | DIAM世界アセット(バランス)ファンド40VA (適格機関投資家限定) | 49,059,889円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 5,215,918,149円 | DIAM世界アセット(バランス)ファンド25VA (適格機関投資家限定) | 354,407,860円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 4,612,393,810円 | DIAM世界アセット(バランス)ファンド3VA (適格機関投資家限定) | 558,346,963円 |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> | 738,611,977円 | DIAM世界アセット(バランス)ファンド4VA (適格機関投資家限定) | 950,183,773円 |
| DIAMコア資産設計ファンド (堅実型) | 1,459,012円 | DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) | 298,351,041円 |
| DIAMコア資産設計ファンド (積極型) | 4,619,684円 | DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定) | 101,646,068円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 6,424,858,123円 | Oneコポートフォリオ・プラス戦略ファンドI (適格機関投資家限定) | 1,043,766,370円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 44,101,884,740円 | コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 382,409,178円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 35,684,515円 | 動的パッケージファンド<DC年金> | 333,573,020円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 17,735,957円 | コア資産形成ファンド | 227,460,602円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 53,072,038円 | MHAM日本債券インデックスファンド (ファンドラップ) | 42,573,117,520円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 176,635,602円 | MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定] | 46,106,741,798円 |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 2,233,253,084円 | MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定] | 14,232,766,343円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 8,448,159,838円 | MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定] | 1,641,455,600円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 5,330,495,531円 | 期末元本合計 | 429,840,166,151円 |

■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月14日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|------------|------------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 2,936,984,033 | 円 |
| | 受取利息 | 2,933,836,057 | |
| | その他の収益 | 4,106,122 | |
| | 支払利息 | △958,146 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | △10,450,257,321 | |
| | 売却益 | 660,402,300 | |
| | 売却損 | △11,110,659,621 | |
| (C) | 当期損益金(A+B) | △7,513,273,288 | |
| (D) | 前期繰越損益金 | 63,427,095,992 | |
| (E) | 解約差損益金 | △119,188,902,023 | |
| (F) | 追加信託差損益金 | 186,738,089,679 | |
| (G) | 計(C+D+E+F) | 123,463,010,360 | |
| | 次期繰越損益金(G) | 123,463,010,360 | |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第20期（決算日 2022年2月7日）

（計算期間 2021年2月9日～2022年2月7日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

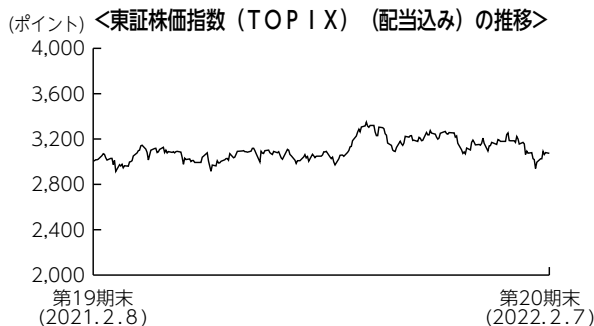
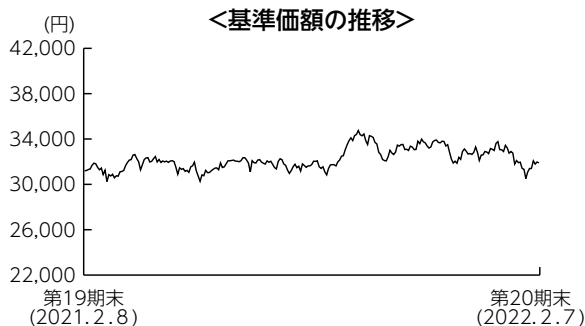
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種
期首 (前期末)

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



期末

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

○組入上位10銘柄
期首 (前期末)

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



期末

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.2%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|------------------|------------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション) | 1円 (0) (0) | 0.002% (0.001) (0.001) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| 合 計 | 1 | 0.002 | |
| 期中の平均基準価額は32,238円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年2月9日から2022年2月7日まで)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---------|--|--------------------------|--------------------|-------------|-------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 内 上 場 | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 192,672.8 (6,584.913) | 479,219,336 (-) | 161,731.513 | 395,856,402 |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|-------------|----------------|----------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 内 | 株 式 先 物 取 引 | 百万円 144,564 | 百万円 142,625 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 875,075,739千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 369,108,651千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b) | 2.37 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月9日から2022年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 区 分 | 当 期 | | | 期 | | |
|-----|----------------|--------------------|-----------|----------------|--------------------|-----------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 株 式 | 百万円 479,219 | 百万円 130,245 | % 27.2 | 百万円 395,856 | 百万円 59,442 | % 15.0 |

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | 期 |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
| 株 式 | 百万円 3,678 | 百万円 3,163 | 百万円 3,133 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|-----|--------------|
| | 買 付 額 |
| 株 式 | 百万円 1,300 |

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 7,278千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 148千円 |
| (B) / (A) | 2.0% |

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

組入資産の明細

(1) 国内株式

| 銘柄 | 当期末 | | | 銘柄 | 当期末 | | | 銘柄 | 当期末 | | |
|----------------------|-------|-------|---------|-------------------|-------|-------|-----------|-----------------------|-------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | | | | | | | | | |
| 極洋 | 5.4 | 7.2 | 22,224 | 矢作建設工業 | 16.7 | 20.5 | 15,641 | DM三井製糖ホールディングス | 9.5 | 13.7 | 27,578 |
| 日本水産 | 148.6 | 199.7 | 103,844 | ビー・エス・三菱 | 12.2 | 15.4 | 9,548 | 塩水漬精糖 | 14.4 | 19.9 | 4,258 |
| マルハニチロ | 25.2 | 31.4 | 78,468 | 日本ハウスホールディングス | 25.6 | 31.7 | 14,360 | 日新製糖 | 4.5 | 7.6 | 13,148 |
| 雪国まいたけ | 9.9 | 14.8 | 17,863 | 大東建託 | 40.5 | 47.2 | 636,256 | 森永製菓 | 27.8 | 34.8 | 128,412 |
| カネコ種苗 | 4.6 | 4.9 | 7,408 | 新日本建設 | 15.9 | 19.9 | 15,004 | 中村屋 | 2.5 | 2.6 | 8,710 |
| サカタのタネ | 19.2 | 24 | 78,600 | N I P P O | 30.8 | — | — | 江崎グリコ | 32.7 | 40.7 | 153,846 |
| ホクト | 13.6 | 17 | 33,320 | 東亜道路工業 | 2.4 | 2.6 | 13,052 | 名糖産業 | 5.6 | 6.9 | 11,460 |
| ホクリヨウ | 2.3 | 3.4 | 2,363 | 前田道路 | 22.9 | — | — | 井村屋グループ | 6.8 | 8.6 | 19,169 |
| 鉱業 (0.3%) | | | | 日本道路 | 3.6 | 4.6 | 38,180 | 不二家 | 7.6 | 8.5 | 19,371 |
| 住石ホールディングス | 27.8 | 35.1 | 4,773 | 東亜建設工業 | 9.9 | 11.5 | 27,933 | 山崎製パン | 89 | 110.7 | 179,887 |
| 日鉄鉱業 | 3.7 | 4.6 | 28,474 | 日本国土開発 | 36.3 | 45.5 | 24,115 | 第一屋製パン | 2.9 | 3.5 | 1,858 |
| 三井松島ホールディングス | 6.7 | 8.3 | 12,640 | 若築建設 | 6.7 | 7.7 | 13,213 | モロゾフ | 1.7 | 3.7 | 10,175 |
| I N P E X | 590.1 | 800.9 | 940,256 | 東洋建設 | 41.6 | 51.7 | 29,882 | 龜田製菓 | 6.9 | 8.6 | 33,669 |
| 石油資源開発 | 21 | 23.5 | 66,951 | 五洋建設 | 157.5 | 182.7 | 116,745 | 寿スビリッツ | 11.4 | 14.3 | 78,364 |
| K&Oエナジーグループ | 7.7 | 9.9 | 15,246 | 世紀東急工業 | 17.9 | 22.4 | 18,256 | カルビー | 54.1 | 67.3 | 164,817 |
| 建設業 (2.3%) | | | | 福田組 | 4.3 | 5 | 21,950 | 森永乳業 | 21.9 | 27.4 | 149,604 |
| ヒノキヤグループ | 4 | 4.5 | 9,292 | 住友林業 | 87.2 | 118 | 240,602 | 六甲バター | 8 | 11 | 16,280 |
| ショーボンドホールディングス | 22.9 | 28.5 | 143,925 | 日本基礎技術 | 11.7 | 12.7 | 7,975 | ヤグルト本社 | 81.6 | 109.4 | 633,422 |
| ミライト・ホールディングス | 55.7 | 64.4 | 121,265 | 巴コーポレーション | 16.8 | 20.7 | 10,060 | 明治ホールディングス | 78.5 | 97.6 | 704,676 |
| タマホーム | 9.7 | 12.1 | 29,717 | 大和ハウス工業 | 342.4 | 425.6 | 1,442,358 | 雪印メグミルク | 28.6 | 35.6 | 73,407 |
| サンヨーホームズ | 2.2 | 2.5 | 1,827 | ライト工業 | 21.3 | 29 | 53,679 | ブリマハム | 16.8 | 18.6 | 44,807 |
| 日本アーク | 6.4 | 8.1 | 5,070 | 積水ハウス | 402.2 | 500 | 1,164,500 | 日本ハム | 45.4 | 56.5 | 237,865 |
| ファーストコーポレーション | 4.9 | 6.4 | 4,454 | 日特建設 | 9.9 | 9.8 | 6,997 | 林兼産業 | 3.6 | 3.8 | 1,919 |
| ベステラ | 3 | 4 | 5,024 | 北陸電気工事 | 6.6 | 9.8 | 8,065 | 丸大食品 | 11.8 | 14.8 | 22,555 |
| Robot Home | 29.9 | 33.3 | 7,425 | ユアテック | 21.3 | 26.5 | 18,470 | S Foods | 10.7 | 13.3 | 43,424 |
| キャンディル | 2.8 | 3.8 | 1,862 | 日本リーテック | 7.7 | 9.6 | 13,468 | 柿安本店 | 4.1 | 5.2 | 13,577 |
| スペースリョーホールディングス | 19.6 | — | — | 四電工 | 1.7 | 5.2 | 8,361 | 伊藤ハム&ポークホールディングス | 76.7 | 95.7 | 64,310 |
| ダイセキ環境ソリューション | 3.1 | 3.9 | 4,555 | 中電工 | 17.1 | 21.3 | 45,219 | サッポロホールディングス | 40.5 | 50.4 | 112,644 |
| 第一カッター興業 | 4 | 5.1 | 7,063 | 関電工 | 60.4 | 75.2 | 65,424 | アサヒグループホールディングス | 259.3 | 347.2 | 1,656,144 |
| 安藤・間 | 102.9 | 99.1 | 86,514 | きんでん | 80.2 | 103.1 | 166,506 | キリンホールディングス | 503.3 | 542.4 | 1,020,796 |
| 東急建設 | 47 | 58.5 | 40,131 | 東京エネシス | 12.3 | 15.5 | 15,035 | 宝ホールディングス | 87.9 | 100.4 | 111,845 |
| コムシスホールディングス | 56.9 | 64.4 | 175,683 | トーエネック | 3.8 | 4.7 | 15,110 | オノンホールディングス | 34.2 | 43 | 14,534 |
| ビーアールホールディングス | 19 | 27.1 | 9,674 | 住友電設 | 10.5 | 11.5 | 25,587 | 養命酒製造 | 4 | 5.1 | 8,981 |
| 福融コンストラクショングループ | 10.1 | 12.6 | 25,263 | 日本電設工業 | 20.4 | 25.4 | 37,134 | コトヨシオチナ・フジ・バウホールディングス | 90.8 | 103.7 | 141,757 |
| 東建コーポレーション | 4.9 | 5.5 | 50,655 | エクシオグループ | 56.2 | 69.8 | 162,424 | サントリー食品インターナショナル | 79.5 | 98.7 | 443,163 |
| ソネック | 1.7 | 2.3 | 2,366 | 新日本空調 | 9.8 | 12.2 | 24,790 | ダイヤグループホールディングス | 6.7 | 7.7 | 37,345 |
| ヤマウラ | 7.2 | 10.3 | 10,186 | 九電工 | 26.1 | 35.6 | 109,470 | 伊藤園 | 36.1 | 45 | 279,900 |
| オリエンタル白石 | — | 67.8 | 16,339 | 三機工業 | 26.3 | 30.2 | 42,823 | キーコーヒー | 11.8 | 14.8 | 30,532 |
| 大成建設 | 115.4 | 133.2 | 508,158 | 日揮ホールディングス | 123.6 | 141.9 | 160,914 | ユニカフェ | 3.9 | 5 | 4,790 |
| 大林組 | 370.8 | 460.9 | 434,167 | 中外炉工業 | 4.1 | 4.7 | 7,562 | ジャパンフーズ | 1.5 | 1.7 | 2,050 |
| 清水建設 | 347.3 | 431.8 | 338,099 | ヤマト | 11.9 | 13.8 | 9,784 | 日清オイルグループ | 15.3 | 18.7 | 56,287 |
| 飛鳥建設 | 10.5 | 12.3 | 13,161 | 太平電業 | 8.2 | 10.4 | 28,797 | 不二製油グループ本社 | 29 | 32 | 74,560 |
| 長谷工コーポレーション | 121.3 | 137.3 | 200,183 | 高砂熱学工業 | 33.5 | 41.7 | 79,104 | かどや製油 | 1 | 1.1 | 4,411 |
| 松井建設 | 14.7 | 18.4 | 13,082 | 三晃金属工業 | 1.6 | 1.7 | 4,236 | Jーオイルミルズ | 5.6 | 14.2 | 24,026 |
| 鎌高組 | 1.2 | 1.7 | 6,834 | 朝日工業社 | 2.1 | 3.3 | 9,543 | キッコマン | 85.4 | 106.3 | 932,251 |
| 鹿島建設 | 271.6 | 337.9 | 465,964 | 明星工業 | 24.1 | 29.9 | 20,989 | 味の素 | 282.3 | 325.9 | 1,055,590 |
| 不動テトラ | 9.1 | 9.8 | 15,278 | ダイダイン | 18 | 22.6 | 63,777 | ブルドックソース | — | 6.4 | 12,524 |
| 大冢建設 | 4.9 | 5 | 6,680 | 日比谷総合設備 | 8.2 | 10.3 | 23,257 | キュービー | 66 | 77.6 | 186,007 |
| 鉄建建設 | 7.5 | 10.3 | 18,797 | フィル・カンパニー | 12.2 | 14.9 | 28,161 | ハウス食品グループ本社 | 44.4 | 55.3 | 161,531 |
| 西松建設 | 26.5 | 28 | 104,580 | テスホールディングス | 2.1 | 2.8 | 3,166 | カゴメ | 48.5 | 56 | 161,840 |
| 三井住友建設 | 89.4 | 103.8 | 44,426 | インフロエア・ホールディングス | — | 8.5 | 11,313 | 焼津水産化学工業 | 4.8 | 5.1 | 4,625 |
| 大豊建設 | 8.1 | 6.8 | 25,092 | OS JBホールディングス | — | 196.5 | 207,111 | アリアケジャパン | 10.9 | 13.5 | 77,625 |
| 前田建設工業 | 92.9 | — | — | 東洋エンジニアリング | 54.1 | — | — | ビエトロ | 1.2 | 1.2 | 2,152 |
| 佐田建設 | 6.7 | 10.2 | 4,773 | レイズネクスツト | 15.4 | 19.4 | 12,959 | エハラ食品工業 | 2.4 | 2.5 | 7,075 |
| ナカノフード建設 | 9.7 | 10.9 | 3,738 | 食料品 (3.4%) | 20 | 22.6 | 25,515 | やまみ | 1.1 | 1.7 | 3,010 |
| 奥村組 | 20.4 | 27.1 | 86,584 | ニッパン | 35 | 43.5 | 72,949 | ニチレイ | 56.5 | 67.3 | 176,056 |
| 東鉄工業 | 16 | 21.5 | 52,481 | 日清製粉グループ本社 | 134.1 | 167 | 273,212 | 東洋水産 | 61 | 71 | 342,220 |
| イチケン | 2.7 | 3.5 | 6,594 | 日東富士製粉 | 0.6 | 1.6 | 6,392 | イトファントホールディングス | 4.2 | 5.7 | 13,110 |
| 富士ビー・エス | 5 | 5.9 | 2,891 | 昭和産業 | 10.1 | 14.3 | 38,181 | 大冷 | 1.5 | 2 | 3,816 |
| 淺沼組 | 4.4 | 5.2 | 28,132 | 昭成製粉 | 10.8 | 13.7 | 8,863 | ソシム・フード・ホールディングス | 6.7 | 7.9 | 4,005 |
| 戸田建設 | 154.1 | 191.4 | 142,401 | 中部飼料 | 14.6 | 16.7 | 16,983 | 日清食品ホールディングス | 46.5 | 57.9 | 518,784 |
| 熊谷組 | 17.1 | 23.5 | 69,842 | フィード・ワン | 16.2 | 20.2 | 14,503 | 永谷園ホールディングス | 6 | 6.9 | 13,461 |
| 北野建設 | 1.9 | 2.9 | 6,194 | 東洋精糖 | 1.7 | 1.8 | 1,845 | 一正蒲鉾 | 4 | 6.2 | 4,811 |
| 樫木組 | 1.6 | 4.1 | 6,076 | 日本甜菜製糖 | 6.4 | 8.1 | 13,737 | フジッコ | 13 | 13.8 | 26,896 |
| | | | | | | | | ロック・フィールド | 12.8 | 16 | 24,704 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---------|---------|-------|-----------|-------|-----|-----|-------|-----------|-----|------|--------|-----------|-----|-----|---------|------|------|-------|---------|-------|------|------|---------|----------------|-----|-----|--------|------|-------|---------|---------|----|------|------|---------|-----|-----|-----|--------|------|-----|-----|--------|-------|----|------|-------|-------|-----|-----|-------|------|------|------|---------|-----------|-----|----|-------|--------------|-----|-----|--------|------|-----|---|-------|----|-------|-------|-----------|---------|---|----|--------|-----|-----|------|---------|--------|-----|-----|--------|-------|------|----|--------|------|-----|-----|--------|--------|---|-----|-------|------|---|-----|-------|-----|-----|------|--------|------|-----|---|-------|-------|-----|-----|-------|------|------|------|--------|------|-----|---|-------|--------|------|------|--------|----------|-----|-----|-------|--------|-----|-----|--------|----------|-----|------|-------|-------------|------|------|------|--------|-----|-------|-------|---------|-------|------|------|--------|-----|-----|-----|--------|------|------|----|--------|----------------|------|-------|---------|-----|------|------|--------|---------|----|------|--------|--------|-------|-------|---------|------|------|------|--------|------|------|------|--------|------|-----|----|-------|-------------|-----|-----|--------|-------|------|------|--------|------|------|----|--------|------|------|------|--------|--------|------|------|--------|--------|-----|------|-------|------|-----|-----|-------|-----|------|------|---------|------|----|------|-------|------|------|------|--------|--------|-------|-------|-----------|------------|-----|------|--------|--------|------|------|-------|-----------|-----|-----|-------|------|------|------|---------|-------------|-----|-----|-------|-------|-----|----|--------|--------|------|------|--------|------|----|------|--------|-----------|------|------|--------|-----------------|-----|------|--------|----|-----|-------|---------|----------|-------|-------|---------|------------|------|------|--------|----|-------|---------|---------|--------------|------|-------|---------|----------------|-------|-------|-----------|-----------|-----|---|---|--------|-----|-----|--------|-----|-----|-------|-----------|------|-----|-----|-------|---------|-----|-----|-------|------|-------|-------|---------|--------|-----|-----|-------|-----------|------|------|--------|--------|-----|------|--------|------|-----|-----|-------|--------|------|------|--------|------|------|------|--------|------|-----|-----|-------|-------|-----|-----|-------|------|------|------|--------|-----|-----|------|-------|--------|------|----|--------|-------|----|------|---------|------|-----|-----|-------|------|-----|-----|-------|------|------|------|---------|------|------|------|--------|----------|-----|-----|--------|----|---|-----|--------|----|---|-----|-------|---------|-----|-----|--------|------|-----|-----|-------|------|-----|-----|-------|------|----|------|---------|------------------|------|------|---------|--------|------|------|--------|--------|-----|----|--------|-------------|----|------|--------|--------------|------|------|--------|-----|----|------|---------|--------------|---|-----|-------|---------|------|------|--------|--------|-----|-------|---------|-------|-----|---|-------|----------------|-----|-----|-----|------|-----|-------|---------|------|-----|-----|--------|---------------|------|------|--------|-------|-------|-------|---------|-----------|-----|---|-------|--------------|-----|-----|-------|--------|------|------|---------|-----|------|------|--------|------|------|------|--------|----------|------|------|--------|-------|------|------|--------|------|---|-----|-------|----------------|-------|-------|---------|-------|-----|-----|-------|------|-----|-----|-------|---------|------|------|--------|------|------|------|---------|---------------|------|------|--------|------|-------|-------|---------|--------|-----|------|--------|-------------|---|-----|-------|----------|------|------|---------|-----|-----|----|--------|-------|------|------|-------|--------|-------|-------|---------|---------|-----|-----|--------|---------|------|----|---------|-------|-------|-------|---------|--------|----|------|--------|------|------|------|--------|-------|------|------|---------|-----|------|------|--------|-----|-----|-----|-------|------|------|------|---------|--------|-----|-----|-------|-------------|------|------|-------|------|------|------|--------|----------|-----|-----|-------|--------------|------------|-------|-------|---------|----------|------|------|--------|---------|----|------|---------|------------|------|----|--------|------|-----|-----|--------|-------|-----|------|--------|------|------|------|-------|------|-----|-----|--------|--------|------|------|--------|------------|------|------|--------|---------|------|------|--------|--------|-----|-----|--------|---------|-----|-----|-------|------|-----|-----|--------|----------|------|------|--------|-------|-----|-----|-------|--------|------|------|-------|------|------|------|--------|------|----|------|---------|--------|-----|-----|--------|------|-----|-----|--------|------|---|---|-------|-----------|-----|-----|-------|-------|------|------|--------|-----|-------|-------|---------|-------|-----|-----|-------|------|------|----|---------|------|-----|---|--------|---------|-----|-----|-------|-----|----|------|--------|-------|-----|----|--------|-----------|------|------|--------|------|------|------|-------|-----------|--------------|------|------|--------|------|-----|-----|-------|-----|------|------|-------|-----|-------|-------|---------|------------|-----|-----|--------|------|------|------|--------|-----|-------|-------|-----------|----|-----|-----|--------|--------|-----|-----|--------|-----|-----|-----|-------|---------------|------|------|--------|-----------------|---|-----|-------|------|-----|------|--------|-------|---|-----|--------|--------|-----|------|--------|------|------|----|--------|
| | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 日本たばこ産業 | 636.5 | 791.4 | 1,851,876 | 共和レザー | 6.8 | 9.2 | 6,127 | トリケミカル研究所 | 9.8 | 14.9 | 44,342 | ケンコーマヨネーズ | 7.3 | 8.5 | 11,517 | 昭和電工 | 87.9 | 124.8 | 297,398 | ADEKA | 53.3 | 66.3 | 167,473 | くわばや日洋ホールディングス | 7.8 | 9.6 | 18,240 | 住友化学 | 911.2 | 1,057.7 | 619,812 | 日油 | 43.6 | 49.2 | 252,888 | なとり | 6.9 | 8.1 | 16,200 | 住友精化 | 5.7 | 6.4 | 21,184 | 新日本理化 | 19 | 23.6 | 5,923 | イフジ産業 | 2.3 | 2.5 | 2,350 | 日産化学 | 63.9 | 78.4 | 516,656 | ハリマ化成グループ | 8.7 | 11 | 8,987 | ビッルスコーポレーション | 2.8 | 7.2 | 11,419 | ラサ工業 | 3.8 | 5 | 8,095 | 花王 | 283.1 | 325.3 | 1,709,126 | ファーマフーズ | - | 14 | 22,848 | クレハ | 9.9 | 11.5 | 103,960 | 第一工業製薬 | 3.9 | 5.4 | 15,660 | ユーグレナ | 51.2 | 75 | 54,750 | 多木化学 | 4.5 | 5.6 | 29,400 | 石原ケミカル | 3 | 7.5 | 9,915 | 紀文食品 | - | 8.6 | 8,187 | テイカ | 8.4 | 10.8 | 14,850 | 日華化学 | 4.3 | 5 | 4,015 | ミヨシ油脂 | 4.4 | 6.2 | 6,869 | 石原産業 | 20.6 | 23.8 | 27,631 | ニイタカ | 2.4 | 3 | 6,849 | 理研ビタミン | 11.2 | 15.4 | 26,257 | 片倉コープアグリ | 2.4 | 2.5 | 2,875 | 三洋化成工業 | 6.9 | 8.6 | 44,118 | 有機合成薬品工業 | 9.2 | 10.3 | 2,811 | 繊維製品 (0.5%) | 片倉工業 | 15.6 | 13.8 | 33,992 | 東ソー | 178.9 | 207.7 | 396,083 | 大日本塗料 | 13.2 | 17.8 | 14,453 | 片倉ゼ | 8.5 | 9.6 | 37,008 | トクヤマ | 34.3 | 46 | 90,666 | 日本ペイントホールディングス | 95.5 | 541.2 | 459,478 | 東洋紡 | 45.8 | 56.9 | 74,254 | セントラル硝子 | 22 | 23.5 | 49,514 | 関西ペイント | 130.1 | 149.3 | 342,792 | ユニチカ | 33.8 | 39.2 | 11,956 | 東亜合成 | 70.7 | 80.1 | 90,352 | 神東塗料 | 9.3 | 10 | 1,540 | 富士紡ホールディングス | 5.6 | 6.4 | 24,288 | 大阪ソーダ | 11.9 | 13.5 | 40,567 | 中国塗料 | 27.9 | 34 | 30,668 | 倉敷紡績 | 10.7 | 12.3 | 23,579 | 関東電化工業 | 27.3 | 31.6 | 34,033 | 日本特殊塗料 | 8.7 | 10.9 | 9,156 | シキボウ | 6.6 | 7.9 | 7,244 | デンカ | 42.2 | 52.4 | 190,474 | 藤倉化成 | 16 | 18.3 | 8,820 | 日本毛織 | 38.1 | 43.4 | 38,929 | 信越化学工業 | 214.1 | 247.4 | 4,693,178 | 太陽ホールディングス | 8.5 | 21.2 | 68,158 | ダイトウボウ | 19.3 | 23.8 | 2,118 | 日本カーバイド工業 | 4.2 | 5.2 | 7,082 | DI C | 48.9 | 60.9 | 182,517 | トア紡コーポレーション | 4.1 | 4.3 | 1,754 | 堺化学工業 | 8.1 | 10 | 20,310 | サカタククス | 25.3 | 28.7 | 28,183 | 帝国繊維 | 13 | 16.3 | 32,811 | 第一稀元素化学工業 | 11.7 | 13.4 | 15,276 | 東キョウS Cホールディングス | 9.5 | 30.5 | 58,712 | 帯人 | 109 | 135.4 | 187,393 | エア・ウォーター | 118.1 | 136.2 | 238,350 | T & K TOKA | 24.1 | 11.7 | 10,120 | 東レ | 838.4 | 1,042.5 | 699,309 | 日本薬研ホールディングス | 95.3 | 138.5 | 316,195 | 富士フィルムホールディングス | 207.8 | 258.5 | 1,967,702 | サカイオーベックス | 3.1 | - | - | 日本化学工業 | 3.2 | 4.6 | 12,134 | 資生堂 | 235 | 273.9 | 1,642,578 | 住江織物 | 2.1 | 3.4 | 6,504 | 東邦アセチレン | 1.9 | 2.6 | 3,302 | ライオン | 153.7 | 177.6 | 268,708 | 日本フェルト | 5.5 | 5.9 | 2,643 | 日本パーカライジフ | 58.4 | 72.6 | 74,632 | 高砂香料工業 | 7.4 | 10.3 | 28,953 | イチカワ | 1.3 | 1.4 | 1,937 | 高圧ガス工業 | 18.5 | 23.1 | 17,278 | マンダム | 24.7 | 30.9 | 39,644 | 日東製網 | 1.3 | 1.7 | 2,459 | チタン工業 | 1.5 | 1.7 | 2,774 | ミルボン | 15.8 | 18.3 | 99,735 | アツギ | 9.3 | 11.5 | 6,704 | 四国化成工業 | 15.5 | 19 | 26,600 | ファンゲル | 43 | 59.6 | 185,356 | ダイニッ | 3.6 | 3.8 | 2,728 | 戸田工業 | 2.4 | 3.2 | 9,968 | コーセー | 22.2 | 27.7 | 304,146 | セーレン | 28.5 | 29.6 | 61,952 | ステラ ケミファ | 6.3 | 7.2 | 17,978 | コタ | 7 | 9.4 | 14,720 | ソト | 4 | 6.2 | 5,139 | 保土独化学工業 | 3.4 | 4.6 | 24,012 | シーボン | 1.3 | 1.4 | 2,525 | 東海染工 | 1.3 | 1.4 | 1,605 | 日本触媒 | 21 | 24.2 | 144,716 | ポーラ・オルビスホールディングス | 50.5 | 62.8 | 108,895 | 小松マテール | 19.1 | 23.6 | 29,877 | 大日精化工業 | 9.6 | 12 | 27,108 | ノビアホールディングス | 10 | 12.6 | 63,252 | ワコールホールディングス | 28.9 | 35.9 | 73,738 | カネカ | 30 | 37.3 | 145,843 | アジパルホールディングス | 3 | 3.5 | 3,846 | ホギメディカル | 15.6 | 19.5 | 61,425 | 三菱瓦斯化学 | 116 | 133.8 | 285,529 | 新日本製薬 | 2.4 | 4 | 5,300 | クラウディアホールディングス | 2.4 | 2.5 | 590 | 三井化学 | 100 | 130.8 | 397,632 | エステー | 7.7 | 9.5 | 14,601 | T S Jホールディングス | 34.7 | 47.9 | 15,807 | J S R | 116.2 | 134.4 | 463,680 | アグロ カネシヨウ | 4.5 | 5 | 6,515 | マツカオコーポレーション | 3.7 | 4.6 | 5,409 | 東京応化工業 | 19.9 | 23.3 | 147,955 | コニシ | 19.5 | 24.1 | 38,222 | ワールド | 15.1 | 18.9 | 22,264 | 大阪有機化学工業 | 10.7 | 12.2 | 36,429 | 長谷川香料 | 20.5 | 25.5 | 61,786 | 三陽商会 | 6 | 6.9 | 5,954 | 三菱ケミカルホールディングス | 774.1 | 962.6 | 807,910 | 星光PMC | 6.9 | 8.6 | 5,633 | ナイガイ | 3.8 | 4.1 | 1,160 | K Hネオケム | 19.1 | 23.7 | 72,640 | 小林製薬 | 33.1 | 41.3 | 391,111 | オンワードホールディングス | 69.3 | 86.3 | 25,631 | ダイセル | 155.5 | 207.2 | 181,507 | 荒川化学工業 | 9.9 | 12.3 | 13,849 | ルックホールディングス | 4 | 4.6 | 6,076 | 住友ベークライト | 18.2 | 22.8 | 121,752 | メック | 8.1 | 11 | 33,880 | キムラタン | 68.3 | 79.9 | 1,518 | 積水化学工業 | 244.9 | 301.3 | 583,618 | 日本高純度化学 | 3.3 | 4.1 | 10,569 | ゴールドウイン | 19.1 | 26 | 158,340 | 日本ゼオン | 104.5 | 129.8 | 175,489 | タカラバイオ | 31 | 38.5 | 88,280 | デサント | 19.8 | 28.1 | 97,085 | アイカ工業 | 32.2 | 40.1 | 127,317 | JCU | 13.3 | 16.6 | 75,613 | キング | 4.6 | 6.7 | 3,463 | 宇部興産 | 58.4 | 67.8 | 147,058 | 新田セラチン | 7.7 | 9.3 | 6,045 | ヤマインターナショナル | 10.6 | 13.3 | 3,790 | 積水樹脂 | 19.1 | 21.9 | 43,843 | OA Tアグリオ | 2.3 | 3.2 | 6,425 | パルプ・紙 (0.2%) | 王子ホールディングス | 521.3 | 602.3 | 363,789 | タキロンシーアイ | 25.2 | 31.4 | 17,552 | デクセラアルズ | 33 | 38.2 | 118,420 | 王子ホールディングス | 51.1 | 69 | 81,213 | 旭有機材 | 6.6 | 8.1 | 17,528 | アース製薬 | 8.9 | 12.1 | 71,027 | 三菱製紙 | 17.1 | 21.3 | 6,794 | ニチバン | 6.2 | 8.6 | 14,852 | 北興化学工業 | 10.9 | 13.8 | 10,874 | 北越コーポレーション | 82.9 | 94.7 | 74,244 | リケンテクノス | 28.2 | 35.4 | 16,142 | 大成ラミック | 3.7 | 4.6 | 12,962 | 中越パルプ工業 | 4.7 | 5.6 | 5,538 | 大倉工業 | 5.5 | 7.5 | 15,037 | クミアイ化学工業 | 48.8 | 54.8 | 44,223 | 巴川製紙所 | 3.7 | 4.6 | 3,762 | 積水化成工業 | 15.6 | 19.6 | 8,800 | 日本農業 | 21.2 | 26.4 | 14,018 | 大王製紙 | 56 | 69.6 | 133,284 | 群栄化学工業 | 2.2 | 3.5 | 12,075 | アキレス | 8.2 | 9.4 | 11,637 | 阿波製紙 | 3 | 4 | 1,324 | タイガースポリマー | 6.7 | 8.5 | 3,714 | 有沢製作所 | 16.5 | 21.5 | 21,414 | レンゴ | 119.4 | 136.3 | 117,763 | ミライアル | 3.7 | 4.7 | 6,974 | 日東電工 | 75.7 | 89 | 775,190 | トーモク | 7.2 | 9 | 15,849 | ダイキアクシス | 4.3 | 5.6 | 3,925 | レック | 14 | 19.1 | 18,106 | ザ・パック | 8.7 | 11 | 29,931 | ダイキョーニシカワ | 24.5 | 30.7 | 18,696 | 三光合成 | 12.4 | 15.5 | 5,766 | 化学 (6.6%) | 北の達人コーポレーション | 41.4 | 51.4 | 11,205 | 竹本容器 | 4.2 | 5.3 | 4,202 | きもと | 18.9 | 22.9 | 4,854 | クラレ | 182.3 | 210.4 | 217,764 | 森六ホールディングス | 6.3 | 7.9 | 15,634 | 藤森工業 | 10.6 | 13.2 | 54,978 | 旭化成 | 767.5 | 954.1 | 1,064,775 | 恵和 | 1.7 | 3.6 | 18,504 | 前澤化成工業 | 7.8 | 9.5 | 11,789 | 来工業 | 4.3 | 5.5 | 8,475 | カーリットホールディングス | 11.5 | 14.3 | 10,552 | ウェーブリンクホールディングス | 4 | 5.6 | 3,931 | 日本精化 | 8.4 | 11.6 | 24,070 | J S P | 7 | 8.7 | 13,685 | 扶桑化学工業 | 9.1 | 12.9 | 61,081 | エフピコ | 21.8 | 27 | 91,125 |

| 銘柄 | 前期中期末 | | | 銘柄 | 前期中期末 | | | 銘柄 | 前期中期末 | | |
|---|---------------|---------------|---------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------|---------------------------------------|------------------|--------------------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| オイシックス・ラ・大地 ネットワーク | 11.5 19.9 | 20.8 29.3 | 53,185 85,907 | ピーシーデポコーポレーション 壹番屋 | 13.6 8.2 | 16.9 10.3 | 4,867 48,049 | パロールホールディングス 藤久 | 23.8 2.7 | 32.1 6.4 | 72,225 - |
| ジョイフル本田 鳥旗ホールディングス | 34.2 3.3 | 42.4 5.3 | 64,660 9,714 | トップカルチャー PLANT | 4.8 3.1 | 5.5 3.6 | 1,545 2,390 | ベルク 大庄 | 5.8 6.3 | - 8 | 34,496 8,256 |
| ホットランド すかいらーくホールディングス | 8.6 130.4 | 11 186.9 | 14,069 280,536 | SFGホールディングス 兼王堂ホールディングス | 23.2 5.1 | 28.9 7.3 | 194,786 17,571 | ファーストリテイリング サンドラッグ | 15.6 43.8 | 19.4 54.5 | 1,242,570 162,628 |
| ヨシダホールディングス 綿半ホールディングス | 5.7 8.8 | 7.2 11 | 10,188 14,289 | ヴィア・ホールディングス スクロール | 14.2 16.6 | 19.3 22.3 | 2,952 20,159 | サクソールホールディングス ヤマザワ | 10 2.6 | 13.8 2.9 | 7,120 4,738 |
| ヨシダホールディングス ヨシダホールディングス | 2.3 33.9 | 2.9 42.3 | 6,252 45,684 | ヨンドシーホールディングス 木曾路 | 10.8 15.3 | 13.3 19.3 | 23,368 42,884 | やまや ペルーナ | 2.5 25 | 3 31.1 | 7,482 23,418 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン BEENOS | 6 5.4 | 7.6 7.5 | 8,109 13,702 | SRSホールディングス 千趣会 | 14.6 20.9 | 20 26.4 | 16,260 9,794 | 銀行業 (5.6%) 島根銀行 | - 4.3 | - 4.5 | - 2,533 |
| あさひ 8.1 | 8.6 | 12 | 17,112 | タカキュー リテールパートナーズ | 9.9 14.1 | 12.9 17.6 | 1,380 22,792 | じもとホールディングス めがきフィナンシャルグループ | 8 604.6 | 10.8 751.7 | 7,430 208,220 |
| 日本語 コスモス薬品 | 7.6 11.8 | 12 14.7 | 17,112 207,270 | ケーヨー 上新電機 | 21.6 13.7 | 26.9 16.6 | 22,918 35,275 | 東京きんぽフィナンシャルグループ 九州フィナンシャルグループ | 14.6 238 | 18.3 296.3 | 30,707 135,705 |
| トーエール オンリー | 5.7 2.6 | 6.8 - | 5,861 - | 日本瓦斯 ロイヤルホールディングス | 19.2 20.3 | 70.4 24.9 | 117,004 46,961 | ゆうちょ銀行 富士第一銀行 | 330.8 28.6 | 342.8 35.7 | 402,447 11,424 |
| セブ&アイ・ホールディングス クワイ・レストラック・ホールディングス | 455.6 62.5 | 566.6 77.1 | 3,282,880 58,596 | 東天虹 いなげや | 0.6 13 | 0.6 18 | 562 25,416 | コンコムフィナンシャルグループ 西日本フィナンシャルホールディングス | 709.7 77.6 | 828 94.6 | 416,484 80,788 |
| ツルハホールディングス サマルクホールディングス | 25.4 9.1 | 31.6 11.5 | 288,192 18,285 | チヨダ ライブコーポレーション | 12.2 8.8 | 14 13.5 | 10,668 41,242 | 関西みらいフィナンシャルグループ 三十三フィナンシャルグループ | 54.8 10.2 | - 13.7 | - 21,344 |
| フェリシモ トリドルホールディングス | 2.6 28.8 | 3.4 35.9 | 4,372 83,682 | リコバーハット Mr Max HD | 14.4 15.9 | 17.9 18.2 | 40,650 11,156 | 湘北越後フィナンシャルグループ ひろさんホールディングス | 19 172.2 | 19 214.3 | 65,584 150,652 |
| TOKYO BASE ウィルプラスホールディングス | 10.4 1.9 | 13.2 2.5 | 5,913 2,425 | テンアライド AOKIホールディングス | 9.5 23.1 | 26.2 28 | 4,758 16,856 | おきなわフィナンシャルグループ 十六フィナンシャルグループ | - - | 13.1 19.5 | 30,418 47,541 |
| JMホールディングス サツドラホールディングス | 8.8 1.5 | 9.8 7.4 | 16,787 4,684 | オークワ コムリ | 18.2 18 | 22.8 22.4 | 21,500 61,219 | 北都フィナンシャルホールディングス 新生銀行 | - 95.1 | 13.4 94.6 | 42,880 221,458 |
| アレンザホールディングス 勢多田中ホールディングス | 6.7 3 | 11.2 3.9 | 12,208 8,037 | 青山商事 Riottokジャパハリミテッド | 18 8.1 | 22.4 25.7 | 61,219 20,582 | あおぞら銀行 三井住友フィナンシャルグループ | 94.6 7,977.2 | 221,458 9,093.4 | 81 6,731,812 |
| クミノアオキホールディングス 力の源ホールディングス | 11.6 5.4 | 14.4 7.7 | 98,928 4,319 | はせがわ 高島屋 | 5.2 84.7 | 8 105.3 | 2,408 117,725 | りそなホールディングス 三井住友トラスト・ホールディングス | 1,267.6 220.5 | 1,659.4 274.1 | 901,386 1,162,184 |
| FOOD & LIFE COMPANIES メデイカシステムネットワーク | 63.9 10.2 | 84.7 14.2 | 300,685 7,668 | 近鉄百貨店 エイチ・オー レテイリング | 25.4 55 | 29.1 68.5 | 91 56,992 | 三井住友フィナンシャルグループ 千葉銀行 | 807.1 388.8 | 1,003.6 483.8 | 4,351,609 381,718 |
| 一家ホールディングス 藤久ホールディングス | - 6.1 | 2.7 6.9 | 1,422 3,519 | エックス 丸井グループ | 14.2 98.5 | 5.5 114.3 | 14,756 259,918 | 群馬銀行 群馬銀行 | 239.8 239.8 | 277.9 277.9 | 182,721 121,271 |
| はるやまホールディングス ソジマ | - 20.7 | 3.5 23.4 | 2,688 58,125 | 丸井グループ アグリアル レテイリング | 9.7 6.3 | 11.4 6.9 | 37,848 2,732 | 武蔵野銀行 千葉興業銀行 | 19.3 29.8 | 21.6 34.5 | 41,752 10,005 |
| カッパ・クワイエット ライトオン | 16.4 8.8 | 20.4 11.2 | 27,478 8,064 | 井筒屋 イオン | 448.1 23.6 | 557.2 26.3 | 1,481,594 86,395 | 筑波銀行 十七七銀行 | 48.4 36.6 | 56.9 45.5 | 11,778 73,164 |
| ジーンズメイト 良品計画 | 3.6 154.5 | - 166.7 | - 293,892 | イズミ 平和堂 | 21.5 14.1 | 26.8 17.6 | 52,474 32,929 | 青森銀行 秋田銀行 | 9 7.1 | 11.3 9.4 | 22,249 17,343 |
| 三城ホールディングス アドヴァングループ | 14.9 12 | 15.7 14.9 | 3,940 14,125 | フジ ヤオコー | 13.2 14 | 16.5 19.7 | 109,560 18,064 | 山形銀行 岩手銀行 | 13 7.6 | 16.3 9.4 | 16,348 18,593 |
| アルピス コナカ | 3.7 14.1 | 4.8 16.9 | 10,502 5,965 | ゼビオホールディングス ケーズホールディングス | 103.7 6 | 133.4 7.9 | 165,282 5,609 | 東邦銀行 東北銀行 | 104.1 5.9 | 121.4 7.5 | 126,960 8,047 |
| ハウス オブ ローゼ G-7ホールディングス | 1.2 6.9 | 1.2 16.2 | 2,026 24,526 | Olympicグループ 日産東京販売ホールディングス | 6 14.3 | 7.9 22.8 | 5,609 5,198 | みちのく銀行 ふくおかフィナンシャルグループ | 7.5 105.1 | 9.5 122 | 8,540 289,018 |
| G-7ホールディングス イオン北海道 | 6.9 15.6 | 26.2 15.7 | 24,526 29,400 | シルバライフ 一家ダイニングプロジェクト | 1.6 1.1 | 3 - | 3,264 - | 静岡銀行 十六銀行 | 283.9 14.6 | 353.2 - | 323,531 - |
| ゴジマ ヒマラヤ | 19.9 4.3 | 24.8 5.1 | 13,392 5,232 | Genky DrugStores ナルマ・インターナショナル | 5.1 2.3 | 6.4 3.4 | 22,848 3,910 | スルガ銀行 八十二銀行 | 101.6 262.3 | 127 326 | 63,627 144,418 |
| コーナン商事 エコス | 16.6 4.3 | 20.6 5.4 | 72,821 11,334 | ゾクゾクグループ ギフト | 6.8 1.1 | 8.8 2.4 | 9,160 5,904 | 山梨中央銀行 大垣共立銀行 | 13.6 23 | 16 28.8 | 15,472 60,307 |
| ワタミ マルシェ | 15.3 3 | 17.6 4 | 16,227 1,760 | アインホールディングス 元気寿司 | 16.9 3.2 | 19.4 4.1 | 115,818 10,455 | 福井銀行 北國銀行 | 10 10.9 | 12.5 10.9 | 18,587 - |
| パルティフィフインターナショナルホールディングス 西松屋チェーン | 232.8 25.5 | 289.5 31.7 | 480,859 47,264 | ヤマダホールディングス アークランドサカモト | 390.2 18.2 | 528.8 22.8 | 210,462 34,884 | 清水銀行 富士銀行 | 4.9 1.9 | 6.3 2.2 | 10,508 4,818 |
| ゼンショーホールディングス 幸楽苑ホールディングス | 62.5 7.3 | 70.8 9.2 | 195,903 12,493 | ニトリホールディングス ブルメク株屋 | 46.3 8.4 | 57.6 12 | 936,000 12,144 | 滋賀銀行 南都銀行 | 23.3 17 | 27.3 22.8 | 62,844 46,603 |
| ハウスレイ サイゼリヤ | 2 17.2 | 6.3 21.5 | 3,024 59,340 | 愛眼 ケーユーホールディングス | 7.6 6 | 8.1 7.9 | 1,417 8,121 | 百五銀行 京都銀行 | 105.2 41.7 | 140 51.9 | 51,380 295,311 |
| VTホールディングス 魚力 | 43.9 3.5 | 54.6 3.9 | 24,897 7,979 | 吉野家ホールディングス 松屋フーズホールディングス | 38.2 5.6 | 50.6 7 | 121,035 25,375 | 紀伊銀行 ほくほくフィナンシャルグループ | 41.3 77.5 | 49.2 90.5 | 74,390 87,061 |
| ポプラ フジ・コーポレーション | 3.3 3.1 | 4.6 7.9 | 648 9,345 | サガミホールディングス 関西フードマーケット | 15.7 8.8 | 22.3 11 | 24,061 11,506 | 山陰合同銀行 中国銀行 | 73.6 100.4 | 86.3 116 | 58,597 110,316 |
| ユニテッドアローズ ハイデイ日高 | 13.2 16.8 | 15.1 20.9 | 27,240 35,927 | 王将フードサービス アレナス | 7.7 13.2 | 9.5 16.4 | 56,525 33,029 | 鳥取銀行 伊予銀行 | 4 154.6 | 4.2 192.3 | 5,191 120,956 |
| YU-MA CREATION HOLDINGS コロワイド | 6.4 38.6 | 8.6 59.5 | 1,720 100,436 | ミニストップ アークス | 8.7 22.1 | 11.2 27.7 | 16,497 60,940 | 百十四銀行 四国銀行 | 12.2 16.7 | 15.4 22.3 | 27,273 18,419 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|--------------------|---------|-------|-------|-----------|------------------------|---------|-------|-------|---------|-----------|----------------------------|---------|-----------|----------|-------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 | 額 | | 株 数 | 株 数 | 評 価 | 額 | | 株 数 | 株 数 | 評 価 | 額 | |
| | | 千株 | | 千円 | | | 千株 | | 千円 | | | 千株 | | 千円 | |
| キャリアデザインセンター | | 2.5 | | 4,194 | リソルホールディングス | | 0.9 | | 1.6 | 7,000 | プロレド・パートナーズ | | 1.6 | 3 | 2,436 |
| ベネフィット・ワン | | 41.2 | | 153,548 | テクノプロ・ホールディングス | | 22.5 | | 84.1 | 295,191 | and factory | | 1 | 3.3 | 1,214 |
| エムスリー | | 199.3 | | 1,042,667 | アトラグループ | | 2.5 | | 2.6 | 676 | テノ・ホールディングス | | 0.9 | 2 | 1,206 |
| ツカガ・グローバルホールディング | | 9.5 | | 2,380 | インターワークス | | 3.5 | | 4.5 | 1,687 | 7フンティア・マネジメント | | 2 | 3.6 | 2,350 |
| プラス | | 1.5 | | 1,392 | アイ・アールジャパンホールディングス | | 4.6 | | 6.6 | 32,505 | ピアラ | | 0.6 | 2.3 | 1,258 |
| アウトソーシング | | 64.7 | | 108,514 | Keep Per 技研 | | 7.3 | | 9 | 16,929 | コプロ・ホールディングス | | 0.6 | 2.9 | 3,204 |
| ウエルネット | | 11.5 | | 6,263 | ファーストロジック | | 2.2 | | 2.9 | 2,166 | ギークス | | 1.5 | 2.6 | 3,803 |
| ワールドホールディングス | | 3.9 | | 13,484 | 三機サービズ | | 2.3 | | 3 | 2,907 | カーブホールディングス | | 31 | 38.7 | 27,244 |
| ディー・エヌ・エー | | 47.8 | | 95,783 | Gunosy | | 6.8 | | 8.8 | 6,274 | フォーラムエンジアリング | | 5.8 | 9.9 | 8,613 |
| 博報堂DYホールディングス | | 157.2 | | 350,124 | デザインワン・ジャパン | | 3.5 | | 3.6 | 673 | FAST FITNESS JAPAN | | - | 2 | 4,224 |
| ぐるなび | | 19.6 | | 8,724 | イー・ガーディアン | | 4.9 | | 5.6 | 14,795 | ダイレクトマーケティングミックス | | 4.4 | 15.2 | 21,964 |
| タカミヤ | | 14.1 | | 7,128 | リブセンス | | 6.2 | | 8.7 | 1,400 | ポピュラスホールディングス | | 2.3 | 3.4 | 8,493 |
| ジャロバベストレスキューシステム | | 8.9 | | 8,610 | ジャパンマテリアル | | 34.8 | | 43.2 | 71,625 | LITALICO | | - | 11.5 | 35,190 |
| ファンコミュニケーションズ | | 31.3 | | 13,267 | ペクトル | | 14 | | 19.7 | 20,448 | アドバレッジシステムマネジメント | | 5.7 | 7.2 | 5,184 |
| ライク | | 3 | | 6,805 | ウチヤマホールディングス | | 5.8 | | 7.4 | 2,412 | リログループ | | 61.7 | 76.9 | 158,337 |
| ビジネス・ブレークスルー | | 5.1 | | 2,304 | チャーム・ケア・コーポレーション | | 8.4 | | 10.6 | 12,084 | 東祥 | | 7.1 | 10.6 | 16,472 |
| エスグループ | | 28.9 | | 39,342 | キャリアリンク | | 3.6 | | 5.1 | 8,573 | TR Eホールディングス | | - | 19.4 | 28,731 |
| WDBホールディングス | | 5.2 | | 18,513 | I B J | | 9.1 | | 11.5 | 8,728 | 人・夢・技術グループ | | - | 5.6 | 10,102 |
| 手間いらず | | 1.1 | | 8,496 | アサンテ | | 4.1 | | 6.4 | 10,419 | エイチ・アイ・エス | | 16.4 | 31.3 | 64,165 |
| ティア | | 7.2 | | 3,801 | N・フィールド | | 7.6 | | - | - | ラックランド | | 3.2 | 4.1 | 11,836 |
| CDG | | 1.3 | | 1,912 | バリュウHR | | 4.5 | | 5.6 | 13,904 | 共立メンテナンス | | 18.7 | 25 | 103,875 |
| アドウェイズ | | 13.7 | | 15,863 | M&Aキャピタルパートナーズ | | 9.3 | | 11.6 | 55,042 | イチネンホールディングス | | 11.8 | 14.6 | 18,804 |
| バリユー・コマース | | 7.5 | | 39,032 | ライオンシステムホールディングス | | 4.3 | | 5.4 | 8,262 | 建設技術研究所 | | 7.3 | 8.5 | 20,102 |
| インフォマート | | 114.3 | | 97,880 | ER Iホールディングス | | 2.8 | | 4 | 4,660 | スペースス | | 7.7 | 10.4 | 9,505 |
| J Pホールディングス | | 32.6 | | 8,246 | アビスト | | 1.8 | | 2.2 | 6,435 | 長 大 | | 4.5 | - | - |
| Eコナックホールディングス | | 20.7 | | 2,288 | ジグマシステムホールディングス | | 6.2 | | 8.6 | 19,049 | 燦ホールディングス | | 4.7 | 6.3 | 9,714 |
| E P Sホールディングス | | 15.3 | | - | ウィルグループ | | 8.2 | | 10.4 | 13,176 | スバル興業 | | 0.7 | 0.7 | 5,537 |
| C Lホールディングス | | 2.7 | | 3,594 | エスコロー・エージェンツ・ジャパン | | 16.6 | | 18.9 | 3,553 | 東京テアトル | | 4.6 | 5.4 | 6,615 |
| プラステック・インターナショナル | | 42.2 | | 37,832 | メドピア | | 5.3 | | 10.9 | 30,498 | タナベ経営 | | 2.2 | 4.8 | 3,028 |
| アマユーズ | | 6.2 | | 16,216 | レアジョブ | | 1.6 | | 2.8 | 2,282 | ナガワ | | 3.6 | 4.6 | 43,608 |
| ドリームインキュベータ | | 3.5 | | 8,088 | リクルートホールディングス | | 809.3 | | 1,083.7 | 6,140,244 | よみうりランド | | 0.6 | - | - |
| クイック | | 7 | | 15,801 | エラン | | 15.6 | | 19.4 | 19,826 | 東京都競馬 | | 7.3 | 10.7 | 46,224 |
| T A C | | 6.3 | | 1,952 | 土木管理総合試験所 | | 5.7 | | 6.9 | 2,187 | 常磐興産 | | 4.7 | 5.4 | 7,317 |
| ケネディクス | | 32.3 | | - | ネットマーケティング | | 5.4 | | 6.9 | 3,029 | カナモト | | 19.9 | 24.8 | 57,015 |
| 電通グループ | | 127 | | 605,988 | 日本郵政 | | 855.3 | | 1,834.3 | 1,880,157 | 東京ドーム | | 44.5 | - | - |
| デアアンドザガンズ | | 5.2 | | 6,880 | ベルシスシステム24ホールディングス | | 18.9 | | 20.1 | 28,642 | 西尾レントオール | | 10.4 | 12.9 | 36,894 |
| ぴあ | | 3.2 | | 16,415 | 鎌倉新書 | | 11.4 | | 16 | 8,400 | アヨラ ホスピタリティグループ | | 71.2 | 75.2 | 1,654 |
| イオンファンタジー | | 4.3 | | 11,718 | SMN | | 2.4 | | 3.4 | 2,046 | トランス・コスモス | | 10.8 | 17.9 | 57,101 |
| シーティーエス | | 12.6 | | 12,976 | 一蔵 | | 1.7 | | 2.3 | 899 | 乃村工藝社 | | 48.3 | 60.2 | 57,671 |
| ネクシイズグループ | | 3.5 | | 3,445 | LITALICO | | 4.6 | | - | - | 藤田観光 | | 4.4 | 6.2 | 15,196 |
| H. U. グループホールディングス | | 31.7 | | 108,411 | グローバルケックCOMPANY | | 2.1 | | 2.7 | 2,130 | KNT-CTホールディングス | | 6 | 8.7 | 12,754 |
| アルプス技研 | | 10 | | 23,347 | エアトリ | | 6.1 | | 9 | 27,270 | 日本管財 | | 12.2 | 15.1 | 42,083 |
| サンックス | | 17.7 | | 4,733 | アトラエ | | 3.4 | | 9.8 | 20,482 | トーカイ | | 11 | 12.5 | 22,887 |
| ダイオーズ | | 2.2 | | 3,475 | ストライク | | 4.2 | | 5.3 | 21,995 | 白洋舎 | | 1 | 1.7 | 2,050 |
| 日本空調サービス | | 12.2 | | 11,730 | ソラスト | | 27.7 | | 34.5 | 36,570 | セコム | | 111.3 | 138.5 | 1,147,749 |
| オリエンタルランド | | 120.1 | | 3,474,812 | セラク | | 3.5 | | 4.6 | 5,602 | セントラル警備保障 | | 5.4 | 6.8 | 16,109 |
| ダスキン | | 26.2 | | 89,650 | インソース | | 9.4 | | 13.7 | 26,112 | 丹青社 | | 21.1 | 28.7 | 20,635 |
| 明光ネットワークジャパン | | 14.2 | | 9,322 | ベイカレント・コンサルティング | | 7.4 | | 9.9 | 402,435 | メイテック | | 13.8 | 17 | 113,900 |
| ファルコホールディングス | | 5.4 | | 14,048 | Orchestra Holdings | | 2.5 | | 2.8 | 7,834 | 応用地質 | | 13.2 | 16 | 34,160 |
| 秀英予備校 | | 2.8 | | 1,519 | アイモパイル | | 4 | | 4 | 4,660 | 船研ホールディングス | | 23.1 | 28.8 | 66,643 |
| 田谷 | | 1.7 | | 991 | キャリアインデックス | | 4.6 | | 4.8 | 3,609 | 進学会ホールディングス | | 4.9 | 5.1 | 1,672 |
| ラウンドワン | | 38.5 | | 57,310 | MS-Japan | | 4.5 | | 5.7 | 5,061 | オオバ | | 7.9 | 10.2 | 7,405 |
| リゾートトラスト | | 51.7 | | 123,390 | 船場 | | 1.6 | | 1.7 | 1,269 | いであ | | 2.7 | 3.9 | 6,953 |
| ビー・エム・エル | | 14.6 | | 66,339 | グレイステクノロジー | | 5.7 | | - | - | 学究社 | | 3.4 | 4.7 | 7,219 |
| ワタベウェディング | | 1.7 | | - | ジャロバエンターテインメントホールディングス | | 32.5 | | 44.5 | 71,422 | ベネッセホールディングス | | 41.4 | 46.8 | 106,516 |
| りらいあコミュニケーションズ | | 17.1 | | 21,917 | フルテック | | 1.8 | | 2.2 | 2,893 | イオンデパート | | 13.9 | 17.3 | 52,332 |
| リソー教育 | | 57.3 | | 26,105 | グリーンズ | | 4.2 | | 5.3 | 2,501 | ナック | | 5.6 | 7.4 | 7,266 |
| 早稲田アカデミー | | 4.4 | | 8,104 | ツナグループホールディングス | | 1.7 | | 3.4 | 1,030 | ダイセキ | | 18.9 | 26 | 127,270 |
| ユー・エス・エス | | 126.4 | | 299,656 | GAMEWITH | | 3.5 | | 4.3 | 1,917 | ステップ | | 4.3 | 5.3 | 9,481 |
| 東京個別指導学院 | | 9.9 | | 7,699 | ソウルドアウト | | 2.7 | | 3.5 | 3,174 | | | | | |
| サイバーエージェント | | 69.6 | | 508,221 | MS&Consulting | | 1.9 | | 2.4 | 1,576 | 合計 | 株数・金額 | 124,117.8 | 161,644 | 387,140,847 |
| 楽天グループ | | 526.6 | | 705,529 | ウェルビー | | - | | 9.1 | 11,129 | 銘柄数<比率> | 2,183銘柄 | 2,174銘柄 | 1<97.4%> | |
| グリーク・アンド・リバー社 | | 5.8 | | 13,087 | エル・ディー・エス | | 0.8 | | 1.8 | 4,152 | (注1) 銘柄柄の () 内は、期末の国内株式評 | | | | |
| モーニングスター | | 12.4 | | 14,424 | ミダックホールディングス | | 2.4 | | 6.2 | 15,710 | 価総額に対する各業種の比率です。 | | | | |
| デー・オー・ダブリュー | | 19.8 | | 7,489 | 日総工業 | | 8.7 | | 11 | 8,558 | (注2) 合計欄の < > 内は、期末の純資産総額に | | | | |
| 山田コンサルタントグループ | | 6.6 | | 8,565 | キューベネットホールディングス | | 5.2 | | 6.6 | 11,180 | に対する評価額の比率です。 | | | | |
| セントラルスポーツ | | 4.2 | | 12,844 | RPAホールディングス | | 12.8 | | 19.7 | 7,052 | (注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。 | | | | |
| フルキャストホールディングス | | 9.8 | | 26,460 | スプリックス | | 3.2 | | 4 | 5,788 | | | | | |
| エン・ジャパン | | 20.1 | | 66,341 | マネジメントソリューションズ | | 5.5 | | 6.9 | 22,770 | | | | | |

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | 当 期 | | 末 |
|-----|-----------|---------------|-------|----------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 | 額 |
| 国内 | T O P I X | 百万円 10,035 | | 百万円 - |

■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|-------------------|---|-----------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 株 式 | 千円 387,140,847 | | % 96.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 12,580,070 | | 3.1 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 399,720,917 | | 100.0 |

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月7日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 399,670,143,174円 |
| 一 般 株 式 (評 価 額) | 11,420,891,042 |
| 株 未 取 入 式 (評 価 額) | 387,140,847,090 |
| 未 取 入 委 託 証 据 | 11,243,540 |
| 差 入 委 託 証 据 | 655,237,202 |
| (B) 負 債 | 2,333,527,720 |
| 未 払 払 解 約 | 909,720 |
| 未 払 産 権 約 | 2,332,618,000 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 397,336,615,454 |
| 元 本 | 124,570,625,521 |
| 次 期 繰 越 損 益 | 272,765,989,933 |
| (D) 受 益 権 総 額 | 124,570,625,521円 |
| 1 万 円 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 31,896円 |

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

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|--------------------------------|-----------------|
| MHAMスリーウェイクオープン | 561,857,238円 |
| MHAM TOP I X オープン | 2,725,686,605円 |
| MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ) | 7,087,968,915円 |
| One DC 国内株式インデックスファンド | 20,422,344,253円 |
| D I AM国内株式バッシブ・ファンド | 4,704,569,337円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 3,424,028円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 23,972,661円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 78,308,323円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 28,249,023円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 21,103,225円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 15,896,115円 |
| たわらノーロード TOP I X | 1,306,069,812円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 1,033,861,326円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 40,906,841円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 262,619,504円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 394,664,404円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) | 3,669,806円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) | 174,139,466円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 434,342,242円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) | 283,511,087円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) | 405,598,982円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 705,164円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 2,916,286円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 36,588,931円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 6,020,593円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 19,092,798円 |
| D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金> | 34,009,153,068円 |
| Oneグローバルバランス | 5,199,858円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 1,065,319,872円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 3,512,005,009円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 3,794,173,475円 |
| D I AM DC バランス30インデックスファンド | 3,343,318,358円 |
| D I AM DC バランス50インデックスファンド | 1,113,385,483円 |
| D I AM DC バランス70インデックスファンド | 1,115,312,187円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 30,317,366円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 1,055,563,450円 |
| マネックス資産設計ファンド エゴリユーション | 18,529,124円 |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 304,544,955円 |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 306,459,778円 |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 545,764,310円 |
| 投資のソムリエ | 13,743,021,171円 |
| フルズコントロール | 128,837,057円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 831,424,634円 |
| D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 337,759,108円 |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> | 549,884,906円 |
| D I AMコア資産設計ファンド (堅実型) | 1,701,235円 |
| D I AMコア資産設計ファンド (積極型) | 5,513,567円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 559,030,369円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 3,846,898,552円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 41,503,360円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 20,515,309円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 4,618,660円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 146,712,017円 |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 348,653,940円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 2,393,008,159円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 279,145,423円 |

| | |
|---|------------------|
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) | 42,977,458円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) | 17,916,384円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) | 15,092,602円 |
| 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> | 105,875,155円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065) | 985,477円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 22,944,960円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 23,431,080円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) | 21,508,092円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 14,273,870円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 22,637,856円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンドI2021-04 (適格機関投資家限定) | 193,585,816円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05 | 41,677,610円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06 | 84,110,969円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07 | 68,984,011円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08 | 47,924,787円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 22,733,018円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09 | 49,987,822円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12 | 70,694,127円 |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) | 329,597,803円 |
| D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) | 34,825,039円 |
| 日米兼重マルチアセット (インカム重視) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定) | 116,640,502円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 39,121,859円 |
| リスクコントロール8資産/トランスファンド (FOF 5用) (適格機関投資家専用) | 7,907,522円 |
| D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 57,045,218円 |
| D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 101,888,672円 |
| D I AM国際分散/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 4,956,036円 |
| D I AM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 26,722,846円 |
| D I AM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 5,712,676円 |
| D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 1,338,373円 |
| D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 7,152,634円 |
| D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 34,835,196円 |
| D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 557,427,217円 |
| D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) | 634,827,723円 |
| D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 1,809,585,772円 |
| D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) | 31,302,862円 |
| D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) | 31,388,733円 |
| D I AM アジア・グローバル・バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 301,727,248円 |
| D I AM世界アセット/トランスファンドVA (適格機関投資家限定) | 74,733,048円 |
| D I AM世界/トランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 1,406,645円 |
| D I AM世界アセット/トランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 349,638,945円 |
| D I AM世界アセット/トランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 20,826,409円 |
| D I AM世界アセット/トランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 73,311,471円 |
| D I AM世界アセット/トランスファンド3VA (適格機関投資家限定) | 173,199,524円 |
| D I AM世界アセット/トランスファンド4VA (適格機関投資家限定) | 237,769,545円 |
| D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) | 38,321,734円 |
| D I AM国内バランス30VA (適格機関投資家限定) | 18,177,991円 |
| D I AMアセット/トランスファンド7VA (121) (適格機関投資家限定) | 291,737,796円 |
| D I AM世界アセット/トランスファンド7VA (1303) (適格機関投資家限定) | 936,557,239円 |
| D I AM世界アセット/トランスファンド7VA (1306) (適格機関投資家限定) | 1,240,495,959円 |
| D I AM世界アセット/トランスファンド7VA (1309) (適格機関投資家限定) | 49,936,951円 |
| 動的パッケージ・ファンド<DC年金> | 19,960,341円 |
| コア資産形成ファンド | 13,478,680円 |
| MHAMトピックスファンド | 692,612,483円 |
| MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用) | 65,067,902円 |
| MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定) | 2,686,127,829円 |
| MHAM日本株式バッシブファンド (適格機関投資家限定) | 2,050,559,819円 |
| 期末元本合計 | 124,570,625,521円 |
| 担保資産 | |
| 代用として担保を提供している資産はありません。 | |

(注3)

■損益の状況

当期 自2021年2月9日 至2022年2月7日

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

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第15期 (決算日 2022年6月22日)

(計算期間 2021年6月23日～2022年6月22日)

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク) | | 債券組入 比率 | 債券先物 比率 | 純資産 総額 |
|------------------|-----------|-----------|---|-----------|------------|------------|-----------|
| | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | 期中 騰落率 | | | |
| 11期 (2018年6月22日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 15期 (2022年6月22日) | 14,333 | △2.2 | 415.85 | △2.1 | 97.9 | — | 573,974 |
| | 12,469 | △13.0 | 361.76 | △13.0 | 104.3 | — | 375,850 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

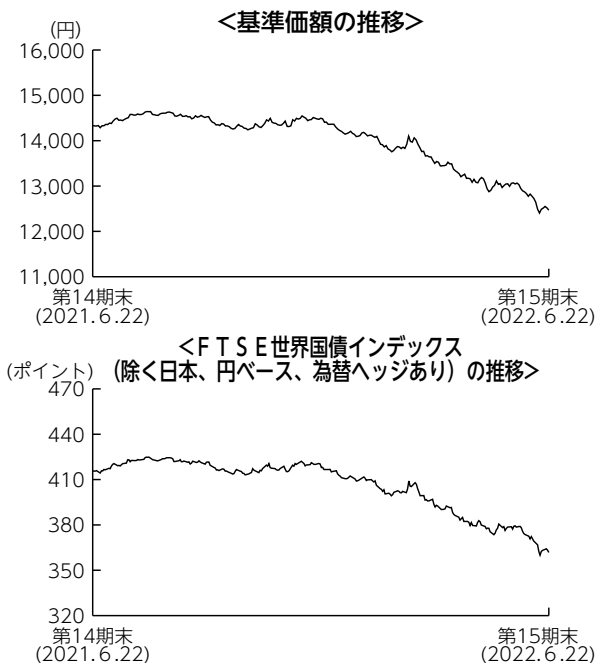
■当期中の基準価額と市況の推移

| 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) 2021 年 6 月 22 日 | 円 14,333 | % - | ポイント 415.85 | % - | % 97.9 | % - |
| 6 月 末 | 14,329 | △0.0 | 415.77 | △0.0 | 97.6 | - |
| 7 月 末 | 14,578 | 1.7 | 423.02 | 1.7 | 97.4 | - |
| 8 月 末 | 14,582 | 1.7 | 423.13 | 1.8 | 98.5 | - |
| 9 月 末 | 14,352 | 0.1 | 416.47 | 0.2 | 90.9 | - |
| 10 月 末 | 14,346 | 0.1 | 416.21 | 0.1 | 100.5 | - |
| 11 月 末 | 14,435 | 0.7 | 418.85 | 0.7 | 96.7 | - |
| 12 月 末 | 14,304 | △0.2 | 415.09 | △0.2 | 100.4 | - |
| 2022 年 1 月 末 | 14,123 | △1.5 | 409.98 | △1.4 | 97.7 | - |
| 2 月 末 | 13,830 | △3.5 | 401.33 | △3.5 | 98.1 | - |
| 3 月 末 | 13,459 | △6.1 | 390.67 | △6.1 | 102.4 | - |
| 4 月 末 | 13,160 | △8.2 | 382.14 | △8.1 | 134.0 | - |
| 5 月 末 | 13,032 | △9.1 | 378.13 | △9.1 | 98.7 | - |
| (期 末) 2022 年 6 月 22 日 | 12,469 | △13.0 | 361.76 | △13.0 | 104.3 | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年6月23日から2022年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は12,469円となり、前期末比で13.0%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------|-----|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) その他費用 (保管費用) | 2円 | 0.016% | (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) | (0.002) | |
| 合 計 | 2 | 0.016 | |
| 期中の平均基準価額は13,992円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年6月23日から2022年6月22日まで)

公社債

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

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 償還年月日 |
|-------------------------|---|-------|--------|----------|-----------|-----------|------------|
| | 種 | 類 | 利 率 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 額 面 金 額 | 外 貨 建 金 額 | 千 円 | |
| (アメリカ) | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| US T N/B 2.625 01/31/26 | 国 | 債 証 券 | 2.6250 | 1,280 | 1,246 | 170,141 | 2026/01/31 |
| US T N/B 2.5 01/31/25 | 国 | 債 証 券 | 2.5000 | 6,000 | 5,879 | 802,433 | 2025/01/31 |
| US T N/B 2.25 01/31/24 | 国 | 債 証 券 | 2.2500 | 6,160 | 6,073 | 829,020 | 2024/01/31 |
| US T N/B 2.5 01/31/24 | 国 | 債 証 券 | 2.5000 | 10,000 | 9,900 | 1,351,357 | 2024/01/31 |
| US T N/B 0.125 01/15/24 | 国 | 債 証 券 | 0.1250 | 10,000 | 9,542 | 1,302,519 | 2024/01/15 |
| US T N/B 0.875 01/31/24 | 国 | 債 証 券 | 0.8750 | 6,000 | 5,785 | 789,701 | 2024/01/31 |
| US T N/B 1.5 01/31/27 | 国 | 債 証 券 | 1.5000 | 13,290 | 12,216 | 1,667,418 | 2027/01/31 |
| US T N/B 1.75 01/31/29 | 国 | 債 証 券 | 1.7500 | 10,000 | 9,035 | 1,233,208 | 2029/01/31 |
| US T N/B 0.75 01/31/28 | 国 | 債 証 券 | 0.7500 | 10,270 | 8,875 | 1,211,420 | 2028/01/31 |
| US T N/B 1.125 01/15/25 | 国 | 債 証 券 | 1.1250 | 2,940 | 2,782 | 379,774 | 2025/01/15 |
| US T N/B 6.0 02/15/26 | 国 | 債 証 券 | 6.0000 | 1,810 | 1,970 | 268,953 | 2026/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 国 | 債 証 券 | 3.1250 | 1,310 | 1,214 | 165,713 | 2042/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 国 | 債 証 券 | 3.1250 | 2,760 | 2,538 | 346,428 | 2043/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/46 | 国 | 債 証 券 | 2.5000 | 5,270 | 4,300 | 587,018 | 2046/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/39 | 国 | 債 証 券 | 3.5000 | 890 | 898 | 122,652 | 2039/02/15 |
| US T N/B 5.375 02/15/31 | 国 | 債 証 券 | 5.3750 | 2,290 | 2,639 | 360,325 | 2031/02/15 |
| US T N/B 4.5 02/15/36 | 国 | 債 証 券 | 4.5000 | 1,410 | 1,610 | 219,799 | 2036/02/15 |
| US T N/B 4.75 02/15/41 | 国 | 債 証 券 | 4.7500 | 2,470 | 2,878 | 392,941 | 2041/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 国 | 債 証 券 | 3.6250 | 5,660 | 5,620 | 767,161 | 2044/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/49 | 国 | 債 証 券 | 3.0000 | 5,450 | 4,986 | 680,583 | 2049/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/52 | 国 | 債 証 券 | 2.2500 | 11,790 | 9,265 | 1,264,681 | 2052/02/15 |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 国 | 債 証 券 | 4.3750 | 1,890 | 2,128 | 290,564 | 2038/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/15/40 | 国 | 債 証 券 | 4.6250 | 2,790 | 3,215 | 438,850 | 2040/02/15 |
| US T N/B 2.375 02/15/42 | 国 | 債 証 券 | 2.3750 | 9,980 | 8,179 | 1,116,447 | 2042/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/51 | 国 | 債 証 券 | 1.8750 | 13,740 | 9,818 | 1,340,158 | 2051/02/15 |
| US T N/B 1.625 02/15/26 | 国 | 債 証 券 | 1.6250 | 7,900 | 7,416 | 1,012,269 | 2026/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/45 | 国 | 債 証 券 | 2.5000 | 4,440 | 3,630 | 495,512 | 2045/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/47 | 国 | 債 証 券 | 3.0000 | 6,430 | 5,783 | 789,456 | 2047/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/48 | 国 | 債 証 券 | 3.0000 | 5,830 | 5,280 | 720,701 | 2048/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/24 | 国 | 債 証 券 | 2.7500 | 3,470 | 3,447 | 470,493 | 2024/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/25 | 国 | 債 証 券 | 2.0000 | 9,000 | 8,695 | 1,186,855 | 2025/02/15 |
| US T N/B 2.625 02/15/29 | 国 | 債 証 券 | 2.6250 | 7,530 | 7,184 | 980,636 | 2029/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/28 | 国 | 債 証 券 | 2.7500 | 9,000 | 8,693 | 1,186,567 | 2028/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/27 | 国 | 債 証 券 | 2.2500 | 8,770 | 8,329 | 1,136,932 | 2027/02/15 |
| US T N/B 2.125 02/29/24 | 国 | 債 証 券 | 2.1250 | 5,000 | 4,915 | 670,906 | 2024/02/29 |
| US T N/B 2.5 02/28/26 | 国 | 債 証 券 | 2.5000 | 5,520 | 5,346 | 729,762 | 2026/02/28 |
| US T N/B 2.75 02/28/25 | 国 | 債 証 券 | 2.7500 | 6,290 | 6,199 | 846,180 | 2025/02/28 |
| US T N/B 2.375 02/29/24 | 国 | 債 証 券 | 2.3750 | 5,800 | 5,725 | 781,530 | 2024/02/29 |
| US T N/B 1.125 02/15/31 | 国 | 債 証 券 | 1.1250 | 14,250 | 11,932 | 1,628,618 | 2031/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/41 | 国 | 債 証 券 | 1.8750 | 6,540 | 4,958 | 676,805 | 2041/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/50 | 国 | 債 証 券 | 2.0000 | 8,510 | 6,290 | 858,624 | 2050/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/32 | 国 | 債 証 券 | 1.8750 | 13,520 | 11,926 | 1,627,868 | 2032/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/28/27 | 国 | 債 証 券 | 1.1250 | 3,840 | 3,463 | 472,671 | 2027/02/28 |
| US T N/B 1.5 02/15/30 | 国 | 債 証 券 | 1.5000 | 8,730 | 7,658 | 1,045,312 | 2030/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/28/27 | 国 | 債 証 券 | 1.8750 | 6,690 | 6,251 | 853,301 | 2027/02/28 |
| US T N/B 0.125 02/15/24 | 国 | 債 証 券 | 0.1250 | 4,870 | 4,634 | 632,587 | 2024/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/28/25 | 国 | 債 証 券 | 1.1250 | 4,820 | 4,547 | 620,721 | 2025/02/28 |
| US T N/B 1.5 02/29/24 | 国 | 債 証 券 | 1.5000 | 8,520 | 8,287 | 1,131,142 | 2024/02/29 |
| US T N/B 1.125 02/29/28 | 国 | 債 証 券 | 1.1250 | 12,380 | 10,931 | 1,491,993 | 2028/02/29 |
| US T N/B 1.875 02/28/29 | 国 | 債 証 券 | 1.8750 | 10,000 | 9,105 | 1,242,805 | 2029/02/28 |
| US T N/B 0.5 02/28/26 | 国 | 債 証 券 | 0.5000 | 10,350 | 9,307 | 1,270,411 | 2026/02/28 |
| US T N/B 1.5 02/15/25 | 国 | 債 証 券 | 1.5000 | 9,580 | 9,130 | 1,246,281 | 2025/02/15 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 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 2.125 03/31/24 | 国債証券 | 2.1250 | 10,900 | 10,702 | 1,460,775 | | 2024/03/31 |
| US T N/B 2.625 03/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 4,430 | 4,349 | 593,644 | | 2025/03/31 |
| US T N/B 2.25 03/31/26 | 国債証券 | 2.2500 | 7,000 | 6,715 | 916,541 | | 2026/03/31 |
| US T N/B 0.625 03/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 2,630 | 2,309 | 315,289 | | 2027/03/31 |
| US T N/B 0.25 03/15/24 | 国債証券 | 0.2500 | 10,000 | 9,508 | 1,297,774 | | 2024/03/15 |
| US T N/B 0.5 03/31/25 | 国債証券 | 0.5000 | 9,000 | 8,321 | 1,135,847 | | 2025/03/31 |
| US T N/B 1.25 03/31/28 | 国債証券 | 1.2500 | 6,880 | 6,108 | 833,774 | | 2028/03/31 |
| US T N/B 0.75 03/31/26 | 国債証券 | 0.7500 | 10,640 | 9,640 | 1,315,821 | | 2026/03/31 |
| US T N/B 2.25 03/31/24 | 国債証券 | 2.2500 | 2,510 | 2,468 | 336,955 | | 2024/03/31 |
| US T N/B 2.5 03/31/27 | 国債証券 | 2.5000 | 9,400 | 9,032 | 1,232,788 | | 2027/03/31 |
| US T N/B 1.75 03/15/25 | 国債証券 | 1.7500 | 6,100 | 5,848 | 798,309 | | 2025/03/15 |
| US T N/B 2.875 04/30/25 | 国債証券 | 2.8750 | 3,920 | 3,866 | 527,767 | | 2025/04/30 |
| US T N/B 2.0 04/30/24 | 国債証券 | 2.0000 | 6,860 | 6,714 | 916,424 | | 2024/04/30 |
| US T N/B 2.375 04/30/26 | 国債証券 | 2.3750 | 4,280 | 4,122 | 562,658 | | 2026/04/30 |
| US T N/B 2.25 04/30/24 | 国債証券 | 2.2500 | 5,000 | 4,915 | 670,933 | | 2024/04/30 |
| US T N/B 1.25 04/30/28 | 国債証券 | 1.2500 | 11,000 | 9,746 | 1,330,254 | | 2028/04/30 |
| US T N/B 0.375 04/15/24 | 国債証券 | 0.3750 | 7,740 | 7,356 | 1,004,147 | | 2024/04/15 |
| US T N/B 0.5 04/30/27 | 国債証券 | 0.5000 | 5,560 | 4,840 | 660,629 | | 2027/04/30 |
| US T N/B 0.75 04/30/26 | 国債証券 | 0.7500 | 8,290 | 7,495 | 1,023,081 | | 2026/04/30 |
| US T N/B 0.375 04/30/25 | 国債証券 | 0.3750 | 6,870 | 6,314 | 861,828 | | 2025/04/30 |
| US T N/B 2.625 04/15/25 | 国債証券 | 2.6250 | 2,280 | 2,235 | 305,106 | | 2025/04/15 |
| US T N/B 6.25 05/15/30 | 国債証券 | 6.2500 | 2,000 | 2,402 | 327,853 | | 2030/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | 国債証券 | 4.3750 | 2,770 | 3,092 | 422,058 | | 2040/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 国債証券 | 4.3750 | 870 | 964 | 131,576 | | 2041/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/42 | 国債証券 | 3.0000 | 3,270 | 2,966 | 404,950 | | 2042/05/15 |
| US T N/B 4.25 05/15/39 | 国債証券 | 4.2500 | 2,000 | 2,209 | 301,621 | | 2039/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 国債証券 | 2.8750 | 3,820 | 3,368 | 459,761 | | 2043/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/51 | 国債証券 | 2.3750 | 13,620 | 10,974 | 1,497,942 | | 2051/05/15 |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | 国債証券 | 3.3750 | 3,580 | 3,418 | 466,531 | | 2044/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 1,930 | 1,727 | 235,807 | | 2045/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 2,810 | 2,528 | 345,063 | | 2047/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 360 | 293 | 40,080 | | 2046/05/15 |
| US T N/B 3.125 05/15/48 | 国債証券 | 3.1250 | 5,440 | 5,059 | 690,530 | | 2048/05/15 |
| US T N/B 1.125 05/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 5,610 | 3,765 | 513,922 | | 2040/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/49 | 国債証券 | 2.8750 | 4,730 | 4,231 | 577,608 | | 2049/05/15 |
| US T N/B 4.5 05/15/38 | 国債証券 | 4.5000 | 2,140 | 2,440 | 333,163 | | 2038/05/15 |
| US T N/B 2.25 05/15/41 | 国債証券 | 2.2500 | 5,460 | 4,401 | 600,729 | | 2041/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/24 | 国債証券 | 2.5000 | 9,050 | 8,931 | 1,219,022 | | 2024/05/15 |
| US T N/B 2.125 05/15/25 | 国債証券 | 2.1250 | 10,000 | 9,659 | 1,318,408 | | 2025/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 11,000 | 10,686 | 1,458,576 | | 2028/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 国債証券 | 2.3750 | 9,450 | 8,862 | 1,209,619 | | 2029/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | 国債証券 | 2.3750 | 5,000 | 4,765 | 650,433 | | 2027/05/15 |
| US T N/B 5.0 05/15/37 | 国債証券 | 5.0000 | 1,450 | 1,737 | 237,136 | | 2037/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 10,000 | 9,339 | 1,274,795 | | 2026/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/31/23 | 国債証券 | 1.6250 | 5,460 | 5,393 | 736,181 | | 2023/05/31 |
| US T N/B 2.0 05/31/24 | 国債証券 | 2.0000 | 8,440 | 8,250 | 1,126,146 | | 2024/05/31 |
| US T N/B 1.25 05/15/50 | 国債証券 | 1.2500 | 9,150 | 5,528 | 754,647 | | 2050/05/15 |
| US T N/B 2.125 05/31/26 | 国債証券 | 2.1250 | 5,000 | 4,764 | 650,246 | | 2026/05/31 |
| US T N/B 1.625 05/15/31 | 国債証券 | 1.6250 | 14,320 | 12,467 | 1,701,668 | | 2031/05/15 |
| US T N/B 2.75 05/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | 7,220 | 7,205 | 983,533 | | 2023/05/31 |
| US T N/B 2.875 05/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 4,550 | 4,489 | 612,732 | | 2025/05/31 |
| US T N/B 0.5 05/31/27 | 国債証券 | 0.5000 | 4,830 | 4,195 | 572,591 | | 2027/05/31 |
| US T N/B 1.25 05/31/28 | 国債証券 | 1.2500 | 10,850 | 9,597 | 1,309,916 | | 2028/05/31 |
| US T N/B 0.25 05/15/24 | 国債証券 | 0.2500 | 10,750 | 10,167 | 1,387,771 | | 2024/05/15 |
| US T N/B 0.625 05/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 12,420 | 10,104 | 1,379,142 | | 2030/05/15 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | | 末 |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 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 0.75 05/31/26 | 国債証券 | 0.7500 | 7,000 | 6,314 | | 861,827 | 2026/05/31 |
| US T N/B 0.25 05/31/25 | 国債証券 | 0.2500 | 8,970 | 8,189 | | 1,117,761 | 2025/05/31 |
| US T N/B 2.0 06/30/24 | 国債証券 | 2.0000 | 6,710 | 6,552 | | 894,382 | 2024/06/30 |
| US T N/B 2.75 06/30/25 | 国債証券 | 2.7500 | 1,150 | 1,129 | | 154,192 | 2025/06/30 |
| US T N/B 1.875 06/30/26 | 国債証券 | 1.8750 | 4,920 | 4,638 | | 633,101 | 2026/06/30 |
| US T N/B 1.75 06/30/24 | 国債証券 | 1.7500 | 6,760 | 6,564 | | 896,001 | 2024/06/30 |
| US T N/B 0.5 06/30/27 | 国債証券 | 0.5000 | 5,170 | 4,481 | | 611,630 | 2027/06/30 |
| US T N/B 1.25 06/30/28 | 国債証券 | 1.2500 | 10,000 | 8,830 | | 1,205,270 | 2028/06/30 |
| US T N/B 0.25 06/30/25 | 国債証券 | 0.2500 | 8,990 | 8,186 | | 1,117,377 | 2025/06/30 |
| US T N/B 0.25 06/15/24 | 国債証券 | 0.2500 | 11,000 | 10,375 | | 1,416,115 | 2024/06/15 |
| US T N/B 0.875 06/30/26 | 国債証券 | 0.8750 | 6,250 | 5,655 | | 771,921 | 2026/06/30 |
| US T N/B 2.125 07/31/24 | 国債証券 | 2.1250 | 6,170 | 6,033 | | 823,524 | 2024/07/31 |
| US T N/B 1.25 07/31/23 | 国債証券 | 1.2500 | 8,400 | 8,236 | | 1,124,212 | 2023/07/31 |
| US T N/B 2.875 07/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 3,270 | 3,222 | | 439,836 | 2025/07/31 |
| US T N/B 1.875 07/31/26 | 国債証券 | 1.8750 | 5,000 | 4,708 | | 642,595 | 2026/07/31 |
| US T N/B 1.75 07/31/24 | 国債証券 | 1.7500 | 8,000 | 7,757 | | 1,058,821 | 2024/07/31 |
| US T N/B 2.75 07/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | 8,860 | 8,832 | | 1,205,522 | 2023/07/31 |
| US T N/B 0.125 07/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 9,000 | 8,728 | | 1,191,365 | 2023/07/15 |
| US T N/B 0.125 07/31/23 | 国債証券 | 0.1250 | 1,850 | 1,792 | | 244,635 | 2023/07/31 |
| US T N/B 1.0 07/31/28 | 国債証券 | 1.0000 | 10,670 | 9,262 | | 1,264,292 | 2028/07/31 |
| US T N/B 0.375 07/31/27 | 国債証券 | 0.3750 | 5,000 | 4,296 | | 586,427 | 2027/07/31 |
| US T N/B 0.25 07/31/25 | 国債証券 | 0.2500 | 8,980 | 8,152 | | 1,112,687 | 2025/07/31 |
| US T N/B 0.625 07/31/26 | 国債証券 | 0.6250 | 8,000 | 7,149 | | 975,775 | 2026/07/31 |
| US T N/B 0.375 07/15/24 | 国債証券 | 0.3750 | 9,000 | 8,489 | | 1,158,736 | 2024/07/15 |
| US T N/B 6.25 08/15/23 | 国債証券 | 6.2500 | 2,390 | 2,479 | | 338,494 | 2023/08/15 |
| US T N/B 3.75 08/15/41 | 国債証券 | 3.7500 | 3,000 | 3,053 | | 416,763 | 2041/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 国債証券 | 3.8750 | 2,580 | 2,690 | | 367,192 | 2040/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 3,000 | 2,602 | | 355,215 | 2042/08/15 |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 国債証券 | 3.1250 | 3,650 | 3,338 | | 455,725 | 2044/08/15 |
| US T N/B 4.5 08/15/39 | 国債証券 | 4.5000 | 2,510 | 2,856 | | 389,936 | 2039/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国債証券 | 3.6250 | 4,000 | 3,971 | | 542,121 | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/51 | 国債証券 | 2.0000 | 15,110 | 11,145 | | 1,521,315 | 2051/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 国債証券 | 2.8750 | 2,400 | 2,102 | | 286,936 | 2045/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 10,000 | 9,589 | | 1,308,917 | 2025/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 4,900 | 4,209 | | 574,594 | 2047/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/49 | 国債証券 | 2.2500 | 7,430 | 5,830 | | 795,847 | 2049/08/15 |
| US T N/B 2.5 08/15/23 | 国債証券 | 2.5000 | 5,000 | 4,970 | | 678,397 | 2023/08/15 |
| US T N/B 2.375 08/15/24 | 国債証券 | 2.3750 | 4,000 | 3,927 | | 536,128 | 2024/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/46 | 国債証券 | 2.2500 | 5,510 | 4,274 | | 583,375 | 2046/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/48 | 国債証券 | 3.0000 | 8,070 | 7,327 | | 1,000,104 | 2048/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 6,190 | 5,850 | | 798,537 | 2027/08/15 |
| US T N/B 1.5 08/15/26 | 国債証券 | 1.5000 | 7,990 | 7,396 | | 1,009,530 | 2026/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 8,860 | 8,590 | | 1,172,549 | 2028/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/31/25 | 国債証券 | 2.7500 | 3,000 | 2,943 | | 401,824 | 2025/08/31 |
| US T N/B 1.375 08/31/23 | 国債証券 | 1.3750 | 7,880 | 7,726 | | 1,054,618 | 2023/08/31 |
| US T N/B 1.625 08/15/29 | 国債証券 | 1.6250 | 8,400 | 7,478 | | 1,020,757 | 2029/08/15 |
| US T N/B 1.875 08/31/24 | 国債証券 | 1.8750 | 7,030 | 6,830 | | 932,313 | 2024/08/31 |
| US T N/B 2.75 08/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | 7,030 | 7,008 | | 956,601 | 2023/08/31 |
| US T N/B 1.75 08/15/41 | 国債証券 | 1.7500 | 14,040 | 10,316 | | 1,408,045 | 2041/08/15 |
| US T N/B 1.125 08/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 6,760 | 4,500 | | 614,297 | 2040/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/15/50 | 国債証券 | 1.3750 | 11,760 | 7,356 | | 1,004,079 | 2050/08/15 |
| US T N/B 1.25 08/15/31 | 国債証券 | 1.2500 | 17,690 | 14,831 | | 2,024,414 | 2031/08/15 |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 16,280 | 13,156 | | 1,795,699 | 2030/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/31/26 | 国債証券 | 1.3750 | 4,750 | 4,371 | | 596,714 | 2026/08/31 |
| US T N/B 1.25 08/31/24 | 国債証券 | 1.2500 | 5,400 | 5,173 | | 706,182 | 2024/08/31 |

| 銘柄 | 当期 | | | | 評価額 | | 末 |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| US T N/B 0.25 08/31/25 | 国債証券 | 0.2500 | 9,920 | 8,979 | 1,225,669 | 2025/08/31 | |
| US T N/B 0.375 08/15/24 | 国債証券 | 0.3750 | 10,000 | 9,408 | 1,284,232 | 2024/08/15 | |
| US T N/B 0.125 08/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 8,310 | 8,037 | 1,097,103 | 2023/08/15 | |
| US T N/B 0.125 08/31/23 | 国債証券 | 0.1250 | 11,040 | 10,665 | 1,455,757 | 2023/08/31 | |
| US T N/B 1.125 08/31/28 | 国債証券 | 1.1250 | 9,870 | 8,616 | 1,176,025 | 2028/08/31 | |
| US T N/B 0.5 08/31/27 | 国債証券 | 0.5000 | 9,520 | 8,210 | 1,120,668 | 2027/08/31 | |
| US T N/B 0.75 08/31/26 | 国債証券 | 0.7500 | 10,000 | 8,966 | 1,223,878 | 2026/08/31 | |
| US T N/B 3.0 09/30/25 | 国債証券 | 3.0000 | 2,000 | 1,977 | 269,844 | 2025/09/30 | |
| US T N/B 2.125 09/30/24 | 国債証券 | 2.1250 | 2,400 | 2,344 | 319,975 | 2024/09/30 | |
| US T N/B 2.875 09/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | 7,810 | 7,788 | 1,063,072 | 2023/09/30 | |
| US T N/B 0.125 09/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 6,120 | 5,903 | 805,723 | 2023/09/15 | |
| US T N/B 0.375 09/30/27 | 国債証券 | 0.3750 | 7,670 | 6,557 | 895,040 | 2027/09/30 | |
| US T N/B 1.625 09/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | 3,820 | 3,550 | 484,568 | 2026/09/30 | |
| US T N/B 1.25 09/30/28 | 国債証券 | 1.2500 | 10,000 | 8,785 | 1,199,192 | 2028/09/30 | |
| US T N/B 0.25 09/30/25 | 国債証券 | 0.2500 | 10,000 | 9,026 | 1,232,035 | 2025/09/30 | |
| US T N/B 1.5 09/30/24 | 国債証券 | 1.5000 | 6,490 | 6,239 | 851,563 | 2024/09/30 | |
| US T N/B 0.375 09/15/24 | 国債証券 | 0.3750 | 10,000 | 9,382 | 1,280,660 | 2024/09/15 | |
| US T N/B 2.25 10/31/24 | 国債証券 | 2.2500 | 6,560 | 6,415 | 875,718 | 2024/10/31 | |
| US T N/B 3.0 10/31/25 | 国債証券 | 3.0000 | 3,620 | 3,576 | 488,149 | 2025/10/31 | |
| US T N/B 1.625 10/31/26 | 国債証券 | 1.6250 | 5,100 | 4,730 | 645,659 | 2026/10/31 | |
| US T N/B 0.125 10/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 10,000 | 9,615 | 1,312,436 | 2023/10/15 | |
| US T N/B 1.375 10/31/28 | 国債証券 | 1.3750 | 7,000 | 6,190 | 844,883 | 2028/10/31 | |
| US T N/B 1.5 10/31/24 | 国債証券 | 1.5000 | 8,000 | 7,679 | 1,048,157 | 2024/10/31 | |
| US T N/B 0.5 10/31/27 | 国債証券 | 0.5000 | 6,000 | 5,149 | 702,848 | 2027/10/31 | |
| US T N/B 0.625 10/15/24 | 国債証券 | 0.6250 | 10,000 | 9,417 | 1,285,458 | 2024/10/15 | |
| US T N/B 0.25 10/31/25 | 国債証券 | 0.2500 | 7,500 | 6,750 | 921,387 | 2025/10/31 | |
| US T N/B 5.25 11/15/28 | 国債証券 | 5.2500 | 1,700 | 1,880 | 256,722 | 2028/11/15 | |
| US T N/B 6.125 11/15/27 | 国債証券 | 6.1250 | 3,000 | 3,396 | 463,532 | 2027/11/15 | |
| US T N/B 3.0 11/15/44 | 国債証券 | 3.0000 | 40 | 35 | 4,886 | 2044/11/15 | |
| US T N/B 4.25 11/15/40 | 国債証券 | 4.2500 | 3,320 | 3,632 | 495,859 | 2040/11/15 | |
| US T N/B 2.75 11/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 4,920 | 4,258 | 581,241 | 2042/11/15 | |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 国債証券 | 3.1250 | 80 | 74 | 10,140 | 2041/11/15 | |
| US T N/B 3.75 11/15/43 | 国債証券 | 3.7500 | 4,000 | 4,051 | 553,040 | 2043/11/15 | |
| US T N/B 2.75 11/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 4,880 | 4,200 | 573,341 | 2047/11/15 | |
| US T N/B 1.625 11/15/50 | 国債証券 | 1.6250 | 8,770 | 5,873 | 801,721 | 2050/11/15 | |
| US T N/B 1.875 11/15/51 | 国債証券 | 1.8750 | 11,990 | 8,580 | 1,171,131 | 2051/11/15 | |
| US T N/B 3.0 11/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 2,370 | 2,125 | 290,147 | 2045/11/15 | |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 国債証券 | 2.8750 | 4,030 | 3,539 | 483,059 | 2046/11/15 | |
| US T N/B 2.25 11/15/24 | 国債証券 | 2.2500 | 10,000 | 9,757 | 1,331,843 | 2024/11/15 | |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 国債証券 | 4.3750 | 1,200 | 1,341 | 183,084 | 2039/11/15 | |
| US T N/B 3.375 11/15/48 | 国債証券 | 3.3750 | 5,050 | 4,938 | 674,035 | 2048/11/15 | |
| US T N/B 2.375 11/15/49 | 国債証券 | 2.3750 | 3,120 | 2,519 | 343,939 | 2049/11/15 | |
| US T N/B 2.25 11/15/25 | 国債証券 | 2.2500 | 7,560 | 7,281 | 993,854 | 2025/11/15 | |
| US T N/B 3.125 11/15/28 | 国債証券 | 3.1250 | 7,380 | 7,256 | 990,376 | 2028/11/15 | |
| US T N/B 2.75 11/15/23 | 国債証券 | 2.7500 | 2,500 | 2,487 | 339,545 | 2023/11/15 | |
| US T N/B 2.0 11/15/26 | 国債証券 | 2.0000 | 10,580 | 9,968 | 1,360,579 | 2026/11/15 | |
| US T N/B 2.25 11/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 8,040 | 7,578 | 1,034,451 | 2027/11/15 | |
| US T N/B 2.125 11/30/23 | 国債証券 | 2.1250 | 8,000 | 7,886 | 1,076,479 | 2023/11/30 | |
| US T N/B 2.125 11/30/24 | 国債証券 | 2.1250 | 6,670 | 6,495 | 886,561 | 2024/11/30 | |
| US T N/B 2.875 11/30/25 | 国債証券 | 2.8750 | 4,140 | 4,070 | 555,577 | 2025/11/30 | |
| US T N/B 2.875 11/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | 8,670 | 8,639 | 1,179,208 | 2023/11/30 | |
| US T N/B 1.375 11/15/40 | 国債証券 | 1.3750 | 10,970 | 7,619 | 1,040,035 | 2040/11/15 | |
| US T N/B 2.0 11/15/41 | 国債証券 | 2.0000 | 6,400 | 4,913 | 670,643 | 2041/11/15 | |
| US T N/B 1.625 11/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | 5,310 | 4,922 | 671,848 | 2026/11/30 | |
| US T N/B 1.75 11/15/29 | 国債証券 | 1.7500 | 6,900 | 6,192 | 845,174 | 2029/11/15 | |

| 銘柄 | 当 | | | | 期 | | | 末 |
|-------------------------|------|--------|-----------|-----------|-------------|--|------------|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | | |
| US T N/B 1.375 11/15/31 | 国債証券 | 1.3750 | 20,420 | 17,237 | 2,352,726 | | 2031/11/15 | |
| US T N/B 0.875 11/15/30 | 国債証券 | 0.8750 | 18,710 | 15,388 | 2,100,441 | | 2030/11/15 | |
| US T N/B 0.25 11/15/23 | 国債証券 | 0.2500 | 12,280 | 11,806 | 1,611,410 | | 2023/11/15 | |
| US T N/B 0.5 11/30/23 | 国債証券 | 0.5000 | 2,000 | 1,925 | 262,860 | | 2023/11/30 | |
| US T N/B 0.625 11/30/27 | 国債証券 | 0.6250 | 8,510 | 7,331 | 1,000,639 | | 2027/11/30 | |
| US T N/B 1.5 11/30/28 | 国債証券 | 1.5000 | 7,000 | 6,230 | 850,407 | | 2028/11/30 | |
| US T N/B 1.5 11/30/24 | 国債証券 | 1.5000 | 7,100 | 6,802 | 928,423 | | 2024/11/30 | |
| US T N/B 0.375 11/30/25 | 国債証券 | 0.3750 | 9,020 | 8,133 | 1,110,141 | | 2025/11/30 | |
| US T N/B 0.75 11/15/24 | 国債証券 | 0.7500 | 4,040 | 3,803 | 519,109 | | 2024/11/15 | |
| US T N/B 2.25 12/31/23 | 国債証券 | 2.2500 | 8,000 | 7,891 | 1,077,119 | | 2023/12/31 | |
| US T N/B 2.625 12/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 2,000 | 1,949 | 266,038 | | 2025/12/31 | |
| US T N/B 2.25 12/31/24 | 国債証券 | 2.2500 | 7,210 | 7,032 | 959,874 | | 2024/12/31 | |
| US T N/B 1.75 12/31/26 | 国債証券 | 1.7500 | 4,990 | 4,647 | 634,340 | | 2026/12/31 | |
| US T N/B 0.75 12/31/23 | 国債証券 | 0.7500 | 4,940 | 4,765 | 650,398 | | 2023/12/31 | |
| US T N/B 1.25 12/31/26 | 国債証券 | 1.2500 | 9,100 | 8,280 | 1,130,225 | | 2026/12/31 | |
| US T N/B 1.375 12/31/28 | 国債証券 | 1.3750 | 6,900 | 6,094 | 831,857 | | 2028/12/31 | |
| US T N/B 0.375 12/31/25 | 国債証券 | 0.3750 | 8,400 | 7,558 | 1,031,595 | | 2025/12/31 | |
| US T N/B 0.625 12/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 10,160 | 8,740 | 1,192,974 | | 2027/12/31 | |
| US T N/B 1.0 12/15/24 | 国債証券 | 1.0000 | 9,760 | 9,224 | 1,259,082 | | 2024/12/15 | |
| 小計 | — | — | 1,610,280 | 1,464,100 | 199,835,047 | | — | |
| (カナダ) | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | | | |
| CANADA 0.75 02/01/24 | 国債証券 | 0.7500 | 4,010 | 3,850 | 405,886 | | 2024/02/01 | |
| CANADA 2.25 03/01/24 | 国債証券 | 2.2500 | 2,400 | 2,359 | 248,735 | | 2024/03/01 | |
| CANADA 1.25 03/01/25 | 国債証券 | 1.2500 | 2,200 | 2,082 | 219,522 | | 2025/03/01 | |
| CANADA 0.25 03/01/26 | 国債証券 | 0.2500 | 2,200 | 1,963 | 206,954 | | 2026/03/01 | |
| CANADA 1.25 03/01/27 | 国債証券 | 1.2500 | 2,380 | 2,157 | 227,468 | | 2027/03/01 | |
| CANADA 0.25 04/01/24 | 国債証券 | 0.2500 | 2,600 | 2,464 | 259,807 | | 2024/04/01 | |
| CANADA 1.5 04/01/25 | 国債証券 | 1.5000 | 2,080 | 1,976 | 208,381 | | 2025/04/01 | |
| CANADA 1.5 05/01/24 | 国債証券 | 1.5000 | 1,000 | 967 | 101,948 | | 2024/05/01 | |
| CANADA 1.5 06/01/26 | 国債証券 | 1.5000 | 1,900 | 1,770 | 186,609 | | 2026/06/01 | |
| CANADA 5.75 06/01/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,440 | 1,642 | 173,177 | | 2029/06/01 | |
| CANADA 5.0 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 1,190 | 1,391 | 146,646 | | 2037/06/01 | |
| CANADA 2.5 06/01/24 | 国債証券 | 2.5000 | 1,090 | 1,073 | 113,153 | | 2024/06/01 | |
| CANADA 4.0 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 600 | 640 | 67,526 | | 2041/06/01 | |
| CANADA 1.5 06/01/23 | 国債証券 | 1.5000 | 1,110 | 1,092 | 115,208 | | 2023/06/01 | |
| CANADA 2.25 06/01/25 | 国債証券 | 2.2500 | 1,260 | 1,221 | 128,803 | | 2025/06/01 | |
| CANADA 1.0 06/01/27 | 国債証券 | 1.0000 | 1,610 | 1,435 | 151,353 | | 2027/06/01 | |
| CANADA 2.25 06/01/29 | 国債証券 | 2.2500 | 1,910 | 1,768 | 186,454 | | 2029/06/01 | |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 5,690 | 4,808 | 506,896 | | 2030/06/01 | |
| CANADA 1.5 06/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 7,200 | 6,094 | 642,398 | | 2031/06/01 | |
| CANADA 2.0 06/01/32 | 国債証券 | 2.0000 | 1,500 | 1,311 | 138,265 | | 2032/06/01 | |
| CANADA 0.25 08/01/23 | 国債証券 | 0.2500 | 810 | 784 | 82,642 | | 2023/08/01 | |
| CANADA 1.5 09/01/24 | 国債証券 | 1.5000 | 800 | 769 | 81,098 | | 2024/09/01 | |
| CANADA 2.0 09/01/23 | 国債証券 | 2.0000 | 2,220 | 2,187 | 230,636 | | 2023/09/01 | |
| CANADA 0.5 09/01/25 | 国債証券 | 0.5000 | 3,990 | 3,647 | 384,457 | | 2025/09/01 | |
| CANADA 1.0 09/01/26 | 国債証券 | 1.0000 | 1,660 | 1,505 | 158,698 | | 2026/09/01 | |
| CANADA 0.75 10/01/24 | 国債証券 | 0.7500 | 3,250 | 3,067 | 323,329 | | 2024/10/01 | |
| CANADA 0.5 11/01/23 | 国債証券 | 0.5000 | 3,490 | 3,362 | 354,423 | | 2023/11/01 | |
| CANADA 3.5 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 1,920 | 1,926 | 203,098 | | 2045/12/01 | |
| CANADA 2.75 12/01/48 | 国債証券 | 2.7500 | 1,120 | 988 | 104,166 | | 2048/12/01 | |
| CANADA 2.0 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 7,720 | 5,722 | 603,220 | | 2051/12/01 | |
| CANADA 1.75 12/01/53 | 国債証券 | 1.7500 | 2,650 | 1,816 | 191,456 | | 2053/12/01 | |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 780 | 666 | 70,307 | | 2064/12/01 | |
| CANADA 0.5 12/01/30 | 国債証券 | 0.5000 | 4,500 | 3,514 | 370,453 | | 2030/12/01 | |
| CANADA 1.5 12/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 4,310 | 3,621 | 381,716 | | 2031/12/01 | |
| 小計 | — | — | 84,590 | 75,656 | 7,974,905 | | — | |

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

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

| 銘柄 | 当期 | | | | | | 償還年月日 |
|---------------------------------|------|---------|--------------|--------------|-----------|------------|-------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 外貨建金額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (イスラエル) | | % | 千イスラエル・シケル | 千イスラエル・シケル | 千円 | | |
| ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30 | 国債証券 | 1.0000 | 2,810 | 2,424 | 95,761 | 2030/03/31 | |
| ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32 | 国債証券 | 1.3000 | 2,690 | 2,283 | 90,207 | 2032/04/30 | |
| ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25 | 国債証券 | 0.5000 | 4,380 | 4,121 | 162,826 | 2025/04/30 | |
| ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37 | 国債証券 | 1.5000 | 1,370 | 1,071 | 42,311 | 2037/05/31 | |
| ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25 | 国債証券 | 1.7500 | 2,330 | 2,260 | 89,290 | 2025/08/31 | |
| ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28 | 国債証券 | 2.2500 | 1,620 | 1,557 | 61,517 | 2028/09/28 | |
| ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26 | 国債証券 | 6.2500 | 3,700 | 4,208 | 166,254 | 2026/10/30 | |
| ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24 | 国債証券 | 0.4000 | 5,490 | 5,209 | 205,803 | 2024/10/31 | |
| ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23 | 国債証券 | 1.5000 | 1,630 | 1,618 | 63,934 | 2023/11/30 | |
| 小計 | - | - | 40,350 | 39,620 | 1,565,167 | - | |
| (デンマーク) | | % | 千デンマーク・クローネ | 千デンマーク・クローネ | 千円 | | |
| DENMARK 0.25 11/15/52 | 国債証券 | 0.2500 | 7,060 | 3,939 | 75,991 | 2052/11/15 | |
| DENMARK 4.5 11/15/39 | 国債証券 | 4.5000 | 18,120 | 23,727 | 457,700 | 2039/11/15 | |
| DENMARK 1.75 11/15/25 | 国債証券 | 1.7500 | 6,330 | 6,353 | 122,566 | 2025/11/15 | |
| DENMARK 1.5 11/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 3,600 | 3,626 | 69,962 | 2023/11/15 | |
| DENMARK 0.5 11/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 5,450 | 5,062 | 97,656 | 2027/11/15 | |
| DENMARK 0.5 11/15/29 | 国債証券 | 0.5000 | 18,520 | 16,608 | 320,371 | 2029/11/15 | |
| DENMARK 0.0 11/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 8,860 | 7,278 | 140,410 | 2031/11/15 | |
| DENMARK 0.0 11/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 11,030 | 10,655 | 205,543 | 2024/11/15 | |
| 小計 | - | - | 78,970 | 77,252 | 1,490,202 | - | |
| (ノルウェー) | | % | 千ノルウェー・クローネ | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | | |
| NORWAY 1.5 02/19/26 | 国債証券 | 1.5000 | 4,220 | 3,975 | 54,905 | 2026/02/19 | |
| NORWAY 1.75 02/17/27 | 国債証券 | 1.7500 | 9,840 | 9,219 | 127,328 | 2027/02/17 | |
| NORWAY 3.0 03/14/24 | 国債証券 | 3.0000 | 12,770 | 12,800 | 176,774 | 2024/03/14 | |
| NORWAY 1.75 03/13/25 | 国債証券 | 1.7500 | 1,250 | 1,205 | 16,643 | 2025/03/13 | |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国債証券 | 2.0000 | 13,360 | 12,553 | 173,357 | 2028/04/26 | |
| NORWAY 2.125 05/18/32 | 国債証券 | 2.1250 | 5,560 | 4,992 | 68,943 | 2032/05/18 | |
| NORWAY 1.375 08/19/30 | 国債証券 | 1.3750 | 8,130 | 7,017 | 96,915 | 2030/08/19 | |
| NORWAY 1.75 09/06/29 | 国債証券 | 1.7500 | 5,720 | 5,157 | 71,231 | 2029/09/06 | |
| NORWAY 1.25 09/17/31 | 国債証券 | 1.2500 | 2,450 | 2,048 | 28,294 | 2031/09/17 | |
| 小計 | - | - | 63,300 | 58,971 | 814,395 | - | |
| (スウェーデン) | | % | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | | |
| SWEDEN 3.5 03/30/39 | 国債証券 | 3.5000 | 6,290 | 7,714 | 103,684 | 2039/03/30 | |
| SWEDEN 0.75 05/12/28 | 国債証券 | 0.7500 | 12,680 | 11,752 | 157,947 | 2028/05/12 | |
| SWEDEN 2.5 05/12/25 | 国債証券 | 2.5000 | 16,220 | 16,349 | 219,743 | 2025/05/12 | |
| SWEDEN 0.125 05/12/31 | 国債証券 | 0.1250 | 6,650 | 5,687 | 76,436 | 2031/05/12 | |
| SWEDEN 2.25 06/01/32 | 国債証券 | 2.2500 | 7,530 | 7,796 | 104,783 | 2032/06/01 | |
| SWEDEN 1.5 11/13/23 | 国債証券 | 1.5000 | 5,230 | 5,205 | 69,961 | 2023/11/13 | |
| SWEDEN 1.0 11/12/26 | 国債証券 | 1.0000 | 21,800 | 20,773 | 279,197 | 2026/11/12 | |
| SWEDEN 0.75 11/12/29 | 国債証券 | 0.7500 | 4,810 | 4,402 | 59,172 | 2029/11/12 | |
| 小計 | - | - | 81,210 | 79,682 | 1,070,927 | - | |
| (メキシコ) | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | | |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26 | 国債証券 | 5.7500 | 63,554 | 56,014 | 378,924 | 2026/03/05 | |
| MEXICAN BONDS 03/04/27 | 国債証券 | 5.5000 | 20,000 | 17,032 | 115,219 | 2027/03/04 | |
| MEXICAN BONDS 03/06/25 | 国債証券 | 5.0000 | 19,510 | 17,383 | 117,593 | 2025/03/06 | |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 | 国債証券 | 8.5000 | 47,501 | 45,711 | 309,223 | 2029/05/31 | |
| MEXICAN BONDS 7.5 05/29/31 | 国債証券 | 7.7500 | 63,290 | 57,776 | 390,840 | 2031/05/29 | |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 国債証券 | 7.5000 | 54,445 | 50,476 | 341,458 | 2027/06/03 | |
| MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24 | 国債証券 | 8.0000 | 38,590 | 37,354 | 252,693 | 2024/09/05 | |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 国債証券 | 7.7500 | 24,328 | 21,114 | 142,833 | 2042/11/13 | |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47 | 国債証券 | 8.0000 | 37,956 | 33,559 | 227,019 | 2047/11/07 | |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38 | 国債証券 | 8.5000 | 41,653 | 39,190 | 265,108 | 2038/11/18 | |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34 | 国債証券 | 7.7500 | 16,011 | 14,312 | 96,819 | 2034/11/23 | |
| MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 国債証券 | 10.0000 | 55,000 | 55,429 | 374,962 | 2024/12/05 | |
| 小計 | - | - | 481,838 | 445,355 | 3,012,696 | - | |

| 銘柄 | 当期 | | | | | | 償還年月日 |
|-------------------------------------|------|--------|--------------|--------------|-----------|------------|-------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 外貨建金額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (中国) | | % | 千オフショア・人民元 | 千オフショア・人民元 | 千円 | | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27 | 国債証券 | 2.3700 | 25,000 | 24,759 | 504,326 | 2027/01/20 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32 | 国債証券 | 2.7500 | 17,000 | 16,888 | 343,999 | 2032/02/17 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 | 国債証券 | 2.2600 | 52,000 | 51,861 | 1,056,381 | 2025/02/24 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29 | 国債証券 | 2.8000 | 18,000 | 18,012 | 366,896 | 2029/03/24 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24 | 国債証券 | 2.2800 | 25,000 | 25,008 | 509,395 | 2024/03/17 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51 | 国債証券 | 3.7200 | 12,950 | 13,855 | 282,223 | 2051/04/12 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 04/15/27 | 国債証券 | 2.4800 | 10,000 | 9,950 | 202,679 | 2027/04/15 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31 | 国債証券 | 3.0200 | 21,500 | 21,773 | 443,504 | 2031/05/27 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 | 国債証券 | 3.0100 | 22,000 | 22,404 | 456,361 | 2028/05/13 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 | 国債証券 | 2.6800 | 23,500 | 23,253 | 473,660 | 2030/05/21 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 | 国債証券 | 2.6900 | 56,500 | 56,740 | 1,155,762 | 2026/08/12 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24 | 国債証券 | 2.4700 | 34,000 | 34,124 | 695,077 | 2024/09/02 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51 | 国債証券 | 3.5300 | 24,400 | 25,349 | 516,337 | 2051/10/18 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28 | 国債証券 | 2.9100 | 15,500 | 15,697 | 319,748 | 2028/10/14 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23 | 国債証券 | 2.5600 | 18,600 | 18,699 | 380,897 | 2023/10/21 | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27 | 国債証券 | 3.2800 | 23,500 | 24,353 | 496,050 | 2027/12/03 | |
| 小計 | - | - | 399,450 | 402,732 | 8,203,301 | - | |
| (マレーシア) | | % | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円 | | |
| MALAYSIA 3.892 03/15/27 | 国債証券 | 3.8920 | 1,370 | 1,362 | 42,255 | 2027/03/15 | |
| MALAYSIA 4.736 03/15/46 | 国債証券 | 4.7360 | 1,480 | 1,439 | 44,652 | 2046/03/15 | |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26 | 国債証券 | 4.3920 | 2,030 | 2,067 | 64,131 | 2026/04/15 | |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30 | 国債証券 | 4.4980 | 3,050 | 3,085 | 95,732 | 2030/04/15 | |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 国債証券 | 3.8440 | 3,510 | 3,302 | 102,459 | 2033/04/15 | |
| MALAYSIA 4.762 04/07/37 | 国債証券 | 4.7620 | 3,640 | 3,655 | 113,417 | 2037/04/07 | |
| MALAYSIA 2.632 04/15/31 | 国債証券 | 2.6320 | 2,090 | 1,829 | 56,746 | 2031/04/15 | |
| MALAYSIA 3.502 05/31/27 | 国債証券 | 3.5020 | 200 | 195 | 6,051 | 2027/05/31 | |
| MALAYSIA 3.757 05/22/40 | 国債証券 | 3.7570 | 3,750 | 3,287 | 102,002 | 2040/05/22 | |
| MALAYSIA 4.254 05/31/35 | 国債証券 | 4.2540 | 1,370 | 1,318 | 40,911 | 2035/05/31 | |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28 | 国債証券 | 3.7330 | 5,090 | 4,951 | 153,619 | 2028/06/15 | |
| MALAYSIA 4.232 06/30/31 | 国債証券 | 4.2320 | 4,200 | 4,156 | 128,951 | 2031/06/30 | |
| MALAYSIA 4.893 06/08/38 | 国債証券 | 4.8930 | 1,030 | 1,048 | 32,523 | 2038/06/08 | |
| MALAYSIA 3.478 06/14/24 | 国債証券 | 3.4780 | 1,830 | 1,832 | 56,845 | 2024/06/14 | |
| MALAYSIA 4.065 06/15/50 | 国債証券 | 4.0650 | 4,520 | 3,877 | 120,303 | 2050/06/15 | |
| MALAYSIA 4.181 07/15/24 | 国債証券 | 4.1810 | 3,500 | 3,558 | 110,389 | 2024/07/15 | |
| MALAYSIA 4.921 07/06/48 | 国債証券 | 4.9210 | 2,400 | 2,381 | 73,880 | 2048/07/06 | |
| MALAYSIA 3.906 07/15/26 | 国債証券 | 3.9060 | 1,810 | 1,808 | 56,094 | 2026/07/15 | |
| MALAYSIA 3.828 07/05/34 | 国債証券 | 3.8280 | 1,860 | 1,712 | 53,117 | 2034/07/05 | |
| MALAYSIA 3.885 08/15/29 | 国債証券 | 3.8850 | 3,910 | 3,808 | 118,153 | 2029/08/15 | |
| MALAYSIA 3.8 08/17/23 | 国債証券 | 3.8000 | 1,070 | 1,082 | 33,584 | 2023/08/17 | |
| MALAYSIA 3.955 09/15/25 | 国債証券 | 3.9550 | 4,750 | 4,783 | 148,399 | 2025/09/15 | |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43 | 国債証券 | 4.9350 | 580 | 583 | 18,101 | 2043/09/30 | |
| MALAYSIA 4.059 09/30/24 | 国債証券 | 4.0590 | 1,920 | 1,944 | 60,319 | 2024/09/30 | |
| MALAYSIA 4.696 10/15/42 | 国債証券 | 4.6960 | 920 | 904 | 28,047 | 2042/10/15 | |
| MALAYSIA 3.9 11/30/26 | 国債証券 | 3.9000 | 3,090 | 3,078 | 95,511 | 2026/11/30 | |
| MALAYSIA 3.899 11/16/27 | 国債証券 | 3.8990 | 2,000 | 1,978 | 61,374 | 2027/11/16 | |
| 小計 | - | - | 66,970 | 65,034 | 2,017,579 | - | |
| (ポーランド) | | % | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円 | | |
| POLAND 2.75 04/25/28 | 国債証券 | 2.7500 | 11,010 | 8,483 | 262,562 | 2028/04/25 | |
| POLAND 1.75 04/25/32 | 国債証券 | 1.7500 | 2,200 | 1,282 | 39,688 | 2032/04/25 | |
| POLAND 2.5 04/25/24 | 国債証券 | 2.5000 | 7,510 | 6,832 | 211,451 | 2024/04/25 | |
| POLAND 0.75 04/25/25 | 国債証券 | 0.7500 | 8,370 | 6,932 | 214,564 | 2025/04/25 | |
| POLAND 2.5 07/25/26 | 国債証券 | 2.5000 | 9,000 | 7,309 | 226,215 | 2026/07/25 | |
| POLAND 3.25 07/25/25 | 国債証券 | 3.2500 | 2,440 | 2,133 | 66,030 | 2025/07/25 | |
| POLAND 2.5 07/25/27 | 国債証券 | 2.5000 | 6,690 | 5,193 | 160,720 | 2027/07/25 | |
| POLAND 07/25/24 | 国債証券 | 0.0000 | 2,220 | 1,892 | 58,555 | 2024/07/25 | |

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

| 銘柄 | 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 1.4 06/22/53 | 国債証券 | 1.4000 | 160 | 110 | 15,850 | 2053/06/22 | |
| BELGIUM 2.25 06/22/57 | 国債証券 | 2.2500 | 870 | 750 | 107,665 | 2057/06/22 | |
| BELGIUM 2.15 06/22/66 | 国債証券 | 2.1500 | 740 | 608 | 87,348 | 2066/06/22 | |
| BELGIUM 0.65 06/22/71 | 国債証券 | 0.6500 | 1,040 | 443 | 63,613 | 2071/06/22 | |
| BELGIUM 1.0 06/22/26 | 国債証券 | 1.0000 | 3,000 | 2,923 | 419,426 | 2026/06/22 | |
| BELGIUM 2.6 06/22/24 | 国債証券 | 2.6000 | 850 | 873 | 125,321 | 2024/06/22 | |
| BELGIUM 1.0 06/22/31 | 国債証券 | 1.0000 | 2,110 | 1,899 | 272,503 | 2031/06/22 | |
| BELGIUM 0.8 06/22/28 | 国債証券 | 0.8000 | 2,000 | 1,879 | 269,676 | 2028/06/22 | |
| BELGIUM 0.4 06/22/40 | 国債証券 | 0.4000 | 1,120 | 747 | 107,167 | 2040/06/22 | |
| BELGIUM 0.9 06/22/29 | 国債証券 | 0.9000 | 2,400 | 2,225 | 319,201 | 2029/06/22 | |
| BELGIUM 3.0 06/22/34 | 国債証券 | 3.0000 | 1,540 | 1,618 | 232,211 | 2034/06/22 | |
| BELGIUM 1.9 06/22/38 | 国債証券 | 1.9000 | 2,120 | 1,908 | 273,850 | 2038/06/22 | |
| BELGIUM 0.8 06/22/25 | 国債証券 | 0.8000 | 2,750 | 2,692 | 386,277 | 2025/06/22 | |
| BELGIUM 0.8 06/22/27 | 国債証券 | 0.8000 | 3,830 | 3,643 | 522,759 | 2027/06/22 | |
| BELGIUM 1.45 06/22/37 | 国債証券 | 1.4500 | 310 | 263 | 37,858 | 2037/06/22 | |
| BELGIUM 0.1 06/22/30 | 国債証券 | 0.1000 | 3,100 | 2,638 | 378,550 | 2030/06/22 | |
| BELGIUM 0.5 10/22/24 | 国債証券 | 0.5000 | 5,100 | 5,006 | 718,222 | 2024/10/22 | |
| BELGIUM 0.0 10/22/31 | 国債証券 | 0.0000 | 3,190 | 2,582 | 370,416 | 2031/10/22 | |
| BELGIUM 0.2 10/22/23 | 国債証券 | 0.2000 | 70 | 69 | 9,963 | 2023/10/22 | |
| BELGIUM 0.0 10/22/27 | 国債証券 | 0.0000 | 800 | 725 | 104,122 | 2027/10/22 | |
| 小計 | - | - | 56,600 | 54,720 | 7,850,197 | - | |
| (ユーロ…フランス) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/27 | 国債証券 | 0.0000 | 1,640 | 1,506 | 216,186 | 2027/02/25 | |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/26 | 国債証券 | 0.0000 | 8,050 | 7,582 | 1,087,723 | 2026/02/25 | |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/24 | 国債証券 | 0.0000 | 5,000 | 4,922 | 706,180 | 2024/02/25 | |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/25 | 国債証券 | 0.0000 | 3,500 | 3,364 | 482,607 | 2025/02/25 | |
| FRANCE OAT 03/25/24 | 国債証券 | 0.0000 | 2,000 | 1,964 | 281,792 | 2024/03/25 | |
| FRANCE OAT 03/25/25 | 国債証券 | 0.0000 | 2,310 | 2,217 | 318,190 | 2025/03/25 | |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26 | 国債証券 | 3.5000 | 6,430 | 6,871 | 985,819 | 2026/04/25 | |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41 | 国債証券 | 4.5000 | 5,040 | 6,349 | 910,913 | 2041/04/25 | |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55 | 国債証券 | 4.0000 | 4,040 | 5,018 | 719,952 | 2055/04/25 | |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60 | 国債証券 | 4.0000 | 3,110 | 3,930 | 563,835 | 2060/04/25 | |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29 | 国債証券 | 5.5000 | 4,460 | 5,457 | 782,953 | 2029/04/25 | |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 国債証券 | 4.7500 | 4,900 | 6,120 | 878,100 | 2035/04/25 | |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 国債証券 | 3.2500 | 4,690 | 5,095 | 731,033 | 2045/05/25 | |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48 | 国債証券 | 2.0000 | 4,280 | 3,697 | 530,431 | 2048/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/50 | 国債証券 | 1.5000 | 5,420 | 4,111 | 589,786 | 2050/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/52 | 国債証券 | 0.7500 | 3,610 | 2,133 | 306,023 | 2052/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/53 | 国債証券 | 0.7500 | 1,420 | 817 | 117,237 | 2053/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 国債証券 | 1.7500 | 1,930 | 1,425 | 204,499 | 2066/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/72 | 国債証券 | 0.5000 | 1,510 | 603 | 86,532 | 2072/05/25 | |
| FRANCE OAT 2.25 05/25/24 | 国債証券 | 2.2500 | 6,880 | 7,021 | 1,007,373 | 2024/05/25 | |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 国債証券 | 2.5000 | 8,620 | 8,905 | 1,277,614 | 2030/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 5,900 | 5,515 | 791,273 | 2028/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31 | 国債証券 | 1.5000 | 8,910 | 8,427 | 1,209,061 | 2031/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25 | 国債証券 | 0.5000 | 7,760 | 7,537 | 1,081,263 | 2025/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/29 | 国債証券 | 0.5000 | 13,600 | 12,293 | 1,763,672 | 2029/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34 | 国債証券 | 1.2500 | 3,300 | 2,884 | 413,790 | 2034/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26 | 国債証券 | 0.5000 | 6,220 | 5,940 | 852,176 | 2026/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27 | 国債証券 | 1.0000 | 8,000 | 7,690 | 1,103,234 | 2027/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/40 | 国債証券 | 0.5000 | 2,270 | 1,572 | 225,529 | 2040/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 国債証券 | 1.2500 | 5,240 | 4,447 | 637,993 | 2036/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/38 | 国債証券 | 1.2500 | 1,160 | 955 | 137,008 | 2038/05/25 | |
| FRANCE OAT 0.0 05/25/32 | 国債証券 | 0.0000 | 1,200 | 954 | 136,895 | 2032/05/25 | |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39 | 国債証券 | 1.7500 | 5,750 | 5,102 | 731,987 | 2039/06/25 | |

| 銘柄 | 当期 | | | | | | 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 0.5 06/25/44 | 国債証券 | 0.5000 | 2,880 | 1,831 | 262,723 | 2044/06/25 | |
| FRANCE OAT 4.25 10/25/23 | 国債証券 | 4.2500 | 8,000 | 8,373 | 1,201,259 | 2023/10/25 | |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25 | 国債証券 | 6.0000 | 6,320 | 7,234 | 1,037,895 | 2025/10/25 | |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 国債証券 | 2.7500 | 6,390 | 6,677 | 957,972 | 2027/10/25 | |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38 | 国債証券 | 4.0000 | 3,530 | 4,198 | 602,324 | 2038/10/25 | |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | 国債証券 | 5.7500 | 7,690 | 10,104 | 1,449,629 | 2032/10/25 | |
| FRANCE OAT 1.75 11/25/24 | 国債証券 | 1.7500 | 6,990 | 7,056 | 1,012,363 | 2024/11/25 | |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25 | 国債証券 | 1.0000 | 6,200 | 6,077 | 871,870 | 2025/11/25 | |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26 | 国債証券 | 0.2500 | 7,530 | 7,045 | 1,010,697 | 2026/11/25 | |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 9,010 | 8,342 | 1,196,767 | 2028/11/25 | |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/31 | 国債証券 | 0.0000 | 7,570 | 6,133 | 879,915 | 2031/11/25 | |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/30 | 国債証券 | 0.0000 | 9,180 | 7,656 | 1,098,465 | 2030/11/25 | |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/29 | 国債証券 | 0.0000 | 6,760 | 5,809 | 833,491 | 2029/11/25 | |
| 小計 | - | - | 246,200 | 238,979 | 34,284,051 | - | |
| (ユーロ…ドイツ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24 | 国債証券 | 6.2500 | 1,180 | 1,279 | 183,500 | 2024/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 国債証券 | 5.6250 | 2,200 | 2,669 | 383,023 | 2028/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 | 国債証券 | 6.2500 | 2,930 | 3,880 | 556,686 | 2030/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31 | 国債証券 | 5.5000 | 3,340 | 4,345 | 623,358 | 2031/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37 | 国債証券 | 4.0000 | 4,600 | 5,788 | 830,362 | 2037/01/04 | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 | 国債証券 | 0.5000 | 4,330 | 4,244 | 608,975 | 2025/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 6,490 | 6,283 | 901,373 | 2026/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29 | 国債証券 | 0.2500 | 5,540 | 5,068 | 727,062 | 2029/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28 | 国債証券 | 0.5000 | 4,470 | 4,207 | 603,630 | 2028/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24 | 国債証券 | 1.7500 | 3,000 | 3,041 | 436,264 | 2024/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27 | 国債証券 | 0.2500 | 4,650 | 4,390 | 629,918 | 2027/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 3,300 | 2,853 | 409,378 | 2031/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 | 国債証券 | 0.0000 | 5,210 | 4,400 | 631,306 | 2032/02/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 3,490 | 3,077 | 441,540 | 2030/02/15 | |
| BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 1,930 | 1,898 | 272,334 | 2024/03/15 | |
| BUNDESUBL 04/05/24 | 国債証券 | 0.0000 | 3,490 | 3,429 | 492,032 | 2024/04/05 | |
| BUNDESUBL 0.0 04/11/25 | 国債証券 | 0.0000 | 4,620 | 4,457 | 639,440 | 2025/04/11 | |
| BUNDESUBL 0.0 04/10/26 | 国債証券 | 0.0000 | 3,100 | 2,937 | 421,409 | 2026/04/10 | |
| BUNDESUBL 0.0 04/16/27 | 国債証券 | 0.0000 | 2,000 | 1,857 | 266,476 | 2027/04/16 | |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24 | 国債証券 | 1.5000 | 4,280 | 4,316 | 619,307 | 2024/05/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35 | 国債証券 | 0.0000 | 90 | 70 | 10,071 | 2035/05/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36 | 国債証券 | 0.0000 | 4,350 | 3,320 | 476,338 | 2036/05/15 | |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27 | 国債証券 | 6.5000 | 1,670 | 2,066 | 296,449 | 2027/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 国債証券 | 4.7500 | 2,000 | 2,361 | 338,843 | 2028/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,990 | 2,638 | 378,533 | 2039/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 2,740 | 3,322 | 476,680 | 2042/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44 | 国債証券 | 2.5000 | 4,840 | 5,325 | 764,003 | 2044/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 国債証券 | 4.7500 | 2,810 | 3,976 | 570,487 | 2040/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 国債証券 | 4.7500 | 3,150 | 4,132 | 592,900 | 2034/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 4,590 | 5,110 | 733,165 | 2046/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52 | 国債証券 | 0.0000 | 1,950 | 1,084 | 155,623 | 2052/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | 国債証券 | 1.2500 | 5,220 | 4,494 | 644,829 | 2048/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25 | 国債証券 | 1.0000 | 6,640 | 6,568 | 942,362 | 2025/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 5,000 | 4,738 | 679,791 | 2027/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 08/15/26 | 国債証券 | 0.0000 | 3,680 | 3,466 | 497,310 | 2026/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 3,500 | 3,222 | 462,362 | 2028/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 | 国債証券 | 2.0000 | 3,730 | 3,788 | 543,540 | 2023/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24 | 国債証券 | 1.0000 | 6,600 | 6,578 | 943,715 | 2024/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 08/15/29 | 国債証券 | 0.0000 | 3,930 | 3,499 | 502,093 | 2029/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50 | 国債証券 | 0.0000 | 3,660 | 2,131 | 305,716 | 2050/08/15 | |

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

| 銘柄 | 当 | | | | 期 | | | 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 | 千円 | | |
| (ユーロ…スペイン) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | |
| SPAIN 2.15 10/31/25 | 国債証券 | 2.1500 | 4,460 | 4,502 | 645,968 | | 2025/10/31 | |
| SPAIN 1.45 10/31/27 | 国債証券 | 1.4500 | 5,000 | 4,799 | 688,584 | | 2027/10/31 | |
| SPAIN 1.3 10/31/26 | 国債証券 | 1.3000 | 3,540 | 3,430 | 492,185 | | 2026/10/31 | |
| SPAIN 0.6 10/31/29 | 国債証券 | 0.6000 | 2,530 | 2,215 | 317,774 | | 2029/10/31 | |
| SPAIN 4.4 10/31/23 | 国債証券 | 4.4000 | 6,420 | 6,702 | 961,543 | | 2023/10/31 | |
| SPAIN 0.5 10/31/31 | 国債証券 | 0.5000 | 3,000 | 2,445 | 350,829 | | 2031/10/31 | |
| SPAIN 1.2 10/31/40 | 国債証券 | 1.2000 | 1,580 | 1,140 | 163,612 | | 2040/10/31 | |
| SPAIN 1.25 10/31/30 | 国債証券 | 1.2500 | 4,770 | 4,287 | 615,121 | | 2030/10/31 | |
| 小計 | — | — | 149,420 | 143,687 | 20,613,341 | | — | |
| (ユーロ…イタリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | |
| ITALY BTPS 0.85 01/15/27 | 国債証券 | 0.8500 | 3,000 | 2,755 | 395,304 | | 2027/01/15 | |
| ITALY BTPS 0.0 01/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 1,850 | 1,806 | 259,222 | | 2024/01/15 | |
| ITALY BTPS 0.0 01/30/24 | 国債証券 | 0.0000 | 3,000 | 2,926 | 419,835 | | 2024/01/30 | |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 2,890 | 3,399 | 487,734 | | 2033/02/01 | |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37 | 国債証券 | 4.0000 | 6,440 | 6,638 | 952,430 | | 2037/02/01 | |
| ITALY BTPS 2.0 02/01/28 | 国債証券 | 2.0000 | 4,200 | 3,999 | 573,802 | | 2028/02/01 | |
| ITALY BTPS 0.35 02/01/25 | 国債証券 | 0.3500 | 2,810 | 2,685 | 385,289 | | 2025/02/01 | |
| ITALY BTPS 0.5 02/01/26 | 国債証券 | 0.5000 | 4,100 | 3,814 | 547,283 | | 2026/02/01 | |
| ITALY BTPS 0.45 02/15/29 | 国債証券 | 0.4500 | 5,000 | 4,175 | 598,945 | | 2029/02/15 | |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47 | 国債証券 | 2.7000 | 2,650 | 2,194 | 314,779 | | 2047/03/01 | |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 国債証券 | 3.4500 | 2,180 | 2,045 | 293,402 | | 2048/03/01 | |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/24 | 国債証券 | 4.5000 | 5,190 | 5,446 | 781,354 | | 2024/03/01 | |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67 | 国債証券 | 2.8000 | 1,440 | 1,113 | 159,812 | | 2067/03/01 | |
| ITALY BTPS 2.15 03/01/72 | 国債証券 | 2.1500 | 1,380 | 883 | 126,743 | | 2072/03/01 | |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/25 | 国債証券 | 5.0000 | 1,620 | 1,741 | 249,907 | | 2025/03/01 | |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26 | 国債証券 | 4.5000 | 3,220 | 3,450 | 494,969 | | 2026/03/01 | |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 国債証券 | 1.6500 | 30 | 25 | 3,628 | | 2032/03/01 | |
| ITALY BTPS 3.1 03/01/40 | 国債証券 | 3.1000 | 2,770 | 2,516 | 361,059 | | 2040/03/01 | |
| ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 国債証券 | 3.3500 | 3,000 | 2,880 | 413,246 | | 2035/03/01 | |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30 | 国債証券 | 3.5000 | 3,860 | 3,922 | 562,694 | | 2030/03/01 | |
| ITALY BTPS 1.45 03/01/36 | 国債証券 | 1.4500 | 2,050 | 1,551 | 222,598 | | 2036/03/01 | |
| ITALY BTPS 1.8 03/01/41 | 国債証券 | 1.8000 | 3,570 | 2,613 | 374,946 | | 2041/03/01 | |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/37 | 国債証券 | 0.9500 | 2,210 | 1,518 | 217,811 | | 2037/03/01 | |
| ITALY BTPS 0.25 03/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 4,610 | 3,934 | 564,396 | | 2028/03/15 | |
| ITALY BTPS 1.5 04/30/45 | 国債証券 | 1.5000 | 2,130 | 1,394 | 200,025 | | 2045/04/30 | |
| ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 国債証券 | 1.3500 | 4,000 | 3,454 | 495,532 | | 2030/04/01 | |
| ITALY BTPS 0.9 04/01/31 | 国債証券 | 0.9000 | 3,770 | 3,026 | 434,159 | | 2031/04/01 | |
| ITALY BTPS 0.0 04/01/26 | 国債証券 | 0.0000 | 3,420 | 3,097 | 444,366 | | 2026/04/01 | |
| ITALY BTPS 1.1 04/01/27 | 国債証券 | 1.1000 | 2,000 | 1,840 | 264,023 | | 2027/04/01 | |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31 | 国債証券 | 6.0000 | 4,300 | 5,118 | 734,269 | | 2031/05/01 | |
| ITALY BTPS 1.85 05/15/24 | 国債証券 | 1.8500 | 2,800 | 2,805 | 402,463 | | 2024/05/15 | |
| ITALY BTPS 1.45 05/15/25 | 国債証券 | 1.4500 | 5,490 | 5,362 | 769,323 | | 2025/05/15 | |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26 | 国債証券 | 1.6000 | 3,790 | 3,654 | 524,302 | | 2026/06/01 | |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25 | 国債証券 | 1.5000 | 5,910 | 5,780 | 829,280 | | 2025/06/01 | |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27 | 国債証券 | 2.2000 | 2,060 | 2,001 | 287,075 | | 2027/06/01 | |
| ITALY BTPS 0.95 06/01/32 | 国債証券 | 0.9500 | 3,250 | 2,523 | 362,039 | | 2032/06/01 | |
| ITALY BTPS 0.6 06/15/23 | 国債証券 | 0.6000 | 3,500 | 3,492 | 501,100 | | 2023/06/15 | |
| ITALY BTPS 2.1 07/15/26 | 国債証券 | 2.1000 | 3,540 | 3,466 | 497,343 | | 2026/07/15 | |
| ITALY BTPS 1.75 07/01/24 | 国債証券 | 1.7500 | 1,000 | 998 | 143,226 | | 2024/07/01 | |
| ITALY BTPS 0.5 07/15/28 | 国債証券 | 0.5000 | 1,500 | 1,290 | 185,192 | | 2028/07/15 | |
| ITALY BTPS 1.85 07/01/25 | 国債証券 | 1.8500 | 3,250 | 3,201 | 459,344 | | 2025/07/01 | |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34 | 国債証券 | 5.0000 | 690 | 773 | 110,984 | | 2034/08/01 | |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39 | 国債証券 | 5.0000 | 4,170 | 4,800 | 688,740 | | 2039/08/01 | |
| ITALY BTPS 4.75 08/01/23 | 国債証券 | 4.7500 | 5,830 | 6,064 | 869,993 | | 2023/08/01 | |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国債証券 | 2.0500 | 3,000 | 2,882 | 413,507 | | 2027/08/01 | |

| 銘柄 | 当期 | | | | | | 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…イタリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| ITALY BTPS 3.0 08/01/29 | 国債証券 | 3.0000 | 4,790 | 4,716 | 676,666 | 2029/08/01 | |
| ITALY BTPS 0.6 08/01/31 | 国債証券 | 0.6000 | 3,000 | 2,310 | 331,509 | 2031/08/01 | |
| ITALY BTPS 0.95 08/01/30 | 国債証券 | 0.9500 | 4,750 | 3,917 | 561,979 | 2030/08/01 | |
| ITALY BTPS 0.3 08/15/23 | 国債証券 | 0.3000 | 3,710 | 3,681 | 528,090 | 2023/08/15 | |
| ITALY BTPS 0.0 08/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 1,000 | 960 | 137,778 | 2024/08/15 | |
| ITALY BTPS 0.0 08/01/26 | 国債証券 | 0.0000 | 2,000 | 1,793 | 257,223 | 2026/08/01 | |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 国債証券 | 2.9500 | 2,240 | 2,022 | 290,211 | 2038/09/01 | |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国債証券 | 4.7500 | 2,810 | 3,192 | 458,053 | 2044/09/01 | |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国債証券 | 3.2500 | 1,940 | 1,774 | 254,501 | 2046/09/01 | |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国債証券 | 4.7500 | 5,480 | 5,988 | 859,101 | 2028/09/01 | |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40 | 国債証券 | 5.0000 | 2,950 | 3,408 | 488,931 | 2040/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 国債証券 | 2.4500 | 1,770 | 1,346 | 193,160 | 2050/09/01 | |
| ITALY BTPS 1.7 09/01/51 | 国債証券 | 1.7000 | 3,660 | 2,312 | 331,739 | 2051/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国債証券 | 2.4500 | 2,960 | 2,621 | 376,064 | 2033/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.15 09/01/52 | 国債証券 | 2.1500 | 1,180 | 811 | 116,415 | 2052/09/01 | |
| ITALY BTPS 3.75 09/01/24 | 国債証券 | 3.7500 | 2,000 | 2,078 | 298,168 | 2024/09/01 | |
| ITALY BTPS 3.85 09/01/49 | 国債証券 | 3.8500 | 1,800 | 1,793 | 257,324 | 2049/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 2,260 | 1,896 | 272,117 | 2036/09/01 | |
| ITALY BTPS 0.95 09/15/27 | 国債証券 | 0.9500 | 2,000 | 1,812 | 260,035 | 2027/09/15 | |
| ITALY BTPS 0.65 10/15/23 | 国債証券 | 0.6500 | 3,840 | 3,810 | 546,636 | 2023/10/15 | |
| ITALY BTPS 2.45 10/01/23 | 国債証券 | 2.4500 | 1,240 | 1,258 | 180,534 | 2023/10/01 | |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27 | 国債証券 | 6.5000 | 3,400 | 4,018 | 576,439 | 2027/11/01 | |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 国債証券 | 5.2500 | 6,440 | 7,308 | 1,048,421 | 2029/11/01 | |
| ITALY BTPS 1.45 11/15/24 | 国債証券 | 1.4500 | 1,000 | 985 | 141,344 | 2024/11/15 | |
| ITALY BTPS 2.5 11/15/25 | 国債証券 | 2.5000 | 3,000 | 3,008 | 431,570 | 2025/11/15 | |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25 | 国債証券 | 2.0000 | 3,610 | 3,557 | 510,358 | 2025/12/01 | |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 国債証券 | 1.2500 | 3,020 | 2,838 | 407,185 | 2026/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/24 | 国債証券 | 2.5000 | 4,090 | 4,129 | 592,374 | 2024/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28 | 国債証券 | 2.8000 | 4,660 | 4,579 | 657,041 | 2028/12/01 | |
| ITALY BTPS 0.95 12/01/31 | 国債証券 | 0.9500 | 70 | 55 | 7,925 | 2031/12/01 | |
| ITALY BTPS 1.65 12/01/30 | 国債証券 | 1.6500 | 3,660 | 3,174 | 455,361 | 2030/12/01 | |
| ITALY BTPS 0.0 12/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 3,000 | 2,845 | 408,150 | 2024/12/15 | |
| 小計 | — | — | 235,800 | 225,079 | 32,289,916 | — | |
| (ユーロ…フィンランド) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| FINLAND 0.125 04/15/52 | 国債証券 | 0.1250 | 420 | 214 | 30,830 | 2052/04/15 | |
| FINLAND 2.0 04/15/24 | 国債証券 | 2.0000 | 3,460 | 3,523 | 505,452 | 2024/04/15 | |
| FINLAND 0.75 04/15/31 | 国債証券 | 0.7500 | 980 | 872 | 125,099 | 2031/04/15 | |
| FINLAND 1.375 04/15/47 | 国債証券 | 1.3750 | 330 | 263 | 37,861 | 2047/04/15 | |
| FINLAND 0.5 04/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 2,900 | 2,778 | 398,623 | 2026/04/15 | |
| FINLAND 1.125 04/15/34 | 国債証券 | 1.1250 | 1,900 | 1,656 | 237,687 | 2034/04/15 | |
| FINLAND 0.5 04/15/43 | 国債証券 | 0.5000 | 100 | 66 | 9,561 | 2043/04/15 | |
| FINLAND 0.125 04/15/36 | 国債証券 | 0.1250 | 180 | 131 | 18,869 | 2036/04/15 | |
| FINLAND 4.0 07/04/25 | 国債証券 | 4.0000 | 290 | 312 | 44,819 | 2025/07/04 | |
| FINLAND 2.75 07/04/28 | 国債証券 | 2.7500 | 160 | 167 | 24,050 | 2028/07/04 | |
| FINLAND 2.625 07/04/42 | 国債証券 | 2.6250 | 1,720 | 1,737 | 249,196 | 2042/07/04 | |
| FINLAND 0.5 09/15/29 | 国債証券 | 0.5000 | 1,060 | 951 | 136,494 | 2029/09/15 | |
| FINLAND 0.5 09/15/28 | 国債証券 | 0.5000 | 90 | 82 | 11,800 | 2028/09/15 | |
| FINLAND 0.5 09/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 10 | 9 | 1,339 | 2027/09/15 | |
| FINLAND 0.25 09/15/40 | 国債証券 | 0.2500 | 1,020 | 684 | 98,268 | 2040/09/15 | |
| FINLAND 0.125 09/15/31 | 国債証券 | 0.1250 | 180 | 149 | 21,404 | 2031/09/15 | |
| FINLAND 0.0 09/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 880 | 739 | 106,062 | 2030/09/15 | |
| FINLAND 0.0 09/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 100 | 97 | 13,981 | 2024/09/15 | |
| 小計 | — | — | 15,780 | 14,438 | 2,071,402 | — | |
| (ユーロ…オーストリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62 | 国債証券 | 3.8000 | 1,640 | 2,084 | 299,028 | 2062/01/26 | |

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

■投資信託財産の構成

2022年6月22日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|-------------|---|-------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 公 社 債 | 千円 | | % |
| 公 社 債 | 391,873,402 | | 98.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 5,999,761 | | 1.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 397,873,163 | | 100.0 |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、396,133,568千円、99.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.49円、1カナダ・ドル=105.41円、1オーストラリア・ドル=94.71円、1シンガポール・ドル=98.39円、1イギリス・ポンド=167.12円、1イスラエル・シェケル=39.504円、1デンマーク・クローネ=19.29円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローナ=13.44円、1メキシコ・ペソ=6.764円、1オフショア・人民元=20.369円、1マレーシア・リンギット=31.023円、1ポーランド・ズロチ=30.948円、1ユーロ=143.46円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月22日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

| | |
|---|------------------|
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) | 4,004,181,571円 |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用) | 178,452,757円 |
| しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定) | 854,354,230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) | 525,449,535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) | 48,155,676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) | 334,162,100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) | 639,323,897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) | 899,271,353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) | 698,032,316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) | 2,403,879,369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) | 3,179,279,422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) | 126,409,489円 |
| 期末元本合計 | 301,416,347,543円 |

■損益の状況

当期 自2021年6月23日 至2022年6月22日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|------------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 9,182,555,387 | 円 |
| | 受取利息 | 9,184,824,272 | |
| | その他の収益 | 241,313 | |
| | 支払利息 | △2,510,198 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | △73,578,958,793 | |
| | 売却益 | 118,689,796,094 | |
| | 売却損 | △192,268,754,887 | |
| (C) | その他の費用 | △77,317,894 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | △64,473,721,300 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 173,515,474,368 | |
| (F) | 解約差損益金 | △383,745,218,616 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 349,137,327,050 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | 74,433,861,502 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 74,433,861,502 | |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2022年2月15日）

（計算期間 2021年2月16日～2022年2月15日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | MSCIコクサイ・インデックス | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|------|---------------------------------------|-----------|------------|------------|----------------|
| | 円 | 騰落率 | （円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | 騰落率 | | | |
| 16期(2018年2月15日) | 33,302 | 10.0 | ポイント 1,070,930.74 | % 10.2 | % 95.7 | % 2.2 | 百万円 284,448 |
| 17期(2019年2月15日) | 34,418 | 3.4 | 1,111,144.35 | 3.8 | 95.3 | 2.0 | 349,689 |
| 18期(2020年2月17日) | 41,812 | 21.5 | 1,354,548.25 | 21.9 | 94.7 | 2.7 | 370,420 |
| 19期(2021年2月15日) | 47,083 | 12.6 | 1,529,401.79 | 12.9 | 95.5 | 2.5 | 477,565 |
| 20期(2022年2月15日) | 56,820 | 20.7 | 1,849,569.21 | 20.9 | 93.1 | 1.8 | 642,642 |

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

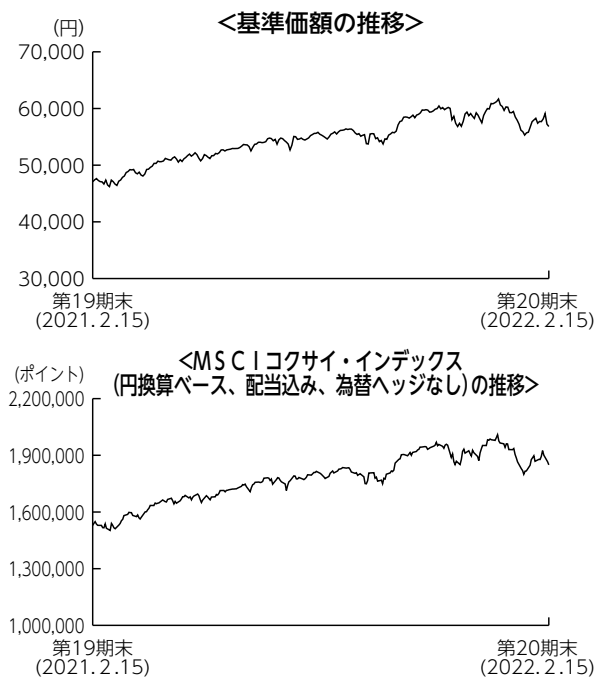
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 株式組入 比 率 | 株式先物 比 率 |
|-------------------------|---------|--------|--|--------|-------------|-------------|
| | 円 | 騰 落 率 | ポイント | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2021年 2 月 15 日 | 47,083 | % - | 1,529,401.79 | % - | % 95.5 | % 2.5 |
| 2 月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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月16日から2022年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は56,820円となり、前期末比で20.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

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

期末

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



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で20.9%上昇しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|---------------------------------------|---|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投 資 証 券) | 3円 (3) (0) (1) (0) (0) | 0.006% (0.005) (0.000) (0.001) (0.000) (0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (b) 有価証券取引税 (株 式) (投資信託受益証券) (投 資 証 券) | 14 (14) (0) (0) | 0.025 (0.025) (0.000) (0.000) | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 22 (0) (22) | 0.040 (0.000) (0.040) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 39 | 0.071 | |
| 期中の平均基準価額は54,626円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年2月16日から2022年2月15日まで)

(1) 株 式

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-------|---------|---------------|---------------------|-----------------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外 国 | ス イ ス | 証券 - | 千スイス・フラン - | 証券 87,844 (-) | 千スイス・フラン 28 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---------------------------------|--|-------------------|--------------|---------------|--------------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | | 7.915 (-) | 1,611 (-) | 6.133 (-) | 1,247 (-) |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 4.07 (-) | 473 (-) | 2.216 (-) | 274 (-) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | | - (-) | - (-) | 22.693 (-) | 657 (-) |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | | 81.1 (-) | 686 (-) | 58.509 (-) | 493 (-) |
| PROLOGIS INC | | 46.303 (-) | 6,342 (-) | 40.623 (-) | 5,636 (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 9.677 (-) | 2,226 (-) | 8.65 (-) | 2,022 (-) |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 12.453 (-) | 1,811 (-) | 11.656 (-) | 1,653 (-) |
| EQUINIX INC | | 6.083 (-) | 4,781 (-) | 5.373 (-) | 4,212 (-) |
| DUKE REALTY TRUST | | 12.617 (-) | 708 (-) | 9.24 (-) | 546 (-) |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | | 28.217 (-) | 5,245 (-) | 25.02 (-) | 4,595 (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | | 3.092 (-) | 988 (-) | 2.464 (-) | 802 (-) |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 30.821 (-) | 2,566 (-) | 31.532 (-) | 2,583 (-) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | | 23.858 (-) | 795 (-) | 19.455 (-) | 665 (-) |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | | 6.199 (-) | 2,128 (-) | 5.486 (-) | 1,933 (-) |
| WELLTOWER INC | | 32.254 (-) | 2,651 (-) | 29.921 (-) | 2,444 (-) |
| IRON MOUNTAIN INC | | 3.849 (-) | 175 (-) | - (-) | - (-) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | | 22.487 (-) | 1,784 (-) | 22.001 (-) | 1,743 (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | | 44.413 (-) | 716 (-) | 32.749 (-) | 518 (-) |
| MID AMERICA | | 5.789 (-) | 1,109 (-) | 4.944 (-) | 931 (-) |
| REALTY INCOME CORP | | 41.631 (18.05) | 2,829 (-) | 35.88 (-) | 2,454 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------|-----------|-------------|---------|-------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| REGENCY CENTERS CORP | 3.639 | 260 | 3.473 | 270 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UDR INC | 38.514 | 2,062 | 37.282 | 1,986 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 21.117 | 2,879 | 17.329 | 2,452 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PUBLIC STORAGE | 10.449 | 3,254 | 9.007 | 2,855 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 5.79 | 1,099 | 4.394 | 857 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VENTAS INC | 19.098 | 1,052 | 13.711 | 712 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | 23.728 | 1,062 | 21.319 | 914 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WEYERHAEUSER CO | 48.016 | 1,759 | 39.928 | 1,479 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 8.076 | 1,464 | 6.463 | 1,122 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 19.54 | 3,025 | 15.672 | 2,491 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 76.011 | 1,576 | 75.842 | 1,601 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AGNC INVESTMENT CORP | 50.845 | 783 | 52.553 | 814 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VEREIT INC | 23.054 | 1,081 | 17.984 | 838 |
| | (△25.604) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN TOWER CORP | 28.174 | 7,568 | 23.609 | 6,307 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WP CAREY INC | 20.944 | 1,621 | 17.027 | 1,295 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVITATION HOMES INC | 47.749 | 1,885 | 43.017 | 1,704 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ORION OFFICE REIT INC | - | - | 5.738 | 100 |
| | (5.738) | (-) | (-) | (-) |
| VICI PROPERTIES INC | 43.226 | 1,246 | 32.427 | 906 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 4.337 | 241 | 4.071 | 223 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| MIRVAC GROUP | 84.707 | 247 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GPT GROUP | 49.06 | 236 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STOCKLAND | 49.463 | 231 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DEXUS | 119.11 | 1,246 | 126.88 | 1,329 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN GROUP | 122.45 | 2,770 | 112.622 | 2,653 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SCENTRE GROUP | 179.768 | 543 | 120.66 | 390 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---|-------------------|---------------|---------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| LINK REIT | 212.6 (-) | 14,716 (-) | 213.1 (-) | 14,405 (-) |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 295.4 (57,741) | 611 (89) | 291.6 (-) | 604 (-) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 478 (-) | 1,446 (△6) | 522 (-) | 1,533 (-) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | - (-) | - (-) | 192.1 (-) | 272 (-) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 473 (-) | 849 (△4) | 258.6 (-) | 480 (-) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | - (-) | - (△1) | - (-) | - (-) |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 76.052 (-) | 389 (-) | 70.101 (-) | 371 (-) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 18.185 (-) | 127 (-) | - (-) | - (-) |
| SEGRO PLC | 53.28 (-) | 602 (-) | 33.876 (-) | 385 (-) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GECINA SA | 1.093 (-) | 145 (-) | - (-) | - (-) |
| KLEPIERRE | - (-) | - (△17) | - (-) | - (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|--------------|----------------|----------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 株式先物取引 | 百万円 213,419 | 百万円 216,105 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 744,105,008千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 572,165,051千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b) | 1.30 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2021年2月16日から2022年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|--------------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (デンマーク) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| GN STORE NORD A/S | 128.95 | 104.48 | 3,823 | 67,072 | ヘルスケア機器・用品 |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 181.27 | 979.91 | 15,952 | 279,814 | 電気設備 |
| COLOPLAST-B | 107.34 | 119.22 | 10,925 | 191,630 | ヘルスケア機器・用品 |
| DSV A/S | 190.49 | 198.61 | 25,044 | 439,284 | 航空貨物・物流サービス |
| DEMANT A/S | 107.39 | 107.39 | 2,870 | 50,349 | ヘルスケア機器・用品 |
| H LUNDBECK A/S | 48.4 | — | — | — | 医薬品 |
| TRYG A/S | 111.07 | 357.84 | 5,439 | 95,403 | 保険 |
| PANDORA A/S | 82.51 | 92.65 | 6,650 | 116,648 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 93.36 | 89.84 | 4,288 | 75,228 | 化学 |
| AMBU A/S B | 141.56 | 141.56 | 1,705 | 29,919 | ヘルスケア機器・用品 |
| ORSTED A/S | 164.71 | 192.05 | 12,586 | 220,775 | 電力 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,845.94 19銘柄 | 5,086.83 18銘柄 | 257,006 — | 4,507,892 <0.7%> |
| (ノルウェー) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| MOWI ASA | 435.37 | 432.02 | 10,161 | 132,094 | 食品 |
| DNB ASA | 807.09 | — | — | — | 銀行 |
| NORSK HYDRO ASA | 1,290.36 | 1,290.36 | 9,984 | 129,802 | 金属・鉱業 |
| TELENOR ASA | 630.38 | 674.35 | 9,258 | 120,364 | 各種電気通信サービス |
| SCHIBSTED ASA | 75.37 | 75.37 | 1,746 | 22,702 | メディア |
| ORKLA ASA | 652.83 | 694.4 | 5,862 | 76,207 | 食品 |
| EQUINOR ASA | 831.49 | 943.06 | 25,816 | 335,611 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 151.93 | 151.93 | 6,730 | 87,496 | 化学 |
| AKER BP ASA | — | 152.17 | 4,129 | 53,688 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 166.83 | 294.84 | 6,262 | 81,411 | 保険 |
| ADEVINTA ASA | 222.65 | 222.65 | 1,847 | 24,023 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| DNB BANK ASA | — | 895.96 | 19,003 | 247,043 | 銀行 |
| SCHIBSTED ASA | 74.45 | 74.45 | 1,514 | 19,686 | メディア |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 5,338.75 11銘柄 | 5,901.56 12銘柄 | 102,317 — | 1,330,132 <0.2%> |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 564.89 | 636.97 | 31,695 | 389,856 | 機械 |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 360.51 | 401.9 | 17,474 | 214,937 | 機械 |
| ERICSSON LM-B SHS | 2,649.68 | 2,794.5 | 32,175 | 395,763 | 通信機器 |
| GETINGE AB-B SHS | — | 244.21 | 8,667 | 106,604 | ヘルスケア機器・用品 |
| INVESTOR AB-A SHS | — | 557.33 | 11,531 | 141,833 | 各種金融サービス |
| LUNDBERGS B | 73.82 | 73.82 | 3,471 | 42,702 | 各種金融サービス |
| SKF AB-B SHS | 348.49 | 322.28 | 6,055 | 74,484 | 機械 |
| SANDVIK AB | 1,034 | 1,143.71 | 26,637 | 327,635 | 機械 |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 1,449.9 | 1,664.38 | 20,072 | 246,890 | 銀行 |
| SKANSKA AB-B SHS | 316.53 | 319.68 | 7,624 | 93,779 | 建設・土木 |
| SWEDBANK AB | 798.25 | 893.78 | 15,061 | 185,262 | 銀行 |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | 529.45 | 543.82 | 8,807 | 108,328 | 紙製品・林産品 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 1,392.3 | 1,340.2 | 12,981 | 159,668 | 銀行 |
| VOLVO AB-A SHS | — | 236.91 | 5,041 | 62,009 | 機械 |
| VOLVO AB-B SHS | 1,305.9 | 1,342.82 | 28,320 | 348,336 | 機械 |
| SWEDISH MATCH AB | 138.45 | 1,583.29 | 11,026 | 135,620 | タバコ |
| TELE2 AB-B SHS | 470.55 | 460.83 | 6,020 | 74,055 | 無線通信サービス |
| INDUSTRIVARDEN A | 119.55 | 142.73 | 4,104 | 50,490 | 各種金融サービス |
| INDUSTRIVARDEN C | 114.03 | 119.4 | 3,371 | 41,473 | 各種金融サービス |
| ELECTROLUX AB-SER B | 191.91 | 252.19 | 4,546 | 55,927 | 家庭用耐久財 |
| SECURITAS AB-B SHS | 240.98 | 483.54 | 5,751 | 70,746 | 商業サービス・用品 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|-------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------|---------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | |
| INVESTOR AB-B SHS | 395.67 | 1,694.19 | 33,029 | 406,268 | 各種金融サービス |
| HENNES&MAURITZ AB-B SHS | 688.14 | 662.7 | 11,793 | 145,058 | 専門小売り |
| ASSA ABLOY AB-B | 870.21 | 1,010.25 | 26,418 | 324,941 | 建設関連製品 |
| TELIA CO AB | 2,104.77 | 2,699.54 | 10,043 | 123,536 | 各種電気通信サービス |
| LUNDIN ENERGY AB | 147.39 | 207.62 | 7,019 | 86,341 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BOLIDEN AB | 283.76 | 240.47 | 9,638 | 118,547 | 金属・鉱業 |
| ALFA LAVAL AB | 283.92 | 279.3 | 7,932 | 97,565 | 機械 |
| KINNEVIK AB-B | 217.22 | 214.49 | 5,430 | 66,799 | 各種金融サービス |
| FASTIGHETS AB BALDER | 89.67 | 114.01 | 6,687 | 82,260 | 不動産管理・開発 |
| ICA GRUPPEN AB | 90.09 | - | - | - | 食品・生活必需品小売り |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 336.92 | 451.58 | 5,477 | 67,375 | 機械 |
| NIBE INDUSTRIER AB | 288.34 | 1,340.88 | 11,416 | 140,419 | 建設関連製品 |
| HEXAGON AB-B SHS | 265.34 | 1,852.43 | 22,738 | 279,684 | 電子装置・機器・部品 |
| SAGAX AB | - | 183.48 | 4,678 | 57,548 | 不動産管理・開発 |
| EPIROC AB-A | 607.5 | 593.63 | 11,273 | 138,658 | 機械 |
| EPIROC AB-B | 308.99 | 389.43 | 6,308 | 77,597 | 機械 |
| ESSITY AB-B | 521.43 | 576.54 | 15,249 | 187,568 | 家庭用品 |
| EQT AB | 209.34 | 300.03 | 10,171 | 125,103 | 資本市場 |
| EMBRACER GROUP AB | - | 491.42 | 4,155 | 51,118 | 娯楽 |
| LIFCO AB | - | 257.38 | 5,237 | 64,423 | コングロマリット |
| EVOLUTION AB | 136.41 | 161.47 | 17,115 | 210,524 | ホテル・レストラン・レジャー |
| NORDEA BANK ABP | 2,957.52 | 3,102.72 | 34,018 | 418,424 | 銀行 |
| INVESTMENT AB LATOUR | 149.45 | 149.45 | 3,987 | 49,044 | コングロマリット |
| SINCH AB | - | 562.99 | 5,393 | 66,339 | ソフトウェア |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 23,051.27 38銘柄 | 33,094.29 44銘柄 | 545,655 - | 6,711,557 <1.0%> |
| (ユーロ…アイルランド) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| CRH PLC | 716.53 | 755.8 | 3,302 | 431,120 | 建設資材 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 141.28 | 175.84 | 2,343 | 305,910 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KERRY GROUP PLC-A | 147.3 | 149.68 | 1,607 | 209,883 | 食品 |
| KINGSPAN GROUP PLC | 134.52 | 143.07 | 1,244 | 162,509 | 建設関連製品 |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 208.7 | 242.28 | 1,139 | 148,765 | 容器・包装 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,348.33 5銘柄 | 1,466.67 5銘柄 | 9,636 - | 1,258,190 <0.2%> |
| (ユーロ…オランダ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| AIRBUS SE | 531.76 | 575.35 | 6,691 | 873,618 | 航空宇宙・防衛 |
| KONINKLIJKE DSM NV | 152.1 | 168.59 | 2,683 | 350,306 | 化学 |
| ING GROEP NV-CVA | 3,448.92 | 3,804.32 | 4,902 | 640,037 | 銀行 |
| ASM INTERNATIONAL NV | - | 42.71 | 1,167 | 152,398 | 半導体・半導体製造装置 |
| RANDSTAD NV | 126.01 | 112.39 | 707 | 92,326 | 専門サービス |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 992.8 | 1,063.9 | 3,060 | 399,623 | 食品・生活必需品小売り |
| HEINEKEN NV | 226.83 | 245.94 | 2,291 | 299,136 | 飲料 |
| AKZO NOBEL | 179.59 | 187.17 | 1,717 | 224,184 | 化学 |
| ASML HOLDING NV | 380.98 | 403.14 | 22,563 | 2,945,922 | 半導体・半導体製造装置 |
| AEGON NV | 1,503.49 | 1,893.23 | 909 | 118,770 | 保険 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 829.19 | 886.59 | 2,596 | 338,983 | ヘルスケア機器・用品 |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 257.15 | 266.29 | 2,328 | 304,001 | 専門サービス |
| STMICROELECTRONICS NV | 541.76 | 650.99 | 2,545 | 332,323 | 半導体・半導体製造装置 |
| QIAGEN N.V. | 207.63 | 204.27 | 876 | 114,412 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| VOPAK (KON.) | 53.64 | - | - | - | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 3,478.24 | 3,414.47 | 1,051 | 137,304 | 各種電気通信サービス |

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 外国新株予約権証券

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

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|---------------------------------|---|---------|--------|----------|-----------|----|-----|
| | | 数 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | |
| | | □ | □ | | | | |
| 不動産ファンド | | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | | % |
| (アメリカ) | | | | | | | |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | | 12.006 | 13.788 | 2,531 | 292,214 | | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 12.947 | 14.801 | 1,730 | 199,789 | | 0.0 |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | | 22.693 | - | - | - | | - |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | | 127.559 | 150.15 | 1,079 | 124,604 | | 0.0 |
| PROLOGIS INC | | 66.35 | 72.03 | 10,468 | 1,208,313 | | 0.2 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 12.329 | 13.356 | 3,180 | 367,120 | | 0.1 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 9.643 | 10.44 | 1,691 | 195,243 | | 0.0 |
| EQUINIX INC | | 7.992 | 8.702 | 5,824 | 672,315 | | 0.1 |
| DUKE REALTY TRUST | | 31.929 | 35.306 | 1,925 | 222,292 | | 0.0 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | | 38.831 | 42.028 | 7,043 | 812,909 | | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | | 5.504 | 6.132 | 1,939 | 223,898 | | 0.0 |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 35.108 | 34.397 | 2,955 | 341,111 | | 0.1 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | | 45.543 | 49.946 | 1,603 | 185,049 | | 0.0 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | | 9.838 | 10.551 | 3,263 | 376,725 | | 0.1 |
| WELLTOWER INC | | 38.411 | 40.744 | 3,246 | 374,661 | | 0.1 |
| IRON MOUNTAIN INC | | 24.591 | 28.44 | 1,241 | 143,283 | | 0.0 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | | 16.087 | 16.573 | 1,268 | 146,429 | | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | | 63.952 | 75.616 | 1,355 | 156,485 | | 0.0 |
| MID AMERICA | | 10.854 | 11.699 | 2,428 | 280,294 | | 0.0 |
| REALTY INCOME CORP | | 29.466 | 53.267 | 3,563 | 411,244 | | 0.1 |
| REGENCY CENTERS CORP | | 14.499 | 14.665 | 955 | 110,292 | | 0.0 |
| UDR INC | | 27.057 | 28.289 | 1,544 | 178,308 | | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | | 28.083 | 31.871 | 4,458 | 514,629 | | 0.1 |
| PUBLIC STORAGE | | 13.834 | 15.276 | 5,432 | 627,048 | | 0.1 |
| SUN COMMUNITIES INC | | 9.67 | 11.066 | 2,093 | 241,678 | | 0.0 |
| VENTAS INC | | 35.021 | 40.408 | 2,022 | 233,474 | | 0.0 |
| VORNADO REALTY TRUST | | 12.714 | 15.123 | 616 | 71,111 | | 0.0 |
| WEYERHAEUSER CO | | 64.096 | 72.184 | 2,953 | 340,840 | | 0.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | | 12.385 | 13.998 | 2,718 | 313,775 | | 0.0 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | | 23.492 | 27.36 | 3,724 | 429,915 | | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | | 53.911 | 54.08 | 1,123 | 129,706 | | 0.0 |
| AGNC INVESTMENT CORP | | 46.028 | 44.32 | 607 | 70,132 | | 0.0 |
| VEREIT INC | | 20.534 | - | - | - | | - |
| AMERICAN TOWER CORP | | 39.736 | 44.301 | 10,379 | 1,197,976 | | 0.2 |
| WP CAREY INC | | 15.529 | 19.446 | 1,474 | 170,174 | | 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | |
|----------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|------------------|---------|-----------|
| | □ 数 | □ 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 末 |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % | |
| INVITATION HOMES INC | 50.475 | 55.207 | 2,285 | 263,800 | 0.0 | |
| VICI PROPERTIES INC | 47.083 | 57.882 | 1,629 | 188,129 | 0.0 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | □ 数 銘柄 数<比率> | 金額 1,135.78 | 金額 11,814.981 | 比率 - | 比率 1.8 |
| | | | 37銘柄<1.8%> | 35銘柄<1.8%> | - | - |
| (カナダ) | 千口 | 千口 | 千カナダ・ドル | 千円 | % | |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 7.954 | 8.22 | 456 | 41,361 | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 13.467 | 13.467 | 319 | 28,966 | 0.0 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | □ 数 銘柄 数<比率> | 金額 21.421 | 金額 70,328 | 比率 - | 比率 0.0 |
| | | | 2銘柄<0.0%> | 2銘柄<0.0%> | - | - |
| (オーストラリア) | 千口 | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | % | |
| MIRVAC GROUP | 329.418 | 414.125 | 1,031 | 84,875 | 0.0 | |
| GPT GROUP | 158.232 | 207.292 | 1,048 | 86,334 | 0.0 | |
| STOCKLAND | 194.018 | 243.481 | 954 | 78,560 | 0.0 | |
| DEXUS | 108.972 | 101.202 | 1,028 | 84,632 | 0.0 | |
| GOODMAN GROUP | 148.357 | 158.185 | 3,609 | 297,121 | 0.0 | |
| VICINITY CENTRES | 371.711 | 371.711 | 631 | 52,012 | 0.0 | |
| SCENTRE GROUP | 420.268 | 479.376 | 1,414 | 116,399 | 0.0 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | □ 数 銘柄 数<比率> | 金額 1,730.976 | 金額 799,936 | 比率 - | 比率 0.1 |
| | | | 7銘柄<0.1%> | 7銘柄<0.1%> | - | - |
| (香港) | 千口 | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | % | |
| LINK REIT | 200.2 | 199.7 | 13,280 | 196,411 | 0.0 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | □ 数 銘柄 数<比率> | 金額 200.2 | 金額 196,411 | 比率 - | 比率 0.0 |
| | | | 1銘柄<0.0%> | 1銘柄<0.0%> | - | - |
| (シンガポール) | 千口 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 483.636 | 545.177 | 1,117 | 95,768 | 0.0 | |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 292.606 | 248.606 | 703 | 60,287 | 0.0 | |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 192.1 | - | - | - | - | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 270.1 | 484.5 | 838 | 71,824 | 0.0 | |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 192.3 | 192.3 | 348 | 29,825 | 0.0 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | □ 数 銘柄 数<比率> | 金額 1,430.742 | 金額 257,705 | 比率 - | 比率 0.0 |
| | | | 5銘柄<0.1%> | 4銘柄<0.0%> | - | - |
| (イギリス) | 千口 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % | |
| BRITISH LAND CO PLC | 69.819 | 75.77 | 407 | 63,737 | 0.0 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 55.843 | 74.028 | 583 | 91,233 | 0.0 | |
| SEGRO PLC | 100.956 | 120.36 | 1,486 | 232,242 | 0.0 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | □ 数 銘柄 数<比率> | 金額 226.618 | 金額 387,213 | 比率 - | 比率 0.1 |
| | | | 3銘柄<0.1%> | 3銘柄<0.1%> | - | - |
| (フランス) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| GECINA SA | 3.67 | 4.763 | 530 | 69,212 | 0.0 | |
| KLEPIERRE | 17.099 | 17.099 | 404 | 52,819 | 0.0 | |
| COVIVIO | 4.663 | 4.663 | 337 | 44,077 | 0.0 | |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 12.92 | 12.92 | 884 | 115,480 | 0.0 | |
| 小計 | □ 数 銘柄 数<比率> | □ 数 銘柄 数<比率> | 金額 38.352 | 金額 281,590 | 比率 - | 比率 0.0 |
| | | | 4銘柄<0.0%> | 4銘柄<0.0%> | - | - |
| 合計 | □ 数 銘柄 数<比率> | □ 数 銘柄 数<比率> | 金額 4,784.089 | 金額 13,808.167 | 比率 - | 比率 2.1 |
| | | | 59銘柄<2.1%> | 56銘柄<2.1%> | - | - |

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 | 柄 | 別 | 当 期 | | 末 | |
|--------|-------------------------------------|---|-----|--------------|---|----------|
| | | | 買 | 建 額 | 売 | 建 額 |
| 外 国 | S & P 5 0 0 E M I N I F U T | | | 百万円 8,545 | | 百万円 - |
| | S & P / T S E 6 0 I X F U T | | | 421 | | - |
| | S P I 2 0 0 F U T U R E S | | | 264 | | - |
| | F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E | | | 536 | | - |
| | D J E U R O S T O X X 5 0 | | | 1,772 | | - |

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

■投資信託財産の構成

2022年2月15日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 | |
|---------------|-------------|-------|-------|-----|
| | 評 価 額 | 比 率 | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 千円 | % | | |
| 株 式 | 598,417,771 | 92.9 | | |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 13,808,167 | 2.1 | | |
| コール・ローン等、その他 | 31,698,088 | 4.9 | | |
| 投資信託財産総額 | 643,924,027 | 100.0 | | |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、642,251,567千円、99.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.42円、1カナダ・ドル=90.68円、1オーストラリア・ドル=82.31円、1香港・ドル=14.79円、1シンガポール・ドル=85.69円、1ニュージーランド・ドル=76.43円、1イギリス・ポンド=156.24円、1イスラエル・シケル=35.452円、1スイス・フラン=124.94円、1デンマーク・クローネ=17.54円、1ノルウェー・クローネ=13.00円、1スウェーデン・クローナ=12.30円、1ユーロ=130.56円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月15日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 663,074,590,376円 |
| 一 般 株 券 (評 価 額) | 8,092,389,228 |
| 株 券 (評 価 額) | 598,417,771,479 |
| 信 託 受 益 証 券 (評 価 額) | 1,057,641,470 |
| 資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額) | 12,750,525,590 |
| 収 入 当 金 | 37,918,383,393 |
| 入 収 委 託 証 当 金 | 461,392,808 |
| (B) 負 債 | 20,432,094,210 |
| 未 払 金 | 20,346,719,210 |
| 未 払 解 約 金 | 85,375,000 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 642,642,496,166 |
| 元 本 | 113,101,593,550 |
| 次 期 繰 越 損 益 | 529,540,902,616 |
| (D) 受 益 権 総 額 (C / D) | 113,101,593,550円 |
| 1 万 円 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 56,820円 |

| | |
|--------------------------------|------------------|
| (注1) 期首元本額 | 101,430,005,374円 |
| 追加設定元本額 | 93,876,718,442円 |
| 一部解約元本額 | 82,205,130,266円 |
| (注2) 期末における元本の内訳 | |
| DIAM外国株式バッシブ・ファンド | 3,311,871,905円 |
| MITO ラップ型ファンド (安定型) | 3,512,255円 |
| MITO ラップ型ファンド (中立型) | 13,337,563円 |
| MITO ラップ型ファンド (積極型) | 57,023,138円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 20,046,091円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 11,721,611円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 11,183,927円 |
| たわらノーロード 先進国株式 | 29,209,837,872円 |
| たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け> | 379,011,003円 |
| たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり> | 2,783,685,914円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 582,139,859円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 67,491,775円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 540,044,742円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 666,401,105円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) | 881,601円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) | 148,165,312円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 439,640,001円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) | 332,155,340円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) | 491,044,760円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 1,447円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 1,241,327円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 18,750,438円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 3,393,492円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 11,200,746円 |
| たわらノーロード 全世界株式 | 228,421,540円 |
| DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金> | 51,140,481,555円 |
| One DC 先進国株式インデックスファンド | 2,232,942,901円 |
| One グローバルバランス | 2,978,639円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 152,382,039円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 773,961,717円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 1,005,264,576円 |
| DIAM DC バランス30インデックスファンド | 95,122,258円 |
| DIAM DC バランス50インデックスファンド | 265,971,133円 |
| DIAM DC バランス70インデックスファンド | 248,725,315円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 20,541,627円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 686,570,224円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 133,496,940円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 172,284,428円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 172,035,194円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 304,995,876円 |
| 投資のソムリエ | 4,886,217,076円 |
| リスクコントロール | 36,245,544円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 294,714,139円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 187,167,284円 |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> | 142,899,507円 |
| DIAMコア資産設計ファンド (堅実型) | 31,576,202円 |
| DIAMコア資産設計ファンド (積極型) | 1,000,259円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 162,957,398円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 1,118,793,304円 |

| | |
|---|------------------|
| ワールドアセットバランス (基本コース) | 203,026,933円 |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) | 434,831,464円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) | 26,209,400円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) | 12,968,413円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 1,345,477円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) | 39,369,147円 |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 95,606,011円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 361,901,590円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 159,502,748円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) | 25,023,763円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) | 11,301,608円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) | 9,568,065円 |
| 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> | 29,534,589円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) | 622,063円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 126,295円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 83,555円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) | 1,732,862円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 13,744円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 111,606円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド112021-04 (適格機関投資家限定) | 557,287円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06 | 57,490,733円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 75,883円 |
| MSC iCコア・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定) | 958,242,351円 |
| DIAM外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用) | 63,352,968円 |
| DIAM外国株式バッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) | 1,191,786,446円 |
| DIAM先進国株式バッシブファンド (適格機関投資家限定) | 2,189,774,417円 |
| 外国株式バッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定) | 1,052,411,163円 |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) | 73,837,834円 |
| DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) | 8,226,089円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 206,917円 |
| リスクコントロール世界8資産(フランスファンド (FOF:用) (適格機関投資家専用) | 2,898,910円 |
| DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 31,546,987円 |
| DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 56,354,600円 |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 2,722,727円 |
| DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 22,177,017円 |
| DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 1,568,925円 |
| DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 489,870円 |
| DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 3,953,136円 |
| DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 28,909,778円 |
| DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 204,390,999円 |
| DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) | 306,392,875円 |
| DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 998,858,127円 |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) | 86,555,947円 |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA.2 (適格機関投資家限定) | 51,952,941円 |
| DIAM アナ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 332,991,420円 |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) | 13,689,728円 |
| DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 3,498,398円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 128,366,149円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 11,208,160円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 40,455,375円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) | 63,324,997円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定) | 130,176,054円 |
| 期末元本合計 | 113,101,593,550円 |

■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月15日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--|---------------------------------|---|
| (A) | 配当 受取 受取 支の 支の 払 他 取 利 収 当 | 益 金 息 金 息 利 損 | 9,113,239,420円 9,080,104,798 12,472 33,540,265 △418,115 |
| (B) | 有価 証 券 買 損 益 | 買 損 益 損 益 | 89,816,332,579 130,353,926,209 △40,537,593,630 |
| (C) | 先物 取 引 等 取 引 損 益 | 取 引 損 益 損 益 | 1,292,545,584 2,927,958,743 △1,635,413,159 |
| (D) | そ の 他 費 用 | 費 用 | △203,677,815 |
| (E) | 当期 損 益 金 | (A + B + C + D) | 100,018,439,768 |
| (F) | 前期 繰 越 損 益 金 | 損 益 金 | 376,135,937,658 |
| (G) | 解約 差 損 益 金 | 損 益 金 | △371,018,562,768 |
| (H) | 追加 信 託 差 損 益 金 | 損 益 金 | 424,405,087,958 |
| (I) | 合 計 | (E + F + G + H) | 529,540,902,616 |
| | 次 期 繰 越 損 益 金 | (I) | 529,540,902,616 |

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

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

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

《お知らせ》

■信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年12月21日)

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2022年6月6日）

（計算期間 2021年6月8日～2022年6月6日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

（注1）不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

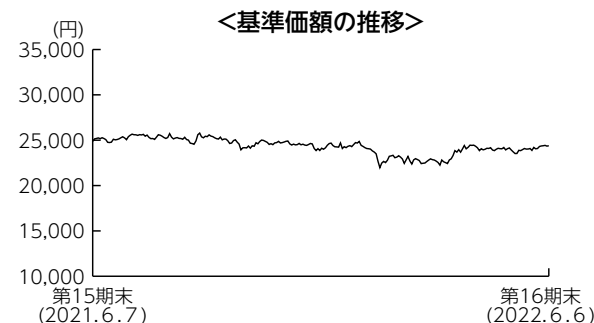
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年6月8日から2022年6月6日まで）

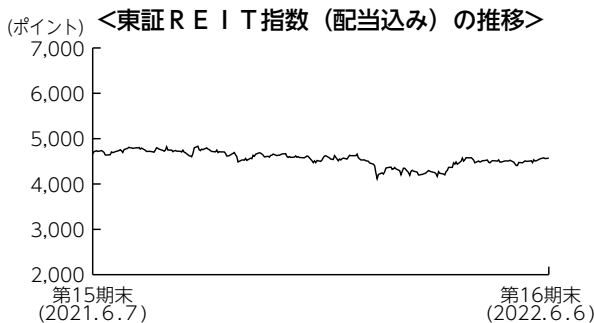


基準価額の推移

当期末の基準価額は24,389円となり、前期末比で1.9%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.0%下落しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------------------------|-----------|-------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売買委託手数料 (先物・オプション) | 1円 (0) | 0.003% (0.001) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (投資証券) | (1) | (0.002) | |
| 合 計 | 1 | 0.003 | |
| 期中の平均基準価額は24,325円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年6月8日から2022年6月6日まで)

(1) 投資証券

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------------|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| | 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 | 6.445 (-) | 908,630 (-) | 4.145 (-) | 564,705 (-) |
| サンケイリアルエステート投資法人 | 10.171 (-) | 1,246,519 (-) | 6.459 (-) | 742,665 (-) |
| S O S I L A物流リート投資法人 | 15.036 (-) | 2,470,185 (-) | 8.857 (-) | 1,421,183 (-) |
| 東海道リート投資法人 | 2.916 (-) | 328,060 (-) | 1.573 (-) | 171,150 (-) |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 10.755 (-) | 6,938,240 (-) | 7.296 (-) | 4,612,569 (-) |
| 森ヒルズリート投資法人 | 36.655 (-) | 5,780,543 (-) | 24.881 (-) | 3,701,548 (-) |
| 産業ファンド投資法人 | 44.19 (-) | 9,054,056 (-) | 29.941 (-) | 5,900,481 (-) |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 31.297 (-) | 11,328,675 (-) | 20.918 (-) | 7,288,268 (-) |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 22.034 (-) | 4,924,796 (-) | 14.619 (-) | 3,083,776 (-) |
| アクティブア・プロパティーズ投資法人 | 16.738 (-) | 7,748,557 (-) | 11.166 (-) | 4,729,881 (-) |
| G L P投資法人 | 101.462 (-) | 18,894,832 (-) | 68.202 (-) | 12,402,848 (-) |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 14.234 (-) | 4,834,233 (-) | 9.463 (-) | 3,081,956 (-) |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 50.834 (-) | 18,357,708 (-) | 34.051 (-) | 12,361,202 (-) |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 5.226 (-) | 3,589,786 (-) | 3.433 (-) | 2,267,405 (-) |
| Oneリート投資法人 | 5.253 (-) | 1,639,088 (-) | 3.384 (-) | 997,445 (-) |
| イオンリート投資法人 | 37.466 (-) | 5,903,228 (-) | 24.481 (-) | 3,659,415 (-) |
| ヒューリックリート投資法人 | 29.329 (-) | 5,210,000 (-) | 19.213 (-) | 3,218,632 (-) |
| 日本リート投資法人 | 9.815 (-) | 4,160,973 (-) | 6.85 (-) | 2,765,100 (-) |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 91.241 (-) | 2,070,962 (-) | 139.141 (-) | 3,156,012 (-) |

| | 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
|---------------------|---|---------|---|------------|---|--------|---|------------|
| | □ | 数 | 金 | 額 | □ | 数 | 金 | 額 |
| | | 千□ | | 千円 | | 千□ | | 千円 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | | 94.815 | | 8,336,334 | | 63.737 | | 5,281,290 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| トーセイ・リート投資法人 | | 6.667 | | 915,689 | | 4.67 | | 615,424 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ケネディクス商業リート投資法人 | | 12.429 | | 3,614,914 | | 8.423 | | 2,341,576 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | | 7.36 | | 1,134,365 | | 4.671 | | 706,878 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | | 7.147 | | 903,361 | | 4.624 | | 565,039 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | 100.834 | | 17,143,184 | | 68.482 | | 11,021,949 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| いちごホテルリート投資法人 | | 5.272 | | 485,596 | | 3.684 | | 312,470 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ラサールロジポート投資法人 | | 38.003 | | 7,098,551 | | 25.646 | | 4,706,781 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| スターアジア不動産投資法人 | | 33.349 | | 2,078,792 | | 22.966 | | 1,373,192 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| マリモ地方創生リート投資法人 | | 3.553 | | 475,972 | | 2.205 | | 287,513 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | | 12.071 | | 7,118,255 | | 7.792 | | 4,507,353 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 大江戸温泉リート投資法人 | | 5.031 | | 393,948 | | 3.417 | | 244,968 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 投資法人みらい | | 37.702 | | 1,987,584 | | 24.594 | | 1,256,245 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | | 7.386 | | 996,245 | | 4.902 | | 612,429 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 三菱地所物流リート投資法人 | | 8.741 | | 4,213,761 | | 5.541 | | 2,611,455 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | | 12.336 | | 2,525,598 | | 7.954 | | 1,634,581 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ザイマックス・リート投資法人 | | 4.999 | | 611,499 | | 3.323 | | 390,695 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| タカラレーベン不動産投資法人 | | 12.651 | | 1,521,341 | | 7.998 | | 921,597 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人 | | 12.135 | | 1,954,846 | | 8.219 | | 1,319,609 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 日本ビルファンド投資法人 | | 36.124 | | 25,428,950 | | 24.156 | | 16,411,837 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | | 31.182 | | 21,023,426 | | 21.178 | | 13,581,977 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 日本都市ファンド投資法人 | | 156.564 | | 17,207,488 | | 105.6 | | 10,606,437 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| オリックス不動産投資法人 | | 62.129 | | 12,088,815 | | 42.196 | | 7,622,256 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | | 21.282 | | 8,882,224 | | 13.988 | | 5,482,023 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| NTT都市開発リート投資法人 | | 29.99 | | 4,740,285 | | 19.983 | | 3,006,886 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 東急リアル・エステート投資法人 | | 20.91 | | 4,116,189 | | 14.203 | | 2,638,050 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | | 21.595 | | 2,610,692 | | 14.811 | | 1,709,256 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | | 70.453 | | 10,570,416 | | 47.083 | | 6,646,022 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------|----------------|-------------------|---------------|-------------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 22.288 (-) | 3,354,263 (-) | 15.138 (-) | 2,160,020 (-) |
| インヴェンシブル投資法人 | 137.746 (-) | 5,793,937 (-) | 92.055 (-) | 3,654,156 (-) |
| フロンティア不動産投資法人 | 11.014 (-) | 5,602,506 (-) | 7.365 (-) | 3,594,447 (-) |
| 平和不動産リート投資法人 | 20.777 (-) | 3,355,067 (-) | 13.69 (-) | 2,067,239 (-) |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 20.853 (-) | 6,919,284 (-) | 13.95 (-) | 4,495,685 (-) |
| 福岡リート投資法人 | 16.127 (-) | 2,846,543 (-) | 10.953 (-) | 1,800,359 (-) |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 9.646 (-) | 7,224,561 (-) | 6.551 (-) | 4,619,046 (-) |
| いちごオフィスリート投資法人 | 25.548 (-) | 2,372,398 (-) | 17.35 (-) | 1,487,895 (-) |
| 大和証券オフィス投資法人 | 6.585 (-) | 4,953,141 (-) | 4.482 (-) | 3,236,468 (-) |
| 阪急阪神リート投資法人 | 14.088 (-) | 2,264,248 (-) | 9.57 (-) | 1,472,807 (-) |
| スターツプロシード投資法人 | 4.858 (-) | 1,178,307 (-) | 3.3 (-) | 769,149 (-) |
| 大和ハウスリート投資法人 | 47.036 (-) | 15,472,383 (-) | 31.452 (-) | 10,149,811 (-) |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 97.424 (-) | 6,309,714 (-) | 67.966 (-) | 4,153,483 (-) |
| 大和証券リビング投資法人 | 42.193 (-) | 4,957,843 (-) | 28.333 (-) | 3,203,570 (-) |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 28.87 (-) | 4,164,397 (-) | 19.772 (-) | 2,621,059 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|----------------|--------|--------|-------|-------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 国内 不動産投信指数先物取引 | 18,774 | 15,886 | - | - |

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2021年6月8日から2022年6月6日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|--------------|----------------|--------------------|----------|----------------|--------------------|----------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 投 資 証 券 | 百万円 362,336 | 百万円 422 | % 0.1 | 百万円 234,027 | 百万円 21,734 | % 9.3 |

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|---------|---------------|
| | 買 付 額 |
| 投 資 証 券 | 百万円 15,547 |

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

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|-------------------------|---|---------|--------|-----|--------|-----------|-----|
| | | □ | 数 | □ | 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| 不動産ファンド | | | 千□ | | 千□ | 千円 | % |
| エスコンジャパンリート投資法人 | | | 1.232 | | 3.532 | 474,347 | 0.2 |
| サンケイリアルエステート投資法人 | | | 1.844 | | 5.556 | 548,932 | 0.3 |
| S O S I L A物流リート投資法人 | | | 1.982 | | 8.161 | 1,260,058 | 0.6 |
| 東海道リート投資法人 | | | — | | 1.343 | 159,145 | 0.1 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | | | 2.598 | | 6.057 | 4,058,190 | 2.0 |
| 森ヒルズリート投資法人 | | | 8.854 | | 20.628 | 3,139,581 | 1.6 |
| 産業ファンド投資法人 | | | 10.655 | | 24.904 | 4,674,480 | 2.3 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | | | 7.16 | | 17.539 | 6,314,040 | 3.2 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | | | 5.137 | | 12.552 | 2,688,638 | 1.3 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | | | 3.777 | | 9.349 | 3,870,486 | 1.9 |
| G L P 投資法人 | | | 23.554 | | 56.814 | 9,584,521 | 4.8 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | | | 3.389 | | 8.16 | 2,762,160 | 1.4 |
| 日本フロロジスリート投資法人 | | | 11.917 | | 28.7 | 9,987,600 | 5.0 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | | | 1.147 | | 2.94 | 2,043,300 | 1.0 |
| One リート投資法人 | | | 1.175 | | 3.044 | 851,711 | 0.4 |
| イオンリート投資法人 | | | 7.645 | | 20.63 | 3,177,020 | 1.6 |
| ヒューリックリート投資法人 | | | 6.249 | | 16.365 | 2,654,403 | 1.3 |
| 日本リート投資法人 | | | 2.448 | | 5.413 | 2,054,233 | 1.0 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | | | 47.9 | | — | — | — |
| 積水ハウス・リート投資法人 | | | 22.17 | | 53.248 | 4,259,840 | 2.1 |
| トーセイ・リート投資法人 | | | 1.668 | | 3.665 | 489,644 | 0.2 |
| ケネディクス商業リート投資法人 | | | 2.998 | | 7.004 | 1,948,512 | 1.0 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | | | 1.608 | | 4.297 | 697,832 | 0.3 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | | | 1.451 | | 3.974 | 551,193 | 0.3 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | | 24.375 | | 56.727 | 9,552,826 | 4.8 |
| いちごホテルリート投資法人 | | | 1.318 | | 2.906 | 285,078 | 0.1 |
| ラサールロジポート投資法人 | | | 9.118 | | 21.475 | 3,841,877 | 1.9 |
| スターアジア不動産投資法人 | | | 7.745 | | 18.128 | 1,114,872 | 0.6 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | | | 0.706 | | 2.054 | 281,192 | 0.1 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | | | 2.631 | | 6.91 | 3,821,230 | 1.9 |
| 大江戸温泉リート投資法人 | | | 1.217 | | 2.831 | 201,567 | 0.1 |
| 投資法人みらい | | | 8.141 | | 21.249 | 1,075,199 | 0.5 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | | | 1.632 | | 4.116 | 548,662 | 0.3 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | | | 1.896 | | 5.096 | 2,377,284 | 1.2 |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | | | 2.412 | | 6.794 | 1,387,334 | 0.7 |
| ザイマックス・リート投資法人 | | | 1.155 | | 2.831 | 363,783 | 0.2 |
| タカラレーベン不動産投資法人 | | | 2.265 | | 6.918 | 821,166 | 0.4 |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------|------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | 比 率 | |
| 不動産ファンド | 千□ | 千□ | 千円 | % | |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 2.924 | 6.84 | 1,093,716 | 0.5 | |
| 日本ビルファンド投資法人 | 8.483 | 20.451 | 14,602,014 | 7.3 | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 7.538 | 17.542 | 11,279,506 | 5.6 | |
| 日本都市ファンド投資法人 | 37.545 | 88.509 | 9,417,357 | 4.7 | |
| オリックス不動産投資法人 | 15.019 | 34.952 | 6,431,168 | 3.2 | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 4.693 | 11.987 | 4,962,618 | 2.5 | |
| N T T都市開発リート投資法人 | 6.808 | 16.815 | 2,525,613 | 1.3 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 5.054 | 11.761 | 2,269,873 | 1.1 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 5.234 | 12.018 | 1,307,558 | 0.7 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 16.12 | 39.49 | 5,773,438 | 2.9 | |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 5.387 | 12.537 | 1,790,283 | 0.9 | |
| インヴィンシブル投資法人 | 31.518 | 77.209 | 3,254,359 | 1.6 | |
| フロンティア不動産投資法人 | 2.501 | 6.15 | 3,265,650 | 1.6 | |
| 平和不動産リート投資法人 | 4.871 | 11.958 | 1,751,847 | 0.9 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 4.925 | 11.828 | 3,873,670 | 1.9 | |
| 福岡リート投資法人 | 3.898 | 9.072 | 1,533,168 | 0.8 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 2.332 | 5.427 | 3,598,101 | 1.8 | |
| いちごオフィスリート投資法人 | 6.176 | 14.374 | 1,239,038 | 0.6 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 1.606 | 3.709 | 2,518,411 | 1.3 | |
| 阪急阪神リート投資法人 | 3.405 | 7.923 | 1,201,126 | 0.6 | |
| スターツプロシード投資法人 | 1.174 | 2.732 | 672,891 | 0.3 | |
| 大和ハウスリート投資法人 | 10.755 | 26.339 | 8,362,632 | 4.2 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 24.283 | 53.741 | 3,584,524 | 1.8 | |
| 大和証券リビング投資法人 | 9.843 | 23.703 | 2,754,288 | 1.4 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 6.994 | 16.092 | 2,087,132 | 1.0 | |
| 合 計 | □ 数 ・ 金 額 | 472.255 | 1,025.069 | 195,071,937 | — |
| | 銘 柄 数<比 率> | 61銘柄<97.6%> | 61銘柄<97.6%> | — | 97.6 |

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | 当 期 | | 末 |
|-----|-------------|--------------|-------|----------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 | 額 |
| 国内 | 東 証 R E I T | 百万円 4,692 | | 百万円 - |

■投資信託財産の構成

2022年6月6日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|-------------------|---|-----------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 投 資 証 券 | 千円 195,071,937 | | % 94.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 11,337,248 | | 5.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 206,409,185 | | 100.0 |

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月6日)現在

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

(注1) 期首元本額 35,599,014,873円
 追加設定元本額 150,824,103,694円
 一部解約元本額 104,449,745,533円

(注2) 期末における元本の内訳

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

| | |
|---|-----------------|
| Jリートインデックスファンド (DC) | 50,855,522円 |
| D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定) | 79,667,856円 |
| D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定) | 720,422,023円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 760,808円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4 | 226,208,631円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 708,067円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) | 43,732,109円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 551,421円 |
| 固定比率マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定) | 190,209,302円 |
| 低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定) | 59,683,551円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03 | 220,977,582円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 527,083円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド I I 2021-04 (適格機関投資家限定) | 2,869,206円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05 | 148,330,752円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07 | 244,308,833円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08 | 170,659,574円 |
| 低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09 | 60,842,765円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 588,327円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09 | 170,407,397円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12 | 245,929,724円 |
| D I A M J - R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け) | 4,526,901,363円 |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) | 254,449,768円 |
| 日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用) | 614,705,854円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 1,014,158円 |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用) | 9,480,923円 |
| 日米資産配分戦略ファンド (T I P S活用型) | 141,000,699円 |
| しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定) | 30,493,320円 |
| D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 1,968,658,850円 |
| MHAM J - R E I Tインデックスファンド<DC年金> | 7,710,368,183円 |
| MHAM J - R E I Tインデックスファンド (毎月決算型) | 37,275,651,521円 |
| MHAM J - R E I Tインデックスファンド (年1回決算型) | 2,584,025,619円 |
| MHAM J - R E I Tインデックスファンド (ファンドラップ) | 111,687,629円 |
| 期末元本合計 | 81,973,373,034円 |

■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2022年6月6日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|------------------|---|
| (A) | 配当等収当益 | 6,593,740,373円 | |
| | 受取配当金 | 6,590,445,292 | |
| | 受取利息 | 12,539 | |
| | その他の収益 | 4,406,968 | |
| | 支払利息 | △1,124,426 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | △19,639,284,044 | |
| | 売却益 | 2,322,804,698 | |
| | 売却損 | △21,962,088,742 | |
| (C) | 先物取引等取引損益 | △181,506,240 | |
| | 取引益 | 395,559,860 | |
| | 取引損 | △577,066,100 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | △13,227,049,911 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 52,932,492,732 | |
| (F) | 解約差損益金 | △144,599,972,511 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 222,842,903,306 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | 117,948,373,616 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 117,948,373,616 | |

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第15期（決算日 2022年6月22日）

（対象期間 2021年6月23日～2022年6月22日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | S & P 先進国 REIT インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 | 純資産額 総 |
|-----------------|--------|-------|---|-------|-------------------------------|-----------|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | |
| 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 |
| 15期(2022年6月22日) | 16,673 | 8.7 | 172,787.99 | 9.4 | 99.3 | 56,003 |

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

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

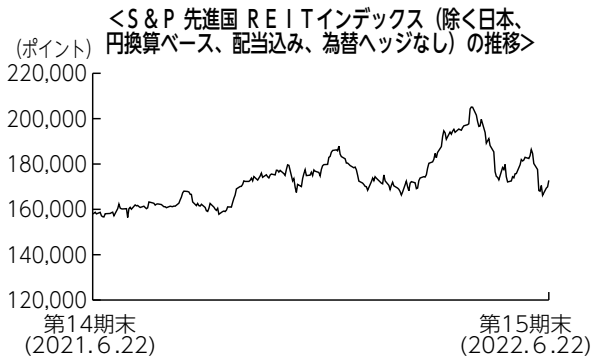
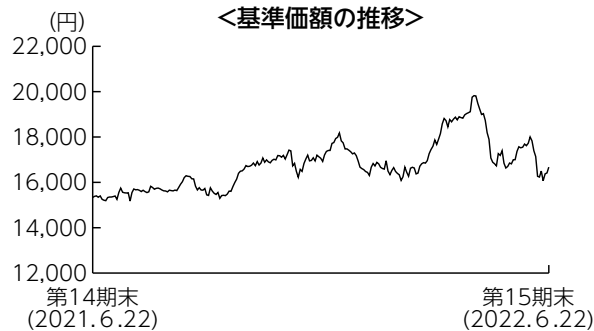
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2021年6月23日から2022年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は16,673円となり、前期末比で8.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で9.4%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマークを0.7%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------------------|-------------------|------------------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売買委託手数料 (投資信託受益証券) (投資証券) | 7円 (1) (6) | 0.040% (0.005) (0.034) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券) | 19 (1) (18) | 0.114 (0.008) (0.106) | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) その他費用 (保管費用) (その他) | 15 (9) (6) | 0.091 (0.054) (0.038) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 41 | 0.246 | |
| 期中の平均基準価額は16,756円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年6月23日から2022年6月22日まで) 投資信託受益証券、投資証券

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

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------------|---------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 114.101 | 18,022 | 127.237 | 19,844 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 79.161 | 1,367 | 91.716 | 1,534 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUINIX INC | 99.737 | 75,362 | 113.69 | 85,340 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 196.799 | 8,811 | 225.376 | 9,945 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CTO REALTY GROUTH INC | 2.639 | 166 | 3.746 | 219 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COUSINS PROPERTIES INC | 162.511 | 6,215 | 187.519 | 7,011 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 28.301 | 540 | 33.029 | 616 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SITE CENTERS CORP | 201.279 | 3,153 | 227.446 | 3,482 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DUKE REALTY TRUST | 420.457 | 23,243 | 477.107 | 26,084 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 43.138 | 485 | 28.031 | 269 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 72.127 | 23,422 | 82.575 | 26,698 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY RESIDENTIAL | 379.1 | 31,969 | 434.939 | 36,088 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 77.397 | 9,357 | 88.546 | 10,482 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 146.041 | 8,455 | 166.773 | 9,520 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 594.934 | 19,848 | 682.228 | 22,393 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY COMMONWEALTH | 131.487 | 3,499 | 153.44 | 4,001 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 161.493 | 4,832 | 181.401 | 5,393 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 116 | 5,054 | 132.347 | 5,650 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 174.023 | 1,582 | 194.951 | 1,725 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WELLTOWER INC | 485.024 | 41,993 | 541.577 | 45,826 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EAST GROUP | 45.566 | 8,556 | 51.724 | 9,673 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIMCO REALTY | 682.246 | 15,752 | 773.865 | 17,641 |
| | (78.06) | (△121) | (-) | (-) |
| KILROY REALTY CORP | 116.51 | 7,920 | 134.131 | 8,852 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LTC PROPERTIES INC | 37.57 | 1,341 | 43.553 | 1,480 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 200.598 | 601 | 232.534 | 669 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-----------------------------|-----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 62.974 | 1,258 | 111.145 | 2,252 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 194.158 | 2,576 | 224.432 | 2,883 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRON MOUNTAIN INC | 321.912 | 15,741 | 368.218 | 17,411 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| THE MACERICH COMPANY | 253.283 | 4,034 | 266.867 | 4,192 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 189.867 | 15,052 | 216.131 | 16,956 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ACADIA REALTY TRUST | 88.709 | 1,870 | 104.132 | 2,130 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 790.713 | 14,017 | 901.597 | 15,719 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MID AMERICA | 128.065 | 25,645 | 146.132 | 28,775 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 28.468 | 270 | 35.964 | 328 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 50.263 | 2,891 | 57.379 | 3,174 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CENTERSPACE | 14.129 | 1,378 | 15.148 | 1,452 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 13.695 | 431 | 15.942 | 487 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | - | - | - | - |
| | (△27.137) | (-) | (-) | (-) |
| GETTY REALTY CORP | 40.703 | 1,204 | 44.454 | 1,277 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PS BUSINESS PARKS | 21.502 | 3,641 | 24.658 | 4,208 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RPT REALTY | 82.25 | 1,054 | 94.901 | 1,193 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REALTY INCOME CORP | 584.127 | 39,839 | 653.082 | 44,164 |
| | (78.539) | (-) | (-) | (-) |
| REGENCY CENTERS CORP | 171.045 | 11,811 | 198.104 | 13,458 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UDR INC | 328.034 | 17,860 | 375.091 | 20,166 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 121.783 | 3,354 | 139.582 | 3,723 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAUL CENTERS INC | 10.583 | 523 | 12.187 | 598 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 362.903 | 48,983 | 415.796 | 55,867 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LIFE STORAGE INC | 91.613 | 11,861 | 101.298 | 12,883 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PUBLIC STORAGE | 169.181 | 57,924 | 193.522 | 65,138 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 130.759 | 24,233 | 145.676 | 26,873 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------------------------|-----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| TANGER FACTORY OUTLET | 106.177 | 1,863 | 121.975 | 2,161 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UMH PROPERTIES INC | 47.409 | 1,092 | 52.036 | 1,175 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 28.55 | 623 | 34.347 | 729 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 10.073 | 573 | 12.287 | 676 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VENTAS INC | 439.274 | 24,263 | 497.685 | 26,335 |
| | (5.792) | (-) | (-) | (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | 173.513 | 7,268 | 198.638 | 8,069 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WASHINGTON REIT | 91.284 | 2,266 | 106.807 | 2,616 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GEO GROUP INC | 56.667 | 435 | 113.771 | 836 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WEINGARTEN REALTY INVST | 2.249 | 72 | 2.895 | 92 |
| | (△55.441) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 155.979 | 8,545 | 177.913 | 9,751 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 203.121 | 4,330 | 237.77 | 4,935 |
| | (61.224) | (-) | (-) | (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 148.735 | 28,506 | 169.96 | 32,134 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 84.762 | 476 | 98.234 | 538 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 248.858 | 2,905 | 281.805 | 3,222 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CUBESMART | 246.264 | 12,480 | 271.595 | 13,495 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 313.291 | 46,748 | 357.633 | 53,438 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 225.157 | 2,161 | 263.596 | 2,475 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 660.812 | 13,574 | 753.532 | 15,152 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DOUGLAS EMMETT INC | 196.573 | 6,295 | 220.349 | 6,883 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 131.563 | 2,409 | 152.251 | 2,715 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 136.96 | 2,353 | 156.261 | 2,657 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 107.883 | 1,018 | 124.997 | 1,161 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TERRENO REALTY CORP | 82.201 | 5,770 | 91.032 | 6,357 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 54.651 | 1,990 | 62.171 | 2,225 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RLJ LODGING TRUST | 184.183 | 2,567 | 209.54 | 2,858 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------------------|------------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 297.472 | 9,005 | 334.363 | 10,023 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORESITE REALTY CORP | 25.471 | 3,900 | 45.824 | 7,385 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VEREIT INC | 76.731 | 3,719 | 73.294 | 3,508 |
| | (△111.404) | (-) | (-) | (-) |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 148.192 | 3,331 | 169.08 | 3,739 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 49.842 | 1,223 | 55.834 | 1,335 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 42.333 | 843 | 66.485 | 1,382 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHATHAM LODGING TRUST | 41.619 | 544 | 46.767 | 608 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 242.499 | 3,438 | 270.593 | 3,663 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WHITESTONE REIT | 30.051 | 340 | 31.519 | 344 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 168.856 | 4,237 | 192.685 | 4,688 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STAG INDUSTRIAL INC | 193.093 | 7,849 | 213.439 | 8,528 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | 65.179 | 847 | 71.259 | 900 |
| | (△98.273) | (-) | (-) | (-) |
| CYRUSONE INC | 105.596 | 8,887 | 162.579 | 14,064 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WP CAREY INC | 210.112 | 16,632 | 234.439 | 18,278 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 69.323 | 1,570 | 80.565 | 1,759 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLADSTONE LAND CORP | 27.504 | 826 | 29.64 | 894 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 245.899 | 7,727 | 278.614 | 8,619 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 60.92 | 5,233 | 69.644 | 5,879 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 61.2 | 878 | 68.946 | 951 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 140.335 | 6,460 | 153.757 | 6,966 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 240.602 | 4,332 | 271.156 | 4,816 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 174.777 | 11,927 | 186.063 | 12,703 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 320.322 | 12,673 | 356.064 | 13,967 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 192.864 | 4,636 | 171.557 | 4,038 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 28.261 | 5,885 | 31.086 | 6,187 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|---------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| JBG SMITH PROPERTIES | 125.167 | 3,561 | 143.727 | 3,970 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| THE NECESSITY RETAIL REIT INC | 123.05 | 996 | 136.478 | 1,087 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL VALUE INC | - | - | 8.794 | 59 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVITATION HOMES INC | 662.529 | 26,758 | 741.06 | 29,572 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| QTS REALTY TRUST INC | 6.185 | 480 | 38.531 | 3,002 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COREPOINT LODGING INC | 17.747 | 276 | 36.853 | 576 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 703 | 523 | 829.9 | 613 |
| | (-) | (△6) | (-) | (-) |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 143.677 | 1,350 | 164.141 | 1,499 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 31.417 | 816 | 30.922 | 824 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAFEHOLD INC | 11.544 | 756 | 13.211 | 867 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 136.877 | 3,623 | 149.645 | 3,909 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 64.209 | 1,437 | 72.39 | 1,566 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 41.819 | 753 | 97.996 | 1,779 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 258.816 | 12,034 | 289.654 | 13,167 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 335.239 | 8,066 | 383.42 | 9,069 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 41.527 | 231 | 21.354 | 121 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | - | - | 17.653 | 326 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRIME US REIT | 518.8 | 408 | 570.4 | 437 |
| | (-) | (△4) | (-) | (-) |
| POSTAL REALTY TRUST INC | 10.309 | 187 | 4.889 | 81 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC | 7.927 | 148 | 5.242 | 98 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 41.679 | 1,235 | 20.925 | 593 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP | - | - | 8.408 | 70 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC | 28.71 | 624 | 31.016 | 653 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FARMLAND PARTNERS INC | 9.908 | 138 | 11.177 | 159 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CITY OFFICE REIT INC | 28.766 | 495 | 34.307 | 570 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|--------------------|---------------|----------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| ORION OFFICE REIT INC | 39.605 (25.252) | 640 (-) | 48.132 (-) | 741 (-) |
| NETSTREIT CORP | 44.288 (-) | 998 (-) | 40.525 (-) | 872 (-) |
| CARETRUST REIT INC | 101.179 (-) | 2,066 (-) | 118.155 (-) | 2,325 (-) |
| INDUS REALTY TRUST INC | 6.505 (-) | 459 (-) | 4.193 (-) | 299 (-) |
| PHILLIPS EDISON & CO INC | 75.398 (-) | 2,506 (-) | 40.473 (-) | 1,326 (-) |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | 175.962 (-) | 8,883 (-) | 201.213 (-) | 10,018 (-) |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 184.386 (-) | 4,342 (-) | 200.821 (-) | 4,641 (-) |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC | 17.195 (-) | 501 (-) | 9.655 (-) | 261 (-) |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD | 104.2 (-) | 92 (-) | - (-) | - (-) |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | - (△37.108) | - (-) | - (-) | - (-) |
| STORE CAPITAL CORP | 273.837 (-) | 8,650 (-) | 309.496 (-) | 9,663 (-) |
| PARAMOUNT GROUP INC | 170.958 (-) | 1,603 (-) | 196.416 (-) | 1,765 (-) |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 58.406 (-) | 904 (-) | 66.316 (-) | 1,002 (-) |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 119.903 (-) | 2,211 (-) | 139.674 (-) | 2,506 (-) |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 86.651 (-) | 1,831 (-) | 95.154 (-) | 1,961 (-) |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 120.487 (-) | 2,167 (-) | 137.758 (-) | 2,426 (-) |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 21.491 (-) | 1,635 (-) | 24.993 (-) | 1,892 (-) |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 95.075 (-) | 5,565 (-) | 102.268 (-) | 5,919 (-) |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 24.167 (-) | 1,037 (-) | 27.658 (-) | 1,164 (-) |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 228.907 (-) | 3,733 (-) | 260.4 (-) | 4,186 (-) |
| GLOBAL NET LEASE INC | 99.803 (-) | 1,541 (-) | 109.932 (-) | 1,623 (-) |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,550.6 (-) | 1,029 (△4) | 1,682.7 (-) | 1,105 (-) |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 262.611 (-) | 4,907 (-) | 300.433 (-) | 5,501 (-) |
| VICI PROPERTIES INC | 825.144 (-) | 23,992 (-) | 781.141 (-) | 22,152 (-) |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 27.482 (-) | 391 (-) | 43.132 (-) | 502 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|---------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 86.209 | 2,367 | 99.799 | 2,704 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIGITALBRIDGE GROUP INC | 507.857 | 3,628 | 746.406 | 5,083 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | 82.001 | 2,538 | 93.831 | 2,852 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 98.869 | 5,540 | 112.949 | 6,224 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 163.1 | 2,404 | 187.431 | 2,674 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 120.497 | 2,118 | 140.726 | 2,433 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 180.005 | 4,146 | 206.404 | 4,636 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 72.475 | 3,100 | 82.519 | 3,455 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COMINAR REAL ESTATE INV TR | 45.618 | 491 | 89.864 | 1,009 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | 25.422 | 627 | 30.075 | 720 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 21.997 | 1,166 | 25.326 | 1,323 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 71.575 | 871 | 85.193 | 1,025 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 60.208 | 1,082 | 65.052 | 1,137 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 73.381 | 1,176 | 82.337 | 1,290 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 114.429 | 1,541 | 125.376 | 1,653 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 7.605 | 140 | 9.73 | 172 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9.894 | 95 | 5.251 | 48 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 123.339 | 1,975 | 129.832 | 2,030 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 55.971 | 230 | 40.548 | 161 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 99.256 | 2,162 | 109.602 | 2,325 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 37.522 | 3,550 | 42.255 | 3,931 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 36.59 | 263 | 41.806 | 293 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 188.86 | 2,812 | 214.484 | 3,137 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 20.446 | 429 | 24.011 | 490 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|-----------|-------------|-----------|-------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 54.846 | 954 | 61.879 | 1,060 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PLAZA RETAIL REIT | 19.973 | 97 | 24.208 | 111 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 31.114 | 144 | 20.998 | 87 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3.678 | 101 | 22.823 | 602 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SLATE GROCERY REIT | 24.906 | 375 | 27.594 | 406 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | 25.992 | 323 | 18.534 | 221 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRIMARIS REIT | 27.937 | 409 | 30.815 | 432 |
| | (16.822) | (-) | (-) | (-) |
| SLATE OFFICE REIT | 13.763 | 69 | 9.662 | 47 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 19.151 | 257 | 18.758 | 251 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 56.911 | 1,224 | 63.719 | 1,353 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| BWP TRUST | 487.34 | 2,006 | 567.653 | 2,296 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MIRVAC GROUP | 4,433.852 | 11,968 | 5,063.359 | 13,566 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 1,623.195 | 1,367 | 2,021.448 | 1,693 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 588.821 | 2,446 | 667.187 | 2,724 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GPT GROUP | 2,122.435 | 10,629 | 2,441.97 | 12,145 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 667.191 | 1,992 | 706.835 | 2,074 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 389.68 | 1,307 | 459.942 | 1,545 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 374.896 | 1,412 | 431.125 | 1,596 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STOCKLAND | 2,676.734 | 11,481 | 3,068.152 | 12,943 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 396.075 | 2,214 | 421.207 | 2,294 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DEXUS | 1,187.661 | 12,724 | 1,360.328 | 14,489 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN GROUP | 1,877.623 | 42,634 | 2,143.587 | 48,201 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VICINITY CENTRES | 4,277.345 | 7,548 | 4,910.399 | 8,384 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHARTER HALL GROUP | 516.531 | 8,756 | 591.78 | 9,827 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------------------|-----------------------|--------------------|------------------|----------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 316.124 (-) | 1,315 (-) | 355.879 (-) | 1,454 (-) |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 1,270.733 (-) | 3,623 (-) | 1,443.294 (-) | 4,068 (-) |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 502.755 (-) | 1,892 (-) | 553.307 (-) | 2,038 (-) |
| ARENA REIT | 331.702 (-) | 1,507 (-) | 387.191 (-) | 1,736 (-) |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 685.451 (-) | 3,464 (-) | 760.017 (-) | 3,767 (-) |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 182.33 (-) | 613 (-) | 191.542 (-) | 615 (-) |
| NATIONAL STORAGE REIT | 1,263.971 (-) | 3,102 (-) | 1,450.937 (-) | 3,490 (-) |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 157.555 (-) | 578 (-) | 165.859 (-) | 602 (-) |
| GDI PROPERTY GROUP | 528.845 (-) | 601 (-) | 597.735 (-) | 656 (-) |
| HOME CONSORTIUM LTD | 86.906 (-) | 617 (-) | 101.174 (-) | 713 (-) |
| RURAL FUNDS GROUP | 482.295 (-) | 1,393 (-) | 516.198 (-) | 1,466 (-) |
| IRONGATE GROUP | 634.385 (-) | 1,088 (-) | 709.339 (-) | 1,201 (-) |
| SCENTRE GROUP | 5,803.8 (-) | 17,298 (-) | 6,635.014 (-) | 19,248 (-) |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND | 220.813 (-) | 203 (-) | 80.47 (-) | 73 (-) |
| HOME CONSORTIUM LTD | 116.968 (6.46) | 765 (42) | 141.533 (-) | 877 (-) |
| HOME CO DAILY NEEDS REIT | 759.24 (374.004) | 1,082 (530) | 906.771 (-) | 1,216 (-) |
| HEALTHCO REIT | 159.265 (-) | 293 (-) | 87.778 (-) | 138 (-) |
| CENTURIA OFFICE REIT | 437.602 (-) | 1,003 (-) | 488.986 (-) | 1,095 (-) |
| AVENTUS GROUP | 226.775 (△170.002) | 774 (△572) | 233.236 (-) | 774 (-) |
| WAYPOINT REIT LTD | 806.09 (△21.228) | 2,178 (△58) | 954.977 (-) | 2,531 (-) |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| LINK REIT | 2,297.2 (-) | 157,065 (-) | 2,626.3 (-) | 177,032 (-) |
| PROSPERITY REIT | 982 (-) | 2,883 (-) | 1,226 (-) | 3,547 (-) |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2,369 (-) | 8,026 (0.21457) | 2,448 (-) | 8,162 (-) |
| CHAMPION REIT | 1,925 (-) | 7,538 (-) | 2,230 (-) | 8,597 (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---|-----------------------|---------------------|----------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,122 (-) | 4,751 (-) | 1,231 (-) | 5,219 (-) |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,628 (-) | 12,412 (-) | 1,872 (-) | 14,300 (-) |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS | - (305.25) | - (△0.21457) | 305.25 (-) | 3 (-) |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 5,835.4 (-) | 12,379 (-) | 6,430.8 (-) | 13,626 (-) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVNT | 3,817.6 (-) | 11,202 (△31) | 4,324.4 (-) | 12,585 (-) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 2,479.8 (-) | 3,906 (△1) | 2,818.3 (-) | 4,420 (-) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 3,586 (-) | 6,671 (△26) | 3,970.8 (-) | 7,346 (-) |
| STARHILL GLOBAL REIT | 1,526.6 (-) | 939 (-) | 1,771 (-) | 1,081 (-) |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 2,078.5 (-) | 2,174 (△4) | 2,382 (-) | 2,473 (-) |
| KEPPEL REIT | 2,247.6 (-) | 2,576 (-) | 2,600.2 (-) | 2,947 (-) |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 1,279 (-) | 2,967 (-) | 1,575.3 (-) | 3,629 (-) |
| ESR LOGOS REIT | 3,408.8 (1,069.91) | 1,506 (458) | 4,069.2 (-) | 1,766 (-) |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 849.4 (-) | 1,023 (△3) | 937.5 (-) | 1,103 (-) |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 1,144.8 (-) | 1,373 (-) | 1,256.8 (-) | 1,488 (-) |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 715.6 (-) | 216 (△9) | 996.7 (-) | 293 (-) |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 451.7 (-) | 647 (△3) | 504.8 (-) | 715 (-) |
| PARKWAY LIFE REIT | 387.3 (-) | 1,859 (△2) | 448.9 (-) | 2,164 (-) |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | - (-) | - (△2) | 2,759.1 (-) | 130 (-) |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 2,173.1 (-) | 5,826 (△0.68061) | 2,488.6 (-) | 6,606 (-) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 2,461.2 (-) | 4,840 (△5) | 2,816.3 (-) | 5,479 (-) |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 1,195 (△603.48) | 1,047 (△517) | 1,179.4 (-) | 1,040 (-) |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | - (-) | - (-) | 313.2 (-) | 131 (-) |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 2,360.4 (-) | 2,600 (△33) | 3,255 (-) | 3,558 (-) |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 1,074.8 (-) | 665 (-) | 1,262.5 (-) | 767 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|-----------|--------------|-----------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| SPH REIT | 968.7 | 937 | 1,127.6 | 1,080 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 209.3 | 147 | 224.3 | 157 |
| | (-) | (△0.00001) | (-) | (-) |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 510 | 439 | 523.6 | 449 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OUÉ COMMERCIAL REIT | 2,366.1 | 996 | 2,698.5 | 1,135 |
| | (-) | (△2) | (-) | (-) |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 1,194.9 | 978 | 1,044.1 | 852 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | - | - | 377.1 | 171 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST | 103.9 | 74 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IREIT GLOBAL | 369.8 | 235 | 415.7 | 261 |
| | (-) | (△2) | (-) | (-) |
| KEPPEL DC REIT | 1,490.3 | 3,454 | 1,678.3 | 3,828 |
| | (-) | (△7) | (-) | (-) |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 3,272.5 | 4,773 | 3,692.7 | 5,352 |
| | (-) | (△15) | (-) | (-) |
| ニュージーランド | 千□ | 千ニュージーランド・ドル | 千□ | 千ニュージーランド・ドル |
| PRECINCT PROPERTIES | 1,380.504 | 2,161 | 1,498.848 | 2,319 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 407.484 | 1,269 | 445.327 | 1,348 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 1,177.028 | 2,864 | 1,379.893 | 3,328 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 1,667.156 | 1,864 | 1,942.429 | 2,154 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 975.321 | 1,430 | 1,073.46 | 1,561 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 1,072.95 | 5,611 | 1,222.357 | 6,288 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DERWENT LONDON PLC | 125.389 | 4,157 | 143.656 | 4,719 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 192.7 | 2,890 | 217.342 | 3,169 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HAMMERSON PLC | 4,584.197 | 1,514 | 5,513.049 | 1,763 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 862.339 | 6,480 | 987.714 | 7,287 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WORKSPACE GROUP PLC | 138.79 | 1,096 | 160.203 | 1,247 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UNITE GROUP PLC | 444.964 | 4,967 | 507.935 | 5,528 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 1,505.98 | 2,276 | 1,715.62 | 2,532 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SHAFTESBURY PLC | 321.302 | 1,959 | 377.658 | 2,287 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| SEGRO PLC | 1,340.273 | 17,188 | 1,534.87 | 19,450 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 287.251 | 2,072 | 328.823 | 2,355 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASSURA PLC | 3,335.879 | 2,348 | 3,675.459 | 2,521 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI | 257.64 | 212 | 321.322 | 256 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD | 421.073 | 227 | 515.379 | 276 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 617.37 | 608 | 695.399 | 685 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | 877.238 | 709 | 969.076 | 786 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 233.808 | 2,887 | 266.972 | 3,216 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 1,067.091 | 2,817 | 1,190.237 | 3,070 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 785.572 | 845 | 916.961 | 978 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC | 959.617 | 1,598 | 1,098.079 | 1,806 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GCP STUDENT LIVING PLC | 204.051 | 435 | 414.247 | 877 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NEWRIVER REIT PLC | 121.045 | 109 | 147.303 | 129 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 564.808 | 522 | 675.904 | 619 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRS REIT PLC/THE | 723.891 | 778 | 542.722 | 569 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC | 384.572 | 372 | 456.276 | 429 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 996.24 | 1,244 | 986.42 | 1,207 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 2,062.787 | 4,738 | 2,297.396 | 5,221 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CUSTODIAN REIT PLC | 394.227 | 406 | 468.275 | 478 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOME REIT PLC | 468.725 | 566 | 383.46 | 457 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 682.508 | 613 | 766.56 | 673 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AEW UK REIT PLC | 80.881 | 95 | 106.184 | 118 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LXI REIT PLC | 820.716 | 1,204 | 835.877 | 1,208 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REGIONAL REIT LTD | 414.619 | 370 | 470.723 | 416 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 313.459 | 370 | 330.806 | 388 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|--|-----------|------------|---------|------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| イスラエル | 千□ | 千イスラエル・シケル | 千□ | 千イスラエル・シケル |
| REIT 1 LTD | 157.562 | 3,177 | 181.198 | 3,740 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD | 87.076 | 876 | 23.453 | 219 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 韓国 | 千□ | 千韓国・ウォン | 千□ | 千韓国・ウォン |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | 43.051 | 283,114 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT | 90.636 | 429,991 | 101.644 | 481,155 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 49.557 | 393,982 | 49.672 | 389,405 |
| | (-) | (3) | (-) | (-) |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 18.615 | 109,358 | 17.541 | 101,772 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LOTTE REIT CO LTD | 141.664 | 805,920 | 156.57 | 877,855 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KORAMCO ENERGY PLUS REIT | 17.79 | 115,758 | 24.498 | 153,062 |
| | (-) | (△8) | (-) | (-) |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD-RTS | - | - | 23.41 | - |
| | (23.41) | (-) | (-) | (-) |
| SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD | 4.123 | 21,978 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| JR REIT XXVII | 143.27 | 781,151 | 154.298 | 831,650 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SK REITS CO LTD | 32.243 | 213,040 | 14.552 | 98,881 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS | - | - | 7.141 | - |
| | (7.141) | (△3) | (-) | (-) |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | 143.555 | 943,970 | 189.413 | 1,225,635 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD | 38.018 | 204,291 | 23.689 | 126,041 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD | 11.162 | 59,530 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KORAMCO ENERGY PLUS REIT-RTS | - | - | 3.188 | - |
| | (3.188) | (8) | (-) | (-) |
| ユーロ (シンガポール) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| CROMWELL REIT EUR | 313.4 | 747 | 343.8 | 820 |
| | (-) | (△3) | (-) | (-) |
| ユーロ (アイルランド) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| HIBERNIA REIT PLC | 670.655 | 908 | 977.503 | 1,366 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC | 425.258 | 652 | 513.785 | 772 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (オランダ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 4.781 | 105 | 4.387 | 96 |
| | (△18.604) | (-) | (-) | (-) |
| VASTNED RETAIL | 19.064 | 466 | 22.698 | 543 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WERELDHAVE NV | 40.773 | 586 | 46.515 | 641 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---------------------------------|----------|-------|---------|--------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| ユーロ (オランダ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| NSI NV | 19.909 | 706 | 22.325 | 781 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 33.552 | 707 | 40.321 | 820 |
| | (18.761) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (ベルギー) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| BEFIMMO | 25.803 | 1,020 | 30.753 | 1,198 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COFINIMMO SA | 32.746 | 4,266 | 37.41 | 4,889 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL ESTATES | 9.371 | 662 | 11.04 | 768 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 24.855 | 649 | 28.305 | 741 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WAREHOUSES DE PAUW | 160.242 | 5,965 | 180.812 | 6,657 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONTEA SCA | 9.915 | 1,166 | 11.58 | 1,340 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AEDIFICA | 41.877 | 4,645 | 46.408 | 5,123 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CARE PROPERTY INVEST NV | 30.116 | 760 | 33.301 | 842 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 20.671 | 1,030 | 21.96 | 1,075 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GECINA SA | 60.455 | 7,020 | 69.268 | 7,984 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ICADE | 33.864 | 2,105 | 38.571 | 2,397 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALTAREA | 3.947 | 632 | 4.342 | 671 |
| | (-) | (△18) | (-) | (-) |
| KLEPIERRE | 216.142 | 4,605 | 249.876 | 5,274 |
| | (-) | (△70) | (-) | (-) |
| COVIVIO | 52.496 | 3,782 | 60.831 | 4,338 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MERCIALYS | 40.088 | 352 | 41.163 | 360 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CARMILA SA | 39.205 | 546 | 47.86 | 660 |
| | (-) | (△9) | (-) | (-) |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 134.349 | 8,772 | 163.439 | 10,582 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALTAREA SCA-RTS | - | - | 1.672 | 4 |
| | (1.672) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (ドイツ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| HAMBORNER REIT AG | 61.156 | 580 | 69.728 | 653 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 108.844 | 1,916 | 189.799 | 3,435 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (スペイン) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 293.908 | 2,399 | 330.438 | 2,652 |
| | (-) | (△25) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------------------|----------------|----------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| ユーロ (スペイン) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 36.39 (-) | 182 (△4) | 45.091 (-) | 223 (-) |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 368.517 (-) | 3,654 (△16) | 424.548 (-) | 4,130 (-) |
| ユーロ (イタリア) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 44.176 (-) | 178 (-) | 55.103 (-) | 218 (-) |
| COIMA RES SPA | 18.292 (-) | 139 (-) | 10.696 (-) | 84 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | 柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 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 | 227.5 | 154 | 21,115 | | 0.0 |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | | 72.7 | 72.7 | 0 | 0 | | 0.0 |
| PRIME US REIT | | 211.4 | 159.8 | 107 | 14,613 | | 0.0 |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE | | - | 104.2 | 93 | 12,728 | | 0.0 |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME | | 658.4 | 526.3 | 302 | 41,304 | | 0.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | | 64.515 | 45.455 | 5,982 | 816,590 | | 1.5 |
| ALEXANDER'S INC. | | 0.989 | 0.661 | 143 | 19,630 | | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 66.493 | 44.04 | 3,963 | 540,991 | | 1.0 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | | - | 3.781 | 101 | 13,830 | | 0.0 |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | | 109.6 | 72.072 | 1,982 | 270,618 | | 0.5 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | | 68.881 | 50.727 | 297 | 40,642 | | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | | 29.676 | 23.151 | 1,606 | 219,295 | | 0.4 |
| BRT APARTMENTS CORP | | 3.832 | 4.22 | 93 | 12,746 | | 0.0 |
| SL GREEN | | 33.08 | 19.707 | 951 | 129,837 | | 0.2 |
| EPR PROPERTIES | | 34.918 | 23.004 | 1,042 | 142,327 | | 0.3 |
| PROLOGIS INC | | 346.969 | 227.981 | 25,615 | 3,496,320 | | 6.2 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 65.657 | 43.06 | 8,241 | 1,124,907 | | 2.0 |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | | 129.482 | 86.864 | 904 | 123,421 | | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 45.941 | 32.805 | 4,276 | 583,738 | | 1.0 |
| VERIS RESIDENTIAL INC | | 39.452 | 26.897 | 371 | 50,698 | | 0.1 |
| EQUINIX INC | | 42.011 | 28.058 | 17,962 | 2,451,656 | | 4.4 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | | 82.875 | 54.298 | 2,245 | 306,450 | | 0.5 |
| CTO REALTY GROUTH INC | | 2.965 | 1.858 | 111 | 15,155 | | 0.0 |
| COUSINS PROPERTIES INC | | 70.851 | 45.843 | 1,340 | 182,957 | | 0.3 |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | | 14.44 | 9.712 | 155 | 21,209 | | 0.0 |
| SITE CENTERS CORP | | 81.132 | 54.965 | 711 | 97,078 | | 0.2 |
| DUKE REALTY TRUST | | 175.583 | 118.933 | 6,254 | 853,702 | | 1.5 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | | - | 15.107 | 86 | 11,814 | | 0.0 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | | 30.569 | 20.121 | 5,140 | 701,601 | | 1.3 |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 161.226 | 105.387 | 7,509 | 1,025,023 | | 1.8 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | | 33.02 | 21.871 | 2,072 | 282,874 | | 0.5 |
| FIRST INDUSTRIAL RT | | 60.986 | 40.254 | 1,869 | 255,153 | | 0.5 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | | 253.462 | 166.168 | 4,134 | 564,285 | | 1.0 |
| EQUITY COMMONWEALTH | | 56.714 | 34.761 | 964 | 131,660 | | 0.2 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | | 65.332 | 45.424 | 1,201 | 163,925 | | 0.3 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | | 48.629 | 32.282 | 1,089 | 148,664 | | 0.3 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | | 76.025 | 55.097 | 278 | 38,052 | | 0.1 |
| WELLTOWER INC | | 196.362 | 139.809 | 11,000 | 1,501,413 | | 2.7 |
| EAST GROUP | | 18.728 | 12.57 | 1,902 | 259,719 | | 0.5 |
| KIMCO REALTY | | 204.567 | 191.008 | 3,632 | 495,864 | | 0.9 |
| KILROY REALTY CORP | | 50.045 | 32.424 | 1,659 | 226,543 | | 0.4 |
| LTC PROPERTIES INC | | 17.932 | 11.949 | 451 | 61,632 | | 0.1 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | | 112.836 | 80.9 | 152 | 20,759 | | 0.0 |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | | 48.171 | - | - | - | | - |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | | 83.055 | 52.781 | 503 | 68,654 | | 0.1 |
| IRON MOUNTAIN INC | | 135.791 | 89.485 | 4,222 | 576,369 | | 1.0 |
| THE MACERICH COMPANY | | 78.672 | 65.088 | 581 | 79,421 | | 0.1 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | | 79.741 | 53.477 | 3,719 | 507,723 | | 0.9 |
| ACADIA REALTY TRUST | | 42.275 | 26.852 | 422 | 57,687 | | 0.1 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | | 332.075 | 221.191 | 3,643 | 497,235 | | 0.9 |
| MID AMERICA | | 53.615 | 35.548 | 5,818 | 794,166 | | 1.4 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|----------------------------------|----------|---------|-----------|-------------|---|-----|
| | □ 数 | □ 数 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 比 | 率 |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | % |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 16.618 | 9.122 | 85 | 11,728 | | 0.0 |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 21.18 | 14.064 | 826 | 112,872 | | 0.2 |
| CENTERSPACE | 6.06 | 5.041 | 391 | 53,495 | | 0.1 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 7.856 | 5.609 | 142 | 19,414 | | 0.0 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 29.075 | 1.938 | 7 | 1,031 | | 0.0 |
| GETTY REALTY CORP | 16.951 | 13.2 | 340 | 46,537 | | 0.1 |
| PS BUSINESS PARKS | 9.349 | 6.193 | 1,151 | 157,222 | | 0.3 |
| RPT REALTY | 37.794 | 25.143 | 239 | 32,704 | | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | 175.691 | 185.275 | 12,129 | 1,655,617 | | 3.0 |
| REGENCY CENTERS CORP | 74.742 | 47.683 | 2,783 | 379,886 | | 0.7 |
| UDR INC | 139.707 | 92.65 | 4,085 | 557,679 | | 1.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 52.297 | 34.498 | 914 | 124,778 | | 0.2 |
| SAUL CENTERS INC | 6.198 | 4.594 | 199 | 27,294 | | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 154.013 | 101.12 | 9,767 | 1,333,122 | | 2.4 |
| LIFE STORAGE INC | 35.667 | 25.982 | 2,759 | 376,615 | | 0.7 |
| PUBLIC STORAGE | 71.371 | 47.03 | 14,207 | 1,939,153 | | 3.5 |
| SUN COMMUNITIES INC | 52.37 | 37.453 | 5,792 | 790,564 | | 1.4 |
| TANGER FACTORY OUTLET | 47.408 | 31.61 | 444 | 60,704 | | 0.1 |
| UMH PROPERTIES INC | 18.196 | 13.569 | 227 | 31,058 | | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 16.822 | 11.025 | 201 | 27,447 | | 0.0 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 5.995 | 3.781 | 191 | 26,128 | | 0.0 |
| VENTAS INC | 175.714 | 123.095 | 5,976 | 815,700 | | 1.5 |
| VORNADO REALTY TRUST | 74.163 | 49.038 | 1,386 | 189,216 | | 0.3 |
| WASHINGTON REIT | 41.358 | 25.835 | 553 | 75,566 | | 0.1 |
| GEO GROUP INC | 57.104 | — | — | — | | — |
| WEINGARTEN REALTY INVST | 56.087 | — | — | — | | — |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 65 | 43.066 | 2,760 | 376,843 | | 0.7 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 40.874 | 67.449 | 1,180 | 161,106 | | 0.3 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 62.579 | 41.354 | 6,691 | 913,378 | | 1.6 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 46.648 | 33.176 | 138 | 18,927 | | 0.0 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 100.104 | 67.157 | 671 | 91,662 | | 0.2 |
| CUBESMART | 94.451 | 69.12 | 2,799 | 382,084 | | 0.7 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 132.013 | 87.671 | 11,234 | 1,533,350 | | 2.7 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 102.73 | 64.291 | 538 | 73,447 | | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 277.416 | 184.696 | 2,707 | 369,566 | | 0.7 |
| DOUGLAS EMMETT INC | 77.84 | 54.064 | 1,200 | 163,818 | | 0.3 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | 57.754 | 37.066 | 577 | 78,821 | | 0.1 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 57.283 | 37.982 | 494 | 67,445 | | 0.1 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 48.846 | 31.732 | 225 | 30,837 | | 0.1 |
| TERRENO REALTY CORP | 32.097 | 23.266 | 1,300 | 177,546 | | 0.3 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 23.736 | 16.216 | 473 | 64,651 | | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST | 76.242 | 50.885 | 560 | 76,537 | | 0.1 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 119.402 | 82.511 | 2,331 | 318,262 | | 0.6 |
| CORESITE REALTY CORP | 20.353 | — | — | — | | — |
| VEREIT INC | 107.967 | — | — | — | | — |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 61.175 | 40.287 | 705 | 96,283 | | 0.2 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 22.164 | 16.172 | 310 | 42,424 | | 0.1 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES | 24.152 | — | — | — | | — |
| CHATHAM LODGING TRUST | 22.362 | 17.214 | 176 | 24,106 | | 0.0 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 98.359 | 70.265 | 971 | 132,636 | | 0.2 |
| WHITESTONE REIT | 17.85 | 16.382 | 175 | 23,992 | | 0.0 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 70.573 | 46.744 | 739 | 100,996 | | 0.2 |
| STAG INDUSTRIAL INC | 74.75 | 54.404 | 1,662 | 226,926 | | 0.4 |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | 104.353 | — | — | — | | — |
| CYRUSONE INC | 56.983 | — | — | — | | — |

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

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|--------------------------|--------------------------|---------|-----------|----------|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 | 比率 | 率 |
| (オーストラリア) | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 | | % |
| GOODMAN GROUP | 789.54 | 523,576 | 9,178 | 869,275 | | 1.6 |
| VICINITY CENTRES | 1,826.547 | 1,193,493 | 2,243 | 212,507 | | 0.4 |
| CHARTER HALL GROUP | 220.887 | 145,638 | 1,625 | 153,934 | | 0.3 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 136.67 | 96,915 | 332 | 31,483 | | 0.1 |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 513.792 | 341,231 | 934 | 88,551 | | 0.2 |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 212.974 | 162,422 | 469 | 44,456 | | 0.1 |
| ARENA REIT | 159.242 | 103,753 | 422 | 39,993 | | 0.1 |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 260.875 | 186,309 | 806 | 76,404 | | 0.1 |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 73.145 | 63,933 | 172 | 16,348 | | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 516.215 | 329,249 | 740 | 70,162 | | 0.1 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 73.965 | 65,661 | 206 | 19,589 | | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP | 247.876 | 178,986 | 170 | 16,104 | | 0.0 |
| HOME CONSORTIUM LTD | 85.98 | — | — | — | | — |
| RURAL FUNDS GROUP | 160.193 | 126.29 | 334 | 31,696 | | 0.1 |
| IRONGATE GROUP | 256.148 | 181.194 | 341 | 32,348 | | 0.1 |
| SCENTRE GROUP | 2,437.607 | 1,606,393 | 4,208 | 398,610 | | 0.7 |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY | — | 140,343 | 115 | 10,899 | | 0.0 |
| HOME CONSORTIUM LTD | — | 53,607 | 241 | 22,847 | | 0.0 |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 213.11 | 439,583 | 580 | 54,955 | | 0.1 |
| HEALTHCO REIT | — | 71,487 | 105 | 10,020 | | 0.0 |
| CENTURIA OFFICE REIT | 179.274 | 127.89 | 225 | 21,317 | | 0.0 |
| AVENTUS GROUP | 176.463 | — | — | — | | — |
| WAYPOINT REIT LTD | 382.777 | 212,662 | 480 | 45,519 | | 0.1 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 15,356.239 31銘柄<6.9%> | 10,522.248 32銘柄<6.4%> | 37,590 | 3,560,193 | — 6.4 |
| (香港) | 千□ | 千円 | 千香港・ドル | 千円 | | % |
| LINK REIT | 977.72 | 648.62 | 41,835 | 727,527 | | 1.3 |
| PROSPERITY REIT | 597 | 353 | 843 | 14,671 | | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR | 761 | 682 | 2,066 | 35,935 | | 0.1 |
| CHAMPION REIT | 937.07 | 632.07 | 2,218 | 38,580 | | 0.1 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | 451 | 342 | 1,231 | 21,410 | | 0.0 |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T | 680 | 436 | 2,816 | 48,979 | | 0.1 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 4,403.79 6銘柄<1.7%> | 3,093.69 6銘柄<1.6%> | 51,012 | 887,106 | — 1.6 |
| (シンガポール) | 千□ | 千円 | 千シンガポール・ドル | 千円 | | % |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 2,169.309 | 1,573,909 | 3,368 | 331,393 | | 0.6 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 1,544.76 | 1,037.96 | 2,854 | 280,843 | | 0.5 |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 1,006.99 | 668.49 | 1,076 | 105,894 | | 0.2 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,370.62 | 985.82 | 1,616 | 159,071 | | 0.3 |
| STARHILL GLOBAL REIT | 656.8 | 412.4 | 239 | 23,534 | | 0.0 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 891.616 | 588,116 | 670 | 65,965 | | 0.1 |
| KEPPEL REIT | 951.5 | 598.9 | 676 | 66,586 | | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 622.9 | 326.6 | 728 | 71,659 | | 0.1 |
| ESR LOGOS REIT | 1,148.73 | 1,558.24 | 638 | 62,859 | | 0.1 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 365.2 | 277.1 | 357 | 35,170 | | 0.1 |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 450.18 | 338.18 | 388 | 38,264 | | 0.1 |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 608.8 | 327.7 | 91 | 9,027 | | 0.0 |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 216.895 | 163,795 | 221 | 21,756 | | 0.0 |
| PARKWAY LIFE REIT | 179 | 117.4 | 564 | 55,560 | | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU | 2,759.1 | — | — | — | | — |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 913.12 | 597.62 | 1,500 | 147,587 | | 0.3 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 1,028.2 | 673.1 | 1,204 | 118,545 | | 0.2 |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 587.88 | — | — | — | | — |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 313.2 | — | — | — | | — |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | 1,019 | 124.4 | 149 | 14,687 | | 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| (シンガポール) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 491.5 | 303.8 | 491.5 | 303.8 | 491.5 | 303.8 |
| SPH REIT | 471.9 | 313 | 471.9 | 313 | 471.9 | 313 |
| EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT | 127.4 | 112.4 | 127.4 | 112.4 | 127.4 | 112.4 |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T | 208.1 | 194.5 | 208.1 | 194.5 | 208.1 | 194.5 |
| OUÉ COMMERCIAL REIT | 1,120.355 | 787,955 | 1,120.355 | 787,955 | 1,120.355 | 787,955 |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 422.2 | 573 | 422.2 | 573 | 422.2 | 573 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 377.1 | - | 377.1 | - | 377.1 | - |
| DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST | - | 103.9 | - | 103.9 | - | 103.9 |
| IREIT GLOBAL | 214.5 | 168.6 | 214.5 | 168.6 | 214.5 | 168.6 |
| KEPPEL DC REIT | 591.5 | 403.5 | 591.5 | 403.5 | 591.5 | 403.5 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T | 1,314.964 | 894,764 | 1,314.964 | 894,764 | 1,314.964 | 894,764 |
| 小計 | 24,143.319 | 14,225.149 | 24,143.319 | 14,225.149 | 24,143.319 | 14,225.149 |
| | 30銘柄<3.3%> | 27銘柄<3.5%> | 30銘柄<3.3%> | 27銘柄<3.5%> | 30銘柄<3.3%> | 27銘柄<3.5%> |
| (ニュージーランド) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| PRECINCT PROPERTIES | 510.038 | 391.694 | 510.038 | 391.694 | 510.038 | 391.694 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 180.112 | 142,269 | 180.112 | 142,269 | 180.112 | 142,269 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 520.345 | 317.48 | 520.345 | 317.48 | 520.345 | 317.48 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 742.461 | 467,188 | 742.461 | 467,188 | 742.461 | 467,188 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 388.009 | 289.87 | 388.009 | 289.87 | 388.009 | 289.87 |
| 小計 | 2,340.965 | 1,608.501 | 2,340.965 | 1,608.501 | 2,340.965 | 1,608.501 |
| | 5銘柄<0.4%> | 5銘柄<0.4%> | 5銘柄<0.4%> | 5銘柄<0.4%> | 5銘柄<0.4%> | 5銘柄<0.4%> |
| (イギリス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| BRITISH LAND CO PLC | 437.522 | 288.115 | 437.522 | 288.115 | 437.522 | 288.115 |
| DERWENT LONDON PLC | 52.817 | 34.55 | 52.817 | 34.55 | 52.817 | 34.55 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 77.686 | 53.044 | 77.686 | 53.044 | 77.686 | 53.044 |
| HAMMERSON PLC | 1,976.821 | 1,047,969 | 1,976.821 | 1,047,969 | 1,976.821 | 1,047,969 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 355.626 | 230.251 | 355.626 | 230.251 | 355.626 | 230.251 |
| WORKSPACE GROUP PLC | 63.229 | 41.816 | 63.229 | 41.816 | 63.229 | 41.816 |
| INTU PROPERTIES PLC | 231.04 | 231.04 | 231.04 | 231.04 | 231.04 | 231.04 |
| UNITE GROUP PLC | 186.15 | 123.179 | 186.15 | 123.179 | 186.15 | 123.179 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 617.519 | 407,879 | 617.519 | 407,879 | 617.519 | 407,879 |
| SHAFTESBURY PLC | 144.406 | 88.05 | 144.406 | 88.05 | 144.406 | 88.05 |
| SEGRO PLC | 564.915 | 370.318 | 564.915 | 370.318 | 564.915 | 370.318 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 119.078 | 77.506 | 119.078 | 77.506 | 119.078 | 77.506 |
| ASSURA PLC | 1,242.776 | 903.196 | 1,242.776 | 903.196 | 1,242.776 | 903.196 |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI | 179.591 | 115.909 | 179.591 | 115.909 | 179.591 | 115.909 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT | 255.156 | 160.85 | 255.156 | 160.85 | 255.156 | 160.85 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 257.572 | 179,543 | 257.572 | 179,543 | 257.572 | 179,543 |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | 347.914 | 256,076 | 347.914 | 256,076 | 347.914 | 256,076 |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 97.821 | 64.657 | 97.821 | 64.657 | 97.821 | 64.657 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 423.479 | 300,333 | 423.479 | 300,333 | 423.479 | 300,333 |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT | 370.408 | 239,019 | 370.408 | 239,019 | 370.408 | 239,019 |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL | 397.993 | 259,531 | 397.993 | 259,531 | 397.993 | 259,531 |
| GCP STUDENT LIVING PLC | 210.196 | - | 210.196 | - | 210.196 | - |
| NEWRIVER REIT PLC | 139.604 | 113,346 | 139.604 | 113,346 | 139.604 | 113,346 |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 294.033 | 182,937 | 294.033 | 182,937 | 294.033 | 182,937 |
| PRS REIT PLC/THE | - | 181,169 | - | 181,169 | - | 181,169 |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT | 177.39 | 105,686 | 177.39 | 105,686 | 177.39 | 105,686 |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 371.767 | 381,587 | 371.767 | 381,587 | 371.767 | 381,587 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 810.128 | 575,519 | 810.128 | 575,519 | 810.128 | 575,519 |
| CUSTODIAN REIT PLC | 202.92 | 128,872 | 202.92 | 128,872 | 202.92 | 128,872 |
| HOME REIT PLC | 100.813 | 186,078 | 100.813 | 186,078 | 100.813 | 186,078 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 281.997 | 197,945 | 281.997 | 197,945 | 281.997 | 197,945 |
| AEW UK REIT PLC | 83.963 | 58.66 | 83.963 | 58.66 | 83.963 | 58.66 |
| LXI REIT PLC | 292.448 | 277,287 | 292.448 | 277,287 | 292.448 | 277,287 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|---------|------------|------------|------------|-----------|-----|
| | □数 | 金額 | □数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (イギリス) | 千口 | | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| REGIONAL REIT LTD | 206.337 | | 150.233 | 115 | 19,332 | 0.0 |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 153.417 | | 136.07 | 166 | 27,879 | 0.0 |
| 小計 | □数・金額 | 11,724.532 | 8,148.22 | 18,267 | 3,052,903 | - |
| | 銘柄数<比率> | 34銘柄<5.6%> | 34銘柄<5.5%> | - | - | 5.5 |
| (イスラエル) | 千口 | | 千口 | 千イスラエル・シケル | 千円 | % |
| REIT 1 LTD | 85.363 | | 61.727 | 1,132 | 44,721 | 0.1 |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD | - | | 63.623 | 613 | 24,241 | 0.0 |
| 小計 | □数・金額 | 85.363 | 125.35 | 1,745 | 68,963 | - |
| | 銘柄数<比率> | 1銘柄<0.1%> | 2銘柄<0.1%> | - | - | 0.1 |
| (韓国) | 千口 | | 千口 | 千韓国・ウォン | 千円 | % |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE | 39.843 | | 28.835 | 129,757 | 13,689 | 0.0 |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 19.635 | | 19.52 | 151,670 | 16,001 | 0.0 |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 9.958 | | 11.032 | 60,124 | 6,343 | 0.0 |
| LOTTE REIT CO LTD | 54.509 | | 39.603 | 224,152 | 23,648 | 0.0 |
| KORAMCO ENERGY PLUS REIT | 17.86 | | 11.152 | 66,688 | 7,035 | 0.0 |
| SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD | - | | 4.123 | 21,315 | 2,248 | 0.0 |
| JR REIT XXVII | 56.222 | | 45.194 | 239,076 | 25,222 | 0.0 |
| SK REITS CO LTD | - | | 17.691 | 109,861 | 11,590 | 0.0 |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | 46.423 | | 43.616 | 244,249 | 25,768 | 0.0 |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD | - | | 14.329 | 71,286 | 7,520 | 0.0 |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD | - | | 11.162 | 57,261 | 6,041 | 0.0 |
| 小計 | □数・金額 | 244.45 | 246.257 | 1,375,444 | 145,109 | - |
| | 銘柄数<比率> | 7銘柄<0.2%> | 11銘柄<0.3%> | - | - | 0.3 |
| (ユーロ…シンガポール) | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| CROMWELL REIT EUR | 131.74 | | 101.34 | 198 | 28,494 | 0.1 |
| 小計 | □数・金額 | 131.74 | 101.34 | 198 | 28,494 | - |
| | 銘柄数<比率> | 1銘柄<0.1%> | 1銘柄<0.1%> | - | - | 0.1 |
| (ユーロ…アイルランド) | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| HIBERNIA REIT PLC | 306.848 | | - | - | - | - |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI | 214.307 | | 125.78 | 158 | 22,808 | 0.0 |
| 小計 | □数・金額 | 521.155 | 125.78 | 158 | 22,808 | - |
| | 銘柄数<比率> | 2銘柄<0.1%> | 1銘柄<0.0%> | - | - | 0.0 |
| (ユーロ…オランダ) | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 18.21 | | - | - | - | - |
| VASTNED RETAIL | 8.822 | | 5.188 | 115 | 16,634 | 0.0 |
| WERELDHAVE NV | 18.894 | | 13.152 | 192 | 27,565 | 0.0 |
| NSI NV | 8.112 | | 5.696 | 195 | 27,987 | 0.0 |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | - | | 11.992 | 263 | 37,779 | 0.1 |
| 小計 | □数・金額 | 54.038 | 36.028 | 766 | 109,967 | - |
| | 銘柄数<比率> | 4銘柄<0.2%> | 4銘柄<0.2%> | - | - | 0.2 |
| (ユーロ…ベルギー) | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| BEFIMMO | 12.281 | | 7.331 | 346 | 49,640 | 0.1 |
| COFINIMMO SA | 13.734 | | 9.07 | 1,028 | 147,554 | 0.3 |
| RETAIL ESTATES | 5.045 | | 3.376 | 218 | 31,287 | 0.1 |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 10.415 | | 6.965 | 179 | 25,679 | 0.0 |
| WAREHOUSES DE PAUW | 64.409 | | 43.839 | 1,386 | 198,862 | 0.4 |
| MONTEA SCA | 4.725 | | 3.06 | 283 | 40,606 | 0.1 |
| AEDIFICA | 15.707 | | 11.176 | 1,058 | 151,913 | 0.3 |
| CARE PROPERTY INVEST NV | 12.034 | | 8.849 | 213 | 30,657 | 0.1 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 8.239 | | 6.95 | 287 | 41,178 | 0.1 |
| 小計 | □数・金額 | 146.589 | 100.616 | 5,000 | 717,379 | - |
| | 銘柄数<比率> | 9銘柄<1.3%> | 9銘柄<1.3%> | - | - | 1.3 |
| (ユーロ…フランス) | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| GECINA SA | 25.599 | | 16.786 | 1,636 | 234,791 | 0.4 |
| ICADE | 14.526 | | 9.819 | 478 | 68,656 | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|----------------------------|----------------------------|------------|-----------------|-----------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (ユーロ…フランス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| ALTAREA | 1,643 | 1,248 | 160 | 160 | 23,095 | 0.0 |
| KLEPIERRE | 93.81 | 60,076 | 1,241 | 1,241 | 178,144 | 0.3 |
| COVIVIO | 22,853 | 14,518 | 829 | 829 | 119,029 | 0.2 |
| MERCIALYS | 19,022 | 17,947 | 151 | 151 | 21,678 | 0.0 |
| CARMILA SA | 21,853 | 13,198 | 196 | 196 | 28,135 | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 64,946 | 35,856 | 1,946 | 1,946 | 279,210 | 0.5 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 264,252 8銘柄<2.4%> | 169,448 8銘柄<1.7%> | 6,641 - | 952,743 - | - 1.7 |
| (ユーロ…ドイツ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| HAMBORNER REIT AG | 32,106 | 23,534 | 200 | 200 | 28,697 | 0.1 |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 84,625 | 3,67 | 44 | 44 | 6,391 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 116,731 2銘柄<0.3%> | 27,204 2銘柄<0.1%> | 244 - | 35,089 - | - 0.1 |
| (ユーロ…スペイン) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 119,135 | 82,605 | 530 | 530 | 76,139 | 0.1 |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 27,656 | 18,955 | 93 | 93 | 13,474 | 0.0 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 15,863 | 102,599 | 998 | 998 | 143,214 | 0.3 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 305,421 3銘柄<0.4%> | 204,159 3銘柄<0.4%> | 1,622 - | 232,828 - | - 0.4 |
| (ユーロ…イタリア) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 25,287 | 14,36 | 51 | 51 | 7,323 | 0.0 |
| COIMA RES SPA | - | 7,596 | 75 | 75 | 10,777 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 25,287 1銘柄<0.0%> | 21,956 2銘柄<0.0%> | 126 - | 18,100 - | - 0.0 |
| 合計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 72,334,932 327銘柄<99.4%> | 47,314,924 328銘柄<99.3%> | - | 55,595,607 - | - 99.3 |

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

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

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

■投資信託財産の構成

2022年6月22日現在

| 項目 | 当期 | | 期末 | |
|---------------|------------|-------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 | 評価額 | 比率 |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 千円 | % | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 55,595,607 | 98.5 | 842,071 | 1.5 |
| 投資信託財産総額 | 56,437,679 | 100.0 | 56,437,679 | 100.0 |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、55,938,040千円、99.1%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.49円、1カナダ・ドル=105.41円、1オーストラリア・ドル=94.71円、1香港・ドル=17.39円、1シンガポール・ドル=98.39円、1ニュージーランド・ドル=85.96円、1イギリス・ポンド=167.12円、1イスラエル・シケル=39.504円、100韓国・ウォン=10.55円、1ユーロ=143.46円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月22日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|-----------------------------------|-----------------|
| 先進国REITインデックスF<為替ヘッジなし> (ファンドラップ) | 89,931,914円 |
| 先進国REITインデックスF<為替ヘッジあり> (ファンドラップ) | 50,563,654円 |
| MITOラップ型ファンド (安定型) | 6,720,407円 |
| MITOラップ型ファンド (中立型) | 23,507,005円 |
| MITOラップ型ファンド (積極型) | 124,969,213円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 31,704,221円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 17,648,722円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 28,738,279円 |
| たわらノーロード 先進国リート | 12,630,933,969円 |
| たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> | 1,109,201,766円 |
| たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> | 313,831,478円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 2,325,859,048円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 21,585,836円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 393,429,232円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 783,248,768円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) | 2,849,915円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 5,559,853円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) | 92,995,102円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) | 219,476,091円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 126,975円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 5,370,883円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 2,144,625円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 11,960,422円 |
| One DC先進国リートインデックスファンド | 1,184,878,273円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 14,409,019円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 497,283,471円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 42,883,778円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10) | 179,983,530円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20) | 232,723,605円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30) | 466,414,247円 |
| 投資のソムリエ | 6,257,726,433円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 394,192,597円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 192,368,902円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 358,133,162円 |

| | |
|---|-----------------|
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 1,813,208,729円 |
| ワールドアセットバランス (基本コース) | 355,965,633円 |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) | 243,707,293円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 36,458,019円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 18,413,243円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 2,367,743円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 82,448,556円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 319,237,578円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 147,067,136円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) | 42,933,275円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) | 19,741,762円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) | 12,168,821円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065) | 2,125,847円 |
| DIAMパッシブ資産分散ファンド | 276,893,448円 |
| DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金> | 252,886,121円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 983,915円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用品) 20-4 | 53,121,417円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 656,048円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 459,027円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用品) 21-03 | 56,379,915円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 583,400円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定) | 826,526円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 692,408円 |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) | 153,285,243円 |
| AMOneマルチアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定) | 8,623,168円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 1,380,735円 |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用) | 7,212,770円 |
| しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定) | 31,286,199円 |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) | 80,722,535円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 194,641,132円 |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 823,557,498円 |
| DIAM海外リートインデックスファンド (適格機関投資家限定) | 436,383,528円 |
| 期末元本合計 | 33,589,773,063円 |

■損益の状況

当期 自2021年6月23日 至2022年6月22日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 2,249,560,788 | 円 |
| | 受取配当金 | 2,170,878,662 | |
| | 受取利息 | 1,204,472 | |
| | その他の収益 | 77,775,326 | |
| | 支払利息 | △297,672 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | 1,466,080,453 | |
| | 売買益 | 20,774,196,674 | |
| | 売買損 | △19,308,116,221 | |
| (C) | その他の費用 | △65,480,614 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 3,650,160,627 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 27,471,618,273 | |
| (F) | 解約差損益金 | △94,232,927,308 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 85,524,453,040 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | 22,413,304,632 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 22,413,304,632 | |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第14期 (決算日 2022年4月18日)

(計算期間 2021年4月20日～2022年4月18日)

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

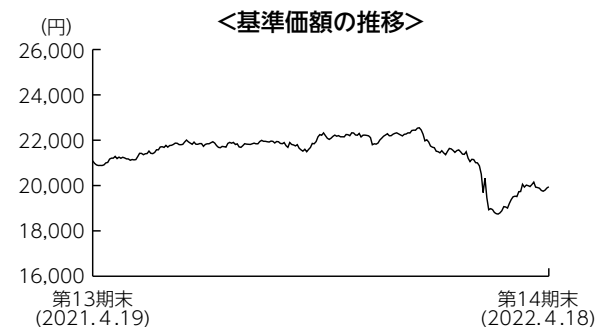
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年4月20日から2022年4月18日まで）



基準価額の推移

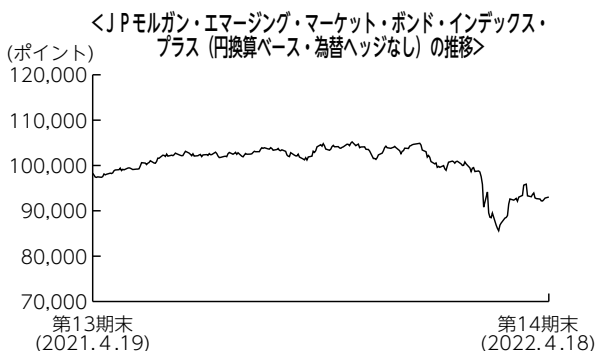
当期末の基準価額は19,947円となり、前期末比で5.4%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米長期金利の上昇（価格は下落）を主因に、基準価額は下落しました。

投資環境

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



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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○国別構成比 期首（前期末）

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

期末

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

(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で5.3%下落しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------|-----------|-------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) その他費用 (保管費用) | 3円 (3) | 0.013% (0.013) | (a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| 合 計 | 3 | 0.013 | |
| 期中の平均基準価額は21,435円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------|--------------------|-----------|-----------|----------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うち B B 格 以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル 1,105,238 | 千アメリカ・ドル 1,057,538 | 千円 133,968,997 | % 97.6 | % 17.8 | % 77.6 | % 12.1 | % 7.9 |
| 合 計 | - | - | 133,968,997 | 97.6 | 17.8 | 77.6 | 12.1 | 7.9 |

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

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

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | | | |
|--|-------|--------|----------|-----------|-------------|------------|
| | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 | 国債証券 | 6.0500 | 9,900 | 10,594 | 1,342,096 | 2040/01/11 |
| BRAZIL 5.625 01/07/41 | 国債証券 | 5.6250 | 10,100 | 9,413 | 1,192,502 | 2041/01/07 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 | 国債証券 | 4.6000 | 11,000 | 9,812 | 1,242,984 | 2046/01/23 |
| REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61 | 国債証券 | 3.1000 | 3,000 | 2,242 | 284,098 | 2061/01/22 |
| PANAMA 4.5 01/19/63 | 国債証券 | 4.5000 | 2,000 | 1,804 | 228,609 | 2063/01/19 |
| PANAMA 7.125 01/29/26 | 国債証券 | 7.1250 | 3,800 | 4,292 | 543,780 | 2026/01/29 |
| PHILIPPINES 7.75 01/14/31 | 国債証券 | 7.7500 | 3,100 | 3,956 | 501,162 | 2031/01/14 |
| ROMANIA 6.125 01/22/44 | 国債証券 | 6.1250 | 8,400 | 9,288 | 1,176,657 | 2044/01/22 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55 | 国債証券 | 3.7500 | 2,000 | 1,820 | 230,593 | 2055/01/21 |
| INDONESIA 5.25 01/17/42 | 国債証券 | 5.2500 | 10,300 | 10,882 | 1,378,614 | 2042/01/17 |
| INDONESIA 6.75 01/15/44 | 国債証券 | 6.7500 | 6,500 | 8,200 | 1,038,837 | 2044/01/15 |
| BRAZIL 5.0 01/27/45 | 国債証券 | 5.0000 | 10,800 | 9,156 | 1,159,926 | 2045/01/27 |
| INDONESIA 5.125 01/15/45 | 国債証券 | 5.1250 | 8,400 | 8,782 | 1,112,590 | 2045/01/15 |
| INDONESIA 4.35 01/11/48 | 国債証券 | 4.3500 | 5,000 | 4,873 | 617,405 | 2048/01/11 |
| DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 | 国債証券 | 5.8750 | 6,000 | 4,830 | 611,864 | 2060/01/30 |
| BRAZIL 8.25 01/20/34 | 国債証券 | 8.2500 | 7,200 | 8,654 | 1,096,339 | 2034/01/20 |
| PANAMA 6.7 01/26/36 | 国債証券 | 6.7000 | 11,900 | 14,093 | 1,785,322 | 2036/01/26 |
| INDONESIA 7.75 01/17/38 | 国債証券 | 7.7500 | 4,500 | 5,926 | 750,709 | 2038/01/17 |
| PHILIPPINES 3.95 01/20/40 | 国債証券 | 3.9500 | 7,800 | 7,412 | 939,008 | 2040/01/20 |
| INDONESIA 5.95 01/08/46 | 国債証券 | 5.9500 | 4,200 | 4,880 | 618,322 | 2046/01/08 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 | 国債証券 | 3.6000 | 4,200 | 4,267 | 540,547 | 2025/01/30 |
| INDONESIA 4.125 01/15/25 | 国債証券 | 4.1250 | 5,800 | 5,930 | 751,235 | 2025/01/15 |
| INDONESIA 4.35 01/08/27 | 国債証券 | 4.3500 | 6,000 | 6,232 | 789,528 | 2027/01/08 |
| PHILIPPINES 3.75 01/14/29 | 国債証券 | 3.7500 | 8,000 | 8,083 | 1,023,998 | 2029/01/14 |
| ROMANIA 4.875 01/22/24 | 国債証券 | 4.8750 | 5,600 | 5,773 | 731,408 | 2024/01/22 |
| COLOMBIA 4.5 01/28/26 | 国債証券 | 4.5000 | 9,000 | 8,843 | 1,120,333 | 2026/01/28 |
| CROATIA 6.0 01/26/24 | 国債証券 | 6.0000 | 11,400 | 11,985 | 1,518,359 | 2024/01/26 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|---|------|--------|----------|----------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 | 国債証券 | 4.1250 | 7,000 | 7,222 | 914,896 | 2026/01/21 |
| INDONESIA 5.875 01/15/24 | 国債証券 | 5.8750 | 6,200 | 6,520 | 826,055 | 2024/01/15 |
| INDONESIA 4.75 01/08/26 | 国債証券 | 4.7500 | 7,800 | 8,169 | 1,034,857 | 2026/01/08 |
| PHILIPPINES 4.2 01/21/24 | 国債証券 | 4.2000 | 6,800 | 6,969 | 882,864 | 2024/01/21 |
| BRAZIL 4.625 01/13/28 | 国債証券 | 4.6250 | 12,800 | 12,785 | 1,619,614 | 2028/01/13 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28 | 国債証券 | 3.7500 | 5,200 | 5,164 | 654,273 | 2028/01/11 |
| INDONESIA 3.5 01/11/28 | 国債証券 | 3.5000 | 5,200 | 5,231 | 662,749 | 2028/01/11 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50 | 国債証券 | 5.2500 | 2,000 | 2,245 | 284,449 | 2050/01/16 |
| PERU 3.0 01/15/34 | 国債証券 | 3.0000 | 5,000 | 4,380 | 554,858 | 2034/01/15 |
| REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50 | 国債証券 | 3.5000 | 3,000 | 2,544 | 322,395 | 2050/01/25 |
| REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34 | 国債証券 | 3.5000 | 2,000 | 1,887 | 239,045 | 2034/01/31 |
| PANAMA 3.16 01/23/30 | 国債証券 | 3.1600 | 10,000 | 9,486 | 1,201,686 | 2030/01/23 |
| BRAZIL 4.75 01/14/50 | 国債証券 | 4.7500 | 12,000 | 9,639 | 1,221,068 | 2050/01/14 |
| REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32 | 国債証券 | 2.5500 | 2,000 | 1,800 | 228,024 | 2032/01/27 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50 | 国債証券 | 4.5000 | 6,000 | 5,281 | 669,098 | 2050/01/31 |
| REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31 | 国債証券 | 2.4500 | 2,000 | 1,804 | 228,591 | 2031/01/31 |
| REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 | 国債証券 | 4.3750 | 4,000 | 4,210 | 533,322 | 2031/01/23 |
| PERU 2.783 01/23/31 | 国債証券 | 2.7830 | 20,000 | 18,025 | 2,283,407 | 2031/01/23 |
| COLOMBIA 3.0 01/30/30 | 国債証券 | 3.0000 | 8,000 | 6,658 | 843,531 | 2030/01/30 |
| PERU 2.392 01/23/26 | 国債証券 | 2.3920 | 6,000 | 5,712 | 723,649 | 2026/01/23 |
| REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27 | 国債証券 | 2.7500 | 2,000 | 1,920 | 243,225 | 2027/01/31 |
| COLOMBIA 3.875 02/15/61 | 国債証券 | 3.8750 | 4,000 | 2,669 | 338,113 | 2061/02/15 |
| BRAZIL 8.75 02/04/25 | 国債証券 | 8.7500 | 4,800 | 5,550 | 703,074 | 2025/02/04 |
| PHILIPPINES 3.7 02/02/42 | 国債証券 | 3.7000 | 8,000 | 7,344 | 930,337 | 2042/02/02 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48 | 国債証券 | 4.6000 | 8,400 | 7,420 | 940,009 | 2048/02/10 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61 | 国債証券 | 3.4500 | 3,000 | 2,513 | 318,420 | 2061/02/02 |
| PHILIPPINES 9.5 02/02/30 | 国債証券 | 9.5000 | 5,800 | 8,005 | 1,014,097 | 2030/02/02 |
| COLOMBIA 4.125 02/22/42 | 国債証券 | 4.1250 | 9,000 | 6,600 | 836,152 | 2042/02/22 |
| COLOMBIA 5.625 02/26/44 | 国債証券 | 5.6250 | 11,000 | 9,358 | 1,185,558 | 2044/02/26 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34 | 国債証券 | 3.5000 | 2,000 | 1,760 | 223,020 | 2034/02/12 |
| INDONESIA 5.35 02/11/49 | 国債証券 | 5.3500 | 3,000 | 3,309 | 419,203 | 2049/02/11 |
| ROMANIA 4.0 02/14/51 | 国債証券 | 4.0000 | 9,000 | 7,485 | 948,324 | 2051/02/14 |
| BRAZIL 5.625 02/21/47 | 国債証券 | 5.6250 | 7,600 | 6,864 | 869,572 | 2047/02/21 |
| INDONESIA 4.75 02/11/29 | 国債証券 | 4.7500 | 5,000 | 5,366 | 679,802 | 2029/02/11 |
| HUNGARY 5.375 02/21/23 | 国債証券 | 5.3750 | 5,358 | 5,482 | 694,492 | 2023/02/21 |
| PHILIPPINES 3.0 02/01/28 | 国債証券 | 3.0000 | 10,000 | 9,816 | 1,243,564 | 2028/02/01 |
| ROMANIA 3.0 02/14/31 | 国債証券 | 3.0000 | 9,000 | 8,080 | 1,023,690 | 2031/02/14 |
| REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28 | 国債証券 | 3.2400 | 3,000 | 2,932 | 371,430 | 2028/02/06 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33 | 国債証券 | 2.2500 | 4,000 | 3,566 | 451,741 | 2033/02/02 |
| DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 | 国債証券 | 6.0000 | 5,000 | 4,693 | 594,604 | 2033/02/22 |
| INDONESIA 2.85 02/14/30 | 国債証券 | 2.8500 | 4,000 | 3,800 | 481,386 | 2030/02/14 |
| DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 | 国債証券 | 5.5000 | 5,000 | 4,797 | 607,747 | 2029/02/22 |
| PANAMA 3.875 03/17/28 | 国債証券 | 3.8750 | 7,100 | 7,085 | 897,638 | 2028/03/17 |
| COLOMBIA 4.5 03/15/29 | 国債証券 | 4.5000 | 9,000 | 8,456 | 1,071,211 | 2029/03/15 |

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

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

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

■投資信託財産の構成

2022年4月18日現在

| 項目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|-------------------|---|-----------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 公 社 債 | 千円 133,968,997 | | % 96.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 5,083,944 | | 3.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 139,052,942 | | 100.0 |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、137,112,810千円、98.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=126.68円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月18日)現在

| 項 | 目 | 当 | 期 | 末 |
|-----|-----------------|-----------------|---|---|
| (A) | 資 産 | 139,052,942,122 | 円 | |
| | コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 3,558,351,761 | | |
| | 公 社 債(評価額) | 133,968,997,674 | | |
| | 未 収 利 息 | 534,037,882 | | |
| | 前 払 費 用 | 991,554,805 | | |
| (B) | 負 債 | 1,760,168,800 | | |
| | 未 払 債 金 | 1,758,951,800 | | |
| | 未 払 解 約 金 | 1,217,000 | | |
| (C) | 純 資 産 総 額(A-B) | 137,292,773,322 | | |
| | 元 本 | 68,830,241,594 | | |
| | 次 期 繰 越 損 益 金 | 68,462,531,728 | | |
| (D) | 受 益 権 総 口 数 | 68,830,241,594 | 口 | |
| | 1万口当たり基準価額(C/D) | 19,947 | 円 | |

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

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|--|-----------------|
| DIAM新興国債券インテックスファンド<為替ヘッジなし> | 193,172,059円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 1,842,717,308円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 137,186,833円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 384,233,606円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 163,093,610円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 1,133,115円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 3,132,310円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 29,703,612円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 2,217,012円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 2,217,582円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 59,256,549円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 236,077,296円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 325,129,552円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 670,583,251円 |
| 投資のソムリエ | 21,826,975,940円 |
| クルーズコントロール | 269,846,036円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 1,327,285,815円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 243,760,761円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 1,135,044,315円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 6,330,686,040円 |
| ワールドアセットバランス (基本コース) | 536,425,776円 |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) | 600,825,759円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) | 33,112,488円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) | 16,727,971円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 7,764,190円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) | 124,678,896円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 798,577,422円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 222,519,382円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) | 36,355,348円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) | 14,482,845円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) | 11,120,595円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) | 1,277,092円 |
| エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定) | 21,510,968,507円 |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) | 555,387,723円 |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 2,435,421,495円 |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド2 (適格機関投資家限定) | 589,689,490円 |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF専用) (適格機関投資家専用) | 19,931,763円 |
| しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定) | 92,241,468円 |
| エマージング債券バッションファンドVA (適格機関投資家専用) | 9,327,182円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 174,538,113円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) | 86,381,611円 |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 5,769,033,876円 |
| 期末元本合計 | 68,830,241,594円 |

■損益の状況

当期 自2021年4月20日 至2022年4月18日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|------------------|------------------|---|
| (A) | 配 当 等 収 益 | 6,283,492,883 | 円 |
| | 受 取 利 息 | 6,283,975,110 | |
| | 支 払 利 息 | △482,227 | |
| (B) | 有 価 証 券 売 買 損 益 | △12,859,825,221 | |
| | 売 買 損 益 | 17,626,879,424 | |
| | 売 買 損 益 | △30,486,704,645 | |
| (C) | そ の 他 費 用 | △17,925,399 | |
| (D) | 当 期 損 益 金(A+B+C) | △6,594,257,737 | |
| (E) | 前 期 繰 越 損 益 金 | 80,324,854,399 | |
| (F) | 解 約 差 損 益 金 | △168,137,236,956 | |
| (G) | 追 加 信 託 差 損 益 金 | 162,869,172,022 | |
| (H) | 合 計(D+E+F+G) | 68,462,531,728 | |
| | 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 68,462,531,728 | |

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2022年4月18日）

（計算期間 2021年4月20日～2022年4月18日）

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | MSCIエマージング・マーケット・インデックス | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託 受益証券・ 投資証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|-------|---|-----------|-----------|----------|-------------------------------|---------------|
| | 円 | 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 | | | | |
| 10期(2018年4月18日) | 12,241 | 20.9 | ポイント 273,007.15 | % 21.9 | % 92.1 | % 7.1 | % 0.7 | 百万円 66,443 |
| 11期(2019年4月18日) | 12,260 | 0.2 | 276,323.22 | 1.2 | 94.4 | 4.4 | 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 |
| 14期(2022年4月18日) | 14,507 | △2.3 | 343,415.90 | △1.3 | 84.0 | 15.2 | 0.6 | 62,888 |

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

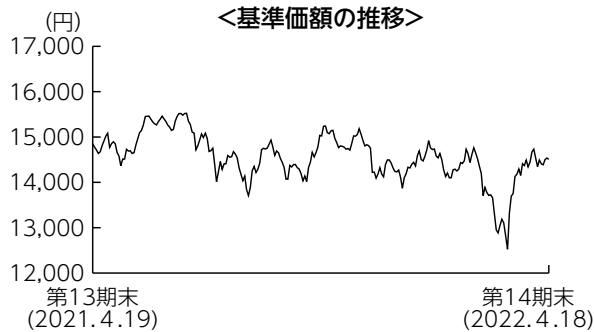
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | MSCIエマージング・ マーケット・インデックス (円換算ベース、 配当込み、 為替ハッジなし) (ベンチマーク) | | 株式組入 比 率 | 株式先物 比 率 | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入 比率 |
|------------------------|-------------|--------|--|--------|-------------|-------------|--------------------------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| (期 首) 2021年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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年4月20日から2022年4月18日まで）

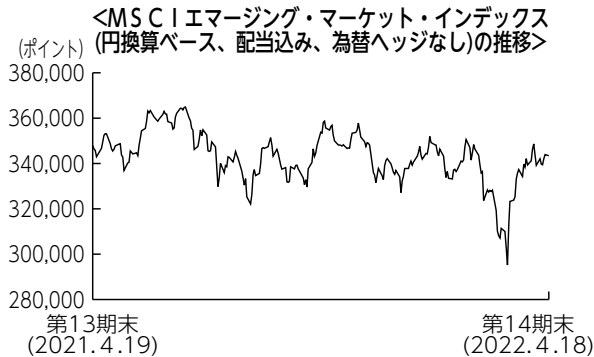


基準価額の推移

当期末の基準価額は14,507円となり、前期末比で2.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

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

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

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

期末

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



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.3%下落しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。また、保有しているロシア関連銘柄につきましては、売却可能となり次第、速やかに売却する方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|---|---|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投 資 証 券) | 17円 (14) (0) (2) (0) (0) | 0.116% (0.098) (0.000) (0.016) (0.001) (0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (b) 有価証券取引税 (株 式) (新株予約権証券) (投資信託受益証券) (投 資 証 券) | 27 (27) (0) (0) (0) | 0.189 (0.189) (0.000) (0.000) (0.000) | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 71 (18) (53) | 0.485 (0.124) (0.361) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 115 | 0.789 | |
| 期中の平均基準価額は14,559円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|----------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------|----------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | ア メ リ カ | 百株 20,146.02 (△824.92) | 千アメリカ・ドル 58,144 (-) | 百株 16,543.25 | 千アメリカ・ドル 77,287 |
| | 香 港 | 百株 616,544.18 (105.96) | 千香港・ドル 1,376,880 (△262) | 百株 618,091.69 | 千香港・ドル 983,742 |
| | 台 湾 | 百株 254,227.68 (2,768.45) | 千台湾・ドル 2,547,939 (△3,777) | 百株 264,897.71 | 千台湾・ドル 2,464,130 |
| | イ ギ リ ス | 百株 371.85 (-) | 千イギリス・ポンド 531 (-) | 百株 528.52 | 千イギリス・ポンド 273 |
| | ト ル コ | 百株 5,577.81 (-) | 千トルコ・リラ 12,088 (-) | 百株 8,363.98 | 千トルコ・リラ 15,167 |
| | メ キ シ コ | 百株 42,372.7 (-) | 千メキシコ・ペソ 181,080 (△283) | 百株 43,439.65 | 千メキシコ・ペソ 189,768 |
| | フ ィ リ ピ ン | 百株 36,563.6 (-) | 千フィリピン・ペソ 200,591 (-) | 百株 37,358.7 | 千フィリピン・ペソ 197,158 |
| チ リ | 百株 135,635.14 (1.33) | 千チリ・ペソ 1,787,010 (-) | 百株 132,638.16 | 千チリ・ペソ 2,027,983 | |

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|---|---------|---------------|----------------|-----------------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外国 | イ | 135,777 | 千タイ・パーツ 82 | 145,242 (-) | 千タイ・パーツ 155 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------------------------------------|---------|--------|------------|--------|------------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| メキシコ | | 千□ | 千メキシコ・ペソ | 千□ | 千メキシコ・ペソ |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV | 157.9 | 26,174 | 165.6 | 26,352 | |
| GRUPO TELEVISIA SAB | (-) | (-) | (-) | (-) | |
| CEMEX SAB DE CV | 142.6 | 6,842 | 163.7 | 7,271 | |
| MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV | (-) | (-) | (-) | (-) | |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 1,334.6 | 18,177 | 1,428.3 | 17,273 | |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | (-) | (-) | (-) | (-) | |
| | 18.1 | 1,255 | 21.1 | 1,558 | |
| | (-) | (-) | (-) | (-) | |
| | 61.5 | 1,312 | 67.4 | 1,513 | |
| | (-) | (△63) | (-) | (-) | |
| | 58.1 | 6,152 | 71.3 | 7,478 | |
| | (-) | (-) | (-) | (-) | |
| ブラジル | | 千□ | 千ブラジル・レアル | 千□ | 千ブラジル・レアル |
| SUL AMERICA SA | - | - | 15.356 | 516 | |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA | (-) | (-) | (-) | (-) | |
| ENERGISA SA | 23.4 | 916 | 12.8 | 469 | |
| KLABIN SA | (-) | (-) | (-) | (-) | |
| BANCO INTER SA | 11.7 | 547 | 21.1 | 962 | |
| GETNET ADQUIRENCIA E SERVICOS | (-) | (-) | (-) | (-) | |
| BANCO BTG PACTUAL SA | 19.1 | 468 | 17.3 | 471 | |
| | (-) | (-) | (-) | (-) | |
| | 10.2 | 758 | 2.2 | 399 | |
| | (9) | (-) | (-) | (-) | |
| | - | - | 5.275 | 29 | |
| | (5.275) | (-) | (-) | (-) | |
| | 65 | 2,107 | 60.4 | 1,491 | |
| | (50.1) | (-) | (-) | (-) | |
| 南アフリカ | | 千□ | 千南アフリカ・ランド | 千□ | 千南アフリカ・ランド |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 541.065 | 7,803 | 610.638 | 8,367 | |
| | (-) | (-) | (-) | (-) | |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|--------|----------------|----------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 | 株式先物取引 | 百万円 107,439 | 百万円 101,899 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 145,146,459千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 62,687,269千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 2.31 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|----------|----------|----------|---------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| TRIP.COM GROUP LTD ADR | 294.2 | 289.44 | 669 | 84,845 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR | 154.93 | 127.55 | 139 | 17,693 | 金属・鉱業 |
| SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF | 242.1 | 242.1 | 12 | 1,564 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CREDICORP LTD | 43.46 | 38.93 | 563 | 71,415 | 銀行 |
| MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR | 316.8 | 423.11 | 232 | 29,479 | 無線通信サービス |
| NETEASE INC-ADR | 254.46 | — | — | — | 娯楽 |
| SOUTHERN COPPER CORP | 45.18 | 51.98 | 378 | 47,930 | 金属・鉱業 |
| TELECOM ARGENTINA SA SP ADR | 37.89 | — | — | — | 各種電気通信サービス |
| YPF SA ADR | 42.48 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LUKOIL SPON ADR | 261.36 | 338.45 | 24 | 3,086 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GAZPROM PAO ADR | 3,686.81 | 4,834.71 | 280 | 35,583 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR | 893.51 | 1,284.21 | 289 | 36,685 | 銀行 |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE | 963.88 | 963.88 | 89 | 11,306 | 不動産管理・開発 |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD | — | 125 | 47 | 5,993 | ソフトウェア |
| SURGUTNEFTEGAZ ADR | 550.84 | 710.84 | 33 | 4,232 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| 51JOB INC ADR | 21.3 | 21.01 | 127 | 16,174 | 専門サービス |
| X5 RETAIL GROUP NV GDR | 70.85 | 160.03 | 8 | 1,076 | 食品・生活必需品小売り |
| NOVATEK PJSC GDR | 58.75 | 74.13 | 4 | 610 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BAIDU INC -SPON ADR | 165.07 | 161.28 | 2,089 | 264,703 | インターネット・メディアおよびサービス |
| NOVOLIPETSK STEEL GDR | 73.5 | 132.6 | 4 | 530 | 金属・鉱業 |
| MMC NORILSK NICKEL ADR | 410.9 | 539.53 | 101 | 12,917 | 金属・鉱業 |
| ROSNEFT OIL CO GDR | 678.41 | 1,079.51 | 64 | 8,218 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH | 947.65 | 127.33 | 141 | 17,872 | 各種消費者サービス |
| SEVERSTAL GDR | 167.71 | 186.08 | 1 | 141 | 金属・鉱業 |
| TATNEFT ADR | 157.61 | 195.09 | 45 | 5,807 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VTB BANK OJSC GDR | 1,120 | 1,520 | 1 | 192 | 銀行 |
| MAGNIT PJSC GDR | 230.51 | 378.7 | 0.45444 | 57 | 食品・生活必需品小売り |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR | 274.29 | 246.13 | 190 | 24,101 | インターネット販売・通信販売 |
| VNET GROUP INC ADR | 41.06 | — | — | — | 情報技術サービス |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR | 234.7 | 246.28 | 74 | 9,422 | 各種消費者サービス |
| VK CO LTD GDR | 68.53 | 98.58 | 8 | 1,068 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| YANDEX NV | 190.65 | 256.01 | 484 | 61,424 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| NOAH HOLDINGS LTD ADR | 17.16 | 6.8 | 14 | 1,866 | 資本市場 |
| SBERBANK ADR | 1,688.88 | 2,242.78 | 112 | 14,205 | 銀行 |
| PHOSAGRO PJSC GDR | 83.08 | 181.63 | 0.94447 | 119 | 化学 |
| HUAZHU GROUP LTD ADR | 88.28 | 97.48 | 325 | 41,281 | ホテル・レストラン・レジャー |
| JOYY INC-ADR | 36.17 | 28.36 | 112 | 14,219 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| DAQO NEW ENERGY CORP ADR | 35.01 | 30.17 | 133 | 16,885 | 半導体・半導体製造装置 |
| GDS HOLDINGS LTD ADR | 58.26 | 46.54 | 168 | 21,324 | 情報技術サービス |
| ZAI LAB LTD ADR | 44.44 | 39.33 | 174 | 22,126 | バイオテクノロジー |
| TCS GROUP HOLDING PLC GDR | 79.99 | 99.61 | 31 | 4,029 | 銀行 |
| HUYA INC ADR | 42.04 | — | — | — | 娯楽 |
| 360 DIGITECH INC ADR | — | 58.13 | 82 | 10,486 | 消費者金融 |
| BILIBILI INC ADR | 98.16 | 91.62 | 228 | 28,946 | 娯楽 |
| NIO INC ADR | 785.09 | 763.43 | 1,500 | 190,037 | 自動車 |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR | 235.57 | 342.05 | 167 | 21,275 | 娯楽 |
| AUTOHOME INC ADR | 37.89 | 38.67 | 110 | 13,936 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR | 73.6 | — | — | — | 娯楽 |
| GAOTU TECHEDU INC ADR | 42.75 | — | — | — | 各種消費者サービス |
| I-MAB ADR | — | 34.03 | 45 | 5,742 | バイオテクノロジー |
| WEIBO CORP ADR | 30.03 | 43.86 | 100 | 12,668 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR | 29.11 | 29.11 | 12 | 1,611 | 情報技術サービス |
| KANZHUN LTD ADR | — | 56.5 | 134 | 16,998 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 | |
|---|-----------|----------|-----------|-----------|----------------------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| RLX TECHNOLOGY INC ADR | 80 | 490.92 | 101 | 12,811 | タバコ | |
| DIDI GLOBAL INC ADR | — | 268.13 | 65 | 8,355 | 陸運・鉄道 | |
| KE HOLDINGS INC ADR | 68.69 | 205.47 | 288 | 36,544 | 不動産管理・開発 | |
| CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR | — | 63.36 | 34 | 4,358 | 情報技術サービス | |
| DADA NEXUS LTD ADR | — | 41.79 | 38 | 4,859 | インターネット販売・通信販売 | |
| JD.COM INC ADR | 528.21 | — | — | — | インターネット販売・通信販売 | |
| LEGEND BIOTECH CORP ADR | — | 33.09 | 134 | 17,035 | バイオテクノロジー | |
| LI AUTO INC ADR | 121.2 | 320.49 | 823 | 104,381 | 自動車 | |
| XPENG INC ADR | 93.72 | 224.58 | 604 | 76,615 | 自動車 | |
| OZON HOLDINGS PLC ADR | — | 45.37 | 52 | 6,667 | インターネット販売・通信販売 | |
| LUFAX HOLDING LTD ADR | 112.72 | 328.01 | 179 | 22,687 | 消費者金融 | |
| GLOBANT SA | 21.45 | — | — | — | 情報技術サービス | |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR | 1,154.1 | — | — | — | インターネット販売・通信販売 | |
| HELLO GROUP INC ADR | 77.93 | 126.41 | 61 | 7,814 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| BAOZUN INC-SPN ADR | 41.12 | — | — | — | インターネット販売・通信販売 | |
| PINDUODUO INC ADR | 240.48 | 253.68 | 1,015 | 128,641 | インターネット販売・通信販売 | |
| YUM CHINA HOLDINGS INC | 244.85 | 243.75 | 1,019 | 129,194 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| IQIYI INC ADR | 154.4 | 154.4 | 63 | 8,058 | 娯楽 | |
| POLYUS PJSC GDR | 39.46 | 67.87 | 26 | 3,353 | 金属・鉱業 | |
| HUTCHMED CHINA LTD ADR | 37.61 | 61.36 | 105 | 13,385 | 医薬品 | |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR | 256.08 | 245.84 | 646 | 81,937 | 航空貨物・物流サービス | |
| BEIGENE LTD ADR | 28.31 | 25.97 | 473 | 59,994 | バイオテクノロジー | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | 19,505.23 | 22,283.08 | 15,303 | 1,938,597 |
| | 66銘柄 | 64銘柄 | — | — | — | <3.1%> |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | | |
| JIANGXI COPPER CO LTD | 670 | 670 | 946 | 15,278 | 金属・鉱業 | |
| JIANGSU EXPRESS | 900 | 900 | 741 | 11,976 | 運送インフラ | |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD | 1,620 | 1,800 | 846 | 13,662 | 旅客航空輸送業 | |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD | 64 | 64 | 672 | 10,860 | 飲料 | |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD | 785 | 735 | 3,109 | 50,211 | 建設資材 | |
| BEIJING ENTERPRISES | 215 | 150 | 406 | 6,564 | ガス | |
| HUANENG POWER INTERNATIONAL IN | 1,800 | 3,420 | 1,200 | 19,386 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY | 2,580 | 1,980 | 950 | 15,348 | インターネット販売・通信販売 | |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD | 700 | 1,080 | 2,808 | 45,349 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD | 460 | 515.9 | 877 | 14,164 | 不動産管理・開発 | |
| HENGAN INTERNATIONAL GROUP | 405 | 330 | 1,207 | 19,505 | パーソナル用品 | |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 1,420 | 1,420 | 0 | 0 | 自動車 | |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 5,656 | 5,036 | 4,285 | 69,213 | 医薬品 | |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME | 2,436.2 | 2,321.2 | 6,302 | 101,778 | 不動産管理・開発 | |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 1,988.88 | 1,908.88 | 7,511 | 121,309 | 不動産管理・開発 | |
| CITIC LTD | 3,470 | 3,300 | 2,877 | 46,473 | コングロメリット | |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL | 960 | 680 | 318 | 5,139 | 運送インフラ | |
| LENOVO GROUP LTD | 4,540 | 4,120 | 3,193 | 51,566 | コンピュータ・周辺機器 | |
| PETRO CHINA CO LTD | 11,200 | 11,920 | 4,863 | 78,543 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD | 1,121.9 | 1,105.9 | 1,066 | 17,217 | 保険 | |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR | 15,432 | 13,872 | 5,548 | 89,613 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 490 | 370 | 449 | 7,254 | 情報技術サービス | |
| KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD | 1,530 | 1,430 | 2,293 | 37,043 | ソフトウェア | |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 501 | 451 | 4,929 | 79,610 | ガス | |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD | 2,080 | 2,760 | 1,854 | 29,953 | ガス | |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 1,520 | 740 | 436 | 7,051 | 運送インフラ | |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 3,160 | 1,252 | 1,116 | 18,036 | 不動産管理・開発 | |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD | 1,140 | 740 | 1,040 | 16,803 | 運送インフラ | |
| ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD | 1,460 | 2,440 | 1,168 | 18,875 | 金属・鉱業 | |
| (THE) WHARF HOLDINGS LTD | 870 | 760 | 1,843 | 29,764 | 不動産管理・開発 | |
| SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING | 910 | 965 | 837 | 13,527 | 運送インフラ | |
| CHINA EVERBRIGHT LTD | 440 | — | — | — | 資本市場 | |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|-----------|-----------|-----------|-------------|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 1,654 | 1,570 | 1,513 | 24,442 | ガス |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD | 460 | 350 | 1,281 | 20,688 | 電子装置・機器・部品 |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD | 3,680 | 3,350 | 3,953 | 63,840 | 自動車 |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD | 2,160 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | 560 | 500 | 1,652 | 26,687 | ガス |
| BYD CO LTD | 480 | 485 | 11,630 | 187,829 | 自動車 |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD | 1,180 | 1,180 | 1,000 | 16,160 | エネルギー設備・サービス |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 5,400 | 10,300 | 700 | 11,311 | 娯楽 |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP | 2,525.92 | 1,745.92 | 843 | 13,618 | 商業サービス・用品 |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | — | 2,080 | 1,401 | 22,641 | 情報技術サービス |
| MMG LTD | — | 1,840 | 732 | 11,826 | 金属・鉱業 |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD | 700 | 700 | 273 | 4,420 | 紙製品・林産品 |
| CHINA YOUZAN LTD | 8,800 | — | — | — | ソフトウェア |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H | 4,337.88 | 3,917.88 | 3,267 | 52,770 | 保険 |
| AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY | 1,350 | 1,350 | 564 | 9,113 | 航空宇宙・防衛 |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS | 912 | 1,312 | 1,968 | 31,783 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD | 1,795 | 1,645 | 1,898 | 30,658 | 自動車 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 4,600 | 4,370 | 5,313 | 85,819 | 保険 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD | 3,390 | 3,170 | 4,399 | 71,059 | 金属・鉱業 |
| SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H | 1,520 | 1,224 | 1,079 | 17,435 | ヘルスケア機器・用品 |
| WEICHAI POWER CO LTD | 1,354.4 | 1,274.4 | 1,506 | 24,327 | 機械 |
| TINGYI HOLDING CORP | 1,060 | 1,040 | 1,535 | 24,790 | 食品 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD | 280 | 400 | 2,548 | 41,150 | 飲料 |
| GUANGDONG INVESTMENTS LTD | 1,780 | 1,540 | 1,583 | 25,567 | 水道 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD | 2,140 | 2,380 | 944 | 15,259 | 医薬品 |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS | 913.33 | 813.33 | 3,765 | 60,816 | 飲料 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD | 680 | 540 | 367 | 5,939 | 運送インフラ |
| HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | — | 710 | 318 | 5,136 | 化学 |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 6,512.5 | 5,562.5 | 2,347 | 37,910 | 医薬品 |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 1,740 | 1,820 | 7,880 | 127,271 | 食品 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 3,503 | 3,375 | 126,360 | 2,040,714 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 3,635 | 3,710 | 21,258 | 343,321 | 保険 |
| LI NING CO LTD | 1,325 | 1,350 | 8,633 | 139,426 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD | 2,600 | 3,620 | 948 | 15,317 | 水道 |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | 6,892.4 | 6,892.4 | 323 | 5,231 | 専門小売り |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 5,000 | 3,490 | 1,357 | 21,925 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AIR CHINA / HONG KONG | 760 | 580 | 337 | 5,451 | 旅客航空輸送業 |
| ZTE CORP | 442.88 | 442.88 | 682 | 11,029 | 通信機器 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD | 1,965 | 2,015 | 5,299 | 85,586 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD | 1,855 | 1,772.5 | 2,297 | 37,099 | 海運業 |
| BANK OF COMMUNICATIONS | 5,752.05 | 5,182.05 | 2,933 | 47,368 | 銀行 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD | 1,102.5 | 1,242.5 | 1,233 | 19,925 | 建設・土木 |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 415 | 600 | 1,022 | 16,511 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK | 58,105.3 | 56,795.3 | 33,282 | 537,505 | 銀行 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD | 514 | 466 | 4,771 | 77,065 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 1,400 | 2,060 | 1,200 | 19,395 | 自動車 |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD | 980 | 980 | 413 | 6,678 | 不動産管理・開発 |
| MINTH GROUP LTD | 460 | 440 | 798 | 12,890 | 自動車部品 |
| SSY GROUP LTD | 1,320 | — | — | — | 医薬品 |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD | 840 | 1,380 | 1,006 | 16,247 | 紙製品・林産品 |
| CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL | 2,380 | 2,280 | 2,421 | 39,104 | 建設資材 |
| BANK OF CHINA LTD | 48,042 | 47,872 | 14,936 | 241,217 | 銀行 |
| SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD | 675 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD | 600 | 600 | 970 | 15,678 | 不動産管理・開発 |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD | 992 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD | 2,399.7 | 2,299.7 | 13,740 | 221,912 | 銀行 |
| IND & COMM BK OF CHINA - H | 36,942.35 | 33,392.35 | 15,861 | 256,161 | 銀行 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|----------|----------|-----------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD | 495 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING | 535 | 535 | 667 | 10,783 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES | 1,676 | 1,676 | 581 | 9,392 | 建設・土木 |
| CHINA COAL ENERGY CO | — | 1,020 | 750 | 12,124 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 330 | 250 | 474 | 7,655 | 機械 |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD | 313 | 446 | 1,168 | 18,871 | 電気設備 |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD | 4,941.42 | 4,741.42 | 2,915 | 47,092 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD | 2,400 | 2,370 | 1,080 | 17,453 | 金属・鉱業 |
| CHINA CITIC BANK-H | 5,968 | 5,798 | 2,359 | 38,110 | 銀行 |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD | 650 | 1,380 | 487 | 7,867 | 不動産管理・開発 |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 448 | 403 | 4,465 | 72,113 | 電子装置・機器・部品 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 670 | 610 | 5,679 | 91,717 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 200 | 200 | 364 | 5,878 | 家庭用品 |
| FOSUN INTERNATIONAL | 1,430.28 | 1,080.28 | 896 | 14,480 | コングロマリット |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD | 3,000 | 3,060 | 853 | 13,787 | 不動産管理・開発 |
| CHINA AOYUAN GROUP LTD | 850 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 1,620 | 2,640 | 934 | 15,093 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| KINGSOFT CORP LTD | 520 | 492 | 1,170 | 18,911 | 娯楽 |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 350 | 340 | 318 | 5,139 | 機械 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD | 3,180 | 2,350 | 1,203 | 19,431 | 建設・土木 |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD | 1,010 | 1,110 | 788 | 12,727 | 食品 |
| DONGYUE GROUP | — | 780 | 693 | 11,198 | 化学 |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD | 425 | 475 | 715 | 11,552 | 通信機器 |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 2,840 | 2,520 | 1,695 | 27,389 | 食品 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 1,604 | 1,570 | 3,011 | 48,631 | 保険 |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 1,100 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| CRRC CORP LTD - H | — | 2,390 | 700 | 11,309 | 機械 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD | 980 | 610 | 718 | 11,605 | 医薬品 |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 835 | 2,265 | 586 | 9,474 | 食品・生活必需品小売り |
| SINOPHARM GROUP CO | 760 | 672 | 1,185 | 19,144 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY CORP LTD | — | 1,690 | 799 | 12,909 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA RESOURCES CEMENT | 1,120 | 1,040 | 693 | 11,202 | 建設資材 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD | 1,785.27 | 1,865.27 | 1,270 | 20,514 | 自動車 |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 1,290 | 1,505 | 1,595 | 25,764 | 金属・鉱業 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK | 1,980 | — | — | — | 銀行 |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP | 1,940 | 1,900 | 3,241 | 52,348 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD | 642 | 466 | 616 | 9,964 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 1,640 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD | 612 | 1,250 | 661 | 10,679 | 機械 |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD | — | 900 | 723 | 11,686 | 機械 |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 1,020 | 1,075 | 4,590 | 74,132 | 不動産管理・開発 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 603 | 650 | 1,482 | 23,934 | 保険 |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD | 3,996.56 | 3,556.56 | 1,070 | 17,288 | 銀行 |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD | 1,250 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | 310 | 688 | 843 | 13,622 | 電気設備 |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD | 790 | 810 | 759 | 12,270 | 建設関連製品 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD | 2,500 | 2,500 | 735 | 11,870 | 銀行 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA | 15,470 | 15,850 | 4,739 | 76,537 | 銀行 |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD | 300 | 410 | 2,218 | 35,822 | 専門小売り |
| FAR EAST HORIZON LTD | 1,030 | 1,030 | 734 | 11,860 | 各種金融サービス |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | 460 | 446 | 718 | 11,596 | ヘルスケア機器・用品 |
| CITIC SECURITIES CO LTD | 1,305 | 1,405 | 2,593 | 41,887 | 資本市場 |
| SEAZEN GROUP LIMITED | 1,180 | 980 | 443 | 7,169 | 不動産管理・開発 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD | 936 | 1,940 | 1,162 | 18,767 | 資本市場 |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD | 4,610 | 6,750 | 1,748 | 28,234 | 保険 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 255 | 345 | 1,190 | 19,222 | 医薬品 |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 2,260 | 1,960 | 901 | 14,560 | 不動産管理・開発 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|----------|----------|-----------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD | 1,065 | 2,165 | 1,028 | 16,608 | 資本市場 |
| HANERGY THIN FILM POWER GROUP | 9,860 | 9,860 | 0 | 0 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD | 3,230 | 3,230 | 0 | 0 | 食品 |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD | 720 | 1,360 | 1,135 | 18,339 | 不動産管理・開発 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD | 5,370 | 4,490 | 2,922 | 47,206 | 銀行 |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD | 260 | 360 | 802 | 12,965 | 食品 |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 780 | 780 | 1,786 | 28,847 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD | 125 | — | — | — | 各種消費者サービス |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD | 900 | 1,170 | 4,527 | 73,125 | 不動産管理・開発 |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD | 920 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD | 283 | 330 | 726 | 11,724 | インターネット販売・通信販売 |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD | 520 | 520 | 337 | 5,450 | 各種消費者サービス |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD | 375 | 375 | 663 | 10,719 | 金属・鉱業 |
| AK MEDICAL HOLDINGS LTD | 200 | — | — | — | ヘルスケア機器・用品 |
| A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD | 237.5 | 442.5 | 588 | 9,504 | 不動産管理・開発 |
| CHINA TOWER CORP LTD | 27,060 | 22,560 | 2,052 | 33,155 | 各種電気通信サービス |
| XIAOMI CORP | 8,778 | 8,246 | 10,291 | 166,199 | コンピュータ・周辺機器 |
| WUXI APPTCE CO LTD | 165.6 | 207.12 | 2,444 | 39,470 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| WEIMOB INC | 1,070 | 1,660 | 828 | 13,377 | ソフトウェア |
| MEITUAN | 2,200 | 2,391 | 37,108 | 599,299 | インターネット販売・通信販売 |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD | 444 | 712 | 1,028 | 16,604 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HAIDLAO INTERNATIONAL HOLDING LTD | 440 | 870 | 1,405 | 22,705 | ホテル・レストラン・レジャー |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 2,340 | 2,760 | 3,836 | 61,957 | 半導体・半導体製造装置 |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 620 | 610 | 1,692 | 27,337 | バイオテクノロジー |
| CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD | 420 | 820 | 964 | 15,573 | 不動産管理・開発 |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD | 6,650 | 6,650 | 897 | 14,498 | 資本市場 |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD | 420 | 400 | 1,100 | 17,765 | 専門小売り |
| LOGAN GROUP COMPANY LTD | 1,110 | 1,030 | 270 | 4,374 | 不動産管理・開発 |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD | 995 | 1,055 | 2,363 | 38,165 | 建設・土木 |
| POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD | 58 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| JINXIN FERTILITY GROUP LTD | 780 | 1,075 | 656 | 10,607 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD | 270 | — | — | — | 各種消費者サービス |
| CANSINO BIOLOGICS INC | 40 | 62 | 644 | 10,403 | 医薬品 |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 620 | 1,160 | 742 | 11,989 | 専門小売り |
| HANSHI PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 660 | 860 | 1,133 | 18,305 | 医薬品 |
| CHINA FEIHE LTD | 830 | 1,850 | 1,411 | 22,796 | 食品 |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | — | 8,894.68 | 84,944 | 1,371,848 | インターネット販売・通信販売 |
| PHARMARON BEIJING CO LTD | 77 | 74 | 733 | 11,849 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| JD.COM INC | — | 1,169.35 | 26,474 | 427,556 | インターネット販売・通信販売 |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 350 | 980 | 1,809 | 29,216 | タバコ |
| VENUS MEDTECH HANGZHOU INC | — | 155 | 216 | 3,494 | ヘルスケア機器・用品 |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 440 | 500 | 835 | 13,485 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KUAISHOU TECHNOLOGY | 132 | 263 | 1,675 | 27,056 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HAIER SMART HOME CO LTD | 1,226 | 1,234 | 3,374 | 54,506 | 家庭用耐久財 |
| AKESO INC | — | 200 | 308 | 4,980 | バイオテクノロジー |
| SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD | — | 770 | 376 | 6,080 | 不動産管理・開発 |
| NETEASE INC | — | 1,202 | 18,090 | 292,155 | 娯楽 |
| MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD | 250 | 250 | 253 | 4,094 | ソフトウェア |
| NONGFU SPRING CO LTD | 190 | 1,010 | 4,272 | 68,997 | 飲料 |
| CHINA BOHAI BANK CO LTD | 2,220 | 1,340 | 178 | 2,878 | 銀行 |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 180 | 176.5 | 904 | 14,608 | インターネット販売・通信販売 |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD | — | 298 | 1,060 | 17,133 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD | — | 324 | 1,274 | 20,590 | 不動産管理・開発 |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD | 80 | 96 | 868 | 14,031 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 926.61 | 1,065.61 | 2,237 | 36,140 | 不動産管理・開発 |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 280 | 370 | 1,132 | 18,285 | 半導体・半導体製造装置 |
| CGN POWER CO LTD | 4,500 | 6,090 | 1,260 | 20,359 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |

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

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|--------------------------------------|---------------------------------|---------------------|----------------------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (台湾) NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 百株 120 | 百株 110 | 千台湾・ドル 3,355 | 千円 14,588 | 家庭用耐久財 |
| 小計 | 株数・金額 195,688.08 銘柄数<比率> 87 | 株数・金額 187,786.5 銘柄数 86 | 1,896,266 | 8,245,725 <13.1%> | |
| (イギリス) POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 百株 156.67 | 百株 - | 千イギリス・ポンド - | 千円 - | 金属・鉱業 |
| 小計 | 株数・金額 156.67 銘柄数<比率> 1 | 株数・金額 - 銘柄数 - | - | - <-%> | |
| (トルコ) AKBANK TAS | 百株 2,388.37 | 百株 2,388.37 | 千トルコ・リラ 2,245 | 千円 19,452 | 銀行 |
| ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 448.98 | 448.98 | 1,236 | 10,713 | 航空宇宙・防衛 |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS | 961.86 | 891.95 | 3,148 | 27,281 | 金属・鉱業 |
| FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 46.68 | 46.68 | 1,428 | 12,376 | 自動車 |
| KOC HOLDING AS | 537.7 | 537.7 | 2,190 | 18,980 | コングロマリット |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS | 900 | 510.26 | 888 | 7,701 | コングロマリット |
| TURK HAVA YOLLARI | 442.06 | - | - | - | 旅客航空輸送業 |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 626.54 | 486.15 | 1,123 | 9,738 | 無線通信サービス |
| TURKIYE GARANTI BANKASI AS | 1,141.53 | 1,814.55 | 2,522 | 21,854 | 銀行 |
| TURKIYE IS BANKASI | 662.05 | 911.35 | 982 | 8,512 | 銀行 |
| TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE | 62.01 | 59.02 | 1,532 | 13,280 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YAPI VE KREDI BANKASI AS | 2,392.3 | - | - | - | 銀行 |
| HACI OMER SABANCI HOLDING AS | 210.58 | - | - | - | 銀行 |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 277.55 | 217.03 | 1,837 | 15,918 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 | 株数・金額 11,098.21 銘柄数<比率> 14 | 株数・金額 8,312.04 銘柄数 11 | 19,136 | 165,812 <0.3%> | |
| (メキシコ) ALFA SAB DE CV | 百株 - | 百株 2,223 | 千メキシコ・ペソ 3,281 | 千円 20,821 | コングロマリット |
| GRUPO BIMBO SAB DE CV | 850 | 869 | 5,021 | 31,862 | 食品 |
| GRUMA SAB DE CV | 106.15 | 103.6 | 2,642 | 16,770 | 食品 |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA | 164.6 | 178.6 | 2,825 | 17,927 | 運送インフラ |
| GRUPO CARSO SAB DE CV | 349 | 349 | 2,499 | 15,859 | コングロマリット |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV | 1,621 | 1,514 | 20,706 | 131,400 | 銀行 |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 530.25 | 784.25 | 3,961 | 25,136 | 化学 |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 76.35 | 83.35 | 2,084 | 13,230 | 金属・鉱業 |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV | 863 | 753 | 2,138 | 13,570 | 家庭用品 |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV | 120.4 | 112.9 | 4,685 | 29,733 | 運送インフラ |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV | 1,939.52 | 1,832.52 | 19,703 | 125,030 | 金属・鉱業 |
| AMERICA MOVIL SAB DE CV | 21,166.78 | 18,088.78 | 39,994 | 253,791 | 無線通信サービス |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA SA | 966 | 1,227 | 4,979 | 31,596 | 銀行 |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 231 | 235 | 2,906 | 18,446 | 飲料 |
| WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | 3,200 | 3,093 | 24,082 | 152,817 | 食品・生活必需品小売り |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV | 240.85 | 202.95 | 6,183 | 39,238 | 運送インフラ |
| INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV | 292 | - | - | - | ガス |
| TELESITES SAB DE CV | 773 | - | - | - | 各種電気通信サービス |
| OPERADORA DE SITOS MEXICANOS SA DE CV | - | 773 | 2,011 | 12,763 | 各種電気通信サービス |
| BECLÉ SAB DE CV | 384 | 384 | 1,838 | 11,664 | 飲料 |
| 小計 | 株数・金額 33,873.9 銘柄数<比率> 18 | 株数・金額 32,806.95 銘柄数 18 | 151,545 | 961,661 <1.5%> | |
| (フィリピン) AYALA LAND INC | 百株 4,255 | 百株 4,567 | 千フィリピン・ペソ 15,527 | 千円 37,693 | 不動産管理・開発 |
| ABOTIZ EQUITY VENTURES INC | 943.3 | 1,133.3 | 6,533 | 15,860 | コングロマリット |
| BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND | 1,075.2 | 937.2 | 9,231 | 22,409 | 銀行 |
| AYALA CORP | 185.83 | 153.73 | 11,806 | 28,660 | コングロマリット |
| GLOBE TELECOM INC | 14.2 | 25.7 | 6,291 | 15,272 | 無線通信サービス |
| INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC | 461.2 | 550.3 | 12,128 | 29,442 | 運送インフラ |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC | 1,934.8 | 1,578.4 | 8,760 | 21,265 | コングロマリット |
| JOLLIBEE FOODS CORP | 325.9 | 339.4 | 7,432 | 18,043 | ホテル・レストラン・レジャー |
| METROPOLITAN BANK & TRUST | 615.75 | 800.15 | 4,400 | 10,683 | 銀行 |

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

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

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|---|-----------|-----------|-------------|-----------|----------------------|--|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | | | |
| YES BANK LTD | 7,148.5 | 7,148.5 | 17,369 | 17,369 | 銀行 | | |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 345.17 | 414.63 | 15,308 | 25,564 | 建設資材 | | |
| BHARAT FORGE LTD | 158.49 | 180.24 | 13,212 | 22,064 | 自動車部品 | | |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 967.13 | 924.72 | 50,559 | 84,433 | 金属・鉱業 | | |
| ITC LTD | 1,874.66 | 1,739.81 | 46,896 | 78,317 | タバコ | | |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 86.76 | 84.2 | 19,922 | 33,269 | 化学 | | |
| UNITED PHOSPHORUS LTD | 297.92 | 279.32 | 22,866 | 38,187 | 化学 | | |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | 25.21 | 39.29 | 11,195 | 18,696 | 医薬品 | | |
| SIEMENS INDIA LTD | 36.37 | 36.01 | 8,883 | 14,835 | コンプロマリット | | |
| INFO EDGE INDIA LTD | 42.16 | 52.47 | 24,943 | 41,655 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 257.69 | 229.9 | 18,078 | 30,190 | パーソナル用品 | | |
| TECH MAHINDRA LTD | 406.6 | 366.01 | 51,623 | 86,211 | 情報技術サービス | | |
| MINDTREE LTD | - | 36.05 | 14,776 | 24,677 | 情報技術サービス | | |
| MARICO LTD | 266.96 | 362.41 | 18,834 | 31,453 | 食品 | | |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 3.78 | 2.91 | 13,041 | 21,779 | 繊維・アパレル・贅沢品 | | |
| DLF LTD | 337.09 | 354.05 | 13,853 | 23,136 | 不動産管理・開発 | | |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 1,403.37 | 1,788.14 | 41,037 | 68,533 | 電力 | | |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE REC LTD | 317.46 | 322.22 | 27,082 | 45,227 | 運送インフラ | | |
| BAJAJ FINSERV LTD | 450.37 | - | - | - | 各種金融サービス | | |
| BAJAJ AUTO LTD | 24.28 | 21.74 | 34,979 | 58,416 | 各種金融サービス | | |
| BAJAJ FOODWORKS LTD | 43.88 | 49.14 | 18,168 | 30,341 | 自動車 | | |
| JUBILANT FOODWORKS LTD | 57.44 | 40.89 | 11,370 | 19,989 | ホテル・レストラン・レジャー | | |
| MUTHOOT FINANCE LTD | 49.65 | 88.1 | 11,777 | 19,667 | 消費者金融 | | |
| COAL INDIA LTD | 994.58 | 845.19 | 15,771 | 26,337 | 石油・ガス・消耗燃料 | | |
| INDUS TOWERS LTD | 373.74 | 549.46 | 11,906 | 19,884 | 各種電気通信サービス | | |
| PI INDUSTRIES LTD | 41.33 | 43.11 | 12,684 | 21,183 | 化学 | | |
| LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD | 27.48 | 35.87 | 21,661 | 36,174 | 情報技術サービス | | |
| ADANI GREEN ENERGY LTD | 253.35 | 224.36 | 64,263 | 107,319 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | | |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 445.36 | 507.11 | 28,644 | 47,835 | 保険 | | |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 24.25 | 40.12 | 8,819 | 14,728 | 資本市場 | | |
| BANDHAN BANK LTD | 389.9 | 377.5 | 12,312 | 20,561 | 銀行 | | |
| ADANI TOTAL GAS LTD | - | 158.08 | 39,533 | 66,020 | ガス | | |
| GODREJ PROPERTIES LTD | - | 69.71 | 11,176 | 18,664 | 不動産管理・開発 | | |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD | - | 222.29 | 16,233 | 27,110 | 消費者金融 | | |
| SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD | - | 166.24 | 13,856 | 23,141 | 消費者金融 | | |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD | - | 129.53 | 10,107 | 16,879 | 商業サービス・用品 | | |
| ZOMATO LTD | - | 1,256.44 | 10,541 | 17,604 | インターネット販売・通信販売 | | |
| BERGER PAINTS INDIA LTD | 125.56 | 109.81 | 7,951 | 13,279 | 化学 | | |
| ADANI TRANSMISSIONS LTD | - | 157.9 | 42,486 | 70,953 | 電力 | | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 88.1 | 92.95 | 38,024 | 63,501 | 食品・生活必需品小売り | | |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD | 115.17 | 113.49 | 15,419 | 25,750 | 保険 | | |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD | 190.44 | 276.04 | 14,933 | 24,939 | 保険 | | |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 48.93 | 77.33 | 14,686 | 24,526 | 旅客航空輸送業 | | |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 240.46 | 251.49 | 28,843 | 48,168 | 保険 | | |
| 小計 | 株数 | 株数 | 金額 | 金額 | | | |
| | 50,386.72 | 52,387.94 | 4,299,658 | 7,180,430 | | | |
| | 96銘柄 | 106銘柄 | - | <11.4%> | | | |
| (パキスタン) | 百株 | 百株 | 千パキスタン・ルピー | 千円 | | | |
| MCB BANK LTD | 124 | - | - | - | 銀行 | | |
| OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD | 218.68 | - | - | - | 石油・ガス・消耗燃料 | | |
| HABIB BANK LTD | 193 | - | - | - | 銀行 | | |
| 小計 | 株数 | 株数 | 金額 | 金額 | | | |
| | 535.68 | - | - | - | | | |
| | 3銘柄 | 1銘柄 | - | <-%> | | | |
| (インドネシア) | 百株 | 百株 | 千インドネシア・ルピア | 千円 | | | |
| ANEKA TAMBANG TBK PT | 5,717 | 5,717 | 1,589,326 | 14,145 | 金属・鉱業 | | |
| BARITO PACIFIC TBK PT | 14,709 | 14,484 | 1,260,108 | 11,214 | 化学 | | |
| UNITED TRACTORS TBK PT | 848.01 | 905.01 | 2,696,929 | 24,002 | 石油・ガス・消耗燃料 | | |
| INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT | 3,529 | 3,529 | 2,161,512 | 19,237 | 食品 | | |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|---|-----------|-----------|-----------------|----------------|----|--|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千ブラジル・レアル | 千円 | | | |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 2,994.47 | 2,871.47 | 7,560 | 203,688 | | | 銀行 |
| AMERICANAS SA | 154 | 361.71 | 1,018 | 27,431 | | | インターネット販売・通信販売 |
| BRASKEM SA | - | 123 | 536 | 14,457 | | | 化学 |
| ENGIE BRASIL SA | 179.87 | 73.87 | 325 | 8,770 | | | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ALPARGATAS SA | 85 | 194 | 440 | 11,859 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| LOCALIZA RENT A CAR | 389.89 | 352.89 | 2,017 | 54,362 | | | 陸運・鉄道 |
| LOJAS RENNER SA | 450.37 | 563.2 | 1,505 | 40,572 | | | 複合小売り |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 379.04 | 559.04 | 839 | 22,621 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COSAN SA | 144 | 575 | 1,332 | 35,892 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TOTVS SA | 236 | 279 | 976 | 26,307 | | | ソフトウェア |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 685 | 560 | 1,449 | 39,059 | | | 電力 |
| JBS SA | 695 | 483 | 1,858 | 50,071 | | | 食品 |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS | 508.69 | 588.17 | 909 | 24,497 | | | 電力 |
| CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO | 179.98 | 188.98 | 950 | 25,599 | | | 水道 |
| HYPERA SA | 182 | 195 | 755 | 20,351 | | | 医薬品 |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO | 1,271.16 | 3,546.48 | 5,138 | 138,445 | | | 資本市場 |
| MAGAZINE LUIZA SA | 1,810 | 1,682 | 1,010 | 27,234 | | | 複合小売り |
| HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA | - | 386 | 961 | 25,893 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TELEFONICA BRASIL SA | 322.28 | 286.28 | 1,538 | 41,440 | | | 各種電気通信サービス |
| VIA S/A | 683 | - | - | - | | | 専門小売り |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 423 | 458 | 1,198 | 32,278 | | | 保険 |
| NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA | 342 | - | - | - | | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA | 591 | 2,456.61 | 2,554 | 68,830 | | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA | 299 | 299 | 690 | 18,615 | | | 食品・生活必需品小売り |
| AMBEV SA | 2,925.95 | 2,773.95 | 4,077 | 109,857 | | | 飲料 |
| NATURA &CO HOLDING SA | 571 | 498 | 1,245 | 33,541 | | | パーソナル用品 |
| TIM SA | 622 | 466 | 636 | 17,149 | | | 無線通信サービス |
| REDE D'OR SAO LUIZ SA | - | 222 | 942 | 25,400 | | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| RUMO SA | 797 | 855 | 1,573 | 42,383 | | | 陸運・鉄道 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 109,231 44銘柄 | 2,942,785 - | | | <4.7%> |
| (チェコ) | 百株 | 百株 | 千チェコ・コルナ | 千円 | | | |
| KOMERCNI BANKA AS | 62.5 | 36.64 | 3,057 | 17,113 | | | 銀行 |
| CEZ | 98.49 | 88.2 | 8,837 | 49,463 | | | 電力 |
| MONETA MONEY BANK AS | 269.89 | 269.89 | 2,469 | 13,821 | | | 銀行 |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 株数 銘柄数 | 14,364 3銘柄 | 80,398 - | | | <0.1%> |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 千円 | | | |
| SKC CO LTD | - | 14.72 | 230,368 | 23,704 | | | 化学 |
| CHEIL WORLDWIDE INC | 73 | 50.14 | 123,344 | 12,692 | | | メディア |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 20.68 | 22.26 | 197,891 | 20,363 | | | 自動車 |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC | 18.56 | 16.95 | 361,035 | 37,150 | | | 保険 |
| DB INSURANCE CO LTD | 38.43 | 34.5 | 237,705 | 24,459 | | | 保険 |
| COWAY CO LTD | 23.34 | 36.97 | 244,002 | 25,107 | | | 家庭用耐久財 |
| KT&G CORP | 64.55 | 66.64 | 531,787 | 54,720 | | | タバコ |
| S-1 CORPORATION | 7.94 | 1.07 | 7,329 | 754 | | | 商業サービス・用品 |
| KOREA GAS CORP | 13.03 | - | - | - | | | ガス |
| CJ CORP | 10.01 | 10.01 | 87,287 | 8,981 | | | コンプロマリット |
| KAKAO CORP | 175.75 | 180.92 | 1,725,976 | 177,603 | | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| CJ ENM CO LTD | 2.99 | 7.61 | 99,158 | 10,203 | | | 娯楽 |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE | 24.97 | - | - | - | | | 機械 |
| KMW CO LTD | 13.34 | - | - | - | | | 通信機器 |
| SK TELECOM CO LTD | 25.24 | 22.04 | 131,138 | 13,494 | | | 無線通信サービス |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | 215.11 | 200.59 | 167,492 | 17,234 | | | 資本市場 |
| NCSOFT CORPORATION | 10.26 | 9.06 | 401,358 | 41,299 | | | 娯楽 |
| LG UPLUS CORP | 156.81 | 146.06 | 208,135 | 21,417 | | | 各種電気通信サービス |
| DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD | 152.61 | 200.52 | 420,089 | 43,227 | | | 電気設備 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|---------|----------|------------|-----------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 千円 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 5.62 | 5.29 | 463,933 | 47,738 | パーソナル用品 |
| LG CHEM LTD | 28.06 | 26.33 | 1,329,665 | 136,822 | 化学 |
| LG CHEM LTD | 4.99 | 4.99 | 130,239 | 13,401 | 化学 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 2.03 | 1.02 | 50,235 | 5,169 | パーソナル用品 |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | 273.94 | 255.17 | 1,028,335 | 105,815 | 銀行 |
| HYUNDAI MERCHANT MARINE | - | 151.96 | 405,733 | 41,749 | 海運業 |
| S-OIL CORP | 24.6 | 23.35 | 251,012 | 25,829 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HANWHA SOLUTIONS CORPORATION | 65.26 | 83.1 | 282,955 | 29,116 | 化学 |
| MERITZ SECURITIES CO LTD | 202.52 | 202.52 | 137,106 | 14,108 | 資本市場 |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 52.63 | 46.18 | 187,490 | 19,292 | 資本市場 |
| POSCO CHEMICAL CO LTD | 13.38 | 20.82 | 271,701 | 27,958 | 建設資材 |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 10.44 | 8.75 | 168,000 | 17,287 | 化学 |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 16.75 | 13.99 | 114,578 | 11,790 | 専門小売り |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD | 22.28 | 19.26 | 188,170 | 19,362 | 機械 |
| HYUNDAI MOBIS | 41.29 | 38.05 | 783,830 | 80,656 | 自動車部品 |
| SK HYNIX INC | 333.67 | 318.1 | 3,435,480 | 353,510 | 半導体・半導体製造装置 |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | 45.34 | 42.06 | 185,694 | 19,108 | 建設・土木 |
| HYUNDAI MOTOR CO | 15.15 | 15.15 | 133,320 | 13,718 | 自動車 |
| HYUNDAI MOTOR CO | 92.1 | 80.41 | 1,423,257 | 146,453 | 自動車 |
| HYUNDAI STEEL CO | 45.33 | 60.59 | 250,236 | 25,749 | 金属・鉱業 |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 211.14 | 183.71 | 202,081 | 20,794 | 銀行 |
| KIA CORPORATION | 163.27 | 153.03 | 1,173,740 | 120,777 | 自動車 |
| KOREA ZINC CO LTD | 4.65 | 4.7 | 294,220 | 30,275 | 金属・鉱業 |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP | 164.88 | 142.75 | 310,481 | 31,948 | 電力 |
| HANWHA CORP | 24.18 | - | - | - | コンピュータ・ソフトウェア |
| KOREAN AIR CO LTD | 97.24 | 94.37 | 296,793 | 30,540 | 旅客航空輸送業 |
| CJ LOGISTICS | 4.51 | 1.29 | 16,770 | 1,725 | 陸運・鉄道 |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD | 10.93 | 11.99 | 182,248 | 18,753 | 化学 |
| DOUZONE BIZON CO LTD | 10.2 | - | - | - | ソフトウェア |
| HLB INC | 48.88 | 67.89 | 207,064 | 21,306 | レジャー用品 |
| LG ELECTRONICS INC | 66.67 | 60.7 | 767,855 | 79,012 | 家庭用耐久財 |
| LOTTE CORP | 15.91 | - | - | - | コンピュータ・ソフトウェア |
| LG CORP | 52.51 | 48.25 | 353,672 | 36,392 | コンピュータ・ソフトウェア |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 91.63 | 91.63 | 101,709 | 10,465 | 資本市場 |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCTION | 47.63 | 46.31 | 196,122 | 20,181 | 建設・土木 |
| NAVER CORP | 75.17 | 71.42 | 2,203,307 | 226,720 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| L&F CO LTD | - | 14.49 | 340,659 | 35,053 | 電子装置・機器・部品 |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD | 22.41 | 29.32 | 219,020 | 22,537 | 資本市場 |
| OTTOGI CORP | 0.66 | - | - | - | 食品 |
| AMOREPACIFIC GROUP | 20.01 | 23.47 | 111,834 | 11,507 | パーソナル用品 |
| KANGWON LAND INC | 87.13 | 43.02 | 118,950 | 12,239 | ホテル・レストラン・レジャー |
| POSCO HOLDINGS INC | 46.03 | 42.5 | 1,200,625 | 123,544 | 金属・鉱業 |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 88.11 | 82.93 | 202,349 | 20,821 | 建設・土木 |
| SAMSUNG SDI CO LTD | 33.81 | 31.92 | 1,956,696 | 201,344 | 電子装置・機器・部品 |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | 35.6 | 30.59 | 480,263 | 49,419 | 電子装置・機器・部品 |
| GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA | - | 4.1 | 78,310 | 8,058 | バイオテクノロジー |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 2,913 | 2,802.68 | 18,665,848 | 1,920,715 | コンピュータ・周辺機器 |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD | 267.7 | 354.68 | 221,320 | 22,773 | 機械 |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD | 494.02 | 485.33 | 2,907,126 | 299,143 | コンピュータ・周辺機器 |
| SHINSEGAE CO LTD | 5.13 | - | - | - | 複合小売り |
| SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD | 15.63 | - | - | - | 医薬品 |
| YUHAN CORP | 37.2 | 21.27 | 126,556 | 13,022 | 医薬品 |
| HANON SYSTEMS | 101.46 | 80.78 | 91,281 | 9,392 | 自動車部品 |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD | 31.66 | - | - | - | 保険 |
| GS HOLDINGS CORP | 28.79 | 26.22 | 115,892 | 11,925 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LG DISPLAY CO LTD | 140.45 | 125.69 | 241,953 | 24,896 | 電子装置・機器・部品 |
| CELLTRION INC | 59.4 | 56.12 | 889,502 | 91,529 | バイオテクノロジー |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|--------------------------------------|-------------------------------|------------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 千円 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 190.41 | 172.18 | 807,524 | 83,094 | 銀行 |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 11.32 | 11.38 | 224,755 | 23,127 | 航空貨物・物流サービス |
| CELLTRION PHARM INC | 9.88 | 10.17 | 89,089 | 9,167 | 医薬品 |
| LOTTE SHOPPING CO | 5.38 | 4.57 | 43,003 | 4,425 | 複合小売り |
| MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD | — | 24.99 | 116,078 | 11,944 | 保険 |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD | 43.61 | 37.28 | 241,201 | 24,819 | 保険 |
| AMOREPACIFIC CORP | 17.7 | 17.9 | 289,085 | 29,746 | パーソナル用品 |
| SAMSUNG CARD CO | 30.26 | — | — | — | 消費者金融 |
| SK INNOVATION CO LTD | 34.79 | 29.24 | 606,730 | 62,432 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 4.66 | 3.85 | 148,610 | 15,291 | 食品 |
| STX PAN OCEAN CO LTD | 195.95 | 201.72 | 133,336 | 13,720 | 海運業 |
| LG INNOTEK CO LTD | 7.64 | 7.85 | 312,822 | 32,189 | 電子装置・機器・部品 |
| SK INC | 19.45 | 24.01 | 601,450 | 61,889 | コングロマリット |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 245.61 | 229.45 | 1,362,933 | 140,245 | 銀行 |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD | 36.64 | 34.39 | 151,831 | 15,623 | 航空宇宙・防衛 |
| ILJIN MATERIALS CO LTD | — | 19.49 | 183,790 | 18,912 | 電子装置・機器・部品 |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC | — | 28 | 114,800 | 11,812 | 各種金融サービス |
| HANMI PHARM CO LTD | 2.87 | 2.35 | 72,145 | 7,423 | 医薬品 |
| FILA HOLDINGS CORP | 25.17 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SEEGENE INC | 9.79 | 19.58 | 81,452 | 8,381 | バイオテクノロジー |
| E-MART CO LTD | 10.07 | 14.26 | 196,788 | 20,249 | 食品・生活必需品小売り |
| GS RETAIL CO LTD | 6.53 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD | 38.56 | 52.61 | 180,978 | 18,622 | 自動車部品 |
| HD HYUNDAI CO LTD | 23.05 | 20.56 | 120,687 | 12,418 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BGF RETAIL CO LTD | 3.44 | 4.13 | 74,133 | 7,628 | 食品・生活必需品小売り |
| ORION CORP REPUBLIC OF KOREA | 17.03 | 17.6 | 152,944 | 15,737 | 食品 |
| SK CHEMICALS CO LTD | 4.09 | 6.13 | 77,544 | 7,979 | 化学 |
| NETMARBLE CORP | 14.5 | 14.78 | 152,234 | 15,664 | 娯楽 |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 299.5 | 284.88 | 433,017 | 44,557 | 銀行 |
| ECOPRO BM CO LTD | — | 5.86 | 268,681 | 27,647 | 電気設備 |
| SD BIOSENSOR INC | — | 30.95 | 150,107 | 15,446 | ヘルスケア機器・用品 |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 11.69 | 20.02 | 177,177 | 18,231 | 医薬品 |
| KRAFTON INC | — | 12.16 | 321,632 | 33,095 | 娯楽 |
| SK IE TECHNOLOGY CO LTD | — | 13.12 | 160,064 | 16,470 | 化学 |
| SK SQUARE CO LTD | — | 53.81 | 307,255 | 31,616 | 半導体・半導体製造装置 |
| SK BIOSCIENCE CO LTD | — | 16.72 | 224,048 | 23,054 | バイオテクノロジー |
| KAKAO GAMES CORP | — | 25.15 | 164,984 | 16,976 | 娯楽 |
| HYBE CO LTD | — | 11.58 | 340,452 | 35,032 | 娯楽 |
| LG ENERGY SOLUTION | — | 11.97 | 520,695 | 53,579 | 電気設備 |
| KAKAOBANK CORP | — | 67.67 | 312,635 | 32,170 | 銀行 |
| F&F CO LTD / NEW | — | 13.7 | 205,500 | 21,145 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD-RTS | — | 0.87 | 17,313 | 1,781 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 21.86 | 18.25 | 250,937 | 25,821 | 情報技術サービス |
| ALTEOGEN INC | 23.29 | 20.26 | 108,796 | 11,195 | バイオテクノロジー |
| SAMSUNG C&T CORP | 54.59 | 46.39 | 505,651 | 52,031 | コングロマリット |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 10.33 | 9.96 | 831,660 | 85,577 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| PEARL ABYSS CORP | 20.8 | 20.8 | 222,976 | 22,944 | 娯楽 |
| DOOSAN BOBCAT INC | 29.22 | 28.05 | 122,017 | 12,555 | 機械 |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | 38.5 | 47.15 | 282,900 | 29,110 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| 小 計 | 株 数 : 9,377.78 銘 柄 数 < 比率 > 106銘柄 | 株 数 : 9,438.09 銘 柄 数 112銘柄 | 63,133,776 | 6,496,465 | <10.3%> |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千オフショア・人民元 | 千円 | |
| EVE ENERGY CO LTD | 90.32 | 88.32 | 629 | 12,491 | 電気設備 |
| WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD | 54 | 59.4 | 69 | 1,376 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | — | 34 | 348 | 6,913 | 電子装置・機器・部品 |
| ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD | 58 | — | — | — | 電子装置・機器・部品 |
| BEIJING THUNISOFT CORP LTD | 64 | — | — | — | ソフトウェア |

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

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|----------|--------|-----------------------|--------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | | | 外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千円 千オフショア・人民元 | 千円 |
| INSPIR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD | 35.7 | 35.7 | 97 | 1,926 |
| JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 149 | — | — | — |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD | 127 | 127 | 122 | 2,423 |
| O-FILM TECH CO LTD | 86 | 86 | 53 | 1,067 |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD | 500 | 367 | 262 | 5,205 |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD | 124.8 | 233.81 | 807 | 16,023 |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD | 139 | 108 | 291 | 5,782 |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD | 48 | 5.6 | 20 | 416 |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD | 69 | 69 | 130 | 2,581 |
| XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD | 382 | 382 | 207 | 4,114 |
| CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 13 | — | — | — |
| DONG-E-E-JIAO CO LTD | 49 | 49 | 159 | 3,169 |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO | 153 | 153 | 147 | 2,919 |
| ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD | 210 | 210 | 137 | 2,724 |
| HUADONG MEDICINE CO LTD | 75 | 75 | 257 | 5,105 |
| YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD | 50 | 50 | 200 | 3,980 |
| TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD | — | 62 | 25 | 504 |
| 37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 66 | 66 | 147 | 2,926 |
| AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD | — | 119 | 254 | 5,051 |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD | 48 | 45 | 938 | 18,611 |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD | 74 | 111 | 583 | 11,581 |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 149.5 | 149.5 | 129 | 2,562 |
| NORTHEAST SECURITIES CO LTD | 177 | 177 | 138 | 2,749 |
| TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD | 178 | 153 | 618 | 12,264 |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD | 59.4 | 59.4 | 81 | 1,622 |
| BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD | 38 | 53.2 | 97 | 1,924 |
| RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD | 160 | 160 | 71 | 1,418 |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD | 21 | 21 | 197 | 3,923 |
| SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD | 364.8 | 364.8 | 229 | 4,544 |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD | 143 | 143 | 110 | 2,195 |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD | 291.54 | 271.54 | 793 | 15,738 |
| SHANXI SECURITIES CO LTD | 275 | 275 | 154 | 3,065 |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD | 445 | 838 | 493 | 9,790 |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD | 199 | 199 | 311 | 6,169 |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD | — | 239 | 375 | 7,452 |
| DHC SOFTWARE CO LTD | 38 | 38 | 25 | 506 |
| IFLYTEK CO LTD | 113 | 135 | 561 | 11,134 |
| HESTEEL CO LTD | 1,047 | 1,047 | 281 | 5,586 |
| GOERTEK INC | 87 | 78 | 248 | 4,932 |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD | 213 | 213 | 163 | 3,236 |
| BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD | 575 | — | — | — |
| BANK OF NINGBO CO LTD | 191 | 192 | 735 | 14,590 |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD | 146 | 124 | 132 | 2,634 |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION | 474 | 474 | 225 | 4,475 |
| CHANGJIANG SECURITIES CO LTD | 283 | 283 | 175 | 3,480 |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD | 376 | 376 | 287 | 5,698 |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD | 124 | 416.6 | 432 | 8,586 |
| WESTERN SECURITIES CO LTD | 227 | 227 | 159 | 3,169 |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD | 82 | 47 | 145 | 2,887 |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD | 38 | 38 | 296 | 5,887 |
| AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUSTRY GROUP | 107 | — | — | — |
| EAST MONEY INFORMATION CO LTD | 278.4 | 267.08 | 718 | 14,251 |
| JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD | 48 | 44 | 607 | 12,044 |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD | 146 | 128 | 2,174 | 43,137 |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD | 208 | 208 | 119 | 2,376 |
| SUNING.COM CO LTD | 237 | 237 | 83 | 1,654 |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 1,256 | 855 | 351 | 6,970 |

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

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

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|----------|--------|-----------|-------------|--------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD | 1,077 | 1,077 | 612 | 12,155 | 銀行 |
| SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD | — | 23 | 195 | 3,886 | バイオテクノロジー |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD | 61 | 61 | 299 | 5,935 | 食品 |
| ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 16 | 73 | 1,465 | 医薬品 |
| INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD | 8 | 12 | 52 | 1,042 | ヘルスケア機器・用品 |
| YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD | — | 39 | 398 | 7,910 | 金属・鉱業 |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD | — | 62 | 473 | 9,395 | 半導体・半導体製造装置 |
| ZHONGTAI SECURITIES CO LTD | — | 506 | 419 | 8,320 | 資本市場 |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD | — | 19 | 511 | 10,141 | バイオテクノロジー |
| FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD | 6 | 6 | 74 | 1,480 | 食品 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD | — | 109 | 454 | 9,022 | 資本市場 |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD | — | 10 | 494 | 9,799 | バイオテクノロジー |
| SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD | — | 43 | 376 | 7,462 | コンピュータ・周辺機器 |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC | — | 24.47 | 443 | 8,803 | ソフトウェア |
| NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD | — | 164 | 369 | 7,319 | 半導体・半導体製造装置 |
| BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD | — | 4.55 | 235 | 4,662 | 家庭用耐久財 |
| CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD | — | 660 | 161 | 3,194 | 建設・土木 |
| PETROCHINA CO LTD | 1,109 | 1,109 | 614 | 12,187 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD | 2,118 | 2,118 | 1,008 | 19,998 | 銀行 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD | 2,744 | 2,744 | 842 | 16,710 | 銀行 |
| BANK OF CHINA LTD | 840 | 840 | 275 | 5,465 | 銀行 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP | 421 | 1,585 | 689 | 13,676 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 100 | 100 | 269 | 5,341 | 保険 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD | 155 | 175 | 543 | 10,771 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD | 736 | 701 | 3,282 | 65,117 | 銀行 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD | 377 | 370 | 1,787 | 35,449 | 保険 |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD | 688 | 686 | 1,527 | 30,290 | 銀行 |
| SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD | 978 | 1,020 | 831 | 16,489 | 銀行 |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD | 1,382 | 1,382 | 529 | 10,499 | 銀行 |
| SAIC MOTOR CORP LTD | 239 | 257 | 433 | 8,589 | 自動車 |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD | 46 | 44 | 7,946 | 157,624 | 飲料 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD | 1,265 | 1,265 | 651 | 12,922 | 銀行 |
| CITIC SECURITIES CO LTD | 466 | 565 | 1,179 | 23,401 | 資本市場 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 325 | 162 | 371 | 7,365 | 保険 |
| SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD | 383 | 383 | 237 | 4,702 | 運送インフラ |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD | 758 | 738 | 1,726 | 34,255 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| DAQIN RAILWAY CO LTD | 977 | 189 | 127 | 2,534 | 陸運・鉄道 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD | 1,097 | 784 | 262 | 5,209 | 銀行 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD | — | 1,223 | 738 | 14,652 | 建設・土木 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD | 661 | — | — | — | 資本市場 |
| HUAXIA BANK CO LTD | 1,129 | 829 | 470 | 9,323 | 銀行 |
| INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD | 163 | 190 | 733 | 14,551 | 食品 |
| BANK OF BEIJING CO LTD | 879 | 879 | 408 | 8,107 | 銀行 |
| CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD | — | 407 | 143 | 2,849 | 無線通信サービス |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD | 705 | 548 | 402 | 7,989 | 金属・鉱業 |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD | 140 | 97 | 387 | 7,684 | 建設資材 |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD | 335 | 335 | 496 | 9,841 | 資本市場 |
| HUANENG POWER INTERNATIONAL INC | 78 | 78 | 49 | 988 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD | 165 | 141 | 362 | 7,182 | 自動車 |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD | 451 | 451 | 871 | 17,283 | 不動産管理・開発 |
| CRRG CORP LTD | — | 770 | 405 | 8,034 | 機械 |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD | 196.6 | 172.52 | 588 | 11,666 | 医薬品 |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD | — | 189 | 656 | 13,016 | 金属・鉱業 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD | 461 | 52 | 77 | 1,537 | 資本市場 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD | — | 1,111 | 748 | 14,853 | 建設・土木 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 120 | — | — | — | 保険 |
| HAIER SMART HOME CO LTD | 317 | 278 | 685 | 13,593 | 家庭用耐久財 |

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

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

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 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 | |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD | 58 | 58 | 255 | 5,062 | 電気設備 |
| DONGXING SECURITIES CO LTD | 132 | 132 | 125 | 2,482 | 資本市場 |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD | - | 20 | 100 | 1,989 | 自動車部品 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD | 506 | 6 | 9 | 188 | 資本市場 |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD | 597 | 597 | 454 | 9,023 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD | 34 | 34 | 190 | 3,777 | 飲料 |
| SKSHU PAINT CO LTD | - | 38 | 316 | 6,283 | 化学 |
| HUAAN SECURITIES CO LTD | 165 | - | - | - | 資本市場 |
| BANK OF JIANGSU CO LTD | 1,173 | 334 | 252 | 5,002 | 銀行 |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD | 236 | 236 | 361 | 7,162 | 銀行 |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD | 90 | 114 | 230 | 4,572 | 自動車部品 |
| AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD | 11 | 14.3 | 66 | 1,310 | ヘルスケア機器・用品 |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD | 20 | 20 | 42 | 847 | 医薬品 |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD | - | 96 | 160 | 3,176 | 航空貨物・物流サービス |
| SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD | 12 | 12 | 80 | 1,591 | 半導体・半導体製造装置 |
| JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD | 15 | 15 | 94 | 1,865 | 家庭用耐久財 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD | 392 | 392 | 401 | 7,970 | 資本市場 |
| SDIC CAPITAL CO LTD | 433 | 0.16 | 0.1128 | 2 | 資本市場 |
| TOPCHOICE MEDICAL CORP | 8 | 8 | 119 | 2,376 | ヘルスケア・アロパイダー/ヘルスケア・サービス |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD | 48 | 47 | 460 | 9,129 | 半導体・半導体製造装置 |
| TOLY BREAD CO LTD | 36 | 50.4 | 111 | 2,202 | 食品 |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD | 22 | 28.6 | 103 | 2,058 | 食品・生活必需品小売り |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD | 29.4 | 29.4 | 118 | 2,344 | 機械 |
| ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD | - | 87 | 215 | 4,266 | 商業サービス・用品 |
| ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA | 194 | 194 | 211 | 4,186 | 資本市場 |
| SPRING AIRLINES CO LTD | 42 | - | - | - | 旅客航空輸送業 |
| EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD | 160 | 160 | 204 | 4,059 | 資本市場 |
| SHANGHAI M&G STATIONERY INC | 63 | 60 | 290 | 5,759 | 商業サービス・用品 |
| GREENLAND HOLDINGS CORP LTD | 292 | 306.6 | 165 | 3,290 | 不動産管理・開発 |
| FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD | 107 | 107 | 327 | 6,496 | 不動産管理・開発 |
| 小 計 | 株数・金 銘柄数<比率> | 76,994.14 358銘柄 | 82,390.45 388銘柄 | 135,213 - | 2,682,111 <4.3%> |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| AMMB HOLDINGS BHD | 814 | 803 | 293 | 8,786 | 銀行 |
| GENTING PLANTATIONS BHD | 141 | - | - | - | 食品 |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 3,589 | 3,731 | 1,899 | 56,774 | 銀行 |
| DIGI.COM BHD | 2,353 | 1,540 | 592 | 17,725 | 無線通信サービス |
| MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD | 897.2 | 479.2 | 328 | 9,827 | 運送インフラ |
| RHB BANK BHD | 834.8 | 1,408.8 | 835 | 24,975 | 銀行 |
| HAP SENG CONSOLIDATED BHD | 317 | 317 | 237 | 7,088 | コンピュータリット |
| TOP GLOVE CORP BHD | 2,627 | 3,823 | 684 | 20,458 | ヘルスケア機器・用品 |
| GAMUDA BHD | 1,002 | - | - | - | 建設・土木 |
| GENTING BHD | 1,072 | 1,049 | 482 | 14,425 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD | 252.56 | 202.56 | 391 | 11,711 | 銀行 |
| HONG LEONG BANK BHD | 349.08 | 339.08 | 701 | 20,963 | 銀行 |
| IOI CORP BHD | 1,908.13 | 1,908.13 | 822 | 24,586 | 食品 |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 226 | 221 | 601 | 17,970 | 食品 |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | 116 | 116 | 272 | 8,142 | 飲料 |
| MALAYAN BANKING BHD | 2,543.75 | 2,859.75 | 2,513 | 75,149 | 銀行 |
| MISC BHD | 1,008.8 | 1,008.8 | 770 | 23,041 | 海運業 |
| NESTLE MALAYSIA BHD | 41 | 41 | 547 | 16,375 | 食品 |
| PPB GROUP BHD | 462.6 | 462.6 | 792 | 23,704 | 食品 |
| PETRONAS DAGANGAN BHD | 223 | 223 | 474 | 14,186 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PETRONAS GAS BHD | 396 | 554 | 932 | 27,890 | ガス |
| GENTING MALAYSIA BHD | 2,198 | 2,198 | 652 | 19,516 | ホテル・レストラン・レジャー |
| TELEKOM MALAYSIA BHD | 595 | 595 | 299 | 8,965 | 各種電気通信サービス |
| TENAGA NASIONAL BHD | 1,396.5 | 1,463.5 | 1,309 | 39,158 | 電力 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 | |
|------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------|-------------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | 千マレーシア・リンギット | 千円 | | |
| QL RESOURCES BHD | 509.5 | 254.5 | 126 | 3,781 | 食品 | |
| DIALOG GROUP BHD | 2,339.44 | 1,837.44 | 477 | 14,282 | エネルギー設備・サービス | |
| PUBLIC BANK BHD(LOCAL) | 8,914.5 | 8,512.5 | 3,975 | 118,845 | 銀行 | |
| KOSSAN RUBBER INDUSTRIES | 828 | — | — | — | ヘルスケア機器・用品 | |
| SUPERMAX CORP BHD | 745.71 | — | — | — | ヘルスケア機器・用品 | |
| SIME DARBY BERHAD | 1,395 | 2,348 | 565 | 16,916 | コンプロマリット | |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD | 1,072 | 1,058 | 488 | 14,612 | ヘルスケア機器・用品 | |
| AXIATA GROUP BERHAD | 1,701 | 1,345 | 485 | 14,515 | 無線通信サービス | |
| MAXIS BHD | 1,308 | 1,052 | 407 | 12,171 | 無線通信サービス | |
| INARI AMERTRON BHD | — | 1,313 | 380 | 11,383 | 電子装置・機器・部品 | |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 1,362 | 1,350 | 1,393 | 41,650 | 化学 | |
| IHH HEALTHCARE BHD | 1,687 | 1,266 | 810 | 24,222 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD | 357 | 176 | 70 | 2,104 | 運送インフラ | |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD | 788 | 1,825 | 1,189 | 35,572 | 金属・鋳業 | |
| SIME DARBY PLANTATION BHD | 934 | 1,064 | 539 | 16,127 | 食品 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 49,304.57 38銘柄 | 48,744.86 35銘柄 | 27,348 — | 817,609 <1.3%> | |
| (南アフリカ) | 百株 | 百株 | 千南アフリカ・ランド | 千円 | | |
| AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 71.63 | 71.63 | 1,917 | 16,527 | 金属・鋳業 | |
| BIDVEST GROUP LTD | 162 | 160.66 | 3,425 | 29,524 | コンプロマリット | |
| CLICKS GROUP LTD | 155.31 | 134.09 | 4,011 | 34,582 | 食品・生活必需品小売り | |
| DISCOVERY LTD | 211.37 | 249.05 | 4,227 | 36,439 | 保険 | |
| GOLD FIELDS LTD | 557.34 | 515.31 | 11,483 | 98,989 | 金属・鋳業 | |
| REMGRO LTD | 260 | 283.02 | 4,094 | 35,291 | 各種金融サービス | |
| NORTHAM PLATINUM LTD | 236.02 | — | — | — | 金属・鋳業 | |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD | 285.37 | 363.08 | 2,504 | 21,589 | 金属・鋳業 | |
| EXXARO RESOURCES LTD | 141.15 | 154.24 | 3,612 | 31,136 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 38.02 | 47.36 | 10,182 | 87,772 | 銀行 | |
| MTN GROUP LTD | 1,063.52 | 992.79 | 17,383 | 149,847 | 無線通信サービス | |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 265.08 | 241.13 | 8,283 | 71,399 | 金属・鋳業 | |
| FIRSTRAND LTD | 3,039.68 | 2,949.79 | 20,613 | 177,685 | 各種金融サービス | |
| NASPERS LTD | 265.6 | 126.73 | 19,303 | 166,394 | インターネット販売・通信販売 | |
| NEDBANK GROUP LTD | 234.74 | 268.1 | 5,903 | 50,884 | 銀行 | |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 29.67 | 31.16 | 6,169 | 53,182 | 金属・鋳業 | |
| SASOL LTD | 312.58 | 330.95 | 12,202 | 105,182 | 化学 | |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD | 325.94 | 294.74 | 6,870 | 59,227 | 食品・生活必需品小売り | |
| MR PRICE GROUP LTD | 182.1 | 142.2 | 3,119 | 26,893 | 専門小売り | |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 842.71 | 794.67 | 13,238 | 114,115 | 銀行 | |
| SPAR GROUP LTD/THE | 94.14 | 95.11 | 1,563 | 13,479 | 食品・生活必需品小売り | |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 542.19 | 560.8 | 3,293 | 28,390 | 複合小売り | |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD | 241.12 | 217.55 | 3,917 | 33,768 | 医薬品 | |
| ABSA GROUP LTD | 391.86 | 420.97 | 7,475 | 64,439 | 銀行 | |
| TIGER BRANDS LTD | 118.03 | 129.81 | 1,906 | 16,430 | 食品 | |
| SANLAM LTD | 1,195.61 | 1,091.85 | 7,491 | 64,573 | 保険 | |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 489.66 | 475.83 | 10,307 | 88,854 | 金属・鋳業 | |
| KUMBA IRON ORE LTD | 31.73 | 44.97 | 2,923 | 25,199 | 金属・鋳業 | |
| RMI HOLDINGS | 358.36 | 393.52 | 1,879 | 16,197 | 保険 | |
| VODACOM GROUP PTY LTD | 432.18 | 367.03 | 5,429 | 46,802 | 無線通信サービス | |
| NEPI ROCKCASTLE PLC | 221.85 | 333.57 | 3,194 | 27,537 | 不動産管理・開発 | |
| OLD MUTUAL LTD | 2,929.73 | 2,992.44 | 3,659 | 31,547 | 保険 | |
| REINET INVESTMENTS SCA | 77.43 | 64.7 | 2,140 | 18,451 | 資本市場 | |
| PEPKOR HOLDINGS LTD | — | 1,003.74 | 2,231 | 19,233 | 専門小売り | |
| MULTICHOICE GROUP LTD | 272.58 | 270.72 | 3,471 | 29,923 | メディア | |
| SIBANYE STILLWATER LTD | 1,755.33 | 1,547.9 | 9,394 | 80,978 | 金属・鋳業 | |
| NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD | — | 287.27 | 5,588 | 48,175 | 金属・鋳業 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|------------------|------------------|------------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (南アフリカ) | 百株 | 百株 | 千南アフリカ・ランド | 千円 | |
| BID CORP LTD | 180.86 | 192.56 | 6,065 | 52,280 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 240,479 | 2,072,930 | |
| | 36銘柄 | 37銘柄 | - | <3.3%> | |
| (タイ) | 百株 | 百株 | 千タイ・バーツ | 千円 | |
| BANGKOK BANK PCL | 277 | - | - | - | 銀行 |
| BERLI JUCKER PCL NVDR | 1,011 | 1,037 | 3,681 | 13,841 | 食品・生活必需品小売り |
| KRUNG THAI BANK PCL NVDR | 1,036 | 1,538 | 2,045 | 7,691 | 銀行 |
| RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR | 342 | 27 | 119 | 449 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR | 432 | 470 | 4,864 | 18,290 | 銀行 |
| TRUE CORP PCL NVDR | 5,093.55 | 6,857.55 | 3,373 | 12,685 | 各種電気通信サービス |
| KASIKORNBANK PCL NVDR | 267 | - | - | - | 銀行 |
| ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR | 124 | 184 | 3,109 | 11,692 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHIN CORP PCL | 1,366 | 570 | 4,189 | 15,752 | 無線通信サービス |
| CHAROEN POKPHAND FOODS PCL | 2,497 | 2,008 | 4,718 | 17,742 | 食品 |
| ADVANCED INFO SERVICE PCL | 664 | 696 | 15,520 | 58,358 | 無線通信サービス |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 4,308.2 | 3,124.2 | 5,092 | 19,147 | 専門小売り |
| DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR | 208 | 210 | 7,392 | 27,793 | 電子装置・機器・部品 |
| PTT PCL | 7,056 | 5,815 | 21,515 | 80,898 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 1,471 | 1,665 | 2,780 | 10,454 | 食品 |
| KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | 656 | 677 | 3,994 | 15,018 | 消費者金融 |
| LAND AND HOUSES PCL NVDR | 6,511 | 4,641 | 4,362 | 16,403 | 不動産管理・開発 |
| SIAM CEMENT PCL NVDR | 489.5 | 451.5 | 16,389 | 61,624 | 建設資材 |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR | 2,345 | 2,511 | 17,074 | 64,201 | 運送インフラ |
| KASIKORNBANK PCL - FOREIGN | 686 | - | - | - | 銀行 |
| CENTRAL PATTANA PCL NVDR | 1,328 | 1,455 | 8,984 | 33,782 | 不動産管理・開発 |
| BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR | 5,106 | 5,386 | 13,868 | 52,147 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 415 | 225 | 3,645 | 13,705 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 1,695.1 | 1,642.1 | 5,665 | 21,301 | ホテル・レストラン・レジャー |
| THAI OIL PCL NVDR | 858 | 831 | 4,300 | 16,169 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CP ALL PCL NVDR | 3,704 | 3,422 | 23,098 | 86,850 | 食品・生活必需品小売り |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL | 3,561 | 4,271 | 3,886 | 14,613 | 陸運・鉄道 |
| PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR | 706.45 | 770.45 | 11,055 | 41,570 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL | 292 | - | - | - | 無線通信サービス |
| INDORAMA VENTURES PCL NVDR | 1,234.22 | 1,313.22 | 5,942 | 22,343 | 化学 |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 1,452.08 | 1,175.08 | 5,787 | 21,760 | 化学 |
| ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR | 760 | 807 | 7,263 | 27,308 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR | 6,136 | 3,021 | 2,537 | 9,541 | 運送インフラ |
| B GRIMM POWER PCL NVDR | 566 | 566 | 1,853 | 6,969 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR | 2,077 | 1,969 | 9,697 | 36,461 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| OSOTSPA PCL NVDR | 237 | 386 | 1,331 | 5,007 | 飲料 |
| BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR | 1,053 | 1,053 | 2,095 | 7,878 | 資本市場 |
| ASSET WORLD CORP PCL NVDR | 3,536 | 3,536 | 1,732 | 6,514 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR | 919.33 | 1,120.33 | 4,509 | 16,955 | 複合小売り |
| SCG PACKAGING PCL NVDR | - | 904 | 5,107 | 19,204 | 容器・包装 |
| SRI SAWAD POWER 1979 PCL NVDR | 568 | 236 | 1,250 | 4,703 | 消費者金融 |
| SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR | 906 | 419 | 1,047 | 3,938 | ヘルスケア機器・用品 |
| PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR | 1,966 | 1,966 | 4,915 | 18,480 | 専門小売り |
| CARABAO GROUP PCL NVDR | - | 262 | 2,633 | 9,900 | 飲料 |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR | 611 | 611 | 3,055 | 11,486 | 消費者金融 |
| GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR | 491 | 491 | 3,412 | 12,830 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 258,902 | 973,472 | |
| | 44銘柄 | 42銘柄 | - | <1.5%> | |
| (ポーランド) | 百株 | 百株 | 千ポーランド・ズロチ | 千円 | |
| MBANK | - | 6.34 | 218 | 6,457 | 銀行 |
| KGHM POLSKA MIEDZ SA | 97.85 | 79.89 | 1,365 | 40,283 | 金属・鉱業 |
| BANK PEKAO SA | 97.3 | 98.56 | 1,079 | 31,842 | 銀行 |
| ORANGE POLSKA SA | 307.83 | 589.32 | 456 | 13,461 | 各種電気通信サービス |

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

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

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

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

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

(2) 外国新株予約権証券

| 銘柄 | 株数 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|------------------------------|------------------|---------|--------------|----------|---------|-----------|--|
| | | 証券数 | 証券数 | 評価額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (タイ) | | | 証券 | 証券 | 千タイ・バーツ | 千円 | |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | | | 9,465 | - | - | - | |
| 合計 | 証券数・金 銘柄数<比率> | | 9,465 1銘柄 | - -銘柄 | - - | - <-%> | |

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 |
|----------------------------------|---------------|-------------------------------|------------------------|------------|---------|
| | □数 | 金額 | □数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (メキシコ) | 千□ | | 千□ | 千メキシコ・ペソ | 千円 |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D | 121.8 | | 114.1 | 17,846 | 113,247 |
| GRUPO TELEvisa SAB | 141.9 | | 120.8 | 5,281 | 33,514 |
| CEMEX SAB DE CV | 948.675 | | 854.975 | 8,096 | 51,378 |
| MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV | 28 | | 25 | 1,492 | 9,470 |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 173.9 | | 168 | 3,860 | 24,498 |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 41.5 | | 28.3 | 3,124 | 19,829 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 1,455,775 6銘柄<0.5%> | 1,311,175 6銘柄<0.4%> | 39,702 | 251,939 |
| (ブラジル) | 千□ | | 千□ | 千ブラジル・レアル | 千円 |
| SUL AMERICA SA | 15,356 | | — | — | — |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA | 21.7 | | 32.3 | 1,127 | 30,369 |
| ENERGISA SA | 17.5 | | 8.1 | 383 | 10,343 |
| KLABIN SA | 48.7 | | 50.5 | 1,150 | 31,006 |
| BANCO INTER SA | 6.7 | | 23.7 | 391 | 10,554 |
| BANCO BTG PACTUAL SA | 12.8 | | 67.5 | 1,694 | 45,644 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 122,756 6銘柄<0.2%> | 182.1 5銘柄<0.2%> | 4,748 | 127,918 |
| (南アフリカ) | 千□ | | 千□ | 千南アフリカ・ランド | 千円 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 259.878 | | 190.305 | 2,679 | 23,097 |
| 小計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 259,878 1銘柄<0.0%> | 190,305 1銘柄<0.0%> | 2,679 | 23,097 |
| 合計 | □数 銘柄数<比率> | 金額 1,838,409 13銘柄<0.7%> | 1,683,58 12銘柄<0.6%> | — | 402,955 |

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 当期 | | 期末 | |
|----|-------------------|----|--------------|----|----------|
| | | 買建 | 額 | 売建 | 額 |
| 外国 | MINI MSCI EMG MKT | | 百万円 9,569 | | 百万円 — |

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

■投資信託財産の構成

2022年4月18日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 52,841,334 | 83.8 |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 402,955 | 0.6 |
| コール・ローン等、その他 | 9,834,830 | 15.6 |
| 投資信託財産総額 | 63,079,120 | 100.0 |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、62,754,884千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=126.68円、1香港・ドル=16.15円、1台湾・ドル=4.348円、1イギリス・ポンド=165.23円、1トルコ・リラ=8.664円、1メキシコ・ペソ=6.345円、1フィリピン・ペソ=2.427円、100チリ・ペソ=15.545円、100コロンビア・ペソ=3.384円、1クウェート・ディナール=415.75円、1カタール・リアル=34.77円、1サウジアラビア・リアル=33.84円、1インド・ルピー=1.67円、100インドネシア・ルピア=0.89円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=34.55円、1ブラジル・レアル=26.94円、1チェコ・コルナ=5.596円、100韓国・ウォン=10.29円、1オフショア・人民元=19.836円、1マレーシア・リングギット=29.895円、1南アフリカ・ランド=8.62円、1タイ・バーツ=3.76円、1ポーランド・ズロチ=29.505円、100ハンガリー・フォリント=36.363円、1ユーロ=136.78円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月18日)現在

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

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

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

One DC 新興国株式インデックスファンド 390,365,407円
マネックス資産設計ファンド エボリューション 385,912,567円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) 345,994,625円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) 463,152,779円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30) 940,074,201円
投資のソムリエ 8,414,976,041円
クルーズコントロール 371,495,340円
投資のソムリエ<DC年金> 512,003,596円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 377,344,929円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 512,932,398円
リスク抑制世界8資産バランスファンド 2,856,021,516円
ワールドアセットバランス (基本コース) 755,160,967円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 832,729,130円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 17,362,940円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 8,593,766円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 3,509,820円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 60,654,292円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 512,298,207円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 334,081,535円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 14,127,616円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 7,563,166円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 5,875,009円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) 682,711円
エマージング株式パッシブファンドVA (適格機関投資家専用) 12,616,953円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 213,862,757円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用) 7,828,376円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定) 40,668,920円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 248,047,269円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 122,753,099円
期末元本合計 43,349,645,868円

■損益の状況

当期 自2021年4月20日 至2022年4月18日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|----------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 1,478,930,564円 | |
| | 受取配当金 | 1,474,434,394 | |
| | 受取利息 | 930,536 | |
| | その他の収益 | 3,662,561 | |
| | 支払利息 | △96,927 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | △4,450,256,246 | |
| | 売買益 | 16,463,925,031 | |
| | 売買損 | △20,914,181,277 | |
| (C) | 先物取引等取引損益 | △592,117,607 | |
| | 取引益 | 1,566,330,273 | |
| | 取引損 | △2,158,447,880 | |
| (D) | その他費用 | △354,426,674 | |
| (E) | 当期損益金(A+B+C+D) | △3,917,869,963 | |
| (F) | 前期繰越損益金 | 18,987,564,725 | |
| (G) | 解約差損益金 | △21,955,890,564 | |
| (H) | 追加信託差損益金 | 26,424,766,926 | |
| (I) | 合計(E+F+G+H) | 19,538,571,124 | |
| | 次期繰越損益金(I) | 19,538,571,124 | |

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

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

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