運 用 報 告 書（全体版）

第12期<決算日2024年１月11日>

ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド

愛称：宝船

ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）

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、「ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド」は、2024年１月11日に第12期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2
https://www.am-one.co.jp/

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類		追加型投信／内外／資産複合（インデックス型）
信託期間		2012年９月６日から無期限です。
運用方針		信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。
主要投資対象	ベビーファンド※	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の株式を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	海外の証券取引所に上場している株式※を主要投資対象とします。 ※ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。
運用方法		主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資し、基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
組入制限		マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 外貨建資産への実質投資割合については、制限を設けません。
分配方針		決算日（原則として１月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買益（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。

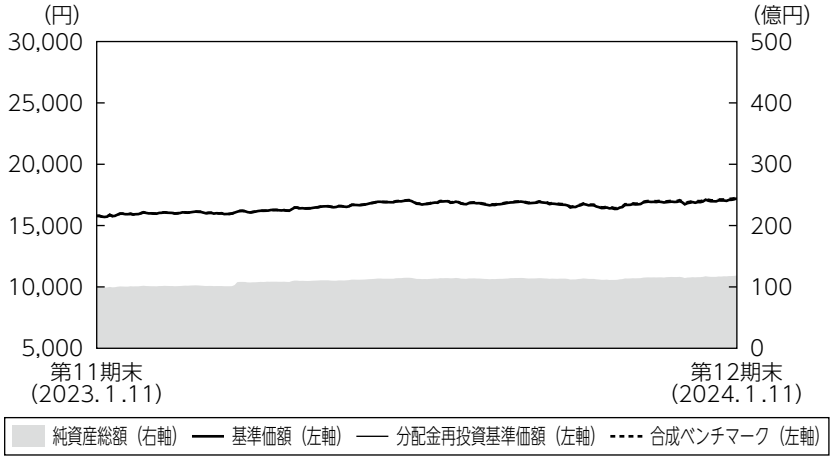
※ベビーファンドとは、ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）、ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）、ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）です。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>
コールセンター：0120-104-694
受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

■当期の運用経過（2023年１月12日から2024年１月11日まで）

ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）

基準価額等の推移



第12期首：　15,794円
第12期末：　17,222円
（既払分配金０円）
騰　落　率：　　9.0%
（分配金再投資ベース）

（注１）分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
（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および合成ベンチマーク（委託会社が独自に合成した指数）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

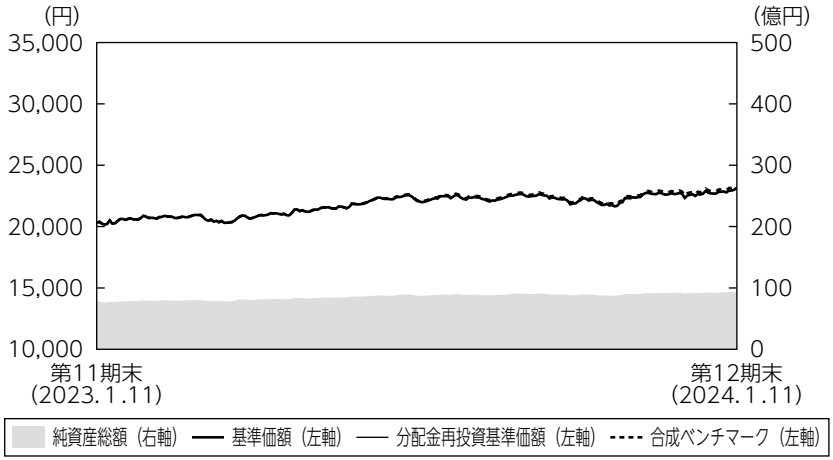
基準価額の主な変動要因

インフレの抑制を目的とした主要国の金融引き締め等から多くの国で長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと等がマイナスに寄与しました。一方、金融政策の方向性の違いが意識されたこと等から主要通貨に対して円安となったこと、欧米での金融機関の破綻などを要因に一時調整の動きもありましたが、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から国内外の株式市場や外国リート市場が上昇したこと等がプラスに寄与しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	34.0%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.2%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	32.6%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.5%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	9.3%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	16.0%
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	2.2%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.5%

ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）
基準価額等の推移



第12期首：　20,338円
第12期末：　23,162円
（既払分配金０円）
騰　落　率：　　13.9%
（分配金再投資ベース）

（注１）分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
（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および合成ベンチマーク（委託会社が独自に合成した指数）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

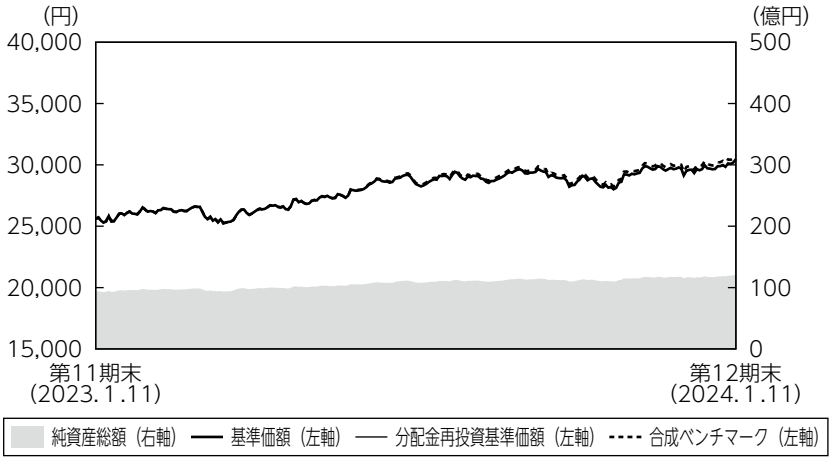
基準価額の主な変動要因

インフレの抑制を目的とした主要国の金融引き締め等から多くの国で長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと等がマイナスに寄与しました。一方、金融政策の方向性の違いが意識されたこと等から主要通貨に対して円安となったこと、欧米での金融機関の破綻などを要因に一時調整の動きもありましたが、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から国内外の株式市場や外国リート市場が上昇したこと等がプラスに寄与しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	34.0%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.2%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	32.6%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.5%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	9.3%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	16.0%
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	2.2%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.5%

ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）
基準価額等の推移



第12期首：　25,595円
第12期末：　30,468円
（既払分配金０円）
騰　落　率：　　19.0%
（分配金再投資ベース）

（注１）分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
（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および合成ベンチマーク（委託会社が独自に合成した指数）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

インフレの抑制を目的とした主要国の金融引き締め等から多くの国で長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと等がマイナスに寄与しました。一方、金融政策の方向性の違いが意識されたこと等から主要通貨に対して円安となったこと、欧米での金融機関の破綻などを要因に一時調整の動きもありましたが、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から国内外の株式市場や外国リート市場が上昇したこと等がプラスに寄与しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	34.0%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.2%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	32.6%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.5%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	9.3%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	16.0%
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	2.2%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.5%

投資環境

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

国内債券市場は上昇（利回りは低下）しました。期初から2023年６月にかけて、日銀の新体制や金融政策修正を巡る思惑から、利回りは大きく上下しました。７月以降は、日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決めたことなどを受けて、利回りは上昇しました。11月以降は、国内債券に対する堅調な需要が確認されたことなどから利回りは低下しました。

先進国株式市場は上昇しました。米国株式市場では米銀破綻を受けた金融システム不安により下落する場面もありましたが、利上げ観測の後退や大型ハイテク企業の決算が好感され上昇しました。欧州株式市場では期前半、ＥＣＢ（欧州中央銀行）の利上げペース鈍化観測や中国の景気回復期待などから上昇しました。期後半はＥＣＢの利上げ等により調整しましたが、2023年11月以降はユーロ圏のインフレ鈍化を受けた長期金利の低下により反発して、期末を迎えました。

先進国債券市場では、米国債の利回りは上昇、ドイツ債の利回りは横ばいでした。米国債は、インフレ懸念から高金利が長期化するという見方から利回りが上昇したのちに、2023年11月月初のＦＯＭＣ（米連邦公開市場委員会）で２会合連続で政策金利の据え置きを決めたことを受けて、利上げ局面終了観測から上昇幅を縮めました。ドイツ債は高金利が長期化するという見方から利回りが上昇したのちユーロ圏のインフレ鈍化基調が意識されたことなどから利回りは上昇幅を打ち消しました。

新興国株式市場（円換算ベース）は上昇しました。不動産市況の悪化が景気に悪影響を及ぼすことが懸念された中国や期前半の原油価格下落の影響等からカタール、クウェートが下落しましたが、国内の物価動向が落ち着きを見せ始めたインド、利下げが続いたブラジルやハイテク企業が堅調に推移した台湾などが上昇しました。

新興国債券市場は上昇しました。期初から2023年９月上旬までは横ばいで推移し、９月中旬以降、米金融引き締めの長期化観測などから米長期国債が下落すると新興国債券も下落しましたが、その後、米経済指標の下振れなどから早期の利下げ観測が強まり、米長期国債の上昇に連れて大きく上昇しました。対米国債スプレッド（利回り格差）は縮小しました。2023年２月から３月にかけ米銀破綻を受けた金融システム不安などにより一時拡大しましたが、11月下旬以降、リスク選好の改善に伴い縮小しました。

国内リート市場は上昇しました。期の前半は2023年３月に米銀破綻等による金融システム不安を受けて急落する局面がありましたが、その後は相対的に高い分配金利回りに着目した資金流入が支えとなって値を戻しました。期の後半は日米の今後の金融政策への思惑が交錯し、方向感の定まらない展開が続きました。中東情勢の緊迫化も相場の重しとなりました。

外国リート市場（現地通貨建て）は上昇しました。米国リート市場は利上げや米銀の破綻等によるリスク回避の動きから調整しましたが、2023年11月以降は利上げ観測の後退などから反発しました。欧州リート市場は英中央銀行が利上げ幅を再拡大したこと等を背景に調整しましたが、ユーロ圏のインフレ鈍化を受け反発しました。オーストラリアリート市場はオーストラリアの長期金利の上昇から2023年５月以降上値の重い展開となりましたが、11月に入りオーストラリアの長期金利が低下したことで反発しました。

為替市場では主要通貨に対して円安の動きとなりました。期初から期後半にかけてドル／円相場は、日銀の金融政策の修正観測が高まった局面では円高に振れましたが、総じて内外金利差の拡大や金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に円安ドル高基調の動きとなりました。期後半にかけてはＦＲＢ（米連邦準備理事会）の早期利下げ観測の高まり等から米長期金利低下による内外金利差縮小を背景に円安の動きは縮小しました。その他主要通貨においても、内外金利差の拡大や金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に概ね円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

各ファンドでは、それぞれ以下の基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざし、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行いました。

＜基本アロケーション＞

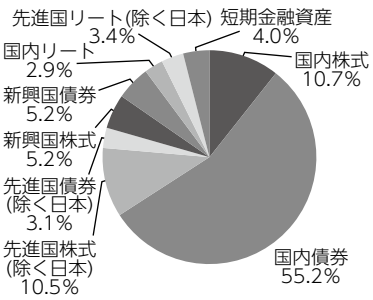
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）：国内株式10％、国内債券57％、先進国株式（除く日本）10％、先進国債券（除く日本）３％、新興国株式５％、新興国債券５％、国内リート３％、先進国リート（除く日本）３％、短期金融資産４％

ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）：国内株式15％、国内債券31％、先進国株式（除く日本）15％、先進国債券（除く日本）４％、新興国株式10％、新興国債券10％、国内リート６％、先進国リート（除く日本）６％、短期金融資産３％

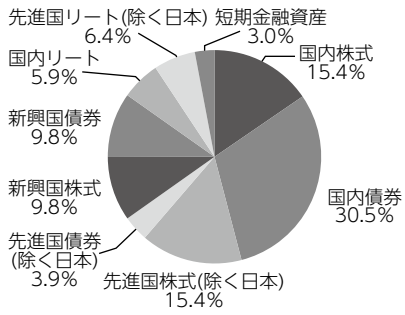
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）：国内株式20％、国内債券５％、先進国株式（除く日本）20％、先進国債券（除く日本）５％、新興国株式15％、新興国債券15％、国内リート９％、先進国リート（除く日本）９％、短期金融資産２％

決算日（2024年１月11日）現在の組入比率

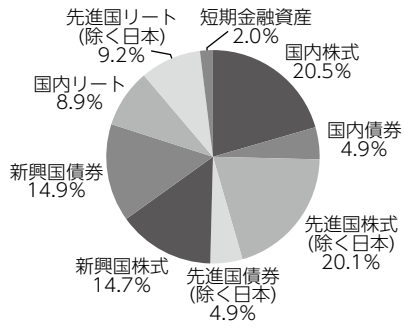
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）



ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）



ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）



●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
　ベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
　ベンチマークである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。

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

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

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

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

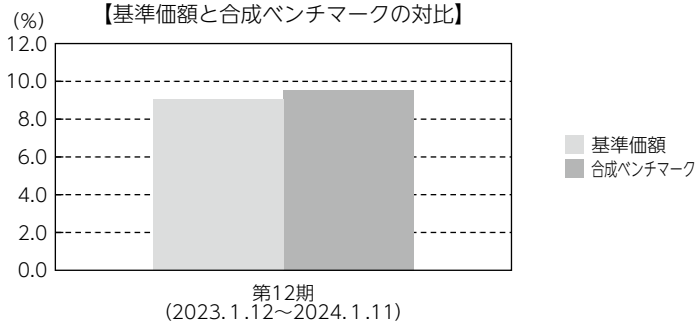
●Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
　リートの実質組入比率を高め、ベンチマークである東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持しました。

●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）に連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行いました。

ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）
合成ベンチマークとの差異について

合成ベンチマークは前期末比で9.5％上昇しました。

当ファンドの騰落率は合成ベンチマークを0.5％下回りました。信託報酬の要因を除くと、合成ベンチマークにほぼ連動した運用結果となりました。



（注）基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。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 2023年１月12日 ～2024年１月11日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	7,222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。

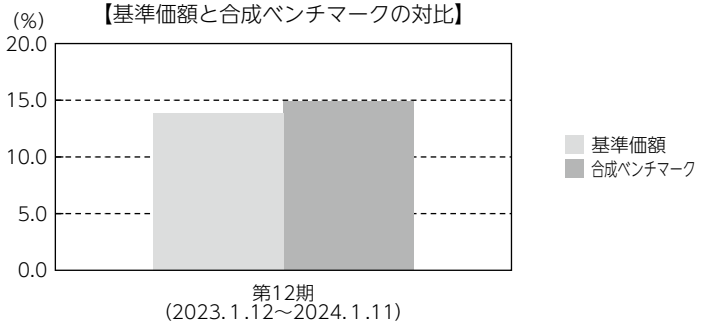
（注２）当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第３位を四捨五入しています。

（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。

ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）
合成ベンチマークとの差異について

合成ベンチマークは前期末比で14.9%上昇しました。

当ファンドの騰落率は合成ベンチマークを1.0%下回りました。信託報酬の要因を除くと、合成ベンチマークにほぼ連動した運用結果となりました。



（注）基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。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 2023年１月12日 ～2024年１月11日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	13,161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。

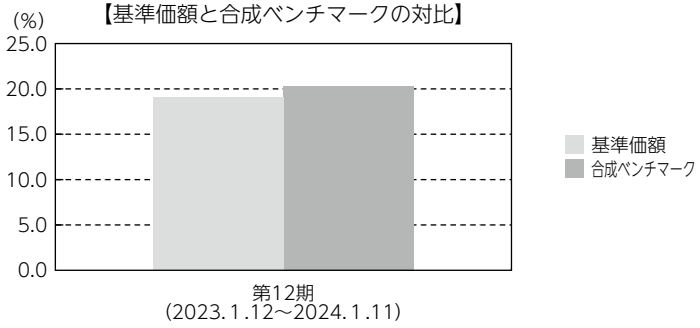
（注２）当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第３位を四捨五入しています。

（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。

ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）
合成ベンチマークとの差異について

合成ベンチマークは前期末比で20.3％上昇しました。

当ファンドの騰落率は合成ベンチマークを1.3％下回りました。信託報酬の要因を除くと、合成ベンチマークにほぼ連動した運用結果となりました。



（注）基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。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 2023年１月12日 ～2024年１月11日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	20,467円

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

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

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

今後の運用方針

各ファンドでは、引き続き、合成ベンチマークに概ね連動した投資成果が得られるよう、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行います。

●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。

●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。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動したパフォーマンスをめざします。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマーク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。また、保有しているロシア関連銘柄につきましては、売却可能となり次第、速やかに売却する方針です。

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

●Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

引き続き、リートの組入比率を高め、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。

■分配金のお知らせ

各ファンドの収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案して無分配とさせていただきました。

＊合成ベンチマークについて

（注１）合成ベンチマークとは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合、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）、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、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）、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）、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）、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）、コール・ローン（オーバーナイト物）を、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。基本アロケーションについては、前掲の「ポートフォリオについて」をご参照ください。

（注２）経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

（注３）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）および東証ＲＥＩＴ指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

（注４）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

（注５）ＭＳＣＩコクサイ・インデックスおよび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。

（注６）ＦＴＳＥ世界国債インデックスは、ＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣにより運営されている債券インデックスです。ＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、ＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣに帰属します。

（注７）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。

（注８）Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは、S&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「ＳＰＤＪＩ」）の商品であり、これの使用ライセンスが委託会社に付与されています。Ｓ＆Ｐ®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「Ｓ＆Ｐ」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはＳＰＤＪＩに付与されており、委託会社により一定の目的でサブライセンスされています。本商品は、ＳＰＤＪＩ、Dow Jones、Ｓ＆Ｐ、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド(新興国10)

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額			合成ベンチマーク		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	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率							
	円	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%	百万円
8期(2020年1月14日)	15,303	0	7.9	15,894.85	8.1	24.3	1.5	61.9	−	−	6.2	8,245
9期(2021年1月12日)	15,646	0	2.2	16,320.35	2.7	25.6	1.2	62.2	−	−	6.2	8,888
10期(2022年1月11日)	16,543	0	5.7	17,309.29	6.1	23.7	1.3	63.9	−	−	6.6	9,852
11期(2023年1月11日)	15,794	0	△4.5	16,673.66	△3.7	24.0	1.2	64.7	−	−	6.1	9,953
12期(2024年1月11日)	17,222	0	9.0	18,264.08	9.5	25.1	1.0	63.0	−	−	6.4	11,863

(注１) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注２) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(注３) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。
(注４) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。
(注５) △（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		合成ベンチマーク		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
		騰落率		騰落率						
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%
2023年1月11日	15,794	−	16,673.66	−	24.0	1.2	64.7	−	−	6.1
1月末	15,905	0.7	16,802.14	0.8	24.3	0.9	64.0	−	−	6.2
2月末	16,081	1.8	16,984.63	1.9	24.1	1.0	64.3	−	−	6.2
3月末	16,190	2.5	17,099.54	2.6	24.2	1.3	64.1	−	−	6.2
4月末	16,342	3.5	17,257.61	3.5	24.4	0.8	64.3	−	−	6.4
5月末	16,549	4.8	17,487.65	4.9	24.7	0.8	63.7	−	−	6.4
6月末	16,972	7.5	17,943.91	7.6	25.7	0.6	62.7	−	−	6.4
7月末	16,888	6.9	17,858.63	7.1	25.9	0.8	62.2	−	−	6.5
8月末	16,887	6.9	17,865.33	7.1	25.6	0.9	61.0	−	−	6.5
9月末	16,700	5.7	17,679.53	6.0	25.4	0.6	62.5	−	−	6.3
10月末	16,360	3.6	17,335.74	4.0	24.8	0.8	63.8	−	−	6.2
11月末	16,931	7.2	17,946.75	7.6	25.2	0.8	63.1	−	−	6.3
12月末	17,043	7.9	18,076.83	8.4	24.8	1.0	63.4	−	−	6.4
(期末)										
2024年1月11日	17,222	9.0	18,264.08	9.5	25.1	1.0	63.0	−	−	6.4

(注１) 騰落率は期首比です。
(注２) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注３) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(注４) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。
(注５) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■１万口当たりの費用明細

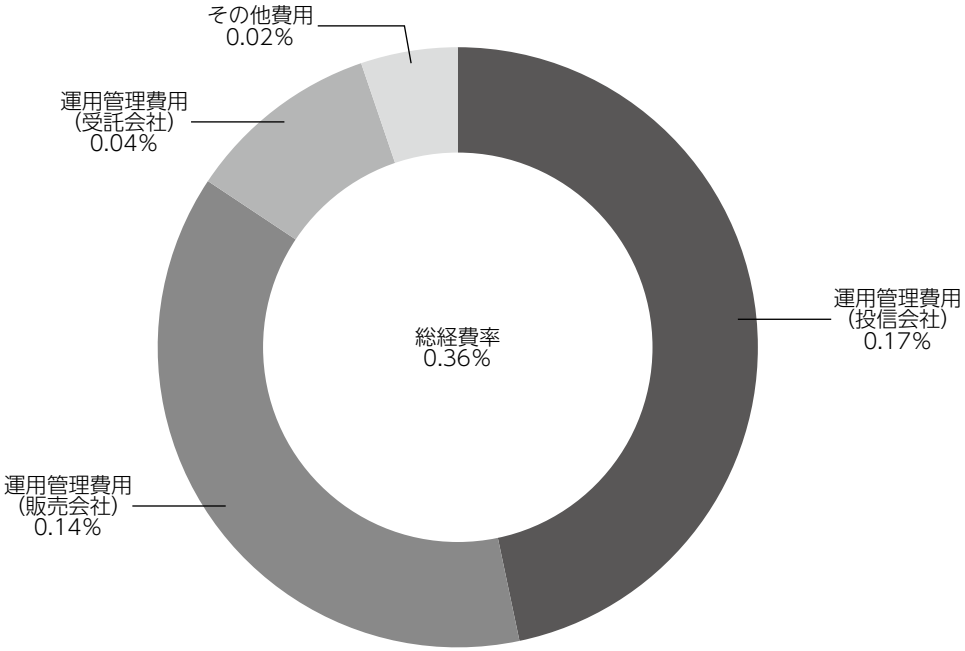
項目	第12期 (2023年１月12日 ～2024年１月11日)		項目の概要
	金額	比率	
(ａ) 信託報酬	57円	0.346%	(ａ) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は16,553円です。
(投信会社)	(28)	(0.170)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(23)	(0.137)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(6)	(0.038)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(ｂ) 売買委託手数料	1	0.004	(ｂ) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.002)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(ｃ) 有価証券取引税	1	0.007	(ｃ) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.006)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(ｄ) その他費用	3	0.019	(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)	(2)	(0.012)	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)	(1)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.003)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	62	0.377	

(注１) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。
(注２) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注３) 比率欄は「１万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.36%です。



（注1）1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
（注2）各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
（注3）各比率は、年率換算した値です。
（注4）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年１月12日から2024年１月11日まで）

	当期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	20,652	69,802	35,192	132,803
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	653,175	817,777	1,811	2,255
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,175	89,870	26,972	182,523
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12,733	25,654	－	－
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	36,116	48,310	1,580	2,363
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	21,766	42,620	－	－
ＪＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	17,877	39,980	－	－
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	29,498	44,158	6,831	12,602

■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	283,932,132千円	650,915,241千円	73,266,988千円
(b)期中の平均組入株式時価総額	425,778,025千円	987,501,679千円	87,256,445千円
(c)売買高比率(a)／(b)	0.66	0.65	0.83

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年１月12日から2024年１月11日まで）

【ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）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）	426千円
うち利害関係人への支払額（B）	1千円
（B）／（A）	0.5%

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

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	159,105	103,694	65.2	124,826	58,472	46.8

平均保有割合　0.3%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	1,614	1,476	4,995

(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
	百万円
株式	198

【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					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	865,446	67,997	7.9	876,992	76,121	8.7

平均保有割合　1.2%

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

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資証券	124,387	25,037	20.1	122,070	5,738	4.7
不動産投信指数先物取引	20,079	9,331	46.5	19,289	8,616	44.7

平均保有割合　0.2%

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

(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
	百万円
投資証券	7,033

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	306,201	291,662	1,263,860
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,592,822	5,244,186	6,551,562
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	170,887	159,091	1,245,223
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	146,595	159,329	363,382
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	366,379	400,914	617,689
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	250,043	271,810	614,317
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	125,636	143,513	338,720
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	185,757	208,424	398,112

■投資信託財産の構成

2024年１月11日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,263,860	10.6
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,551,562	55.1
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,245,223	10.5
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	363,382	3.1
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	617,689	5.2
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	614,317	5.2
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	338,720	2.8
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	398,112	3.3
コール・ローン等、その他	500,486	4.2
投資信託財産総額	11,893,356	100.0

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

（注２）期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2024年１月11日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,259,040,014千円、99.9％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは245,278,017千円、98.1％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは85,902,570千円、99.7％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは97,079,610千円、98.6％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは85,914,096千円、99.8％です。

（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
なお、2024年１月11日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝145.65円、１カナダ・ドル＝108.89円、１オーストラリア・ドル＝97.70円、１香港・ドル＝18.63円、１シンガポール・ドル＝109.45円、１ニュージーランド・ドル＝90.83円、１台湾・ドル＝4.676円、１イギリス・ポンド＝185.67円、１イスラエル・シュケル＝38.913円、１スイス・フラン＝171.25円、１トルコ・リラ＝4.873円、１デンマーク・クローネ＝21.43円、１ノルウェー・クローネ＝14.07円、１スウェーデン・クローナ＝14.24円、１メキシコ・ペソ＝8.578円、１フィリピン・ペソ＝2.587円、100チリ・ペソ＝15.865円、100コロンビア・ペソ＝3.699円、１クウェート・ディナール＝474.58円、１カタール・リアル＝40.02円、１サウジアラビア・リアル＝38.90円、１インド・ルピー＝1.77円、100インドネシア・ルピア＝0.94円、１アラブ首長国連邦・ディルハム＝39.73円、１ブラジル・レアル＝29.741円、１チェコ・コルナ＝6.504円、100韓国・ウォン＝11.07円、１オフショア・人民元＝20.276円、１マレーシア・リンギット＝31.378円、１南アフリカ・ランド＝7.79円、１タイ・バーツ＝4.16円、１ポーランド・ズロチ＝36.883円、100ハンガリー・フォリント＝42.29円、１ユーロ＝159.81円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年1月11日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**11,893,356,172円**
コール・ローン等	500,486,415
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	1,263,860,716
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	6,551,562,550
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,245,223,420
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	363,382,516
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	617,689,634
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	614,317,959
J-REITインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	338,720,836
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	398,112,126
(B) 負債	**30,123,022**
未払解約金	9,940,170
未払信託報酬	19,957,399
その他未払費用	225,453
(C) 純資産総額(A−B)	**11,863,233,150**
元本	6,888,287,393
次期繰越損益金	4,974,945,757
(D) 受益権総口数	**6,888,287,393口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**17,222円**

(注) 期首における元本額は6,302,143,676円、当期中における追加設定元本額は1,074,888,415円、同解約元本額は488,744,698円です。

■損益の状況

当期　自2023年1月12日　至2024年1月11日

項目	当期
(A) 配当等収益	**△172,816円**
受取利息	10,797
支払利息	△183,613
(B) 有価証券売買損益	**957,347,533**
売買益	994,121,359
売買損	△36,773,826
(C) 信託報酬等	**△38,707,471**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**918,467,246**
(E) 前期繰越損益金	**539,907,093**
(F) 追加信託差損益金	**3,516,571,418**
(配当等相当額)	(2,768,362,315)
(売買損益相当額)	(748,209,103)
(G) 合計(D＋E＋F)	**4,974,945,757**
次期繰越損益金(G)	**4,974,945,757**
追加信託差損益金	3,516,571,418
(配当等相当額)	(2,769,964,801)
(売買損益相当額)	(746,606,617)
分配準備積立金	1,458,374,339

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注4) 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	164,590,868円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	240,207,226
(c) 収益調整金	3,516,571,418
(d) 分配準備積立金	1,053,576,245
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	4,974,945,757
(f) 1万口当たり当期分配対象額	7,222.33
(g) 分配金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド(新興国20)

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額			合成ベンチマーク		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	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率							
	円	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%	百万円
8期(2020年1月14日)	18,760	0	13.0	19,775.39	13.2	37.3	2.7	43.1	−	−	12.2	4,278
9期(2021年1月12日)	19,322	0	3.0	20,577.20	4.1	39.4	2.1	42.7	−	−	12.0	5,107
10期(2022年1月11日)	21,285	0	10.2	22,759.31	10.6	37.4	2.5	44.1	−	−	12.4	6,618
11期(2023年1月11日)	20,338	0	△4.4	22,012.47	△3.3	38.4	2.0	44.6	−	−	12.0	7,704
12期(2024年1月11日)	23,162	0	13.9	25,286.24	14.9	38.7	1.7	43.7	−	−	12.4	9,429

(注１) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注２) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(注３) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。
(注４) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。
(注５) △（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		合成ベンチマーク		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
		騰落率		騰落率						
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%
2023年1月11日	20,338	−	22,012.47	−	38.4	2.0	44.6	−	−	12.0
1月末	20,584	1.2	22,296.01	1.3	38.7	1.7	43.8	−	−	12.2
2月末	20,807	2.3	22,523.13	2.3	38.3	1.8	44.3	−	−	12.2
3月末	20,822	2.4	22,536.54	2.4	38.1	2.1	44.5	−	−	12.1
4月末	21,111	3.8	22,844.37	3.8	38.5	1.5	44.5	−	−	12.3
5月末	21,561	6.0	23,362.05	6.1	39.1	1.4	43.9	−	−	12.2
6月末	22,420	10.2	24,335.41	10.6	39.5	1.0	43.6	−	−	12.2
7月末	22,447	10.4	24,392.12	10.8	39.6	1.3	43.3	−	−	12.2
8月末	22,535	10.8	24,514.44	11.4	38.9	1.5	43.0	−	−	12.2
9月末	22,215	9.2	24,178.86	9.8	39.2	1.0	43.3	−	−	12.0
10月末	21,691	6.7	23,631.64	7.4	38.4	1.4	44.7	−	−	12.1
11月末	22,654	11.4	24,711.73	12.3	38.7	1.4	44.2	−	−	12.2
12月末	22,859	12.4	24,959.76	13.4	38.2	1.7	44.0	−	−	12.5
(期末)										
2024年1月11日	23,162	13.9	25,286.24	14.9	38.7	1.7	43.7	−	−	12.4

(注１) 騰落率は期首比です。
(注２) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注３) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(注４) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。
(注５) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■１万口当たりの費用明細

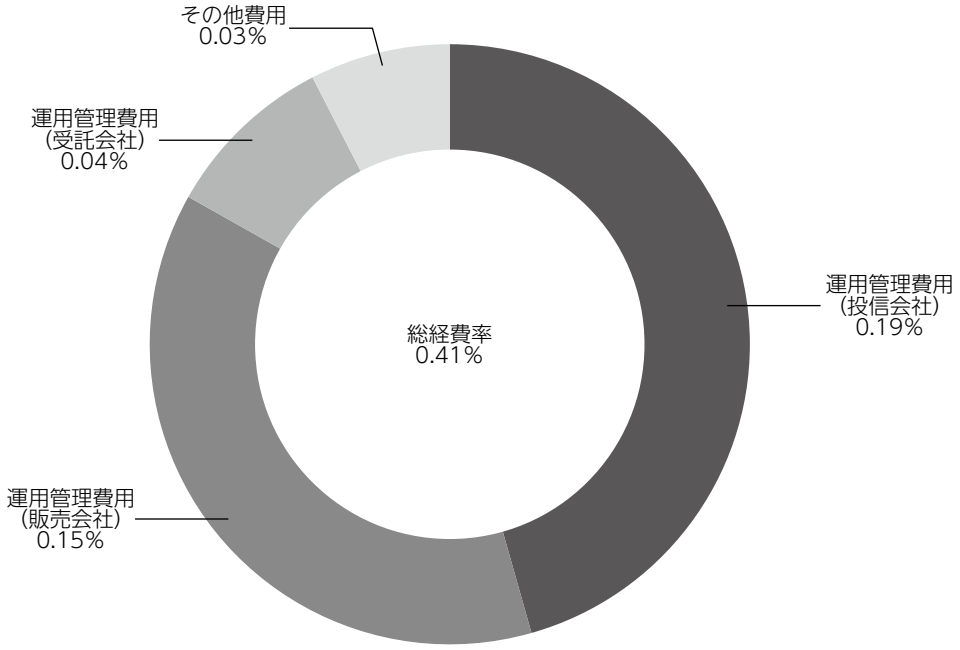
項目	第12期 (2023年１月12日～2024年１月11日)		項目の概要
	金額	比率	
(ａ) 信託報酬	83円	0.379%	(ａ) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は21,769円です。
(投信会社)	(41)	(0.187)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(34)	(0.154)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(8)	(0.038)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(ｂ) 売買委託手数料	2	0.007	(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)	(1)	(0.004)	
(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	3	0.014	(ｃ) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(2)	(0.011)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(ｄ) その他費用	7	0.031	(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)	(5)	(0.023)	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)	(1)	(0.004)	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)	(1)	(0.005)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	94	0.431	

(注１) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。
(注２) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注３) 比率欄は「１万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.41％です。



（注1）1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
（注2）各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
（注3）各比率は、年率換算した値です。
（注4）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年１月12日から2024年１月11日まで）

	当期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,989	7,359	22,075	84,023
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	370,583	464,627	7,908	9,936
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,488	47,566	19,792	137,069
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10,002	21,228	－	－
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	36,704	50,857	7,522	11,622
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	22,230	45,206	－	－
ＪＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	42,526	98,991	－	－
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	39,335	60,595	14,387	26,333

■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	283,932,132千円	650,915,241千円	73,266,988千円
(b)期中の平均組入株式時価総額	425,778,025千円	987,501,679千円	87,256,445千円
(c)売買高比率(a)／(b)	0.66	0.65	0.83

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年１月12日から2024年１月11日まで）

【ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）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）	618千円
うち利害関係人への支払額（B）	2千円
（B）／（A）	0.5%

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

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	159,105	103,694	65.2	124,826	58,472	46.8

平均保有割合　0.3%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	1,614	1,476	4,995

(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
	百万円
株式	198

【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					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	865,446	67,997	7.9	876,992	76,121	8.7

平均保有割合　0.5%

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

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資証券	124,387	25,037	20.1	122,070	5,738	4.7
不動産投信指数先物取引	20,079	9,331	46.5	19,289	8,616	44.7

平均保有割合　0.3%

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

(2) 利害関係人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
	百万円
投資証券	7,033

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	356,000	335,914	1,455,618
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,937,579	2,300,254	2,873,708
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	197,773	185,469	1,451,685
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	150,866	160,868	366,893
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	568,786	597,969	921,291
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	387,327	409,557	925,641
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	192,913	235,440	555,685
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	288,624	313,572	598,955

■投資信託財産の構成

2024年１月11日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,455,618	15.4
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,873,708	30.4
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,451,685	15.4
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	366,893	3.9
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	921,291	9.7
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	925,641	9.8
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	555,685	5.9
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	598,955	6.3
コール・ローン等、その他	307,450	3.3
投資信託財産総額	9,456,929	100.0

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

（注２）期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2024年１月11日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,259,040,014千円、99.9％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは245,278,017千円、98.1％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは85,902,570千円、99.7％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは97,079,610千円、98.6％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは85,914,096千円、99.8％です。

（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
なお、2024年１月11日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝145.65円、１カナダ・ドル＝108.89円、１オーストラリア・ドル＝97.70円、１香港・ドル＝18.63円、１シンガポール・ドル＝109.45円、１ニュージーランド・ドル＝90.83円、１台湾・ドル＝4.676円、１イギリス・ポンド＝185.67円、１イスラエル・シュケル＝38.913円、１スイス・フラン＝171.25円、１トルコ・リラ＝4.873円、１デンマーク・クローネ＝21.43円、１ノルウェー・クローネ＝14.07円、１スウェーデン・クローナ＝14.24円、１メキシコ・ペソ＝8.578円、１フィリピン・ペソ＝2.587円、100チリ・ペソ＝15.865円、100コロンビア・ペソ＝3.699円、１クウェート・ディナール＝474.58円、１カタール・リアル＝40.02円、１サウジアラビア・リアル＝38.90円、１インド・ルピー＝1.77円、100インドネシア・ルピア＝0.94円、１アラブ首長国連邦・ディルハム＝39.73円、１ブラジル・レアル＝29.741円、１チェコ・コルナ＝6.504円、100韓国・ウォン＝11.07円、１オフショア・人民元＝20.276円、１マレーシア・リンギット＝31.378円、１南アフリカ・ランド＝7.79円、１タイ・バーツ＝4.16円、１ポーランド・ズロチ＝36.883円、100ハンガリー・フォリント＝42.29円、１ユーロ＝159.81円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年1月11日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**9,456,929,638円**
コール・ローン等	305,197,953
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	1,455,618,198
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,873,708,045
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,451,685,129
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	366,893,848
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	921,291,342
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	925,641,077
J-REITインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	555,685,884
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	598,955,162
未収入金	2,253,000
(B) 負債	**27,751,964**
未払解約金	10,362,770
未払信託報酬	17,211,693
その他未払費用	177,501
(C) 純資産総額(A－B)	**9,429,177,674**
元本	4,071,030,378
次期繰越損益金	5,358,147,296
(D) 受益権総口数	**4,071,030,378口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**23,162円**

(注) 期首における元本額は3,788,001,637円、当期中における追加設定元本額は611,393,392円、同解約元本額は328,364,651円です。

■損益の状況

当期　自2023年1月12日　至2024年1月11日

項目	当期
(A) 配当等収益	**△102,162円**
受取利息	6,809
支払利息	△108,971
(B) 有価証券売買損益	**1,101,144,342**
売買益	1,148,026,784
売買損	△46,882,442
(C) 信託報酬等	**△32,972,183**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**1,068,069,997**
(E) 前期繰越損益金	**602,254,274**
(F) 追加信託差損益金	**3,687,823,025**
(配当等相当額)	(2,953,117,641)
(売買損益相当額)	(734,705,384)
(G) 合計(D＋E＋F)	**5,358,147,296**
次期繰越損益金(G)	**5,358,147,296**
追加信託差損益金	3,687,823,025
(配当等相当額)	(2,954,331,914)
(売買損益相当額)	(733,491,111)
分配準備積立金	1,670,324,271

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注4) 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	185,317,335円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	486,397,321
(c) 収益調整金	3,687,823,025
(d) 分配準備積立金	998,609,615
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	5,358,147,296
(f) 1万口当たり当期分配対象額	13,161.65
(g) 分配金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド(新興国30)

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額			合成ベンチマーク		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	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率							
	円	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%	百万円
8期(2020年1月14日)	22,720	0	18.3	24,389.27	18.3	50.8	4.0	23.9	－	－	18.1	5,610
9期(2021年1月12日)	23,400	0	3.0	25,635.88	5.1	53.1	3.0	23.6	－	－	17.7	6,419
10期(2022年1月11日)	26,787	0	14.5	29,551.39	15.3	51.0	3.8	24.3	－	－	18.4	8,927
11期(2023年1月11日)	25,595	0	△4.4	28,659.09	△3.0	52.8	2.8	24.3	－	－	18.1	9,373
12期(2024年1月11日)	30,468	0	19.0	34,488.91	20.3	52.7	2.3	24.1	－	－	18.3	12,083

(注１) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注２) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(注３) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。
(注４) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。
(注５) △（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		合成ベンチマーク		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
		騰落率		騰落率						
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	%
2023年1月11日	25,595	－	28,659.09	－	52.8	2.8	24.3	－	－	18.1
1月末	26,035	1.7	29,174.27	1.8	53.0	2.4	23.9	－	－	18.1
2月末	26,311	2.8	29,450.01	2.8	52.4	2.6	24.3	－	－	18.3
3月末	26,175	2.3	29,280.65	2.2	52.2	3.0	24.4	－	－	18.1
4月末	26,660	4.2	29,808.81	4.0	52.5	2.1	24.5	－	－	18.5
5月末	27,464	7.3	30,762.26	7.3	53.0	2.0	24.4	－	－	18.2
6月末	28,956	13.1	32,527.93	13.5	53.4	1.4	24.1	－	－	18.2
7月末	29,175	14.0	32,834.01	14.6	53.5	1.8	24.0	－	－	18.2
8月末	29,418	14.9	33,149.89	15.7	52.8	2.1	24.3	－	－	18.2
9月末	28,904	12.9	32,586.04	13.7	53.6	1.4	22.8	－	－	18.0
10月末	28,123	9.9	31,742.68	10.8	52.6	2.0	24.8	－	－	18.0
11月末	29,649	15.8	33,525.59	17.0	52.7	1.9	24.4	－	－	18.5
12月末	29,987	17.2	33,952.64	18.5	52.1	2.4	24.2	－	－	18.6
(期末)										
2024年1月11日	30,468	19.0	34,488.91	20.3	52.7	2.3	24.1	－	－	18.3

(注１) 騰落率は期首比です。
(注２) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注３) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(注４) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。
(注５) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■１万口当たりの費用明細

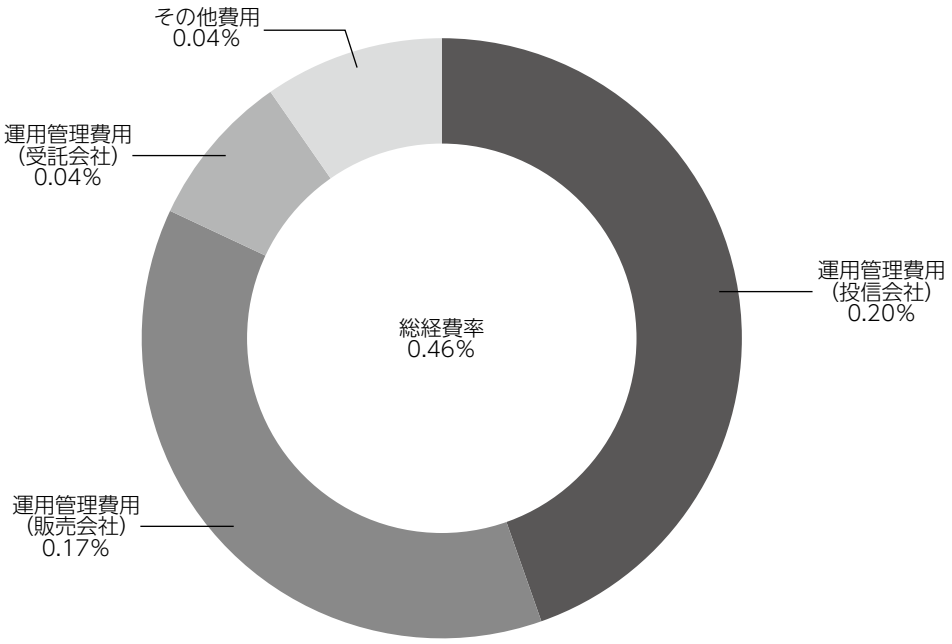
項目	第12期 (2023年１月12日～2024年１月11日)		項目の概要
	金額	比率	
(ａ) 信託報酬	115円	0.412%	(ａ) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は27,998円です。
(投信会社)	(57)	(0.203)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(48)	(0.170)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(11)	(0.038)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(ｂ) 売買委託手数料	3	0.011	(ｂ) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(2)	(0.006)	
(先物・オプション)	(1)	(0.003)	
(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	6	0.020	(ｃ) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(5)	(0.016)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(1)	(0.003)	
(ｄ) その他費用	12	0.044	(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)	(9)	(0.033)	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)	(1)	(0.004)	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)	(2)	(0.007)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	136	0.487	

(注１) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。
(注２) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注３) 比率欄は「１万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.46％です。



（注1）1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
（注2）各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
（注3）各比率は、年率換算した値です。
（注4）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年１月12日から2024年１月11日まで）

	当期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	29,904	118,664	33,589	126,299
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	92,532	116,057	－	－
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,120	98,770	25,020	167,658
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	29,012	62,018	－	－
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	131,001	189,999	20,845	30,639
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	97,210	202,775	9,159	18,901
ＪＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	99,051	231,227	966	2,279
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	110,071	175,698	54,964	96,974

■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	283,932,132千円	650,915,241千円	73,266,988千円
(b)期中の平均組入株式時価総額	425,778,025千円	987,501,679千円	87,256,445千円
(c)売買高比率(a)／(b)	0.66	0.65	0.83

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年１月12日から2024年１月11日まで）

【ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）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）	1,141千円
うち利害関係人への支払額（B）	5千円
（B）／（A）	0.5%

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

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	159,105	103,694	65.2	124,826	58,472	46.8

平均保有割合　0.5%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	1,614	1,476	4,995

(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
	百万円
株式	198

【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					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	865,446	67,997	7.9	876,992	76,121	8.7

平均保有割合　0.1%

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

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資証券	124,387	25,037	20.1	122,070	5,738	4.7
不動産投信指数先物取引	20,079	9,331	46.5	19,289	8,616	44.7

平均保有割合　0.5%

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

(2) 利害関係人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
	百万円
投資証券	7,033

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	576,024	572,339	2,480,117
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	377,779	470,311	587,560
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	320,757	310,857	2,433,109
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	229,942	258,954	590,598
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,041,246	1,151,401	1,773,964
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	706,275	794,325	1,795,255
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	355,658	453,743	1,070,925
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	529,206	584,314	1,116,098

■投資信託財産の構成

2024年１月11日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	2,480,117	20.4
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	587,560	4.8
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,433,109	20.0
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	590,598	4.9
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,773,964	14.6
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,795,255	14.8
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	1,070,925	8.8
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,116,098	9.2
コール・ローン等、その他	299,263	2.5
投資信託財産総額	12,146,892	100.0

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

（注２）期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2024年１月11日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,259,040,014千円、99.9％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは245,278,017千円、98.1％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは85,902,570千円、99.7％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは97,079,610千円、98.6％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは85,914,096千円、99.8％です。

（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
なお、2024年１月11日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝145.65円、１カナダ・ドル＝108.89円、１オーストラリア・ドル＝97.70円、１香港・ドル＝18.63円、１シンガポール・ドル＝109.45円、１ニュージーランド・ドル＝90.83円、１台湾・ドル＝4.676円、１イギリス・ポンド＝185.67円、１イスラエル・シュケル＝38.913円、１スイス・フラン＝171.25円、１トルコ・リラ＝4.873円、１デンマーク・クローネ＝21.43円、１ノルウェー・クローネ＝14.07円、１スウェーデン・クローナ＝14.24円、１メキシコ・ペソ＝8.578円、１フィリピン・ペソ＝2.587円、100チリ・ペソ＝15.865円、100コロンビア・ペソ＝3.699円、１クウェート・ディナール＝474.58円、１カタール・リアル＝40.02円、１サウジアラビア・リアル＝38.90円、１インド・ルピー＝1.77円、100インドネシア・ルピア＝0.94円、１アラブ首長国連邦・ディルハム＝39.73円、１ブラジル・レアル＝29.741円、１チェコ・コルナ＝6.504円、100韓国・ウォン＝11.07円、１オフショア・人民元＝20.276円、１マレーシア・リンギット＝31.378円、１南アフリカ・ランド＝7.79円、１タイ・バーツ＝4.16円、１ポーランド・ズロチ＝36.883円、100ハンガリー・フォリント＝42.29円、１ユーロ＝159.81円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年1月11日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**12,146,892,763円**
コール・ローン等	283,051,305
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)	2,480,117,113
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	587,560,233
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,433,109,513
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	590,598,137
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	1,773,964,899
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	1,795,255,643
J-REITインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	1,070,925,550
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,116,098,370
未収入金	16,212,000
(B) 負債	**63,117,458**
未払解約金	39,292,457
未払信託報酬	23,601,036
その他未払費用	223,965
(C) 純資産総額(A－B)	**12,083,775,305**
元本	3,966,063,126
次期繰越損益金	8,117,712,179
(D) 受益権総口数	**3,966,063,126口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**30,468円**

(注) 期首における元本額は3,662,294,004円、当期中における追加設定元本額は808,128,696円、同解約元本額は504,359,574円です。

■損益の状況

当期　自2023年1月12日　至2024年1月11日

項目	当期
(A) 配当等収益	**△87,176円**
受取利息	7,732
支払利息	△94,908
(B) 有価証券売買損益	**1,793,147,209**
売買益	1,906,322,828
売買損	△113,175,619
(C) 信託報酬等	**△44,474,368**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**1,748,585,665**
(E) 前期繰越損益金	**888,380,122**
(F) 追加信託差損益金	**5,480,746,392**
(配当等相当額)	(4,283,424,227)
(売買損益相当額)	(1,197,322,165)
(G) 合計(D＋E＋F)	**8,117,712,179**
次期繰越損益金(G)	**8,117,712,179**
追加信託差損益金	5,480,746,392
(配当等相当額)	(4,286,137,883)
(売買損益相当額)	(1,194,608,509)
分配準備積立金	2,636,965,787

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注4) 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	304,055,797円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	930,534,184
(c) 収益調整金	5,480,746,392
(d) 分配準備積立金	1,402,375,806
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	8,117,712,179
(f) 1万口当たり当期分配対象額	20,467.93
(g) 分配金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日　2023年２月７日）

（計算期間　2022年２月８日～2023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21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年10月30日から無期限です。
運用方針	主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(ＴＯＰＩＸ)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率	(配当込み)(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期（2019年２月７日）	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
18期（2020年２月７日）	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
19期（2021年２月８日）	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
20期（2022年２月７日）	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336
21期（2023年２月７日）	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9	396,982

（注１）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注３）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

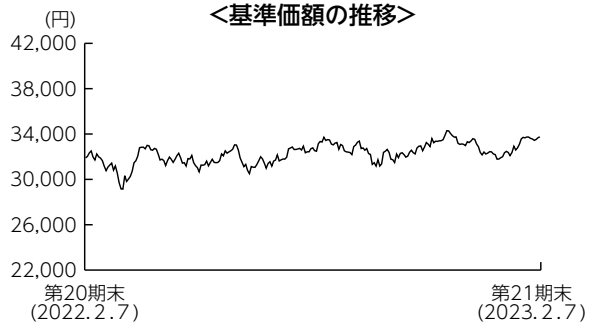
■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		東証株価指数(ＴＯＰＩＸ)		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	(配当込み)(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2022年2月7日	31,896	－	3,073.66	－	97.4	2.5
2月末	31,265	△2.0	3,012.57	△2.0	98.0	1.3
3月末	32,610	2.2	3,142.06	2.2	96.9	3.1
4月末	31,831	△0.2	3,066.68	△0.2	96.2	3.9
5月末	32,079	0.6	3,090.73	0.6	96.7	3.4
6月末	31,424	△1.5	3,027.34	△1.5	96.7	3.3
7月末	32,592	2.2	3,140.07	2.2	97.1	2.9
8月末	32,985	3.4	3,177.98	3.4	98.0	2.0
9月末	31,176	△2.3	3,003.39	△2.3	96.3	3.7
10月末	32,765	2.7	3,156.44	2.7	97.1	2.8
11月末	33,730	5.7	3,249.61	5.7	97.7	2.3
12月末	32,189	0.9	3,101.25	0.9	96.9	3.1
2023年1月末	33,613	5.4	3,238.48	5.4	97.7	2.3
(期末) 2023年2月7日	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9

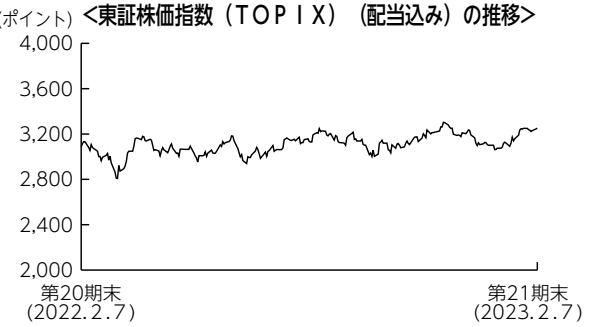
（注１）騰落率は期首比です。
（注２）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年２月８日から2023年２月７日まで）

<基準価額の推移>



<東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）の推移>



基準価額の推移

当期末の基準価額は33,751円となり、前期末比で5.8％上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの感染状況、日本や米国などの金融政策、ウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式市場は一進一退の展開となりました。期末にかけては、米国で金融引き締めの長期化懸念が後退したことや日銀の金融緩和継続などを受けて上昇しました。

投資環境

期初から2022年３月半ばまでは、新型コロナウイルスの感染拡大、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、国内株式市場は下落しました。その後は、米国での金融引き締め、日銀の金融政策への思惑、インフレ動向、国内の新型コロナウイルスの感染状況やウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式市場は一進一退の展開となりました。期末にかけては、日銀の金融緩和継続などを要因として上昇しました。

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	比率
1	電気機器	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

期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.3%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.3
4	銀行業	6.4
5	化学	6.1
6	卸売業	5.9
7	医薬品	5.2
8	サービス業	5.2
9	機械	5.2
10	小売業	4.4

○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	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	

期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.6%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.1
4	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	日本・円	2.0
5	日本電信電話	日本・円	1.7
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
7	武田薬品工業	日本・円	1.3
8	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
9	第一三共	日本・円	1.2
10	任天堂	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,161銘柄	

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5.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマーク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	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(株式)	(0)	(0.000)	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
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) その他費用	0	0.000	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は32,278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（2022年２月８日から2023年２月７日まで）

(1) 株　式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	152,381.9 (2,240.729)	362,922,344 (－)	156,466.829	364,983,330

(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 116,409	百万円 119,651	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	727,905,675千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	377,008,289千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.93

(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２月８日から2023年２月７日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	362,922	231,022	63.7	364,983	229,125	62.8
金銭信託	1.380	1.380	100.0	1.380	1.380	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	3,015	2,776	4,163

(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
	百万円
株式	3

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	4,537千円
うち利害関係人への支払額（B）	231千円
（B）／（A）	5.1%

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	7.2	7.3	26,572
ニッスイ	199.7	191.5	100,729
マルハニチロ	31.4	28.4	67,734
雪国まいたけ	14.8	16.3	16,919
カネコ種苗	4.9	5.9	9,735
サカタのタネ	24	21.8	89,162
ホクト	17	17	31,654
ホクリヨウ	3.4	2.5	2,262
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	35.1	26.4	9,108
日鉄鉱業	4.6	7.6	25,992
三井松島ホールディングス	8.3	8.7	27,144
ＩＮＰＥＸ	800.9	707.9	989,644
石油資源開発	23.5	22.2	92,463
K&Oエナジーグループ	9.9	8.7	17,800
建設業 (1.9%)			
ヒノキヤグループ	4.5	－	－
ショーボンドホールディングス	28.5	26.1	139,896
ミライト・ワン	64.4	66.5	101,146
タマホーム	12.1	12.1	38,478
サンヨーホームズ	2.5	2.2	1,601
日本アクア	8.1	7.1	6,780
ファーストコーポレーション	6.4	4.3	3,057
ベステラ	4	3.7	3,300
Ｒｏｂｏｔ Ｈｏｍｅ	33.3	32.7	5,460
キャンディル	3.8	2.7	1,358
ダイセキ環境ソリューション	3.9	3.4	3,233
第一カッター興業	5.1	5.1	5,253
安藤・間	99.1	110.9	93,377
東急建設	58.5	54.6	35,271
コムシスホールディングス	64.4	64.8	156,556
ビーアールホールディングス	27.1	30.5	10,339
高松コンストラクショングループ	12.6	12.5	23,950
東建コーポレーション	5.5	5.5	41,195
ソネック	2.3	2	1,890
ヤマウラ	10.3	9.8	10,103
オリエンタル白石	67.8	68.7	20,472
大成建設	133.2	133.2	571,428
大林組	460.9	478.7	463,860
清水建設	431.8	402.5	283,360
飛島建設	12.3	14.9	15,451
長谷工コーポレーション	137.3	138.2	203,706
松井建設	18.4	12.6	7,421
錢高組	1.7	1.5	4,072
鹿島建設	337.9	296.9	450,694
不動テトラ	9.8	9.3	14,322
大末建設	5	4.3	4,940
鉄建建設	10.3	9.6	17,212
西松建設	28	22.7	75,818
三井住友建設	103.8	107.5	44,505
大豊建設	6.8	5.6	20,188
佐田建設	10.2	7.7	4,150
ナカノフドー建設	10.9	8.5	2,822
奥村組	27.1	21.7	64,557
東鉄工業	21.5	18.5	48,451
イチケン	3.5	2.7	4,881
富士ピー・エス	5.9	6.1	2,751
淺沼組	5.2	10.7	33,705
戸田建設	191.4	164.6	112,915
熊谷組	23.5	23.2	59,670
北野建設	2.9	2.3	6,288
植木組	4.1	3.4	4,539
矢作建設工業	20.5	18.4	14,536
ピーエス三菱	15.4	17.2	10,853
日本ハウスホールディングス	31.7	26.6	10,241
新日本建設	19.9	18.8	15,698
東亜道路工業	2.6	2.3	14,191
日本道路	4.6	2.7	16,578
東亜建設工業	11.5	11.5	28,520
日本国土開発	45.5	40.2	21,868
若築建設	7.7	6	17,952
東洋建設	51.7	43.4	37,931
五洋建設	182.7	189.9	119,826
世紀東急工業	22.4	17.7	13,983
福田組	5	5.1	23,001
住友林業	118	102.7	249,252
日本基礎技術	12.7	7.2	3,837
巴コーポレーション	20.7	13.5	5,535
大和ハウス工業	425.6	374.1	1,138,760
ライト工業	29	25.5	47,302
積水ハウス	500	419.4	1,038,015
日特建設	9.8	12.9	11,868
北陸電気工事	9.8	9.3	6,463
ユアテック	26.5	29.9	22,155
日本リーテック	9.6	8.9	7,805
四電工	5.2	5.7	10,208
中電工	21.3	20.8	43,243
関電工	75.2	73.6	62,265
きんでん	103.1	94.5	135,040
東京エネシス	15.5	13.3	11,903
トーエネック	4.7	4.4	14,784
住友電設	11.5	12.8	29,964
日本電設工業	25.4	22	32,956
エクシオグループ	69.8	61.5	140,958
新日本空調	12.2	7.4	14,097
九電工	35.6	32.6	104,157
三機工業	30.2	29.7	44,371
日揮ホールディングス	141.9	132.4	220,048
中外炉工業	4.7	4.4	7,700
ヤマト	13.8	10.1	8,019
太平電業	10.4	8.4	28,350
高砂熱学工業	41.7	32.3	58,624
三晃金属工業	1.7	1.4	5,222
朝日工業社	3.3	5.6	11,586
明星工業	29.9	23	18,009
大氣社	22.6	16.1	55,062
ダイダン	10.3	8.9	19,366
日比谷総合設備	14.9	11.5	22,367
フィル・カンパニー	2.8	2.4	2,712
テスホールディングス	8.5	14.4	16,300
インフロニア・ホールディングス	196.5	140.2	142,162
東洋エンジニアリング	19.4	17.7	10,478
レイズネクスト	22.6	19.4	24,851
食料品 (3.4%)			
ニップン	43.5	36.3	57,898
日清製粉グループ本社	167	124.3	193,783
日東富士製粉	1.6	2.2	9,515
昭和産業	14.3	11.8	29,216
鳥越製粉	13.7	9.8	5,733
中部飼料	16.7	18.7	19,167
フィード・ワン	20.2	19.7	13,297
東洋精糖	1.8	2.4	2,080
日本甜菜製糖	8.1	8	13,080
DM三井製糖ホールディングス	13.7	13.3	26,812
塩水港精糖	19.9	14.9	2,890
ウェルネオシュガー	7.6	7	11,501
森永製菓	34.8	24.9	92,503
中村屋	2.6	2.8	8,540
江崎グリコ	40.7	38.5	135,905
名糖産業	6.9	5.5	9,234
井村屋グループ	8.6	7.2	16,070
不二家	8.5	9.3	23,417
山崎製パン	110.7	90	134,280
第一屋製パン	3.5	2.2	851
モロゾフ	3.7	4.3	14,620
亀田製菓	8.6	8.6	36,636
寿スピリッツ	14.3	14.3	123,981
カルビー	67.3	61.5	178,842
森永乳業	27.4	24.5	114,415
六甲バター	11	9.9	13,246
ヤクルト本社	109.4	96.1	873,549
明治ホールディングス	97.6	83.4	561,282
雪印メグミルク	35.6	32.6	57,636
プリマハム	18.6	18.2	40,331
日本ハム	56.5	52.6	192,253
林兼産業	3.8	3.7	1,731
丸大食品	14.8	13.5	19,642
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	13.3	14.9	43,001
柿安本店	5.2	5.3	10,621
伊藤ハム米久ホールディングス	95.7	104.7	73,499
サッポロホールディングス	50.4	44.3	141,981
アサヒグループホールディングス	347.2	310.6	1,343,345
キリンホールディングス	542.4	606.7	1,232,511
宝ホールディングス	100.4	91.8	94,921
オエノンホールディングス	43	40.1	10,345
養命酒製造	5.1	4.4	8,030
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	103.7	105.3	140,154
サントリー食品インターナショナル	98.7	94.7	428,991
ダイドーグループホールディングス	7.7	7.6	36,214
伊藤園	45	45.5	202,702
キーコーヒー	14.8	15.1	31,257
ユニカフェ	5	4.1	3,673
ジャパンフーズ	1.7	1.5	1,633
日清オイリオグループ	18.7	19	60,135
不二製油グループ本社	32	31.3	63,413
かどや製油	1.1	1.2	4,266
Ｊ－オイルミルズ	14.2	13.7	21,166
キッコーマン	106.3	89.1	592,515
味の素	325.9	329	1,349,229
ブルドックソース	6.4	5.4	10,022
キユーピー	77.6	72.2	159,345
ハウス食品グループ本社	55.3	41.3	110,931
カゴメ	56	62.7	193,429
焼津水産化学工業	5.1	5.6	5,073
アリアケジャパン	13.5	11.8	52,451
ピエトロ	1.2	1.7	3,073
エバラ食品工業	2.5	3.3	10,362
やまみ	1.7	1.2	1,622
ニチレイ	67.3	61.6	161,576
東洋水産	71	67.9	379,561
イートアンドホールディングス	5.7	5.8	13,415
大冷	2	1.7	3,226
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7.9	8.6	7,765
日清食品ホールディングス	57.9	47.3	530,706
永谷園ホールディングス	6.9	6.7	13,527
一正蒲鉾	6.2	5.2	3,655
フジッコ	13.8	13.9	25,840
ロック・フィールド	16	15.1	23,435

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本たばこ産業	791.4	884.9	2,341,002
ケンコーマヨネーズ	8.5	9.3	12,173
わらべや日洋ホールディングス	9.6	9.9	18,810
なとり	8.1	8.6	17,647
イフジ産業	2.5	2.2	2,017
ピックルスコーポレーション	7.2	–	–
ファーマフーズ	14	20.7	28,110
ユーグレナ	75	86.6	86,426
紀文食品	8.6	10.5	9,985
ピックルスホールディングス	–	7.9	9,511
ミヨシ油脂	6.2	4.2	3,880
理研ビタミン	15.4	11.6	22,156
繊維製品（0.5%）			
片倉工業	13.8	12.6	22,012
グンゼ	9.6	10.2	43,248
東洋紡	56.9	59	60,239
ユニチカ	39.2	41.4	9,646
富士紡ホールディングス	6.4	5.4	17,010
倉敷紡績	12.3	10.2	22,256
シキボウ	7.9	6.8	6,636
日本毛織	43.4	36	33,660
ダイトウボウ	23.8	21.5	1,827
トーア紡コーポレーション	4.3	4.2	1,474
ダイドーリミテッド	20.5	18.6	4,724
帝国繊維	16.3	15.4	23,931
帝人	135.4	131.6	173,317
東レ	1,042.5	916.3	715,721
住江織物	3.4	2.5	4,635
日本フエルト	5.9	6.7	2,733
イチカワ	1.4	1.5	2,010
日東製網	1.7	1.3	2,022
アツギ	11.5	7.1	2,726
ダイニック	3.8	3	2,040
セーレン	29.6	26.4	64,125
ソトー	6.2	3.9	3,178
東海染工	1.4	1.3	1,435
小松マテーレ	23.6	19.9	14,188
ワコールホールディングス	35.9	26.3	62,699
ホギメディカル	19.5	18.4	59,432
クラウディアホールディングス	2.5	2.7	977
ＴＳＩホールディングス	47.9	48.8	27,328
マツオカコーポレーション	4.6	3.3	4,125
ワールド	18.9	17.5	23,275
三陽商会	6.9	4.6	6,490
ナイガイ	4.1	4.1	1,061
オンワードホールディングス	86.3	88.5	30,090
ルックホールディングス	4.6	3.5	8,988
キムラタン	79.9	72.8	1,528
ゴールドウイン	26	24.3	240,084
デサント	28.1	23.5	92,707
キング	6.7	5.4	2,743
ヤマトインターナショナル	13.3	9.8	2,450
パルプ・紙（0.2%）			
特種東海製紙	8.9	6.1	17,805
王子ホールディングス	602.3	569.8	297,435
日本製紙	69	71.1	67,402
三菱製紙	21.3	15.1	4,303
北越コーポレーション	94.7	86.4	68,688
中越パルプ工業	5.6	4.7	4,958
巴川製紙所	4.6	3.8	2,667
大王製紙	69.6	60.3	59,817
阿波製紙	4	2.9	1,957
レンゴー	136.3	124.6	109,025
トーモク	9	7.9	12,008
ザ・パック	11	10.1	26,967
化学（6.2%）			
北の達人コーポレーション	51.4	57.6	18,950
クラレ	210.4	217.3	230,120
旭化成	954.1	853.9	823,586
共和レザー	9.2	7.1	3,578
レゾナック・ホールディングス	124.8	132.1	291,148
住友化学	1,057.7	1,014.5	466,670
住友精化	6.4	5.8	23,606
日産化学	78.4	64.9	397,188
ラサ工業	5	5.3	10,525
クレハ	11.5	11.7	96,876
多木化学	5.6	5.4	24,840
テイカ	10.8	9.2	11,178
石原産業	23.8	24.7	26,923
片倉コープアグリ	2.5	2.5	4,300
日本曹達	18.4	14.7	63,945
東ソー	207.7	182.6	307,681
トクヤマ	46	44.1	86,303
セントラル硝子	23.5	21.9	64,473
東亞合成	80.1	68.5	77,610
大阪ソーダ	13.5	8.2	34,563
関東電化工業	31.6	26.4	26,584
デンカ	52.4	49.7	132,301
信越化学工業	247.4	230.7	4,442,128
日本カーバイド工業	5.2	4.6	5,878
堺化学工業	10	10.4	18,803
第一稀元素化学工業	13.4	12.5	13,825
エア・ウォーター	136.2	129	200,079
日本酸素ホールディングス	138.5	132.6	299,676
日本化学工業	4.6	4.5	8,541
東邦アセチレン	2.6	2.6	3,013
日本パーカライジング	72.6	67.8	63,121
高圧ガス工業	23.1	20.1	13,266
チタン工業	1.7	1.4	2,049
四国化成ホールディングス	19	16.2	20,671
戸田工業	3.2	3.1	8,091
ステラ　ケミファ	7.2	8	20,680
保土谷化学工業	4.6	3.9	12,928
日本触媒	24.2	20.8	113,984
大日精化工業	12	9.6	17,212
カネカ	37.3	31.3	104,385
三菱瓦斯化学	133.8	102.1	192,152
三井化学	130.8	112.7	352,751
ＪＳＲ	134.4	127.7	396,508
東京応化工業	23.3	23.9	155,589
大阪有機化学工業	12.2	10.3	21,784
三菱ケミカルグループ	962.6	922.8	654,080
ＫＨネオケム	23.7	22.7	61,539
ダイセル	207.2	201	181,101
住友ベークライト	22.8	20.2	88,981
積水化学工業	301.3	279.7	512,130
日本ゼオン	129.8	82	101,024
アイカ工業	40.1	34.5	103,465
ＵＢＥ	67.8	70.4	139,532
積水樹脂	21.9	19.9	38,526
タキロンシーアイ	31.4	30.2	14,888
旭有機材	8.1	9.1	24,451
ニチバン	8.6	8.5	15,045
リケンテクノス	35.4	29.5	15,841
大倉工業	7.5	6.4	11,897
積水化成品工業	19.6	18.7	7,293
群栄化学工業	3.5	2.7	6,714
タイガースポリマー	8.5	5.8	2,395
ミライアル	4.7	3.7	5,616
ダイキアクシス	5.6	4.4	3,000
ダイキョーニシカワ	30.7	30.1	18,150
竹本容器	5.3	4.1	3,349
森六ホールディングス	7.9	6.9	12,240
恵和	3.6	8.9	14,204
日本化薬	113.4	104.3	120,570
カーリットホールディングス	14.3	12.3	8,843
日本精化	11.6	7.8	18,517
扶桑化学工業	12.9	12.7	46,164
トリケミカル研究所	14.9	18.3	43,718
ＡＤＥＫＡ	66.3	47.7	101,791
日油	49.2	42.3	231,804
新日本理化	23.6	16.8	3,796
ハリマ化成グループ	11	8.7	7,629
花王	325.3	333	1,722,609
第一工業製薬	5.4	5	10,290
石原ケミカル	7.5	6.3	8,051
日華化学	5	5	4,135
ニイタカ	3	2.2	4,391
三洋化成工業	8.6	8.5	35,657
有機合成薬品工業	10.3	9.2	2,640
大日本塗料	17.8	16.9	13,351
日本ペイントホールディングス	541.2	605.1	705,546
関西ペイント	149.3	125.3	224,036
神東塗料	10	10.4	1,310
中国塗料	34	22.4	23,497
日本特殊塗料	10.9	7.7	6,760
藤倉化成	18.3	18.6	8,035
太陽ホールディングス	21.2	20.7	50,052
ＤＩＣ	60.9	53.5	129,577
サカタインクス	28.7	30.3	32,542
東洋インキＳＣホールディングス	30.5	26.7	49,341
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	11.7	12.2	15,408
富士フイルムホールディングス	258.5	262.7	1,808,426
資生堂	273.9	285.8	1,892,853
ライオン	177.6	164.3	231,663
高砂香料工業	10.3	9.3	24,561
マンダム	30.9	29.5	42,008
ミルボン	18.3	20.3	112,056
ファンケル	59.6	59.9	156,938
コーセー	27.7	27.9	418,500
コタ	9.4	11.6	20,021
シーボン	1.4	1.5	2,392
ポーラ・オルビスホールディングス	62.8	70.2	126,219
ノエビアホールディングス	12.6	12.2	67,466
アジュバンホールディングス	3.5	3	2,964
新日本製薬	4	7.8	11,286
エステー	9.5	10.6	16,726
アグロ　カネショウ	5	5.5	8,514
コニシ	24.1	22.9	39,983
長谷川香料	25.5	28.4	90,454
星光ＰＭＣ	8.6	6.4	3,622
小林製薬	41.3	39.8	361,384
荒川化学工業	12.3	11.7	11,442
メック	11	11.2	28,078
日本高純度化学	4.1	3.4	7,939
タカラバイオ	38.5	36.9	63,541
ＪＣＵ	16.6	15.5	50,297
新田ゼラチン	9.3	7.5	6,450
ＯＡＴアグリオ	3.2	5	7,320
デクセリアルズ	38.2	39.5	112,456
アース製薬	12.1	12.4	62,248
北興化学工業	13.8	13.8	11,467

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大成ラミック	4.6	4.3	12,409
クミアイ化学工業	54.8	54.5	47,251
日本農薬	26.4	25.1	17,821
アキレス	9.4	8.9	11,098
有沢製作所	21.5	22.4	31,270
日東電工	89	99.4	840,924
レック	19.1	19.5	19,597
三光合成	15.5	17.1	9,866
きもと	22.9	18.1	3,620
藤森工業	13.2	10.8	34,290
前澤化成工業	9.5	8.8	11,968
未来工業	5.5	5	7,400
ウェーブロックホールディングス	5.6	3.7	2,260
ＪＳＰ	8.7	9.6	15,273
エフピコ	27	25.9	95,441
天馬	11.6	11.7	25,833
信越ポリマー	26.4	25.4	33,451
東リ	38.8	27.6	7,010
ニフコ	49.1	49.4	171,418
バルカー	12	11.5	36,512
ユニ・チャーム	283.4	285.2	1,438,834
ショーエイコーポレーション	4	3.8	2,219
医薬品（5.4%）			
協和キリン	172.7	165.4	479,329
武田薬品工業	1,155.5	1,211.6	5,066,911
アステラス製薬	1,274.7	1,312.1	2,511,359
住友ファーマ	90.9	101.5	88,000
塩野義製薬	184.8	175	1,101,625
わかもと製薬	17.6	11.5	2,564
日本新薬	38.5	32.3	212,857
中外製薬	460	428.6	1,468,383
科研製薬	23.1	23.4	83,772
エーザイ	176.1	166.6	1,265,660
ロート製薬	75.5	132.6	302,593
小野薬品工業	337.6	264.2	747,025
久光製薬	38.8	30.4	120,232
持田製薬	18.7	16.4	54,612
参天製薬	274.1	257.6	255,281
扶桑薬品工業	5.2	4.3	8,286
日本ケミファ	1.2	1.2	2,053
ツムラ	45.7	43.1	112,749
日医工	45.6	－	－
キッセイ薬品工業	26.2	21.2	52,385
生化学工業	26	26.2	21,431
栄研化学	25.9	22.2	34,587
日水製薬	5.9	－	－
鳥居薬品	8	7.3	22,995
ＪＣＲファーマ	41.5	46.3	77,784
東和薬品	21.1	21.1	42,263
富士製薬工業	9.1	8.9	9,113
ゼリア新薬工業	26.9	19	40,147
第一三共	1,155.4	1,192.7	4,854,289
キョーリン製薬ホールディングス	29.6	29.7	49,509
大幸薬品	22.3	24.8	9,597
ダイト	9.4	9.6	24,268
大塚ホールディングス	305.5	313.3	1,280,770
大正製薬ホールディングス	35	30.4	160,816
ペプチドリーム	77.1	66.4	134,592
あすか製薬ホールディングス	16.8	14	16,744
サワイグループホールディングス	32.2	31.3	122,696
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	123.8	123.5	10,744
ニチレキ	18.9	16.3	22,249
ユシロ化学工業	7.9	7.1	5,836
ビーピー・カストロール	5.5	4.6	4,075
富士石油	39.4	27.9	7,365
ＭＯＲＥＳＣＯ	5.1	4	4,796
出光興産	163.3	152.1	478,354
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,210.8	2,473.4	1,137,764
コスモエネルギーホールディングス	42.6	54.1	190,702
ゴム製品（0.7%）			
横浜ゴム	85	77.9	164,836
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	77.5	78.6	121,751
ブリヂストン	423.6	437.2	2,111,238
住友ゴム工業	132.1	134.2	156,611
藤倉コンポジット	11.9	8.7	7,716
オカモト	8.8	7.6	28,880
フコク	6.6	7.2	7,444
ニッタ	15.3	13.9	39,434
住友理工	28.7	26.7	18,289
三ツ星ベルト	17.9	20	73,100
バンドー化学	24	21.8	21,865
ガラス・土石製品（0.7%）			
日東紡績	22	16.3	33,349
ＡＧＣ	135.1	139.3	654,013
日本板硝子	70.5	69.8	45,160
石塚硝子	2.5	1.9	2,743
日本山村硝子	5.7	4.4	2,455
日本電気硝子	59.1	55.8	132,692
オハラ	5.9	6.5	7,852
住友大阪セメント	27.3	19.3	65,716
太平洋セメント	83.5	87.2	191,840
日本ヒューム	15.4	12.5	8,325
日本コンクリート工業	29.1	27.3	6,169
三谷セキサン	6.9	5.8	23,693
アジアパイルホールディングス	23.3	21.8	14,017
東海カーボン	123.2	114.9	124,436
日本カーボン	7.6	7.8	33,579
東洋炭素	9.5	8.6	34,959
ノリタケカンパニーリミテド	8.2	6.8	28,764
ＴＯＴＯ	105	90.4	423,072
日本碍子	159.3	162	288,360
日本特殊陶業	111.9	104.2	272,795
ダントーホールディングス	9.5	8.7	2,749
ＭＡＲＵＷＡ	5.1	5.1	89,658
品川リフラクトリーズ	3.5	3.8	15,143
黒崎播磨	2.7	2.8	16,128
ヨータイ	9.4	9.2	13,763
イソライト工業	6.6	－	－
東京窯業	19.4	11.6	3,317
ニッカトー	6.8	5.6	3,029
フジミインコーポレーテッド	11.9	10.9	71,286
クニミネ工業	4.9	3.6	3,038
エーアンドエーマテリアル	3.2	2.4	2,155
ニチアス	34.2	34.6	87,226
ニチハ	20.5	17.1	43,895
鉄鋼（0.8%）			
日本製鉄	650.6	630.7	1,683,969
神戸製鋼所	271.2	283.2	192,859
中山製鋼所	23.1	29	30,740
合同製鐵	7.9	7	20,972
ＪＦＥホールディングス	392.6	376.4	585,678
東京製鐵	49.6	39.6	57,340
共英製鋼	16.5	16.1	23,506
大和工業	28	23.2	116,232
東京鐵鋼	6.4	6.7	11,242
大阪製鐵	7.9	6.6	8,038
淀川製鋼所	19.3	16.1	41,360
中部鋼鈑	－	11.7	23,470
丸一鋼管	51.5	42.9	117,631
モリ工業	4.5	2.9	8,502
大同特殊鋼	23.8	17.7	86,199
日本高周波鋼業	4.2	4.2	1,365
日本冶金工業	10.8	10.3	43,363
山陽特殊製鋼	15	13.9	36,946
愛知製鋼	8.2	8.2	18,146
日立金属	156.7	－	－
日本金属	3.6	2.8	2,492
大平洋金属	8.9	10	19,390
新日本電工	93.6	90	33,570
栗本鐵工所	6.8	6.7	12,428
虹　技	2.3	1.7	1,705
日本鋳鉄管	1.6	1.4	1,324
三菱製鋼	9.2	8.8	10,181
日亜鋼業	19.5	13.3	3,511
日本精線	2.5	2	8,980
エンビプロ・ホールディングス	4.8	8.7	6,177
シンニッタン	18	13.7	3,356
新家工業	3.8	2.7	6,679
非鉄金属（0.7%）			
大紀アルミニウム工業所	22	20	26,440
日本軽金属ホールディングス	36.7	38.1	54,292
三井金属鉱業	39.4	41	137,350
東邦亜鉛	8.1	8.4	17,673
三菱マテリアル	95.9	94	201,348
住友金属鉱山	185.8	163.4	825,170
ＤＯＷＡホールディングス	39.7	31.7	139,955
古河機械金属	24.1	20.6	27,192
エス・サイエンス	69	76.5	2,065
大阪チタニウムテクノロジーズ	16.7	20.6	75,087
東邦チタニウム	26.2	25.5	59,542
ＵＡＣＪ	22.2	19.7	46,610
ＣＫサンエツ	3.2	2.6	10,881
古河電気工業	45.2	46.9	116,405
住友電気工業	543.6	486.4	791,372
フジクラ	162	151.1	151,402
昭和電線ホールディングス	12.6	15.8	29,008
東京特殊電線	1.7	－	－
タツタ電線	25.7	28.8	20,476
カナレ電気	2.8	2	2,620
平河ヒューテック	8.2	8.2	10,651
リョービ	17.9	15	18,960
アーレスティ	15.4	13.8	6,624
アサヒホールディングス	58.3	57.1	111,573
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	8.3	8.3	11,561
宮地エンジニアリンググループ	4.6	3.9	14,898
トーカロ	37.6	38.7	46,672
アルファ	4.8	4.5	4,257
ＳＵＭＣＯ	223.9	268.1	537,540
川田テクノロジーズ	3	3.3	11,104
ＲＳ Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4.7	9.4	37,553
ジェイテックコーポレーション	1.6	1.7	5,185
信和	9.1	6.8	5,535
東洋製罐グループホールディングス	92.6	93.2	150,331
ホッカンホールディングス	8.2	7.5	10,417
コロナ	8.6	7.8	7,020
横河ブリッジホールディングス	25	18.6	36,809
駒井ハルテック	2.9	2.1	3,225
高田機工	0.7	0.6	1,554
三和ホールディングス	137.1	129.6	172,886
文化シヤッター	46.4	40.6	45,918

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三協立山	18.9	16.1	10,110
アルインコ	10.9	10.8	11,232
東洋シヤッター	2.5	2.2	1,139
ＬＩＸＩＬ	228.9	205.2	438,102
日本フイルコン	10.9	8.2	3,690
ノーリツ	28	20.7	30,718
長府製作所	14.9	14.1	29,243
リンナイ	27.4	25.5	251,940
ダイニチ工業	7.2	6.5	4,335
日東精工	18.4	20.6	10,403
三洋工業	1.4	1.4	2,570
岡部	27.8	22.6	16,226
ジーテクト	18.2	15.7	21,446
東プレ	27.1	24.9	31,448
高周波熱錬	25.9	22.8	15,663
東京製綱	8.9	8.4	9,307
サンコール	12.9	11.1	7,215
モリテックスチール	11.4	9.4	2,782
パイオラックス	21.6	19.4	34,726
エイチワン	14.4	14.7	9,555
日本発条	133.7	124.7	112,604
中央発條	7.2	7.8	5,483
アドバネクス	2.2	1.5	1,584
立川ブラインド工業	6.7	6.4	7,692
三益半導体工業	11.5	10.8	27,853
機械（5.3%）			
日本ドライケミカル	3.8	3	4,851
日本製鋼所	44.1	38	102,372
三浦工業	63	57.6	182,592
タクマ	49.2	42.4	52,915
ツガミ	31.9	30.6	43,023
オークマ	16.9	13.8	71,484
芝浦機械	16.5	13.7	38,250
アマダ	229.4	220	250,580
アイダエンジニアリング	38.2	28.4	23,117
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	4.8	3.3	3,663
ＦＵＪＩ	67	60	128,700
牧野フライス製作所	16	15.3	70,915
オーエスジー	67.3	65.8	129,691
ダイジェット工業	1.1	1.3	1,060
旭ダイヤモンド工業	38.3	38.5	28,528
DMG森精機	86.3	83.6	164,942
ソディック	32.2	37.9	28,387
ディスコ	21.5	22.1	892,840
日東工器	8.1	6.8	11,396
日進工具	11.6	11.6	12,481
パンチ工業	12.2	10.7	4,964
冨士ダイス	6.8	5.9	3,463
豊和工業	7.9	6.6	6,375
ニデックオーケーケー	5.6	5	4,695
石川製作所	3.9	3.1	4,383
東洋機械金属	9.9	8.5	4,734
津田駒工業	3.4	2.3	1,182
エンシュウ	3.5	2.6	1,781
島精機製作所	21.2	21.9	40,821
オプトラン	18.3	20.4	51,102
NCホールディングス	4.1	2.5	5,117
イワキ	9.4	9.3	11,820
フリュー	12.8	14.4	17,236
ヤマシンフィルタ	29.3	32.8	15,317
日阪製作所	18.3	13.3	11,318
やまびこ	28.3	22.5	25,290
野村マイクロ・サイエンス	3.9	4.6	21,574
平田機工	6.9	6.6	42,570
ペガサスミシン製造	15	15.3	10,220
マルマエ	6	6.7	11,771
タツモ	6.9	7.5	14,655
ナブテスコ	82.9	86.5	316,157
三井海洋開発	15.5	17.3	23,389
レオン自動機	15.6	14.6	16,074
ＳＭＣ	43.1	44.7	3,031,107
ホソカワミクロン	10.3	10.6	28,726
ユニオンツール	5.5	6.1	20,801
オイレス工業	20.5	19.3	30,687
日精エー・エス・ビー機械	4.9	6.3	28,822
サトーホールディングス	19.3	19.6	41,748
技研製作所	12.8	14.3	41,169
日本エアーテック	6.8	7	7,714
カワタ	4.7	3.6	3,074
日精樹脂工業	10.4	10.3	10,083
オカダアイヨン	4.7	3.8	6,254
ワイエイシイホールディングス	5.7	5.2	10,784
小松製作所	666.1	646	2,020,688
住友重機械工業	84.1	81.5	227,629
日立建機	58.9	54.9	166,072
日工	20.4	20.6	12,875
巴工業	5.9	6	14,670
井関農機	13.7	12.9	15,531
ＴＯＷＡ	12.6	14	27,496
丸山製作所	3.2	2.2	3,568
北川鉄工所	6.8	5.4	6,318
ローツェ	7.4	7.2	75,312
タカキタ	5	3.6	1,504
クボタ	712.6	729.6	1,427,097
荏原実業	6.9	6.6	17,503
三菱化工機	4.7	4.4	9,702
月島機械	27.3	18.7	19,410
帝国電機製作所	10.6	10	24,860
東京機械製作所	－	2.9	1,711
新東工業	32.6	28.2	20,219
澁谷工業	12.8	12.9	31,863
アイチコーポレーション	21.7	19.6	15,131
小森コーポレーション	37.5	31.9	26,413
鶴見製作所	11.5	10.5	20,800
住友精密工業	2.4	－	－
日本ギア工業	6	4	1,792
酒井重工業	2.7	2	7,480
荏原製作所	61.1	56.4	308,508
石井鐵工所	1.2	1	2,282
西島製作所	13.5	12	18,060
北越工業	14	13.8	19,016
ダイキン工業	187.4	164.6	3,778,393
オルガノ	4.2	19	61,560
トーヨーカネツ	5.5	5.3	13,970
栗田工業	79.7	77.1	474,936
椿本チエイン	19.4	19.5	59,865
大同工業	6.7	5	3,665
木村化工機	12.2	10.5	7,392
アネスト岩田	23	23.4	20,100
ダイフク	81	71.1	512,631
サムコ	3.6	4.5	16,650
加藤製作所	6.9	5.8	4,524
油研工業	1.8	1.7	3,194
タダノ	77	72.6	68,607
フジテック	54.6	50.5	157,307
ＣＫＤ	43.4	38.1	76,428
キトー	12.6	－	－
平和	41.1	45.8	104,744
理想科学工業	12.3	12.3	27,613
ＳＡＮＫＹＯ	31.8	27.1	140,649
日本金銭機械	15	15.2	17,647
マースグループホールディングス	9.4	8.2	20,221
フクシマガリレイ	10.3	10.1	44,339
オーイズミ	5.4	4.6	2,208
ダイコク電機	6.9	7.5	15,885
竹内製作所	22.4	25	70,950
アマノ	38.5	39.1	95,325
ＪＵＫＩ	20.5	21.4	13,011
サンデン	20.4	18.3	4,044
ジャノメ	12.5	14.1	8,572
マックス	19.7	17	35,819
グローリー	37.7	35.7	81,039
新晃工業	13.8	13.8	21,045
大和冷機工業	21.2	21.2	25,291
セガサミーホールディングス	145.9	110.8	222,597
日本ピストンリング	5.4	4.2	5,334
リケン	6.4	5.5	13,387
ＴＰＲ	19.9	15.8	20,777
ツバキ・ナカシマ	32.2	34	39,950
ホシザキ	43	88.7	401,811
大豊工業	12	12.1	7,598
日本精工	276.6	253	183,931
ＮＴＮ	314.8	271.8	82,899
ジェイテクト	140.9	122.7	120,246
不二越	12.6	10.2	39,219
日本トムソン	40.2	33.7	20,354
ＴＨＫ	83	79.6	214,124
ユーシン精機	11.7	10.8	7,776
前澤給装工業	11.4	9.8	9,074
イーグル工業	18.3	15.3	17,258
前澤工業	8.9	7.1	4,366
日本ピラー工業	14.9	12.8	40,640
キッツ	49.7	50.7	40,560
マキタ	179	171.5	604,537
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	53	63.2	25,153
日立造船	124.3	113	99,779
三菱重工業	231	241.1	1,191,034
ＩＨＩ	91.8	86.9	332,392
サノヤスホールディングス	17	16.8	2,200
スター精密	22.8	26	43,550
電気機器（17.7%）			
日清紡ホールディングス	89.8	112.1	107,728
イビデン	77.2	79	394,605
コニカミノルタ	320.9	307.8	166,827
ブラザー工業	179.5	184.2	367,847
ミネベアミツミ	253.4	239.8	570,004
日立製作所	707.2	670.5	4,704,898
東芝	256.9	265.3	1,194,911
三菱電機	1,470.1	1,425	2,143,912
富士電機	88.6	83.8	434,084
東洋電機製造	5.9	3.9	3,424
安川電機	158.4	163.4	833,340
シンフォニア テクノロジー	17.7	15.2	24,912
明電舎	24.9	20.9	39,772
オリジン	4	2.8	3,553
山洋電気	6.6	6	33,900
デンヨー	12.6	10.5	15,991
ＰＨＣホールディングス	16.9	19.2	29,856
ソシオネクスト	－	14.1	117,453
東芝テック	16	20.6	77,559
芝浦メカトロニクス	2.7	2.7	30,618
マブチモーター	34.1	34.3	128,282

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	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
日本電産	381.1	334.9	2,469,552	日本航空電子工業	33.7	28.3	64,184	ＫＯＡ	22.3	20.6	38,460
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.6	9.9	4,959	ＴＯＡ	16	15.7	12,183	市光工業	17.7	19.7	7,683
トレックス・セミコンダクター	7.5	6.5	17,927	マクセル	29.3	29.9	42,996	小糸製作所	80.7	164.2	363,703
東光高岳	8.2	8.4	16,783	古野電気	17.4	18	16,740	ミツバ	27	25.6	13,568
ダブル・スコープ	42.3	45.1	67,424	ユニデンホールディングス	3.3	－	－	ＳＣＲＥＥＮホールディングス	25.6	23.3	238,825
ダイヘン	16.1	12.5	51,750	スミダコーポレーション	13.9	12.6	18,711	キヤノン電子	13.7	15.1	25,790
ヤーマン	24	23.8	32,177	アイコム	5.5	5.4	13,635	キヤノン	730.5	749	2,182,586
ＪＶＣケンウッド	119.5	125.5	51,455	リオン	5.6	5.7	10,516	リコー	408.1	342.2	344,937
ミマキエンジニアリング	13.3	13.1	7,846	本多通信工業	11.9	－	－	象印マホービン	39.8	40.8	67,850
ＩＰＥＸ	6.9	7.6	8,952	横河電機	147.2	150.9	345,108	ＭＵＴＯＨホールディングス	1.2	1.7	2,748
日新電機	34.7	33	56,100	新電元工業	5.6	5.3	17,940	東京エレクトロン	93.3	96.3	4,498,173
大崎電気工業	26.8	32.5	17,095	アズビル	86.2	95.4	348,210	イノテック	8.7	9.1	12,212
オムロン	122.4	126.3	954,322	東亜ディーケーケー	7.6	5.9	4,472	**輸送用機器（7.4%）**			
日東工業	19.6	18.6	47,076	日本光電工業	60.9	63.1	207,599	トヨタ紡織	60	57.5	115,805
ＩＤＥＣ	18.3	20.3	63,133	チノー	4.8	5.7	10,869	芦森工業	2.5	2.3	3,286
正興電機製作所	4.6	4.6	4,650	共和電業	14.9	11.6	3,920	ユニプレス	21.9	24.5	19,159
不二電機工業	3.4	2.5	2,720	日本電子材料	7.2	9	13,095	豊田自動織機	119.2	99.8	755,486
ジーエス・ユアサ コーポレーション	47.9	45.3	101,517	堀場製作所	27.3	30.3	184,830	モリタホールディングス	23.6	24	27,624
サクサホールディングス	2.9	2.6	3,177	アドバンテスト	109.3	107.5	1,059,950	三櫻工業	20.2	20.9	13,773
メルコホールディングス	3.3	3.7	12,265	小野測器	6.9	4.5	1,881	デンソー	323.7	281.6	2,070,886
テクノメディカ	3.5	3.3	5,633	エスペック	12	10.9	22,345	東海理化電機製作所	38.8	38.6	56,394
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4.1	4.5	6,187	キーエンス	133.2	136.5	8,336,055	川崎重工業	107.3	102.9	297,072
日本電気	186.9	195	937,950	日置電機	7	7.1	51,830	名村造船所	43.7	31.2	12,261
富士通	132.4	137.4	2,458,773	シスメックス	124.4	117.7	1,035,053	日本車輌製造	5.5	5.3	10,345
沖電気工業	59.8	62.3	45,603	日本マイクロニクス	25.6	22.5	31,410	三菱ロジスネクスト	19.5	21.8	17,156
岩崎通信機	6.3	5.4	4,109	メガチップス	13.8	11.2	32,872	近畿車輌	1.7	1.5	1,606
電気興業	7.9	5.5	10,604	ＯＢＡＲＡ ＧＲＯＵＰ	6.8	6.4	23,424	日産自動車	1,733.9	1,939.1	919,327
サンケン電気	13.8	12.8	103,936	澤藤電機	1.8	1.4	1,601	いすゞ自動車	461.4	396.9	635,833
ナカヨ	2.2	2.1	2,375	原田工業	7.5	5.5	4,719	トヨタ自動車	7,450.7	7,495.9	14,219,722
アイホン	8.5	8.4	16,287	コーセル	16.3	16.4	18,220	日野自動車	183.6	175.8	98,448
ルネサスエレクトロニクス	796.7	899.7	1,274,425	イリソ電子工業	12.3	12.6	56,070	三菱自動車工業	544.1	532.6	272,158
セイコーエプソン	182.4	183.6	343,332	オプテックスグループ	24	25.1	50,777	エフテック	10.3	8.3	4,482
ワコム	114	109.2	72,072	千代田インテグレ	6.4	4.7	10,697	レシップホールディングス	5.7	4.7	2,190
アルバック	29.3	32.7	197,508	アイ・オー・データ機器	5.5	－	－	ＧＭＢ	2.8	2.4	1,718
アクセル	6.3	4.5	7,366	レーザーテック	64.5	62.5	1,415,625	ファルテック	2.9	2.1	1,241
ＥＩＺＯ	11.5	10.1	36,562	スタンレー電気	102.8	97.1	271,006	武蔵精密工業	32.7	33.3	59,940
ジャパンディスプレイ	500	528.8	24,324	岩崎電気	5.4	4.4	12,742	日産車体	21.7	24.1	20,533
日本信号	37.5	31.4	32,404	ウシオ電機	75.3	71.3	113,010	新明和工業	41.7	42.9	45,345
京三製作所	31.6	29	11,832	岡谷電機産業	9.3	9.8	2,518	極東開発工業	27.3	24	34,536
能美防災	19.5	18.7	32,126	ヘリオス テクノ ホールディング	12.9	11.1	4,839	トピー工業	12.1	11.1	18,858
ホーチキ	10.9	10.3	15,398	エノモト	4	3.1	5,809	ティラド	4.2	3.4	7,633
星和電機	7.2	5.2	2,246	日本セラミック	13.8	13.9	37,349	曙ブレーキ工業	80.6	83.3	12,661
エレコム	33.7	32.9	44,053	遠藤照明	6.9	5.4	3,963	タチエス	25.7	21.6	26,157
パナソニック ホールディングス	1,568.1	1,628.6	1,882,661	古河電池	10.7	10.1	10,817	ＮＯＫ	71.2	53	62,805
シャープ	167.6	166	179,612	双信電機	6.4	5	1,880	フタバ産業	36.8	36.5	14,381
アンリツ	94.6	97.1	120,306	山一電機	10.8	11.9	20,884	ＫＹＢ	15.4	13.1	47,684
富士通ゼネラル	39.9	39.1	141,346	図研	9.5	11.9	38,020	大同メタル工業	28.5	26.6	13,273
ソニーグループ	921.1	965.7	11,641,513	日本電子	30.8	34.2	135,261	プレス工業	73	60.8	26,691
ＴＤＫ	213	218.4	1,036,308	カシオ計算機	106.5	101.6	130,454	ミクニ	19.6	14	4,746
帝国通信工業	6.7	6.2	9,163	ファナック	129.1	133.9	3,090,412	太平洋工業	30.8	31.3	34,868
タムラ製作所	56.8	59.1	44,797	日本シイエムケイ	28.9	29	14,558	河西工業	17.7	16.1	2,495
アルプスアルパイン	129.9	123.1	173,694	エンプラス	3.6	4	16,040	アイシン	107.7	105.4	382,075
池上通信機	5	4	2,472	大真空	19.9	16.6	12,151	マツダ	461.4	451.5	480,396
日本電波工業	13.3	16.5	23,859	ローム	65.8	63.1	663,181	今仙電機製作所	9.6	7.7	5,205
鈴木	6.8	7.4	7,296	浜松ホトニクス	105.5	109.5	770,880	本田技研工業	1,157.5	1,109.7	3,617,622
メイコー	12	15.1	44,016	三井ハイテック	14.6	14.1	100,815	スズキ	336.2	250.8	1,212,116
日本トリム	2.9	3.1	9,008	新光電気工業	43.2	48.3	189,577	ＳＵＢＡＲＵ	421.2	432	932,904
ローランド ディー．ジー．	8.7	7.7	22,607	京セラ	206.9	212.1	1,380,771	安永	7.2	5.4	3,682
フォスター電機	14.8	12.8	12,544	太陽誘電	71.3	66.5	303,240	ヤマハ発動機	191.9	214.5	709,995
ＳＭＫ	3.5	3.3	7,844	村田製作所	431.9	414	3,191,112	ＴＢＫ	16.9	11.7	2,878
ヨコオ	10.9	10.9	24,623	双葉電子工業	25.1	25.8	14,112	エクセディ	22.3	22.2	38,472
ティアック	23.5	18.8	2,199	北陸電気工業	5.5	4.5	5,881	豊田合成	47.4	39.8	85,808
ホシデン	35.4	33	53,460	ニチコン	46.3	27.9	37,497	愛三工業	23.1	22.6	19,119
ヒロセ電機	22.8	22.8	382,356	日本ケミコン	14	13.5	26,392	盟和産業	1.7	1.5	1,401

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本プラスト	11.5	9.5	4,037
ヨロズ	13.9	12.6	9,072
エフ・シー・シー	24	24.3	34,821
シマノ	59.1	55.8	1,333,062
テイ・エス テック	62.1	62.5	98,875
ジャムコ	8.6	6.6	9,781
精密機器（2.6%）			
テルモ	416	426.5	1,640,745
クリエートメディック	4.3	4.2	3,725
日機装	44.1	34.1	35,702
日本エム・ディ・エム	8.6	8	8,016
島津製作所	189.3	166.2	664,800
ＪＭＳ	12.3	12.8	6,412
クボテック	3.3	3.2	736
長野計器	10.8	9.9	11,325
ブイ・テクノロジー	6.4	6.6	18,321
東京計器	9.4	10.4	13,280
愛知時計電機	3.7	5.4	7,554
インターアクション	7.5	6.4	9,420
オーバル	13.3	10.7	4,889
東京精密	24.8	29.9	137,988
マニー	58.6	60.1	115,091
ニコン	224.5	212.3	266,861
トプコン	69.1	71.8	117,823
オリンパス	771.1	853.3	2,132,396
理研計器	12	8.5	39,950
タムロン	11.5	10.2	32,946
ＨＯＹＡ	287	291.5	4,145,130
シード	6.9	6.2	3,236
ノーリツ鋼機	13.2	12.9	30,405
A&Dホロンホールディングス	13.4	19.9	21,870
朝日インテック	161.2	152.5	352,275
シチズン時計	172.1	149.9	91,139
リズム	4.6	3.8	6,224
大研医器	12	9.3	4,287
メニコン	48.8	46.9	134,040
シンシア	1.8	1.2	592
松風	6.4	6.2	13,590
セイコーグループ	20.7	21.2	62,328
ニプロ	109.6	113.8	117,100
その他製品（2.3%）			
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	－	17.6	2,164
中本パックス	4.2	3.8	6,099
スノーピーク	19.3	23.3	49,675
パラマウントベッドホールディングス	28.2	31.6	73,122
トランザクション	8.1	10.5	16,233
粧美堂	5	3.5	1,323
ニホンフラッシュ	12.6	12.9	11,958
前田工繊	16.3	11.6	39,382
永大産業	20.5	13	2,899
アートネイチャー	12.7	14.1	10,363
バンダイナムコホールディングス	131.8	124.7	1,075,038
アイフィスジャパン	4.3	3.5	2,128
共立印刷	25.1	－	－
ＳＨＯＥＩ	13.9	14.4	72,576
フランスベッドホールディングス	19.3	16.8	16,262
パイロットコーポレーション	24.9	21.4	96,300
萩原工業	9.6	9.1	10,683
フジシールインターナショナル	35.7	27.7	45,788
タカラトミー	61.5	62.9	79,442
広済堂ホールディングス	9	8.2	16,924
エステールホールディングス	4	2.9	1,824
タカノ	5.4	4.6	3,086
プロネクサス	11.5	11.4	11,058
ホクシン	11	9.4	1,353
ウッドワン	4.6	4	3,628
大建工業	8.7	8.3	18,002
凸版印刷	223.5	178.5	368,245
大日本印刷	173.8	162	498,150
共同印刷	4.6	3.8	10,784
ＮＩＳＳＨＡ	30.2	26	50,258
光村印刷	0.7	0.6	748
TAKARA & COMPANY	7.4	8.8	18,981
アシックス	129.9	126	389,340
ツツミ	3.8	2.4	4,550
ローランド	10.3	10	37,700
小松ウオール工業	4.3	5.1	9,735
ヤマハ	85.5	86.1	438,249
河合楽器製作所	4.1	3.7	9,568
クリナップ	14	15.4	9,532
ピジョン	89	86.9	179,448
兼松サステック	0.6	0.6	1,347
キングジム	12.3	12.2	10,723
リンテック	31.6	27.4	60,499
イトーキ	26.8	27.9	18,888
任天堂	83	861.9	4,847,325
三菱鉛筆	24.2	19.4	27,295
タカラスタンダード	30.5	26.4	35,904
コクヨ	70.5	65.7	117,603
ナカバヤシ	14	15	7,275
グローブライド	13.2	11	29,095
オカムラ	50.6	41.1	53,388
美津濃	14.7	13.5	39,271
電気・ガス業（1.2%）			
東京電力ホールディングス	1,100.2	1,230.6	564,845
中部電力	449.8	503.1	696,793
関西電力	557	527.1	640,953
中国電力	229.8	217.4	149,136
北陸電力	134.6	128.7	68,211
東北電力	343.8	333.7	222,244
四国電力	132.5	116.5	84,695
九州電力	303	315	230,580
北海道電力	127.8	131.7	62,689
沖縄電力	31.4	31.9	33,590
電源開発	125.2	102.8	219,683
エフオン	8.9	8.9	4,458
イーレックス	21.7	24.3	57,105
レノバ	28.7	36.3	78,662
東京瓦斯	281.8	288.6	791,629
大阪瓦斯	266.1	276.6	593,860
東邦瓦斯	67.5	53.8	133,424
北海道瓦斯	7.6	8.2	14,776
広島ガス	29.1	28.8	9,763
西部ガスホールディングス	16.6	12.8	22,617
静岡ガス	38.4	31.2	34,788
メタウォーター	15.3	17	28,271
陸運業（2.9%）			
ＳＢＳホールディングス	11	12.2	35,794
東武鉄道	143.6	150	455,250
相鉄ホールディングス	47	45.1	101,790
東急	370.8	382.7	617,677
京浜急行電鉄	188.7	154.8	201,704
小田急電鉄	218.7	206.9	344,902
京王電鉄	76.3	72.2	346,560
京成電鉄	102.5	88	329,120
富士急行	17.6	16.8	74,340
新京成電鉄	3.4	－	－
東日本旅客鉄道	258.8	231.6	1,591,786
西日本旅客鉄道	178.4	174.3	918,386
東海旅客鉄道	122.1	105.2	1,614,294
西武ホールディングス	191.8	165.1	240,220
鴻池運輸	23.5	23.3	35,602
西日本鉄道	40.7	36.4	85,576
ハマキョウレックス	10.6	10.7	34,614
サカイ引越センター	6.9	6.5	28,015
近鉄グループホールディングス	139.3	136.3	571,097
阪急阪神ホールディングス	174.1	181.7	700,453
南海電気鉄道	62.3	65.1	179,871
京阪ホールディングス	62.1	56.3	190,857
神戸電鉄	3.3	3.7	11,692
名古屋鉄道	114.5	150.6	311,591
山陽電気鉄道	11	10.3	22,309
アルプス物流	9.9	10.9	14,300
ヤマトホールディングス	195.2	174.5	425,780
山九	36.6	34.7	173,500
丸運	8.3	6.5	1,436
丸全昭和運輸	11.5	8.5	26,265
センコーグループホールディングス	69.9	72.2	71,694
トナミホールディングス	3.4	2.5	9,312
ニッコンホールディングス	46.8	43.7	108,157
日本石油輸送	1.1	0.8	1,858
福山通運	23	10.4	35,048
セイノーホールディングス	94.9	84.9	111,643
エスライン	3.2	3.7	3,019
神奈川中央交通	3.4	3.9	12,870
日立物流	26.9	－	－
AZ-COM丸和ホールディングス	29.5	32.9	55,666
C&Fロジホールディングス	14.3	13.2	15,866
九州旅客鉄道	107.8	96.3	274,551
ＳＧホールディングス	263.3	261.6	552,760
NIPPON EXPRESSホールディングス	48.2	50.9	382,259
海運業（0.6%）			
日本郵船	116.4	364.6	1,164,532
商船三井	77.1	240.2	792,660
川崎汽船	42.9	116.1	362,232
ＮＳユナイテッド海運	7.7	7.3	28,433
明治海運	16.5	11.8	7,752
飯野海運	64.5	50	46,100
共栄タンカー	2.5	2.2	2,098
乾汽船	9.4	17.3	34,427
空運業（0.5%）			
日本航空	319.2	334.8	875,167
ＡＮＡホールディングス	353.8	370.8	1,051,218
パスコ	2.8	2.5	3,650
倉庫・運輸関連業（0.1%）			
トランコム	4	3.9	27,807
日新	11.3	10.3	22,536
三菱倉庫	44.1	29.3	91,269
三井倉庫ホールディングス	14.9	12.7	47,625
住友倉庫	49.2	37.5	75,262
澁澤倉庫	8.5	5.5	11,533
東陽倉庫	22.8	16.4	4,542
日本トランスシティ	30.8	27.6	14,931
ケイヒン	2.8	2.2	3,341
中央倉庫	8.8	6.7	6,512
川西倉庫	2.9	2.1	2,114
安田倉庫	12	9.5	8,873
ファイズホールディングス	2.9	2.3	2,661
東洋埠頭	3.2	3.5	4,669
上組	76.7	65.3	172,914
サンリツ	4	2.8	2,086
キムラユニティー	4	5.9	5,882

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	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
キユーソー流通システム	7.3	7.3	6,978	インターネットイニシアティブ	38.5	76.4	180,151	東邦システムサイエンス	4.1	3.5	3,591
近鉄エクスプレス	26.3	−	−	さくらインターネット	15.4	15.3	9,210	ソースネクスト	61.7	69.6	19,696
東海運	8.6	7.5	2,122	ヴィンクス	4.2	3.6	5,256	インフォコム	15.9	17.6	39,952
エーアイテイー	8.8	8.6	13,467	GMOグローバルサイン・ホールディングス	3.3	4.2	18,564	シンプレクス・ホールディングス	16.8	23	55,315
内外トランスライン	5.4	5	11,040	ＳＲＡホールディングス	7.2	7	21,490	ＨＥＲＯＺ	4	4.5	5,085
日本コンセプト	4.6	4.2	6,392	システムインテグレータ	4.8	3.7	1,546	ラクスル	15.9	38.7	60,101
情報・通信業（8.9%）				朝日ネット	13.3	14.8	8,658	メルカリ	−	61.8	182,371
ＮＥＣネッツエスアイ	47.8	45.7	73,577	ｅＢＡＳＥ	17.2	19.3	12,738	ＩＰＳ	4	4.4	12,522
クロスキャット	3.9	7.8	10,514	アバントグループ	15.5	17.3	24,271	ＦＩＧ	16	14.1	5,287
システナ	205.8	230.2	83,102	アドソル日進	5.1	5.8	7,824	システムサポート	4.3	5.3	8,474
デジタルアーツ	7.9	8.7	48,285	ＯＤＫソリューションズ	3	2.7	1,571	イーソル	8.7	8.8	6,987
日鉄ソリューションズ	20.9	23.4	77,220	フリービット	8.6	7.1	8,094	アルテリア・ネットワークス	18.3	12.7	15,849
キューブシステム	7.5	8.3	8,939	コムチュア	16.2	18.1	41,811	東海ソフト	2.4	1.9	1,763
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2.2	−	−	サイバーコム	2.4	2	2,878	ウイングアーク１ｓｔ	8.2	14.1	27,650
コア	6.4	5.9	8,897	アステリア	10.4	10.7	8,003	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3.4	3.7	5,742
手間いらず	1.8	2.3	11,465	アイル	8	7.6	15,116	サーバーワークス	2.6	2.8	6,568
ラクーンホールディングス	10.3	11.4	13,178	マークラインズ	7.4	7.4	20,424	東名	1.5	0.9	2,031
ソリトンシステムズ	7.3	7	7,966	メディカル・データ・ビジョン	18.3	20.4	19,808	ヴィッツ	1.2	1.2	1,129
ソフトクリエイトホールディングス	6.4	5.7	20,064	ｇｕｍｉ	20	21.1	17,850	トビラシステムズ	2.9	3.1	2,551
ＴＩＳ	137.6	153.9	533,263	ショーケース	3.4	3	927	Ｓａｎｓａｎ	51.3	44.7	77,375
ＪＮＳホールディングス	6.7	5.6	1,797	モバイルファクトリー	3.3	2.6	2,488	Ｌｉｎｋ−Ｕ	2.7	2.3	2,120
グリー	65.7	36.7	25,910	テラスカイ	5.2	5.9	11,794	ギフティ	12.6	14.9	35,313
ＧＭＯペパボ	1.5	2	3,768	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6.4	7.9	14,844	メドレー	−	13.7	60,896
コーエーテクモホールディングス	46.1	85.8	199,399	ＰＣＩホールディングス	6.6	5.1	5,349	ベース	2.6	4.6	21,942
三菱総合研究所	6.3	6.7	32,528	パイプドＨＤ	2.8	−	−	ＪＭＤＣ	13.5	22.5	97,762
ボルテージ	4	3.6	1,137	アイビーシー	2.6	1.9	725	フォーカスシステムズ	9.6	10	10,880
電算	1.1	0.8	1,280	ネオジャパン	4	4.5	4,392	クレスコ	10.7	10.5	19,026
ＡＧＳ	7.2	5.3	3,598	ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3.2	3.4	6,358	フジ・メディア・ホールディングス	139	131.4	138,101
ファインデックス	12.1	10.7	5,703	ラクス	49.6	64.7	120,471	オービック	45.6	45.7	942,334
ブレインパッド	11.3	10.2	7,354	ランドコンピュータ	2.5	3	2,820	ジャストシステム	20.5	19.7	63,138
ＫＬａｂ	26.3	27.2	11,070	ダブルスタンダード	4.5	5.6	12,482	ＴＤＣソフト	12.6	11.6	18,107
ポールトゥウィンホールディングス	20.9	23.4	20,404	オープンドア	8.6	9.6	16,608	Ｚホールディングス	2,096.9	1,948.4	803,520
ネクソン	325.4	354	1,092,090	マイネット	5.1	4	1,504	トレンドマイクロ	77.1	79	497,700
アイスタイル	43.7	39.8	19,701	アカツキ	6.4	6.5	15,268	ＩＤホールディングス	9.4	9.3	9,272
エムアップホールディングス	16.4	16.7	19,923	ベネフィットジャパン	1.1	0.8	969	日本オラクル	23.4	26.2	236,324
エイチーム	9.9	9.9	7,781	Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3.9	4.2	8,379	アルファシステムズ	3.3	4.3	17,630
エニグモ	15.5	17.4	10,631	カナミックネットワーク	15.4	19.7	11,426	フューチャー	30.5	34.1	55,855
テクノスジャパン	11.2	10	5,990	ノムラシステムコーポレーション	7.6	11.7	1,345	ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8.6	8.6	11,945
ｅｎｉｓｈ	8.8	9.2	3,330	チェンジ	26.5	33.5	77,351	ＳＢテクノロジー	6.4	5.8	11,698
コロプラ	47.3	53.2	33,675	シンクロ・フード	7.5	7.6	3,663	トーセ	4.5	3.2	2,390
オルトプラス	11.2	9.2	1,784	オークネット	7.7	6.7	12,709	オービックビジネスコンサルタント	13.9	26.9	133,020
ブロードリーフ	71.5	79.9	36,514	キャピタル・アセット・プランニング	2.9	2.4	1,459	伊藤忠テクノソリューションズ	65.7	73.5	227,482
クロス・マーケティンググループ	5.4	7.3	5,599	セグエグループ	3.8	3.3	2,795	アイティフォー	17.4	18.2	15,706
デジタルハーツホールディングス	6.7	8.6	15,677	エイトレッド	2.2	1.9	2,781	東計電算	1.7	2	11,500
システム情報	10.9	12.1	10,224	マクロミル	29.5	26.8	29,694	エックスネット	2.5	1.8	1,814
メディアドゥ	5.1	5.5	8,998	ビーグリー	3.4	2.1	2,490	大塚商会	78	77.6	353,856
じげん	40.6	39.9	15,281	オロ	4.6	4.1	8,183	サイボウズ	19.4	18.9	50,292
ブイキューブ	14.7	16.4	11,726	ユーザーローカル	4.5	5	6,965	電通国際情報サービス	20.8	16.6	69,139
エンカレッジ・テクノロジ	3.4	2.9	1,441	テモナ	3.3	2.3	646	ＡＣＣＥＳＳ	16.4	16.2	16,054
サイバーリンクス	4.8	3.9	3,744	ニーズウェル	3.4	3.7	3,248	デジタルガレージ	23.8	24.3	114,088
ディー・エル・イー	9.6	8.8	2,279	マネーフォワード	22	32.9	173,383	イーエムシステムズ	24	22.8	21,249
フィックスターズ	15.4	15.5	21,173	サインポスト	4.6	4.7	2,758	ウェザーニューズ	4.5	4.2	29,316
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5.7	6.4	10,585	ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	−	7.2	10,519	ＣＩＪ	9.8	11.4	11,810
オプティム	10	11.2	12,812	電算システムホールディングス	6	6.6	14,242	ビジネスエンジニアリング	1.7	2.6	6,432
セレス	5.3	5.5	5,857	ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	−	38.9	73,287	日本エンタープライズ	14.9	12.4	1,661
ＳＨＩＦＴ	7.3	10	238,400	ソルクシーズ	12.2	10.2	3,723	ＷＯＷＯＷ	7	7.6	9,568
ティーガイア	12.7	14.3	23,251	フェイス	4	3.4	1,700	スカラ	12.7	12.7	9,144
セック	2.3	1.7	5,635	プロトコーポレーション	15.4	17.1	21,340	インテリジェント　ウェイブ	8.7	6.5	4,725
テクマトリックス	24.3	25	40,800	ハイマックス	4	4.3	6,170	ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ　ＧＲＯＵＰ	−	2.2	3,293
プロシップ	4.9	6	8,610	野村総合研究所	278.9	280.9	841,857	ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	12.2	11.2	7,358
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	37.5	41.9	90,587	サイバネットシステム	10.3	11.5	11,408	ネットワンシステムズ	55	51	164,475
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	28	31.3	374,348	ＣＥホールディングス	7.6	6.2	3,155	システムソフト	30.8	46.4	4,176
ザッパラス	5.6	3.4	1,166	日本システム技術	2.9	5.1	8,680	アルゴグラフィックス	11.4	12.6	49,203
システムリサーチ	4	4.2	9,819	インテージホールディングス	16.6	15.5	24,288	マーベラス	22.8	22.3	15,610

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	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
エイベックス	24.9	23.2	41,156	東京エレクトロン デバイス	4.2	5.4	41,418	丸文	12.7	12.9	16,202
ＢＩＰＲＯＧＹ	45.1	50.4	155,232	円谷フィールズホールディングス	12.6	12.4	30,938	ハピネット	12.1	12.3	25,202
兼松エレクトロニクス	8	8.5	52,615	双日	159.9	153.3	393,214	橋本総業ホールディングス	3	5.8	6,165
都築電気	7.5	7.2	9,612	アルフレッサ ホールディングス	160.8	144.9	231,115	日本ライフライン	42.9	42.3	37,900
ＴＢＳホールディングス	87.7	70.2	104,668	横浜冷凍	41.4	39.4	41,921	タカショー	11	12.5	8,437
日本テレビホールディングス	120.4	121.3	124,453	神栄	2	1.8	1,519	ＩＤＯＭ	43.9	43.7	36,620
朝日放送グループホールディングス	14.9	13	8,333	ラサ商事	8.2	5.8	7,215	進和	8.7	9.6	20,121
テレビ朝日ホールディングス	34.7	33.3	43,523	アルコニックス	15.4	19	26,125	エスケイジャパン	3.3	3.2	1,792
スカパーＪＳＡＴホールディングス	122	121.3	57,738	神戸物産	112.5	111.8	418,691	ダイトロン	6.3	5.7	14,324
テレビ東京ホールディングス	10.6	9.8	18,708	ハイパー	2.3	2.5	1,140	シークス	20.6	20.5	29,417
日本ＢＳ放送	5.3	4.4	3,977	あい ホールディングス	20.6	23.1	49,919	田中商事	3.3	3.9	2,269
ビジョン	24.6	18.1	25,846	ディーブイエックス	4.8	3.5	3,545	オーハシテクニカ	8.2	7.2	10,699
スマートバリュー	3.6	3	1,233	ダイワボウホールディングス	70.4	59	115,817	白銅	4.7	5.3	13,583
USEN-NEXT HOLDINGS	13.8	12.3	28,228	マクニカホールディングス	34.5	35.4	121,953	ダイコー通産	1.7	1.4	1,496
ワイヤレスゲート	5.5	5.5	1,380	ラクト・ジャパン	5	5.7	11,793	伊藤忠商事	1,012.8	890.1	3,610,245
コネクシオ	10.4	8.9	16,990	グリムス	6.6	6	15,276	丸紅	1,428.3	1,140.3	1,981,841
日本通信	119.8	126.2	27,637	バイタルケーエスケー・ホールディングス	25.2	21.1	17,576	高島	2.3	2.1	6,117
クロップス	2.9	2.1	2,297	八洲電機	11	11.8	12,779	長瀬産業	79.6	67.9	138,923
日本電信電話	1,509.2	1,754.4	6,766,720	メディアスホールディングス	8.5	9.2	6,559	蝶理	8.2	7.8	19,016
ＫＤＤＩ	1,051.8	1,058	4,198,144	レスターホールディングス	13.8	13.8	30,898	豊田通商	145.3	126.5	712,195
ソフトバンク	2,185.1	2,199.3	3,366,028	ジューテックホールディングス	3.6	2.7	3,272	三共生興	19.6	20.7	10,577
光通信	16.6	16.1	301,392	大光	6.8	5.2	3,421	兼松	53.9	56	88,592
エムティーアイ	14.2	12.5	6,337	ＯＣＨＩホールディングス	3.6	2.9	3,726	ツカモトコーポレーション	1.8	1.9	2,637
GMOインターネットグループ	51.1	50.9	132,340	ＴＯＫＡＩホールディングス	70.4	71.3	61,104	三井物産	1,124.4	1,056.8	4,134,201
ファイバーゲート	4.7	7.3	6,810	黒谷	4	3.7	2,205	日本紙パルプ商事	7.7	7.6	39,520
アイドマーケティングコミュニケーション	3.5	3.1	871	Ｃｏｍｉｎｉｘ	1.8	2.4	1,824	カメイ	17.1	15.4	22,638
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	78.7	72.3	181,545	三洋貿易	14.7	14.9	17,060	東都水産	0.6	0.6	3,150
学研ホールディングス	20.2	22.8	21,591	ビューティガレージ	2.5	2.3	8,257	ＯＵＧホールディングス	2.3	2	4,826
ゼンリン	23.4	23.3	20,154	ウイン・パートナーズ	10.9	10.5	10,510	スターゼン	10.9	11	23,111
昭文社ホールディングス	4.6	5.6	1,635	ミタチ産業	4	3.3	3,953	山善	60.9	38.9	40,883
インプレスホールディングス	11.7	10.8	2,203	シップヘルスケアホールディングス	46.5	51.9	127,777	椿本興業	2.3	2.1	8,652
アイネット	7.6	8.4	10,810	明治電機工業	4.7	5.5	6,226	住友商事	913.9	894.6	2,079,497
松竹	9.5	7.8	86,112	デリカフーズホールディングス	6	5.2	2,667	内田洋行	6.3	6.4	30,176
東宝	85.2	85.7	406,218	スターティアホールディングス	3.4	2.5	2,460	三菱商事	1,085.1	903.1	4,145,229
東映	4.7	3.8	64,562	コメダホールディングス	31.6	35.3	83,413	第一実業	6.7	5.1	24,709
エヌ・ティ・ティ・データ	384.2	429.6	853,185	ピーバンドットコム	2.4	1.7	895	キヤノンマーケティングジャパン	35.9	33.4	101,870
ピー・シー・エー	8.6	7.8	9,640	アセンテック	4.9	4.7	2,641	西華産業	7.9	5.7	9,034
ビジネスブレイン太田昭和	5.1	5.9	11,977	富士興産	3.8	2.9	3,436	佐藤商事	12.1	10.1	13,685
ＤＴＳ	27.7	29.1	90,792	協栄産業	1.7	1.1	1,900	菱洋エレクトロ	8.6	12.3	28,363
スウェア・エニックス・ホールディングス	67.1	68.8	422,432	フルサト・マルカホールディングス	14	14.3	47,118	東京産業	13.2	13.3	10,294
シーイーシー	15.4	19.2	30,163	ヤマエグループホールディングス	9.8	8.2	11,791	ユアサ商事	13.8	13	45,955
カプコン	136.1	136	569,160	小野建	14.3	13.4	20,167	神鋼商事	3.4	3.6	20,160
アイ・エス・ビー	6.8	7	8,379	南陽	2.3	2.5	5,010	トルク	6	6.6	1,379
ジャステック	8.6	8.4	10,315	佐鳥電機	9.1	8	11,360	阪和興業	28.9	25.9	107,226
ＳＣＳＫ	100	111.7	219,267	エコートレーディング	2.9	2.5	2,010	正栄食品工業	9.4	9.6	39,936
ＮＳＷ	5.4	5.4	11,296	伯東	8.7	8.3	38,470	カナデン	12	11.7	12,905
アイネス	13.2	9.5	12,521	コンドーテック	11.6	11.1	11,155	菱電商事	11.6	11.6	20,648
ＴＫＣ	24.4	24.6	89,175	中山福	7.6	6.6	2,204	岩谷産業	34.8	32.9	178,976
富士ソフト	15.4	15.5	114,545	ナガイレーベン	19.3	18.2	35,271	ナイス	5.1	3.5	4,669
ＮＳＤ	46.5	48.8	112,972	三菱食品	14.2	13.4	43,885	ニチモウ	2.4	1.4	4,305
コナミグループ	52.4	58.6	359,218	松田産業	10.7	10.9	25,331	極東貿易	4.1	8.7	12,145
福井コンピュータホールディングス	6.7	9.5	28,642	第一興商	27.5	27.9	109,507	アステナホールディングス	20.3	25	10,525
ＪＢＣＣホールディングス	9.8	9.9	19,899	メディパルホールディングス	156.2	149.7	257,633	三愛オブリ	35.6	39.8	53,968
ミロク情報サービス	12.7	12.5	22,950	ＳＰＫ	6	6.4	9,702	稲畑産業	31.8	29.2	71,773
ソフトバンクグループ	865	791.6	4,961,748	萩原電気ホールディングス	5.4	5.5	13,975	ＧＳＩクレオス	6.9	8.5	13,472
卸売業（6.0%）				アズワン	21.1	21.2	128,260	明和産業	13.3	19.2	13,555
ホウスイ	0.6	－	－	スズデン	5.3	5.1	12,525	クワザワホールディングス	4.6	4.4	1,944
高千穂交易	5.9	4.5	10,696	尾家産業	3.2	3.1	2,920	ワキタ	31	26.5	30,713
オルバヘルスケアホールディングス	1.7	2	3,256	シモジマ	9	9.9	9,969	東邦ホールディングス	46.5	35.9	73,846
伊藤忠食品	3	2.7	13,351	ドウシシャ	13.8	15.3	27,524	サンゲツ	38.4	36.3	81,239
エレマテック	11.7	13	22,919	小津産業	2.5	2.9	4,584	ミツウロコグループホールディングス	21.3	18.6	21,483
ＪＡＬＵＸ	4.1	－	－	高速	8.8	7.5	14,392	シナネンホールディングス	5.4	4.6	16,353
あらた	11.6	11	45,540	たけびし	5.6	5.6	8,954	伊藤忠エネクス	32.1	35.8	38,306
トーメンデバイス	2.4	2.1	13,461	リックス	2.5	2.7	6,164	サンリオ	44.9	41	202,335

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	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
サンワ　テクノス	8.8	7.4	14,585	ハニーズホールディングス	11.5	11.4	17,202	メディカルシステムネットワーク	14.2	12.6	5,103
リョーサン	16	15.4	45,522	ファーマライズホールディングス	4	2.9	1,792	一家ホールディングス	2.7	2.8	1,778
新光商事	22	19.4	24,987	アルペン	11.2	11.9	22,467	ジャパンクラフトホールディングス	3.5	4	2,320
トーホー	6.8	6.2	10,812	ハブ	4.8	4.1	2,824	はるやまホールディングス	6.9	5.3	2,316
三信電気	6.8	5.8	14,215	クオールホールディングス	17.8	19.9	23,382	ノジマ	23.4	47.2	61,548
東陽テクニカ	14.3	15.9	21,528	ジンズホールディングス	9.9	8.6	32,637	カッパ・クリエイト	20.4	22.8	32,718
モスフードサービス	19.1	21.3	65,391	ビックカメラ	85.7	96	114,720	ライトオン	11.2	9.7	5,422
加賀電子	13.1	11.8	52,510	DCMホールディングス	89.3	88.1	103,165	良品計画	166.7	186.3	257,466
ソーダニッカ	15.1	9.4	6,993	ペッパーフードサービス	19.7	30.2	5,043	パリミキホールディングス	15.7	16.5	4,570
立花エレテック	11.7	10.5	19,183	ＭｏｎｏｔａＲＯ	183.1	204.7	416,973	アドヴァングループ	14.9	13.8	12,489
フォーバル	6.6	5.5	5,764	東京一番フーズ	4	3.1	1,503	アルピス	4.8	4.7	11,355
ＰＡＬＴＡＣ	20.3	22.7	108,279	DDホールディングス	7.7	8.3	6,424	コナカ	16.9	14	4,802
三谷産業	17.1	25.3	7,969	きちりホールディングス	4.1	3.1	1,773	ハウス　オブ　ローゼ	1.2	1.7	2,777
太平洋興発	5.6	4.4	3,946	アークランドサービスホールディングス	10.8	11.8	25,322	G－7ホールディングス	16.2	18	26,892
西本Wismettacホールディングス	3.4	3.6	12,672	J．フロント　リテイリング	172.8	179.5	216,477	イオン北海道	25.7	21.4	19,003
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.2	1	1,746	ドトール・日レスホールディングス	25	25.6	46,822	コジマ	24.8	28	15,764
コーア商事ホールディングス	10.9	8.2	5,518	マツキヨココカラ&カンパニー	89.1	87.6	553,632	ヒマラヤ	5.1	4.1	3,808
KPPグループホールディングス	30	33.6	29,534	ブロンコビリー	8.3	7.6	18,468	コーナン商事	20.6	19.5	64,350
ヤマタネ	6.9	6.4	10,681	ZOZO	99.8	95.5	312,285	エコス	5.4	5.4	10,103
丸紅建材リース	1.1	0.8	1,500	トレジャー・ファクトリー	4.3	3.9	8,392	ワタミ	17.6	17.4	16,912
日鉄物産	10.4	9.9	91,377	物語コーポレーション	7.2	8	51,600	マルシェ	4	4	1,576
泉州電業	4.1	7.2	25,236	三越伊勢丹ホールディングス	253.3	243.1	335,964	パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	289.5	291.5	692,895
トラスコ中山	30.2	30.3	61,781	Ｈａｍｅｅ	3.8	5	4,025	西松屋チェーン	31.7	32	49,056
オートバックスセブン	48.8	50.2	71,284	マーケットエンタープライズ	1.1	1.3	1,341	ゼンショーホールディングス	70.8	79	258,330
モリト	10.9	10.4	9,869	ウエルシアホールディングス	76.6	74.9	218,932	幸楽苑ホールディングス	9.2	9.5	10,260
加藤産業	21	17.5	62,475	クリエイトSDホールディングス	21.3	23.8	82,467	ハークスレイ	6.3	4.5	3,627
北恵	4	2.9	1,989	丸善CHIホールディングス	18.9	15.4	5,313	サイゼリヤ	21.5	24	76,560
イエローハット	25.1	25.5	44,191	ミサワ	3	2.4	1,488	ＶＴホールディングス	54.6	54.8	27,783
ＪＫホールディングス	11.7	11.4	12,118	ティーライフ	2	1.7	2,147	魚力	3.9	4.5	9,697
日伝	12.1	8.6	15,953	エー・ピーホールディングス	2.2	1.9	875	ポプラ	4.6	3.2	444
北沢産業	7.6	7.1	1,661	チムニー	4.6	4	4,516	フジ・コーポレーション	7.9	8.2	10,856
杉本商事	6.6	6.2	12,065	シュッピン	12	10.7	11,491	ユナイテッドアローズ	15.1	15.4	26,611
因幡電機産業	38.7	37.4	103,261	オイシックス・ラ・大地	20.8	19.4	41,962	ハイデイ日高	20.9	21.4	43,805
東テク	4.6	4.9	18,889	ネクステージ	29.3	32.9	99,851	YU-WA CREATION HOLDINGS	8.6	7.1	1,412
ミスミグループ本社	181.7	217.9	716,891	ジョイフル本田	42.4	42.8	77,682	コロワイド	59.5	66.6	122,477
アルテック	10.3	7.1	1,909	鳥貴族ホールディングス	5.3	5.4	11,118	ピーシーデポコーポレーション	16.9	15.7	4,474
タキヒヨー	4.1	3.1	2,954	ホットランド	11	11	15,554	壱番屋	10.3	11.5	54,222
蔵王産業	2.2	2.2	4,241	すかいらーくホールディングス	186.9	197.4	304,983	トップカルチャー	5.5	4.2	777
スズケン	56.6	44.9	152,660	ＳＦＰホールディングス	7.2	7.9	14,030	ＰＬＡＮＴ	3.6	3.2	2,124
ジェコス	10.8	9.4	7,990	綿半ホールディングス	11	11.4	16,062	スギホールディングス	28.9	29.1	162,960
グローセル	17.1	15.4	6,267	ヨシックスホールディングス	2.9	2.6	5,733	薬王堂ホールディングス	7.3	8	19,688
小売業（4.5%）				コナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	42.3	47.2	53,147	ヴィア・ホールディングス	19.3	17.9	1,754
ローソン	32.1	35.8	182,938	ゴルフダイジェスト・オンライン	7.6	6.5	7,689	スクロール	22.3	21.5	16,662
サンエー	11	11	45,650	ＢＥＥＮＯＳ	7.5	8.2	17,416	ヨンドシーホールディングス	13.3	12.4	21,972
カワチ薬品	11.3	11.4	25,832	あさひ	12	12.1	16,431	木曽路	19.3	21.9	45,902
エービーシー・マート	22.7	21.1	145,801	日本調剤	8.8	9.9	11,454	ＳＲＳホールディングス	20	23.8	21,586
ハードオフコーポレーション	6.9	5.2	6,354	コスモス薬品	14.7	14.2	183,038	千趣会	26.4	27.1	10,731
アスクル	32.7	29.8	52,209	トーエル	6.8	5.8	4,390	タカキュー	12.9	9.2	717
ゲオホールディングス	19.4	15.2	27,694	セブン&アイ・ホールディングス	566.6	497.8	2,963,403	リテールパートナーズ	17.6	21.5	28,401
アダストリア	15.5	17.4	37,270	クリエイト・レストランツ・ホールディングス	77.1	108.7	106,634	ケーヨー	26.9	23.4	20,755
ジーフット	10	6.8	2,033	ツルハホールディングス	31.6	30.3	286,638	上新電機	16.6	12.9	24,819
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	2.3	1.7	691	サンマルクホールディングス	11.5	11.7	20,264	日本瓦斯	70.4	77.4	146,595
くら寿司	15.1	16.9	53,826	フェリシモ	3.4	2.9	2,894	ロイヤルホールディングス	24.9	28	70,028
キャンドゥ	5.3	5.2	11,949	トリドールホールディングス	35.9	35.9	99,945	東天紅	0.6	0.6	450
ＩＫホールディングス	4	4	1,500	ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	13.2	14.8	6,023	いなげや	18	14.1	17,963
パルグループホールディングス	12.6	14.1	40,297	ウイルプラスホールディングス	2.5	2.1	2,400	チヨダ	14	13.8	10,653
エディオン	66.3	57.2	73,101	ＪＭホールディングス	9.8	12.3	22,632	ライフコーポレーション	13.5	12.6	34,587
サーラコーポレーション	29.6	30.3	21,967	サツドラホールディングス	7.4	5.8	4,547	リンガーハット	17.9	18.6	41,905
ワッツ	7.2	6.3	4,353	アレンザホールディングス	11.2	10.8	11,286	ＭｒＭａｘＨＤ	18.2	20.4	13,770
ハローズ	6.7	6.6	21,021	串カツ田中ホールディングス	3.9	3.8	6,167	テンアライド	15.3	13.7	3,699
フジオフードグループ本社	12.3	12.1	16,976	バロックジャパンリミテッド	10.6	9.4	7,933	AOKIホールディングス	28	26.8	18,358
あみやき亭	3.4	3.5	10,248	クスリのアオキホールディングス	14.4	12.9	94,428	オークワ	22.8	23	20,631
ひらまつ	30.8	27.2	5,195	力の源ホールディングス	7.7	7.4	9,102	コメリ	22.4	22.3	57,980
大黒天物産	4.7	4.4	23,496	FOOD & LIFE COMPANIES	84.7	83	272,240	青山商事	29.7	30.9	28,211

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	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
しまむら	16.8	16.9	213,278	おきなわフィナンシャルグループ	13.1	12.8	30,208	北日本銀行	4.7	4.7	10,062
はせがわ	8	6.2	2,089	十六フィナンシャルグループ	19.5	17.4	52,287	東和銀行	25.9	24.9	14,940
高島屋	105.3	108.9	194,713	北國フィナンシャルホールディングス	13.4	11.4	45,144	福島銀行	16.8	12.8	3,276
松屋	29.1	24.5	27,807	プロクレアホールディングス	–	16.6	38,312	大東銀行	7.4	4.6	3,381
エイチ・ツー・オー リテイリング	68.5	70.3	88,437	あいちフィナンシャルグループ	–	18.8	42,600	トモニホールディングス	112.3	109	42,183
近鉄百貨店	5.5	4.6	11,477	ＳＢＩ新生銀行	94.6	39.7	95,081	フィデアホールディングス	13.2	13.8	20,272
丸井グループ	114.3	106.5	233,661	あおぞら銀行	81	84.4	221,465	池田泉州ホールディングス	165.8	170.8	42,187
アクシアル リテイリング	11.4	9.9	33,957	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,093.4	8,536.5	8,008,090	**証券、商品先物取引業（0.8%）**			
井筒屋	6.9	6.1	2,031	りそなホールディングス	1,659.4	1,716	1,221,620	ＦＰＧ	48.8	54.5	63,329
イオン	557.2	489.7	1,285,952	三井住友トラスト・ホールディングス	274.1	244.4	1,171,898	ジャパンインベストメントアドバイザー	11.3	10.9	11,782
イズミ	26.3	22	63,382	三井住友フィナンシャルグループ	1,003.6	982.5	5,535,405	マーキュリアホールディングス	5.1	7.1	5,396
平和堂	26.8	24	50,736	千葉銀行	483.8	374.7	358,213	ＳＢＩホールディングス	178.9	194.6	538,847
フジ	17.6	22.2	40,159	群馬銀行	277.9	260.6	127,433	日本アジア投資	11.5	9.6	2,150
ヤオコー	16.5	16.3	109,210	武蔵野銀行	21.6	17.1	39,586	ジャフコ グループ	55.7	44.9	96,310
ゼビオホールディングス	19.7	19.7	18,045	千葉興業銀行	34.5	28	14,252	大和証券グループ本社	1,086	961.3	591,199
ケーズホールディングス	133.4	114.9	134,892	筑波銀行	56.9	59.1	13,652	野村ホールディングス	2,214.1	2,476.6	1,339,097
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7.9	5.2	2,698	七十七銀行	45.5	43	96,234	岡三証券グループ	113.8	118.4	49,846
日産東京販売ホールディングス	22.8	16.4	5,084	青森銀行	11.3	–	–	丸三証券	42.9	44.7	18,952
シルバーライフ	3	3.3	5,613	秋田銀行	9.4	9	16,479	東洋証券	46.8	44.6	13,246
Ｇｅｎｋｙ ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6.4	6.3	26,743	山形銀行	16.3	15	17,265	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	165.7	146.2	54,825
ナルミヤ・インターナショナル	3.4	2.1	1,936	岩手銀行	9.4	9.2	21,077	光世証券	2.9	2.7	985
ブックオフグループホールディングス	8.8	8.4	10,600	東邦銀行	121.4	107.2	25,513	水戸証券	38.7	36.2	10,823
ギフトホールディングス	2.4	3.1	13,066	東北銀行	7.5	6	6,138	いちよし証券	27.3	24.6	15,178
アインホールディングス	19.4	19.9	107,062	みちのく銀行	9.5	–	–	松井証券	71.2	79.5	62,010
元気寿司	4.1	4.1	12,201	ふくおかフィナンシャルグループ	122	107.3	313,745	マネックスグループ	118	150.1	77,301
ヤマダホールディングス	528.8	592.4	276,650	静岡銀行	353.2	–	–	極東証券	19.5	16.8	10,096
アークランズ	22.8	21.2	30,528	スルガ銀行	127	118.5	49,888	岩井コスモホールディングス	13.7	15.3	20,517
ニトリホールディングス	57.6	58.4	992,800	八十二銀行	326	275.5	153,453	アイザワ証券グループ	24	19.4	13,851
グルメ杵屋	12	11.8	11,918	山梨中央銀行	16	13.7	17,371	マネーパートナーズグループ	15.4	12.5	3,250
愛眼	8.1	7.6	1,254	大垣共立銀行	28.8	25.7	49,241	スパークス・グループ	66.7	15	25,785
ケーユーホールディングス	7.9	8.5	12,265	福井銀行	12.5	12	20,148	小林洋行	3.2	2.8	630
吉野家ホールディングス	50.6	56.4	133,442	清水銀行	6.3	5.4	8,170	**保険業（2.4%）**			
松屋フーズホールディングス	7	6.8	26,928	富山銀行	2.2	1.9	3,357	かんぽ生命保険	145.9	163.3	373,793
サガミホールディングス	22.3	23.2	29,000	滋賀銀行	27.3	22.4	62,809	ＳＯＭＰＯホールディングス	238.1	230.7	1,280,615
関西フードマーケット	11	13	16,731	南都銀行	22.8	20.2	52,479	アニコム ホールディングス	44.4	45.7	27,008
王将フードサービス	9.5	9.5	56,905	百五銀行	140	126.6	51,273	ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	325.2	273.6	1,149,667
プレナス	16.4	–	–	京都銀行	51.9	42.6	259,860	第一生命ホールディングス	713.7	684.5	2,030,227
ミニストップ	11.2	10.4	14,612	紀陽銀行	49.2	48.1	77,248	東京海上ホールディングス	477.6	1,353.8	3,691,812
アークス	27.7	26.5	57,028	ほくほくフィナンシャルグループ	90.5	85.4	85,314	Ｔ＆Ｄホールディングス	376.3	360.9	726,130
パローホールディングス	32.1	27.6	50,728	山陰合同銀行	86.3	84	67,536	アドバンスクリエイト	7	7.8	9,110
ベルク	6.4	7.2	39,456	中国銀行	116	–	–	**その他金融業（1.1%）**			
大 庄	8	6.9	7,148	鳥取銀行	4.2	3.9	4,793	全国保証	34.7	35.2	172,480
ファーストリテイリング	19.4	21.7	1,791,552	伊予銀行	192.3	–	–	あんしん保証	4.9	6	1,602
サンドラッグ	54.5	54.8	197,554	百十四銀行	15.4	12.2	23,472	ジェイリース	4.9	4	10,880
サックスバー ホールディングス	13.8	13.7	10,165	四国銀行	22.3	21.2	19,885	イントラスト	6.3	4.5	4,243
ヤマザワ	2.9	2.3	3,155	阿波銀行	22.3	19.9	42,227	日本モーゲージサービス	8.2	6.7	5,916
やまや	3	2.8	7,173	大分銀行	8.6	8	16,824	ＣＡＳＡ	5.1	4.5	3,699
ベルーナ	31.1	33.8	23,153	宮崎銀行	9.1	8.8	23,284	アルヒ	21.3	16.5	17,605
銀行業（6.5%）				佐賀銀行	8.6	7.8	14,297	プレミアグループ	7.5	22.6	37,312
いよぎんホールディングス	–	160.1	112,710	琉球銀行	31.6	30.5	28,853	ネットプロテクションズホールディングス	33	44.4	26,551
しずおかフィナンシャルグループ	–	303.9	327,604	セブン銀行	430.4	481.4	126,126	クレディセゾン	92.9	85.1	147,137
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	–	113.2	105,049	みずほフィナンシャルグループ	1,854.4	1,944.5	4,039,698	芙蓉総合リース	15.3	12.4	109,740
島根銀行	4.5	4.2	2,100	高知銀行	4.3	4.1	2,964	みずほリース	22.6	20	68,700
じもとホールディングス	10.8	7.9	3,365	山口フィナンシャルグループ	168.7	148.5	130,086	東京センチュリー	28.1	25.1	114,707
めぶきフィナンシャルグループ	751.7	666.7	225,344	長野銀行	4.9	3.7	5,180	日本証券金融	57.1	54	56,106
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18.3	17.2	48,968	名古屋銀行	10.9	8.9	31,194	アイフル	243	222.6	86,814
九州フィナンシャルグループ	296.3	236.8	112,480	北洋銀行	218.8	204.1	56,535	リコーリース	12.8	12.7	48,768
ゆうちょ銀行	342.8	382.9	443,398	愛知銀行	5.3	–	–	イオンフィナンシャルサービス	78.8	77.1	100,384
富山第一銀行	35.7	33.4	20,340	中京銀行	5.3	–	–	アコム	286	240.2	77,344
コンコルディア・フィナンシャルグループ	828	740.9	419,349	大光銀行	3.6	3.5	4,312	ジャックス	16.1	14.3	59,416
西日本フィナンシャルホールディングス	94.6	85	90,015	愛媛銀行	20.5	18.1	16,851	オリエントコーポレーション	391.5	35.1	40,540
三十三フィナンシャルグループ	13.7	12.1	20,073	トマト銀行	5.7	4	4,300	オリックス	880.3	899.2	2,098,283
第四北越フィナンシャルグループ	23.6	21.2	64,872	京葉銀行	62.5	62.5	38,000	三菱ＨＣキャピタル	535.7	523.8	348,850
ひろぎんホールディングス	214.3	175.5	116,883	栃木銀行	70.5	61.6	19,342	九州リースサービス	7.9	5.6	4,524

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	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
日本取引所グループ	367.1	377.7	739,158	MIRARTHホールディングス	61	67.7	24,304	博報堂DYホールディングス	195.6	178.9	250,638
イー・ギャランティ	21.2	21.7	49,541	ＡＶＡＮＴＩＡ	7.7	5.9	4,708	ぐるなび	22.9	25.8	10,139
アサックス	8.5	5.5	3,366	イオンモール	72.7	69.7	125,111	タカミヤ	17.6	19.2	7,468
NECキャピタルソリューション	6.2	6.7	16,890	毎日コムネット	5.4	4.5	3,055	ジャパンベストレスキューシステム	9.4	8.7	7,221
不動産業（1.9%）				ファースト住建	5.6	5	5,275	ファンコミュニケーションズ	35.1	27.8	11,425
大東建託	47.2	49.2	615,492	ランド	787.3	810.9	7,298	ライク	3.8	5.3	10,700
いちご	161.7	154.8	44,582	カチタス	35.9	36.1	101,404	ビジネス・ブレークスルー	5.5	4.6	1,784
日本駐車場開発	158	160.1	41,305	トーセイ	20	22.3	31,710	エスプール	39.7	40.3	29,419
スター・マイカ・ホールディングス	8	12.2	8,161	穴吹興産	3.4	2.4	5,097	WDBホールディングス	6.6	7.1	15,186
ＳＲＥホールディングス	3.5	6.6	22,176	サンフロンティア不動産	20	22.4	24,505	ティア	8.7	7.4	3,122
ＡＤワークスグループ	30	30	4,380	ＦＪネクストホールディングス	14.6	14.1	13,930	ＣＤＧ	1.4	1.4	1,590
ヒューリック	346.1	313.4	332,517	インテリックス	3.5	3.1	1,798	アドウェイズ	20.9	19.3	9,939
三栄建築設計	5.9	6.5	9,626	ランドビジネス	6	4.4	1,020	バリューコマース	11.2	10.5	19,057
野村不動産ホールディングス	75	84	240,072	サンネクスタグループ	5	3.6	3,380	インフォマート	153.9	145.6	61,588
三重交通グループホールディングス	29.9	28.8	14,083	グランディハウス	10.3	10.1	5,807	ＪＰホールディングス	35.7	40.3	13,500
サムティ	23.4	21.4	43,270	日本空港ビルデング	55.3	47.6	309,400	エコナックホールディングス	26	22	2,024
ディア・ライフ	18.9	20.7	12,875	**サービス業（5.3%）**				ＣＬホールディングス	3	3.9	3,159
コーセーアールイー	4.6	3.7	2,730	明豊ファシリティワークス	6.6	6.3	4,958	プレステージ・インターナショナル	52.4	59	41,300
地主	9.2	10.2	18,645	日本工営	8.3	8.5	30,132	アミューズ	7.7	7.6	13,148
プレサンスコーポレーション	18.9	17.6	28,494	ＬＩＦＵＬＬ	43	48	10,608	ドリームインキュベータ	3.9	4.3	11,128
ＴＨＥグローバル社	9.1	7	1,526	ＭＩＸＩ	32.1	31.9	78,952	クイック	9.6	10.7	19,837
ハウスコム	1.2	2	2,192	ジェイエイシーリクルートメント	11.5	12.7	29,387	ＴＡＣ	8.6	6.8	1,373
ＪＰＭＣ	7	6.8	6,834	日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	230.5	240.8	323,153	電通グループ	144.8	137.9	564,700
サンセイランディック	4.6	3.7	3,045	メンバーズ	4.2	4.1	7,125	テイクアンドギヴ・ニーズ	6.7	4.2	5,590
エストラスト	1.4	1.5	870	中広	1.2	1	387	ぴあ	4.9	4.7	15,251
フージャースホールディングス	18.8	20.6	16,274	ＵＴグループ	20.3	20.6	50,923	イオンファンタジー	5.4	6.1	18,007
オープンハウスグループ	46.1	49.2	237,144	アイティメディア	6.7	5.4	8,202	シーティーエス	16	15.6	12,682
東急不動産ホールディングス	426.9	404.1	260,240	Ｅ・Ｊホールディングス	7.5	8.2	11,029	ネクシィーズグループ	5	3.8	2,519
飯田グループホールディングス	121	117.8	251,149	オープンアップグループ	45.7	42	78,372	Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	36.7	41.1	111,997
イーグランド	2.5	1.9	2,810	コシダカホールディングス	37.5	42	38,304	アルプス技研	12.6	12.2	25,729
ムゲンエステート	9.4	7.9	3,950	アルトナー	3.6	3.1	3,081	サニックス	24.4	22.7	5,198
ビーロット	9.9	8.3	4,490	パソナグループ	15.3	17	34,765	ダイオーズ	3.5	－	－
ファーストブラザーズ	3.5	2.3	1,996	ＣＤＳ	2.5	3.2	5,769	日本空調サービス	15	15.4	10,918
And Doホールディングス	7.2	8	6,760	リンクアンドモチベーション	31	40.3	25,832	オリエンタルランド	166.1	148.5	3,203,887
シーアールイー	4	6.1	6,453	エス・エム・エス	47.8	53.4	184,497	ダスキン	32.6	31.3	91,208
プロパティエージェント	1.7	1.5	1,875	サニーサイドアップグループ	5.1	3.8	2,116	明光ネットワークジャパン	16.5	18.4	11,371
ケイアイスター不動産	6.6	6.5	31,395	パーソルホールディングス	140.5	157.1	446,321	ファルコホールディングス	6.8	6.1	11,376
アグレ都市デザイン	2.5	2.2	3,561	リニカル	8.1	7.1	5,033	秀英予備校	3.6	3.1	1,354
グッドコムアセット	6.4	12.5	10,062	クックパッド	44.1	38.4	8,332	田谷	1.8	1.7	902
ジェイ・エス・ビー	3	3.3	13,200	エスクリ	6.2	5.2	1,721	ラウンドワン	39.2	117.3	56,538
ロードスターキャピタル	－	5.8	9,355	アイ・ケイ・ケイホールディングス	6.7	6.2	3,881	リゾートトラスト	64.4	55.4	128,417
テンポイノベーション	4.1	3.7	4,380	学情	5.6	6.4	8,857	ビー・エム・エル	18.2	17.4	54,375
グローバル・リンク・マネジメント	2.7	2.3	2,697	スタジオアリス	6.4	7	14,651	りらいあコミュニケーションズ	21.3	23.2	33,732
フェイスネットワーク	1.4	1.7	2,747	シミックホールディングス	8	7.7	13,282	リソー教育	64.3	63.8	22,138
パーク２４	77.8	104.7	225,733	エプコ	3.3	2.7	1,992	早稲田アカデミー	8	7.8	9,492
パラカ	4	4.7	9,150	ＮＪＳ	2.9	2.6	5,686	ユー・エス・エス	157.3	144.3	313,131
宮越ホールディングス	5.5	6.2	5,542	綜合警備保障	55.9	52.1	183,652	東京個別指導学院	12.3	16.7	9,034
三井不動産	660.9	584.3	1,425,399	カカクコム	103.1	104.7	224,162	サイバーエージェント	346.2	335.7	420,967
三菱地所	952.8	811.2	1,364,438	アイロムグループ	5	5.1	12,321	楽天グループ	721.4	649.5	437,763
平和不動産	24.9	21.8	76,845	セントケア・ホールディング	9.1	9.1	7,462	クリーク・アンド・リバー社	7.5	8.3	18,907
東京建物	143.1	128.1	203,038	サイネックス	2.5	2.2	1,216	モーニングスター	24.7	23	10,879
京阪神ビルディング	22.6	16.9	20,989	ルネサンス	9.8	9.8	9,045	テー・オー・ダブリュー	24.8	27.2	7,996
住友不動産	304.3	243	761,562	ディップ	24.7	24.6	98,154	山田コンサルティンググループ	7.5	7.1	8,228
テーオーシー	26.2	24.5	16,145	デジタルホールディングス	9.6	10.9	13,875	セントラルスポーツ	5.2	5.3	12,778
東京楽天地	2.3	2.4	10,296	新日本科学	17.1	14.9	37,756	フルキャストホールディングス	12	13.4	36,555
レオパレス２１	150.2	151.4	49,205	キャリアデザインセンター	3.6	2.6	4,882	エン・ジャパン	22.9	25.4	61,595
スターツコーポレーション	19.9	19.3	48,037	ベネフィット・ワン	51.2	65	148,915	リソルホールディングス	1.6	1.1	5,175
フジ住宅	17.2	18.8	12,784	エムスリー	247.9	277.3	997,725	テクノプロ・ホールディングス	84.1	83.1	303,730
空港施設	15	16.2	8,391	ツカダ・グローバルホールディング	8.5	7.8	3,042	アトラグループ	2.6	3	543
明和地所	7	6.1	5,319	プラス	2.2	1.7	1,932	インターワークス	4.5	3.2	1,139
ゴールドクレスト	11.5	12.8	20,672	アウトソーシング	80.5	83.6	82,346	アイ・アールジャパンホールディングス	6.6	7.3	14,395
エスリード	5.7	6.4	13,440	ウェルネット	14.3	9.5	6,422	ＫｅｅＰｅｒ技研	9	8.7	29,971
日神グループホールディングス	23.6	21.7	9,656	ワールドホールディングス	5.6	6.3	16,279	ファーストロジック	2.9	2	1,712
日本エスコン	27.3	30.3	24,936	ディー・エヌ・エー	53.6	59.9	108,059	三機サービス	3	2	1,840

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Ｇｕｎｏｓｙ	8.8	11.1	7,070
デザインワン・ジャパン	3.6	3.7	706
イー・ガーディアン	5.6	5.3	13,085
リブセンス	8.7	5.8	1,954
ジャパンマテリアル	43.2	42.9	101,415
ベクトル	19.7	22	27,346
ウチヤマホールディングス	7.4	5.6	1,495
チャーム・ケア・コーポレーション	10.6	11.7	13,197
キャリアリンク	5.1	5.2	13,639
ＩＢＪ	11.5	8.6	8,858
アサンテ	6.4	7	11,585
バリューＨＲ	5.6	12.3	20,688
M&Aキャピタルパートナーズ	11.6	13	50,570
ライドオンエクスプレスホールディングス	5.4	5.1	5,477
ＥＲＩホールディングス	4	3.2	4,457
アビスト	2.2	2	5,992
シグマクシス・ホールディングス	8.6	21.3	24,047
ウィルグループ	10.4	11.7	14,098
エスクロー・エージェント・ジャパン	18.9	13.5	2,038
メドピア	10.9	11	16,929
レアジョブ	2.8	2.4	2,220
リクルートホールディングス	1,083.7	1,039	4,509,260
エラン	19.4	18.6	18,451
土木管理総合試験所	6.9	5.3	1,611
ネットマーケティング	6.9	−	−
日本郵政	1,834.3	1,839.2	2,094,848
ベルシステム２４ホールディングス	20.1	18.8	28,294
鎌倉新書	16	15.9	17,108
ＳＭＮ	3.4	3.2	1,484
一蔵	2.3	1.5	693
グローバルキッズCOMPANY	2.7	1.9	1,520
エアトリ	9	9.1	23,423
アトラエ	9.8	11	14,190
ストライク	5.3	6.9	27,841
ソラスト	34.5	38.7	26,122
セラク	4.6	5	7,690
インソース	13.7	34.8	50,251
ベイカレント・コンサルティング	9.9	111	609,390
Orchestra Holdings	2.8	3	5,925
アイモバイル	4	7.3	9,373
キャリアインデックス	4.8	4.2	1,360
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	5.7	4.1	4,382
船場	1.7	1.5	1,051
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	44.5	50	90,600
フルテック	2.2	1.7	1,849
グリーンズ	5.3	4.2	5,006
ツナググループ・ホールディングス	3.4	3.5	1,834
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	4.3	3.7	1,232
ソウルドアウト	3.5	−	−
MS&Consulting	2.4	1.4	838
ウェルビー	9.1	10.3	6,550
エル・ティー・エス	1.8	1.9	5,441
ミダックホールディングス	6.2	8.6	25,404
日総工産	11	10.5	6,478
キュービーネットホールディングス	6.6	6.6	9,840
ＲＰＡホールディングス	19.7	19	6,213
スプリックス	4	4.3	3,792
マネジメントソリューションズ	6.9	7.7	27,373
プロレド・パートナーズ	3	3.3	1,709
ａｎｄ ｆａｃｔｏｒｙ	3.3	3.6	1,299
テノ．ホールディングス	2	1.5	1,408
フロンティア・マネジメント	3.6	4.7	6,913
ピアラ	2.3	2	1,112
コプロ・ホールディングス	2.9	2.1	2,520
ギークス	2.6	1.8	1,760
カーブスホールディングス	38.7	43.1	34,480
フォーラムエンジニアリング	9.9	8.3	7,403
FAST FITNESS JAPAN	2	4.7	5,654
ダイレクトマーケティングミックス	15.2	16.8	27,367
ポピンズ	3.4	2.1	4,321
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	11.5	10.9	29,299
アドバンテッジリスクマネジメント	7.2	5.7	2,650
リログループ	76.9	78.1	167,212
東祥	10.6	9.8	11,485
ビーウィズ	−	2.7	3,958
ＴＲＥホールディングス	19.4	29.5	41,860
人・夢・技術グループ	5.6	6.3	8,782
大栄環境	−	26.7	43,627
エイチ・アイ・エス	31.3	36.7	75,785
ラックランド	4.1	4.4	12,817
共立メンテナンス	25	24	136,320
イチネンホールディングス	14.6	15	19,185
建設技術研究所	8.5	7.2	23,724
スペース	10.4	10	9,340
燦ホールディングス	6.3	6	11,550
スバル興業	0.7	0.6	5,382
東京テアトル	5.4	4.6	5,170
タナベコンサルティンググループ	4.8	5	3,355
ナガワ	4.6	3.7	28,083
東京都競馬	10.7	11.8	45,607
常磐興産	5.4	4.3	5,293
カナモト	24.8	25.7	56,437
西尾レントオール	12.9	13	38,844
アゴーラ ホスピタリティー グループ	75.2	70.2	1,544
トランス・コスモス	17.9	17.4	57,594
乃村工藝社	60.2	61.2	56,059
藤田観光	6.2	6.2	20,925
KNT−CTホールディングス	8.7	8.4	14,338
日本管財	15.1	14.8	37,000
トーカイ	12.5	12.5	23,812
白洋舎	1.7	1.1	1,900
セコム	138.5	142.9	1,088,183
セントラル警備保障	6.8	7.5	19,110
丹青社	28.7	27	19,089
メイテック	17	55.9	136,507
応用地質	16	13.1	25,715
船井総研ホールディングス	28.8	29.5	79,709
進学会ホールディングス	5.1	4.2	1,251
オオバ	10.2	7.9	5,609
いであ	3.9	2.8	4,396
学究社	4.7	5.6	10,746
ベネッセホールディングス	46.8	52.3	100,939
イオンディライト	17.3	15.5	46,329
ナック	7.4	6.5	6,253
ダイセキ	26	28.7	122,118
ステップ	5.3	5.8	10,300
	千株	千株	千円
合計 株数・金額	161,644	159,799.8	389,230,950
合計 銘柄数<比率>	2,174銘柄	2,161銘柄	<98.0%>

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
国内	TOPIX	百万円 7,621	百万円 －

■投資信託財産の構成

2023年２月７日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	389,230,950	98.0
コール・ローン等、その他	8,041,935	2.0
投資信託財産総額	397,272,885	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨てております。％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

(2023年２月７日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**397,272,885,824円**
コール・ローン等	7,105,053,675
株式(評価額)	389,230,950,760
未収入金	279,324,650
未収配当金	620,986,739
差入委託証拠金	36,570,000
(B) 負債	**289,963,000**
未払解約金	289,963,000
(C) 純資産総額(A－B)	**396,982,922,824**
元本	117,622,712,134
次期繰越損益金	279,360,210,690
(D) 受益権総口数	**117,622,712,134口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**33,751円**

(注１) 期首元本額 124,570,625,521円
追加設定元本額 128,363,975,255円
一部解約元本額 135,311,888,642円

(注２) 期末における元本の内訳

MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,645,423,721円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	4,020,227,881円
One DC 国内株式インデックスファンド	24,845,344,460円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,943,887,105円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,060,345円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	14,320,221円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	40,143,190円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,541,745円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	24,853,218円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	28,002,416円
たわらノーロード TOPIX	1,674,620,773円
たわらノーロード バランス（８資産均等型）	1,460,942,246円
たわらノーロード バランス（堅実型）	52,176,853円
たわらノーロード バランス（標準型）	349,503,344円
たわらノーロード バランス（積極型）	550,702,894円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	2,858,868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）	171,426,417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）	431,690,813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）	329,347,990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）	441,937,258円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	413,659円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,761,301円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	32,921,123円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,228,726円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	12,768,526円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,601,320,487円
Oneグローバルバランス	9,945,679円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>１安定型	1,069,194,980円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>２安定・成長型	3,604,894,445円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>３成長型	3,977,108,233円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	337,230,087円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,073,452,202円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,128,091,784円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	31,667,873円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	1,158,418,676円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,484,653円
DIAM DC ８資産バランスファンド（新興国10）	305,935,932円
DIAM DC ８資産バランスファンド（新興国20）	356,000,978円
DIAM DC ８資産バランスファンド（新興国30）	576,024,312円
投資のソムリエ	6,962,375,127円
クルーズコントロール	371,076,985円
投資のソムリエ<DC年金>	512,324,687円
DIAM ８資産バランスファンドN<DC年金>	369,360,628円
４資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	886,808,363円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	690,449,672円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,925,993,896円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	57,858,403円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	29,095,833円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	4,863,218円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	100,473,455円
４資産分散投資・スタンダード<DC年金>	494,603,718円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	556,231,620円
９資産分散投資・スタンダード<DC年金>	276,065,472円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	42,963,704円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	31,180,825円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	19,176,919円
４資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	373,583,154円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	4,139,504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）	70,190,490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）	71,566,262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）	23,234,424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）	43,811,639円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03（適格機関投資家限定）	69,167,191円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII2021-04（適格機関投資家限定）	173,752,833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	194,219,300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）	62,459,767円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型）22-05	198,034,533円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資）22-10	500,445,383円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	188,318,998円
AMOneマルチアセット・インカム戦略（適格機関投資家限定）	27,824,141円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	29,351,203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）（適格機関投資家限定）	230,704,117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）	119,336,352円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,665,294円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	7,940,239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）	45,113,121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）	88,905,582円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,022,472円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	18,327,200円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	4,076,237円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	90,458円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	5,854,508円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	26,240,499円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	416,572,017円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	515,249,605円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,525,175,305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）	15,914,184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）	21,162,392円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	223,693,267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）	49,325,464円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	65,368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）	274,002,585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）	16,040,531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）	53,951,794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）	122,912,087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）	171,605,339円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	31,023,888円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	15,258,914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）	743,503,325円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)（適格機関投資家限定）	1,220,307,862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）	48,743,066円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,881,642円
コア資産形成ファンド	17,452,381円
MHAMトピックスファンド	770,553,770円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	50,331,323円
MHAM動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	3,300,674,671円
MHAM日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,491,222,882円
期末元本合計	117,622,712,134円

(注３) 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。

■損益の状況

当期　自2022年２月８日　至2023年２月７日

項目	当期
(A) 配当等収益	**10,038,422,831円**
受取配当金	10,036,451,031
受取利息	198,966
その他収益金	5,808,781
支払利息	△4,035,947
(B) 有価証券売買損益	**4,151,090,178**
売買益	35,089,806,650
売買損	△30,938,716,472
(C) 先物取引等取引損益	**827,282,850**
取引益	2,648,479,200
取引損	△1,821,196,350
(D) その他費用	**△4**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**15,016,795,855**
(F) 前期繰越損益金	**272,765,989,933**
(G) 解約差損益金	**△292,592,755,843**
(H) 追加信託差損益金	**284,170,180,745**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**279,360,210,690**
次期繰越損益金(I)	**279,360,210,690**

(注１) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注２) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
(注３) (H)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■信託金の限度額を１兆円から３兆円に変更しました。

(2022年３月15日)

■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20期（決算日　2023年２月14日）

（計算期間　2022年２月15日～2023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		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
		期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率				
	円	%	ポイント	%	%	%	%	百万円
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
20期（2023年２月14日）	12,411	△3.6	367.66	△3.6	99.7	－	－	554,514

（注１）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注２）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません（以下同じ）。

（注３）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

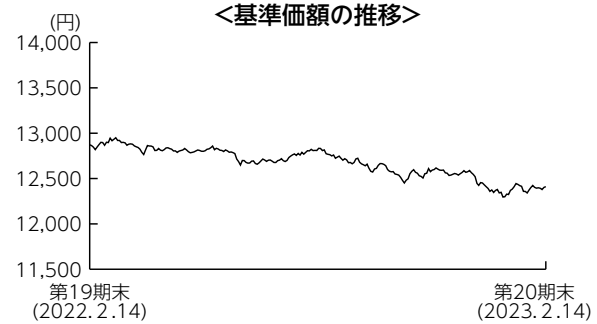
■当期中の基準価額と市況の推移

年　月　日	基準価額		NOMURA－BPI総合		債券組入比率	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)	円	%	ポイント	%	%	%	%
2022年2月14日	12,872	－	381.31	－	99.6	－	－
2　月　末	12,900	0.2	382.13	0.2	99.8	－	－
3　月　末	12,864	△0.1	381.04	△0.1	99.6	－	－
4　月　末	12,832	△0.3	380.12	△0.3	99.2	－	－
5　月　末	12,812	△0.5	379.54	△0.5	86.5	－	－
6　月　末	12,694	△1.4	376.08	△1.4	99.6	－	－
7　月　末	12,777	△0.7	378.55	△0.7	99.3	－	－
8　月　末	12,747	△1.0	377.67	△1.0	99.4	－	－
9　月　末	12,612	△2.0	373.60	△2.0	103.4	－	－
10　月　末	12,598	△2.1	373.25	△2.1	99.4	－	－
11　月　末	12,538	△2.6	371.33	△2.6	99.6	－	－
12　月　末	12,374	△3.9	366.60	△3.9	99.6	－	－
2023年1　月　末	12,341	△4.1	365.59	△4.1	99.4	－	－
(期　末)							
2023年2月14日	12,411	△3.6	367.66	△3.6	99.7	－	－

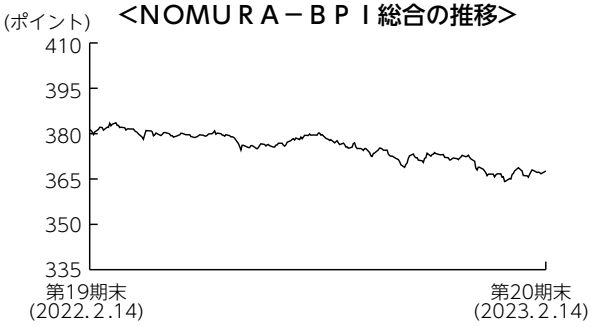
(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年２月15日から2023年２月14日まで）

<基準価額の推移>



<NOMURA－BPI総合の推移>



基準価額の推移

当期末の基準価額は12,411円となり、前期末比で3.6％下落しました。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初から2022年12月中旬にかけては、高インフレ抑制に向けた欧米の主要中央銀行の金融引き締め姿勢などを背景に基準価額は下落基調となりました。2022年12月下旬から期末にかけては、日本銀行が長期金利の変動幅を従来の±0.25％から±0.5％に拡大したことなどから基準価額は下落しました。

投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2022年12月中旬にかけては、ウクライナ情勢を巡る不透明感などが意識された一方、高インフレ抑制に向けた欧米の主要中央銀行の金融引き締め姿勢が観測されたことなどを背景に、利回りは横ばいとなりました。2022年12月下旬から期末にかけては、日本銀行が長期金利の変動幅を従来の±0.25％から±0.5％に拡大したことなどから利回りは上昇しました。

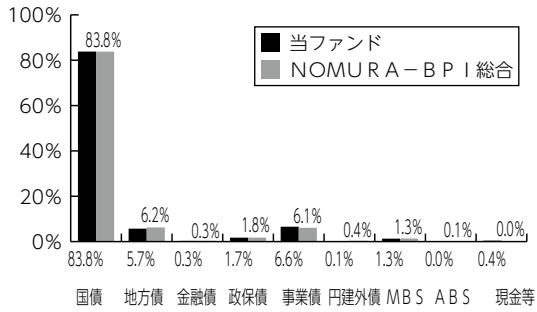
ポートフォリオについて

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

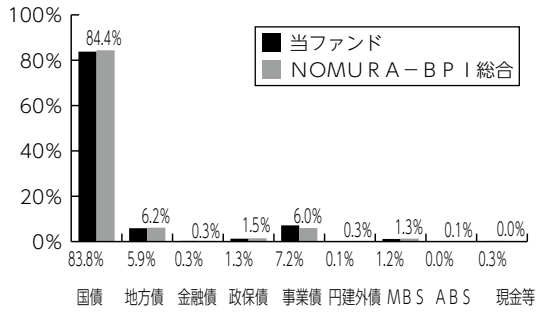
【運用状況】 （注）比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

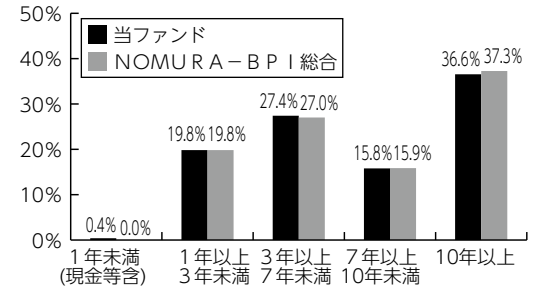


期末

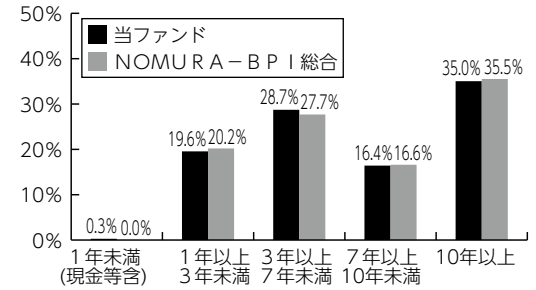


○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA－BPI総合は、前期末比で3.6%下落しました。

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

今後の運用方針

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

■１万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a)その他費用	0円	0.000%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	0	0.000	
期中の平均基準価額は12,671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（2022年２月15日から2023年２月14日まで）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	1,481,029,349	1,452,519,943 (－)
	地方債証券	6,447,190	4,140,237 (－)
	特殊債券	7,637,720	3,833,526 (369,528)
	社債券	3,368,168	4,648,915 (－)

(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（2022年２月15日から2023年２月14日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	1,498,482	96,387	6.4	1,465,142	110,127	7.5
金銭信託	6	6	100.0	6	6	100.0

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、みずほ証券、みずほ信託銀行です。

■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ＢＢ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	469,265,000	464,530,535	83.8	−	52.3	20.8	10.7
地方債証券	32,839,330	32,767,927	5.9	4.9	3.9	1.4	0.5
特殊債券	28,478,559	28,511,051	5.1	−	3.4	1.6	0.1
金融債券	1,700,000	1,693,591	0.3	−	−	0.3	0.0
普通社債券	26,381,000	25,503,782	4.6	0.1	2.2	2.1	0.3
合計	558,663,889	553,006,886	99.7	5.0	61.8	26.2	11.7

（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、ＢＢ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	
１３９回 利付国庫債券（５年）	0.1000	2,550,000	2,555,406	2024/03/20
６７回 利付国庫債券（２０年）	1.9000	50,000	51,088	2024/03/20
４３５回 利付国庫債券（２年）	0.0050	3,720,000	3,724,166	2024/04/01
４３６回 利付国庫債券（２年）	0.0050	6,100,000	6,107,320	2024/05/01
４３７回 利付国庫債券（２年）	0.0050	3,850,000	3,854,966	2024/06/01
１４０回 利付国庫債券（５年）	0.1000	6,990,000	7,007,824	2024/06/20
３３４回 利付国庫債券（１０年）	0.6000	4,420,000	4,460,973	2024/06/20
７０回 利付国庫債券（２０年）	2.4000	50,000	51,673	2024/06/20
７１回 利付国庫債券（２０年）	2.2000	40,000	41,230	2024/06/20
４３８回 利付国庫債券（２年）	0.0050	3,800,000	3,804,940	2024/07/01
４３９回 利付国庫債券（２年）	0.0050	1,300,000	1,301,703	2024/08/01
４４０回 利付国庫債券（２年）	0.0050	1,700,000	1,702,363	2024/09/01
１４１回 利付国庫債券（５年）	0.1000	2,810,000	2,818,064	2024/09/20
３３５回 利付国庫債券（１０年）	0.5000	4,610,000	4,652,688	2024/09/20
７２回 利付国庫債券（２０年）	2.1000	460,000	476,008	2024/09/20
４４１回 利付国庫債券（２年）	0.0050	1,100,000	1,101,518	2024/10/01
４４２回 利付国庫債券（２年）	0.0050	1,500,000	1,502,175	2024/11/01
４４３回 利付国庫債券（２年）	0.0050	2,500,000	2,503,800	2024/12/01
１４２回 利付国庫債券（５年）	0.1000	2,930,000	2,939,463	2024/12/20
３３６回 利付国庫債券（１０年）	0.5000	3,000,000	3,031,830	2024/12/20
３３７回 利付国庫債券（１０年）	0.3000	1,900,000	1,913,148	2024/12/20
７３回 利付国庫債券（２０年）	2.0000	380,000	394,557	2024/12/20
７４回 利付国庫債券（２０年）	2.1000	40,000	41,606	2024/12/20
４４４回 利付国庫債券（２年）	0.0050	3,100,000	3,104,650	2025/01/01
１４３回 利付国庫債券（５年）	0.1000	3,100,000	3,110,354	2025/03/20

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	
３３８回 利付国庫債券（１０年）	0.4000	5,430,000	5,482,236	2025/03/20
７５回 利付国庫債券（２０年）	2.1000	180,000	188,136	2025/03/20
７６回 利付国庫債券（２０年）	1.9000	70,000	72,871	2025/03/20
７７回 利付国庫債券（２０年）	2.0000	40,000	41,724	2025/03/20
１４４回 利付国庫債券（５年）	0.1000	5,900,000	5,920,060	2025/06/20
３３９回 利付国庫債券（１０年）	0.4000	5,980,000	6,043,089	2025/06/20
７８回 利付国庫債券（２０年）	1.9000	250,000	261,400	2025/06/20
７９回 利付国庫債券（２０年）	2.0000	50,000	52,397	2025/06/20
８０回 利付国庫債券（２０年）	2.1000	90,000	94,526	2025/06/20
１４５回 利付国庫債券（５年）	0.1000	2,650,000	2,658,930	2025/09/20
３４０回 利付国庫債券（１０年）	0.4000	3,040,000	3,073,926	2025/09/20
８１回 利付国庫債券（２０年）	2.0000	400,000	421,080	2025/09/20
８２回 利付国庫債券（２０年）	2.1000	140,000	147,742	2025/09/20
１４６回 利付国庫債券（５年）	0.1000	2,900,000	2,909,889	2025/12/20
３４１回 利付国庫債券（１０年）	0.3000	4,420,000	4,460,222	2025/12/20
８３回 利付国庫債券（２０年）	2.1000	70,000	74,222	2025/12/20
８４回 利付国庫債券（２０年）	2.0000	170,000	179,769	2025/12/20
１４７回 利付国庫債券（５年）	0.0050	4,250,000	4,251,275	2026/03/20
３４２回 利付国庫債券（１０年）	0.1000	4,520,000	4,534,644	2026/03/20
８５回 利付国庫債券（２０年）	2.1000	590,000	628,385	2026/03/20
８６回 利付国庫債券（２０年）	2.3000	120,000	128,548	2026/03/20
８７回 利付国庫債券（２０年）	2.2000	120,000	128,178	2026/03/20
１４８回 利付国庫債券（５年）	0.0050	3,310,000	3,309,437	2026/06/20
３４３回 利付国庫債券（１０年）	0.1000	4,690,000	4,704,070	2026/06/20
８８回 利付国庫債券（２０年）	2.3000	590,000	635,140	2026/06/20

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	
89回 利付国庫債券（20年）	2.2000	10,000	10,731	2026/06/20
149回 利付国庫債券（5年）	0.0050	5,010,000	5,003,687	2026/09/20
344回 利付国庫債券（10年）	0.1000	5,570,000	5,581,975	2026/09/20
90回 利付国庫債券（20年）	2.2000	470,000	506,439	2026/09/20
91回 利付国庫債券（20年）	2.3000	110,000	118,922	2026/09/20
150回 利付国庫債券（5年）	0.0050	4,720,000	4,708,200	2026/12/20
345回 利付国庫債券（10年）	0.1000	6,080,000	6,086,992	2026/12/20
92回 利付国庫債券（20年）	2.1000	1,160,000	1,250,271	2026/12/20
151回 利付国庫債券（5年）	0.0050	4,200,000	4,182,864	2027/03/20
152回 利付国庫債券（5年）	0.1000	1,030,000	1,029,783	2027/03/20
346回 利付国庫債券（10年）	0.1000	4,690,000	4,689,015	2027/03/20
93回 利付国庫債券（20年）	2.0000	370,000	398,638	2027/03/20
94回 利付国庫債券（20年）	2.1000	670,000	724,584	2027/03/20
153回 利付国庫債券（5年）	0.0050	5,310,000	5,280,157	2027/06/20
347回 利付国庫債券（10年）	0.1000	5,130,000	5,122,202	2027/06/20
95回 利付国庫債券（20年）	2.3000	550,000	601,535	2027/06/20
96回 利付国庫債券（20年）	2.1000	120,000	130,207	2027/06/20
154回 利付国庫債券（5年）	0.1000	4,300,000	4,287,229	2027/09/20
348回 利付国庫債券（10年）	0.1000	4,970,000	4,955,239	2027/09/20
97回 利付国庫債券（20年）	2.2000	660,000	721,406	2027/09/20
98回 利付国庫債券（20年）	2.1000	160,000	174,156	2027/09/20
155回 利付国庫債券（5年）	0.3000	1,300,000	1,306,851	2027/12/20
349回 利付国庫債券（10年）	0.1000	4,250,000	4,231,640	2027/12/20
99回 利付国庫債券（20年）	2.1000	750,000	818,947	2027/12/20
350回 利付国庫債券（10年）	0.1000	5,860,000	5,826,012	2028/03/20
100回 利付国庫債券（20年）	2.2000	830,000	913,415	2028/03/20
101回 利付国庫債券（20年）	2.4000	230,000	255,433	2028/03/20
351回 利付国庫債券（10年）	0.1000	5,020,000	4,981,597	2028/06/20
102回 利付国庫債券（20年）	2.4000	500,000	557,115	2028/06/20
103回 利付国庫債券（20年）	2.3000	160,000	177,432	2028/06/20
104回 利付国庫債券（20年）	2.1000	110,000	120,824	2028/06/20
352回 利付国庫債券（10年）	0.1000	4,260,000	4,220,083	2028/09/20
105回 利付国庫債券（20年）	2.1000	640,000	705,126	2028/09/20
106回 利付国庫債券（20年）	2.2000	500,000	553,640	2028/09/20
353回 利付国庫債券（10年）	0.1000	4,510,000	4,459,442	2028/12/20
107回 利付国庫債券（20年）	2.1000	600,000	662,784	2028/12/20
108回 利付国庫債券（20年）	1.9000	690,000	754,266	2028/12/20
354回 利付国庫債券（10年）	0.1000	4,200,000	4,144,770	2029/03/20
109回 利付国庫債券（20年）	1.9000	350,000	383,379	2029/03/20
110回 利付国庫債券（20年）	2.1000	440,000	487,220	2029/03/20
355回 利付国庫債券（10年）	0.1000	3,630,000	3,575,876	2029/06/20
111回 利付国庫債券（20年）	2.2000	460,000	513,755	2029/06/20
112回 利付国庫債券（20年）	2.1000	740,000	821,881	2029/06/20
356回 利付国庫債券（10年）	0.1000	4,500,000	4,424,625	2029/09/20
1回 利付国庫債券（30年）	2.8000	110,000	127,494	2029/09/20
113回 利付国庫債券（20年）	2.1000	1,370,000	1,525,508	2029/09/20
357回 利付国庫債券（10年）	0.1000	3,720,000	3,649,282	2029/12/20
114回 利付国庫債券（20年）	2.1000	410,000	457,646	2029/12/20
115回 利付国庫債券（20年）	2.2000	360,000	404,240	2029/12/20
2回 利付国庫債券（30年）	2.4000	100,000	113,955	2030/02/20

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	
358回 利付国庫債券（10年）	0.1000	3,750,000	3,676,200	2030/03/20
116回 利付国庫債券（20年）	2.2000	530,000	597,214	2030/03/20
117回 利付国庫債券（20年）	2.1000	1,070,000	1,198,303	2030/03/20
359回 利付国庫債券（10年）	0.1000	5,070,000	4,952,629	2030/06/20
118回 利付国庫債券（20年）	2.0000	555,000	618,336	2030/06/20
119回 利付国庫債券（20年）	1.8000	470,000	516,746	2030/06/20
120回 利付国庫債券（20年）	1.6000	670,000	727,084	2030/06/20
360回 利付国庫債券（10年）	0.1000	5,200,000	5,060,744	2030/09/20
121回 利付国庫債券（20年）	1.9000	640,000	708,665	2030/09/20
122回 利付国庫債券（20年）	1.8000	570,000	626,965	2030/09/20
4回 利付国庫債券（30年）	2.9000	200,000	236,836	2030/11/20
361回 利付国庫債券（10年）	0.1000	4,620,000	4,482,185	2030/12/20
123回 利付国庫債券（20年）	2.1000	1,050,000	1,179,916	2030/12/20
124回 利付国庫債券（20年）	2.0000	600,000	669,696	2030/12/20
362回 利付国庫債券（10年）	0.1000	5,360,000	5,189,230	2031/03/20
125回 利付国庫債券（20年）	2.2000	600,000	680,634	2031/03/20
126回 利付国庫債券（20年）	2.0000	510,000	570,368	2031/03/20
127回 利付国庫債券（20年）	1.9000	540,000	599,713	2031/03/20
363回 利付国庫債券（10年）	0.1000	5,070,000	4,899,698	2031/06/20
128回 利付国庫債券（20年）	1.9000	370,000	411,810	2031/06/20
364回 利付国庫債券（10年）	0.1000	5,400,000	5,211,270	2031/09/20
130回 利付国庫債券（20年）	1.8000	910,000	1,007,897	2031/09/20
6回 利付国庫債券（30年）	2.4000	200,000	232,188	2031/11/20
365回 利付国庫債券（10年）	0.1000	4,330,000	4,176,198	2031/12/20
132回 利付国庫債券（20年）	1.7000	830,000	914,352	2031/12/20
133回 利付国庫債券（20年）	1.8000	1,030,000	1,143,403	2031/12/20
366回 利付国庫債券（10年）	0.2000	2,780,000	2,707,469	2032/03/20
134回 利付国庫債券（20年）	1.8000	900,000	1,000,422	2032/03/20
135回 利付国庫債券（20年）	1.7000	1,840,000	2,028,452	2032/03/20
136回 利付国庫債券（20年）	1.6000	360,000	393,746	2032/03/20
367回 利付国庫債券（10年）	0.2000	3,000,000	2,959,290	2032/06/20
137回 利付国庫債券（20年）	1.7000	1,880,000	2,075,783	2032/06/20
138回 利付国庫債券（20年）	1.5000	1,020,000	1,107,577	2032/06/20
139回 利付国庫債券（20年）	1.6000	900,000	985,716	2032/06/20
368回 利付国庫債券（10年）	0.2000	3,750,000	3,742,950	2032/09/20
140回 利付国庫債券（20年）	1.7000	1,450,000	1,601,235	2032/09/20
369回 利付国庫債券（10年）	0.5000	1,400,000	1,400,000	2032/12/20
141回 利付国庫債券（20年）	1.7000	1,060,000	1,170,547	2032/12/20
142回 利付国庫債券（20年）	1.8000	1,530,000	1,703,808	2032/12/20
143回 利付国庫債券（20年）	1.6000	1,730,000	1,893,692	2033/03/20
144回 利付国庫債券（20年）	1.5000	1,450,000	1,573,409	2033/03/20
11回 利付国庫債券（30年）	1.7000	250,000	276,240	2033/06/20
145回 利付国庫債券（20年）	1.7000	2,850,000	3,149,136	2033/06/20
12回 利付国庫債券（30年）	2.1000	230,000	263,446	2033/09/20
146回 利付国庫債券（20年）	1.7000	2,340,000	2,584,810	2033/09/20
13回 利付国庫債券（30年）	2.0000	150,000	170,340	2033/12/20
147回 利付国庫債券（20年）	1.6000	2,890,000	3,161,688	2033/12/20
14回 利付国庫債券（30年）	2.4000	340,000	400,720	2034/03/20
148回 利付国庫債券（20年）	1.5000	2,060,000	2,230,732	2034/03/20
15回 利付国庫債券（30年）	2.5000	260,000	309,501	2034/06/20

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	
149回 利付国庫債券（20年）	1.5000	2,640,000	2,855,925	2034/06/20
16回 利付国庫債券（30年）	2.5000	240,000	286,020	2034/09/20
150回 利付国庫債券（20年）	1.4000	2,700,000	2,888,730	2034/09/20
17回 利付国庫債券（30年）	2.4000	270,000	318,978	2034/12/20
151回 利付国庫債券（20年）	1.2000	2,660,000	2,782,626	2034/12/20
18回 利付国庫債券（30年）	2.3000	400,000	468,468	2035/03/20
152回 利付国庫債券（20年）	1.2000	2,440,000	2,548,994	2035/03/20
19回 利付国庫債券（30年）	2.3000	280,000	328,101	2035/06/20
153回 利付国庫債券（20年）	1.3000	2,700,000	2,848,446	2035/06/20
20回 利付国庫債券（30年）	2.5000	330,000	394,864	2035/09/20
154回 利付国庫債券（20年）	1.2000	2,530,000	2,635,222	2035/09/20
21回 利付国庫債券（30年）	2.3000	310,000	363,732	2035/12/20
155回 利付国庫債券（20年）	1.0000	2,680,000	2,721,808	2035/12/20
22回 利付国庫債券（30年）	2.5000	290,000	347,594	2036/03/20
156回 利付国庫債券（20年）	0.4000	2,240,000	2,103,897	2036/03/20
23回 利付国庫債券（30年）	2.5000	350,000	419,706	2036/06/20
157回 利付国庫債券（20年）	0.2000	2,060,000	1,875,918	2036/06/20
24回 利付国庫債券（30年）	2.5000	470,000	564,159	2036/09/20
158回 利付国庫債券（20年）	0.5000	2,480,000	2,344,220	2036/09/20
25回 利付国庫債券（30年）	2.3000	330,000	388,063	2036/12/20
159回 利付国庫債券（20年）	0.6000	2,460,000	2,350,333	2036/12/20
26回 利付国庫債券（30年）	2.4000	620,000	737,211	2037/03/20
160回 利付国庫債券（20年）	0.7000	2,380,000	2,297,485	2037/03/20
161回 利付国庫債券（20年）	0.6000	2,410,000	2,287,644	2037/06/20
27回 利付国庫債券（30年）	2.5000	620,000	746,039	2037/09/20
162回 利付国庫債券（20年）	0.6000	2,170,000	2,051,604	2037/09/20
163回 利付国庫債券（20年）	0.6000	2,240,000	2,110,528	2037/12/20
28回 利付国庫債券（30年）	2.5000	770,000	926,902	2038/03/20
164回 利付国庫債券（20年）	0.5000	2,540,000	2,348,839	2038/03/20
165回 利付国庫債券（20年）	0.5000	2,130,000	1,960,941	2038/06/20
29回 利付国庫債券（30年）	2.4000	860,000	1,022,419	2038/09/20
166回 利付国庫債券（20年）	0.7000	1,680,000	1,588,423	2038/09/20
167回 利付国庫債券（20年）	0.5000	1,850,000	1,688,828	2038/12/20
30回 利付国庫債券（30年）	2.3000	880,000	1,032,829	2039/03/20
168回 利付国庫債券（20年）	0.4000	1,890,000	1,690,642	2039/03/20
169回 利付国庫債券（20年）	0.3000	2,060,000	1,804,209	2039/06/20
31回 利付国庫債券（30年）	2.2000	720,000	834,062	2039/09/20
170回 利付国庫債券（20年）	0.3000	1,700,000	1,482,111	2039/09/20
171回 利付国庫債券（20年）	0.3000	1,940,000	1,683,551	2039/12/20
32回 利付国庫債券（30年）	2.3000	970,000	1,137,451	2040/03/20
172回 利付国庫債券（20年）	0.4000	1,480,000	1,301,008	2040/03/20
173回 利付国庫債券（20年）	0.4000	2,220,000	1,942,722	2040/06/20
33回 利付国庫債券（30年）	2.0000	1,180,000	1,326,768	2040/09/20
174回 利付国庫債券（20年）	0.4000	2,170,000	1,890,330	2040/09/20
175回 利付国庫債券（20年）	0.5000	2,330,000	2,058,508	2040/12/20
34回 利付国庫債券（30年）	2.2000	1,200,000	1,385,568	2041/03/20
176回 利付国庫債券（20年）	0.5000	2,100,000	1,848,525	2041/03/20
177回 利付国庫債券（20年）	0.4000	2,050,000	1,764,968	2041/06/20
35回 利付国庫債券（30年）	2.0000	1,460,000	1,640,047	2041/09/20
178回 利付国庫債券（20年）	0.5000	2,400,000	2,099,904	2041/09/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
179回 利付国庫債券（20年）	0.5000	2,150,000	1,875,466	2041/12/20
36回 利付国庫債券（30年）	2.0000	1,370,000	1,540,222	2042/03/20
180回 利付国庫債券（20年）	0.8000	1,740,000	1,602,035	2042/03/20
181回 利付国庫債券（20年）	0.9000	2,000,000	1,872,000	2042/06/20
37回 利付国庫債券（30年）	1.9000	1,660,000	1,837,055	2042/09/20
182回 利付国庫債券（20年）	1.1000	1,980,000	1,916,659	2042/09/20
183回 利付国庫債券（20年）	1.4000	800,000	814,544	2042/12/20
38回 利付国庫債券（30年）	1.8000	1,550,000	1,685,532	2043/03/20
39回 利付国庫債券（30年）	1.9000	1,300,000	1,435,876	2043/06/20
40回 利付国庫債券（30年）	1.8000	1,130,000	1,227,767	2043/09/20
41回 利付国庫債券（30年）	1.7000	1,270,000	1,356,639	2043/12/20
42回 利付国庫債券（30年）	1.7000	1,420,000	1,515,267	2044/03/20
43回 利付国庫債券（30年）	1.7000	1,350,000	1,440,207	2044/06/20
44回 利付国庫債券（30年）	1.7000	1,500,000	1,598,460	2044/09/20
45回 利付国庫債券（30年）	1.5000	1,570,000	1,612,437	2044/12/20
46回 利付国庫債券（30年）	1.5000	1,670,000	1,714,071	2045/03/20
47回 利付国庫債券（30年）	1.6000	1,560,000	1,629,732	2045/06/20
48回 利付国庫債券（30年）	1.4000	1,480,000	1,487,651	2045/09/20
49回 利付国庫債券（30年）	1.4000	1,490,000	1,495,170	2045/12/20
50回 利付国庫債券（30年）	0.8000	1,460,000	1,290,245	2046/03/20
51回 利付国庫債券（30年）	0.3000	1,390,000	1,087,508	2046/06/20
52回 利付国庫債券（30年）	0.5000	1,430,000	1,171,599	2046/09/20
53回 利付国庫債券（30年）	0.6000	1,460,000	1,221,713	2046/12/20
54回 利付国庫債券（30年）	0.8000	1,450,000	1,269,257	2047/03/20
55回 利付国庫債券（30年）	0.8000	1,120,000	977,580	2047/06/20
56回 利付国庫債券（30年）	0.8000	1,360,000	1,183,635	2047/09/20
57回 利付国庫債券（30年）	0.8000	1,430,000	1,242,083	2047/12/20
1回 利付国庫債券（40年）	2.4000	110,000	132,266	2048/03/20
58回 利付国庫債券（30年）	0.8000	1,540,000	1,333,747	2048/03/20
59回 利付国庫債券（30年）	0.7000	1,220,000	1,027,569	2048/06/20
60回 利付国庫債券（30年）	0.9000	1,300,000	1,147,250	2048/09/20
61回 利付国庫債券（30年）	0.7000	1,140,000	954,145	2048/12/20
2回 利付国庫債券（40年）	2.2000	630,000	730,497	2049/03/20
62回 利付国庫債券（30年）	0.5000	1,120,000	886,692	2049/03/20
63回 利付国庫債券（30年）	0.4000	1,410,000	1,081,399	2049/06/20
64回 利付国庫債券（30年）	0.4000	1,030,000	786,930	2049/09/20
65回 利付国庫債券（30年）	0.4000	950,000	724,356	2049/12/20
3回 利付国庫債券（40年）	2.2000	540,000	626,691	2050/03/20
66回 利付国庫債券（30年）	0.4000	990,000	751,974	2050/03/20
67回 利付国庫債券（30年）	0.6000	1,570,000	1,257,020	2050/06/20
68回 利付国庫債券（30年）	0.6000	1,470,000	1,175,103	2050/09/20
69回 利付国庫債券（30年）	0.7000	1,530,000	1,256,283	2050/12/20
4回 利付国庫債券（40年）	2.2000	720,000	836,971	2051/03/20
70回 利付国庫債券（30年）	0.7000	1,410,000	1,155,100	2051/03/20
71回 利付国庫債券（30年）	0.7000	1,400,000	1,145,368	2051/06/20
72回 利付国庫債券（30年）	0.7000	1,490,000	1,222,112	2051/09/20
73回 利付国庫債券（30年）	0.7000	1,490,000	1,220,518	2051/12/20
5回 利付国庫債券（40年）	2.0000	710,000	798,054	2052/03/20
74回 利付国庫債券（30年）	1.0000	1,520,000	1,349,668	2052/03/20
75回 利付国庫債券（30年）	1.3000	1,620,000	1,550,809	2052/06/20

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	
76回 利付国庫債券（30年）	1.4000	1,520,000	1,488,840	2052/09/20
77回 利付国庫債券（30年）	1.6000	600,000	614,268	2052/12/20
6回 利付国庫債券（40年）	1.9000	1,040,000	1,139,236	2053/03/20
7回 利付国庫債券（40年）	1.7000	1,210,000	1,266,676	2054/03/20
8回 利付国庫債券（40年）	1.4000	1,190,000	1,156,703	2055/03/20
9回 利付国庫債券（40年）	0.4000	1,950,000	1,386,723	2056/03/20
10回 利付国庫債券（40年）	0.9000	1,970,000	1,649,421	2057/03/20
11回 利付国庫債券（40年）	0.8000	1,380,000	1,113,135	2058/03/20
12回 利付国庫債券（40年）	0.5000	1,440,000	1,034,971	2059/03/20
13回 利付国庫債券（40年）	0.5000	2,070,000	1,483,010	2060/03/20
14回 利付国庫債券（40年）	0.7000	2,050,000	1,566,979	2061/03/20
15回 利付国庫債券（40年）	1.0000	1,540,000	1,280,818	2062/03/20
小計	－	469,265,000	464,530,535	－
（地方債証券）	%	千円	千円	
208回 神奈川県公募公債	0.5510	300,000	302,097	2024/06/20
26年度4回 札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	100,684	2024/06/20
1回 兵庫県公募公債（12年）	1.1000	300,000	304,362	2024/06/26
26年度4回 神戸市公募公債	0.6060	100,000	100,808	2024/07/18
26年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	403,328	2024/07/29
488回 名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	454,014	2024/09/20
26年度1回 相模原市公募公債	0.5290	100,000	100,782	2024/09/20
26年度1回 長崎県公募公債	0.5540	100,000	100,827	2024/09/30
26年度1回 静岡市公募公債	0.5150	100,000	100,835	2024/11/25
26年度11回 京都府公募公債	0.4760	350,000	352,779	2024/12/19
26年度1回 三重県公募公債	0.4560	100,000	100,755	2024/12/25
26年度1回 浜松市公募公債	0.3350	100,000	100,545	2025/01/23
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	502,825	2025/01/24
26年度3回 広島市公募公債	0.4290	100,000	100,754	2025/02/25
26年度17回 兵庫県公募公債	0.4600	200,000	201,636	2025/02/26
5回 東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	104,277	2025/03/19
213回 神奈川県公募公債	0.5340	100,000	100,987	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	403,400	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	606,564	2025/05/23
27年度4回 千葉県公募公債	0.6020	200,000	202,546	2025/07/25
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	505,765	2025/07/25
7回 東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	105,371	2025/09/19
1回 静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	105,410	2025/09/19
150回 共同発行市場公募地方債	0.5100	300,000	303,279	2025/09/25
27年度15回 愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	101,029	2025/11/27
153回 共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,038	2025/12/25
27年度9回 千葉県公募公債	0.0950	100,000	99,922	2026/03/25
157回 共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	119,827	2026/04/24
9回 東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	215,374	2026/06/19
159回 共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,564	2026/06/25
160回 共同発行市場公募地方債	0.0500	500,000	498,370	2026/07/24
1回 兵庫県公募公債 15年	1.6600	200,000	210,406	2026/07/29
28年度6回 北海道公募公債	0.0700	100,000	99,665	2026/08/31
760回 東京都公募公債	0.0450	100,000	99,589	2026/09/18
10回 東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	323,247	2026/09/18
4回 京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	108,373	2026/09/18

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	
413回 大阪府公募公債 10年	0.0210	100,000	99,389	2026/10/28
190回 大阪府公募公債 5年	0.0010	300,000	297,654	2026/12/25
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	499,510	2027/01/25
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	0.0010	300,000	297,540	2027/01/28
28年度8回 福岡県公募公債	0.2400	100,000	100,079	2027/02/24
169回 共同発行市場公募地方債	0.2050	500,000	499,270	2027/04/23
419回 大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	99,775	2027/04/27
2回 静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	104,939	2027/06/25
5回 兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	101,854	2027/07/07
173回 共同発行市場公募地方債	0.2150	400,000	398,836	2027/08/25
29年度4回 大阪市公募公債	0.1500	200,000	198,728	2027/09/21
174回 共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,340	2027/09/24
24年度1回 福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	104,808	2027/11/29
178回 共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	99,547	2028/01/25
179回 共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	497,495	2028/02/25
29年度6回 広島市公募公債	0.2300	300,000	298,347	2028/02/25
29年度13回 京都府公募公債	0.2000	109,330	108,536	2028/03/16
5回 兵庫県公募公債 15年	1.3100	300,000	314,676	2028/05/26
783回 東京都公募公債	0.2200	110,000	109,105	2028/06/20
4回 静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	105,053	2028/06/23
30年度8回 北海道公募公債	0.2490	400,000	396,400	2028/08/31
30年度7回 神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	297,438	2028/09/20
第911回 川崎市公募公債	0.1850	200,000	197,536	2028/09/20
7回 静岡県公募公債 20年	2.3200	300,000	331,548	2028/09/21
30年度3回 広島県公募公債	0.2540	100,000	99,144	2028/09/25
30年度3回 堺市公募公債	0.1950	100,000	98,576	2028/12/19
237回 神奈川県公募公債	0.1350	200,000	196,578	2028/12/20
20回2号 福岡県公募公債	2.0500	100,000	109,208	2028/12/20
6回 大阪市公募公債 20年	2.2100	200,000	220,240	2028/12/20
17回 横浜市公募公債 20年	2.0700	100,000	109,322	2028/12/20
6回 北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	109,031	2028/12/20
30年度6回 福岡県公募公債	0.2000	200,000	197,318	2028/12/21
189回 共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	98,714	2028/12/25
30年度14回 北海道公募公債	0.1950	400,000	394,280	2028/12/28
18回 東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	110,361	2029/03/19
30年度19回 愛知県公募公債	0.1150	200,000	195,720	2029/03/28
30年度3回 岡山県公募公債 10年	0.1500	200,000	196,134	2029/03/29
194回 共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	293,058	2029/05/25
6回 川崎市公募公債 20年	2.2100	200,000	221,006	2029/05/25
令和元年度1回 福岡県公募公債	0.0290	200,000	194,264	2029/06/21
9回 兵庫県公募公債 15年	1.0200	100,000	103,236	2029/07/13
11回 神奈川県公募公債 20年	2.0800	100,000	109,884	2029/07/20
196回 共同発行市場公募地方債	0.0600	500,000	486,175	2029/07/25
796回 東京都公募公債	0.0400	200,000	193,754	2029/09/20
令和元年度 9回 静岡県公募公債	0.0500	200,000	193,944	2029/09/20
令和元年度3回 横浜市公募公債	0.0500	400,000	387,512	2029/10/16
令和元年度16回 兵庫県公募公債	0.0500	200,000	193,738	2029/10/23
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	110,892	2029/12/20
17回 さいたま市公募公債	0.1100	200,000	194,190	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	0.1350	200,000	194,434	2030/01/30

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	
21年度2回 福岡県公募公債（20年）	2.2300	100,000	111,371	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	96,840	2030/02/25
802回 東京都公募公債	0.1300	400,000	388,276	2030/03/19
511回 名古屋市公募公債 10年	0.0750	200,000	193,306	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公募公債	0.1350	400,000	388,048	2030/04/12
令和2年 2回 大阪市公募公債	0.1310	300,000	290,415	2030/05/22
9回 埼玉県公募公債 20年	2.1500	100,000	111,028	2030/05/24
8回 静岡県公募公債 15年	0.8280	200,000	203,408	2030/06/07
令和2年度 10回 静岡県公募公債	0.1350	100,000	96,268	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公募公債	0.1350	100,000	96,142	2030/10/23
36回2号 宮城県公募公債 10年	0.1350	250,000	240,335	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公募公債	0.1350	200,000	192,022	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公募公債	0.1350	200,000	192,022	2030/11/27
22年度14回 愛知県公募公債	2.0870	300,000	331,965	2030/12/13
9回 京都市公募公債 20年	2.1430	200,000	222,170	2030/12/17
813回 東京都公募公債	0.1790	300,000	288,789	2030/12/20
16回 神奈川県公募公債 20年	2.0900	300,000	332,343	2031/01/24
464回 大阪府公募公債 10年	0.0720	200,000	190,528	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公募公債	0.1450	100,000	95,702	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公募公債	0.2140	200,000	192,564	2031/03/12
令和2年 7回 広島県公募公債	0.2140	200,000	192,474	2031/03/19
251回 神奈川県公募公債 10年	0.1990	200,000	192,242	2031/03/20
令和2年度 14回 静岡県公募公債	0.1400	200,000	191,338	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	0.1900	200,000	192,040	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公募公債	0.1750	100,000	95,856	2031/04/25
467回 大阪府公募公債 10年	0.1640	200,000	191,388	2031/04/28
469回 大阪府公募公債 10年	0.1280	200,000	190,590	2031/06/27
11回 北九州市公募公債 20年	2.0190	300,000	331,587	2031/07/18
令和3年 5回 千葉県公募公債	0.1050	200,000	189,864	2031/09/25
472回 大阪府公募公債 10年	0.1000	200,000	189,618	2031/09/29
474回 大阪府公募公債 10年	0.1190	300,000	284,616	2031/11/28
19回 神奈川県公募公債 20年	1.8180	100,000	109,234	2032/01/30
227回 共同発行市場公募地方債	0.2440	500,000	479,015	2032/02/25
228回 共同発行市場公募地方債	0.1990	500,000	476,525	2032/03/25
258回 神奈川県公募公債 10年	0.2900	300,000	286,713	2032/06/18
24年度2回 福岡県公募公債（20年）	1.6350	300,000	323,976	2032/08/16
10回 大阪府公募公債 20年	1.7200	200,000	218,262	2032/09/24
24年度12回 神戸市公募公債	1.7110	200,000	216,916	2032/12/17
14回 千葉県公募公債 20年	1.1370	100,000	102,557	2033/04/15
13回 埼玉県公募公債 20年	1.5990	100,000	107,254	2033/05/20
1回 東京都公募公債 30年	2.2100	200,000	226,936	2033/06/20
14回 埼玉県公募公債 20年	1.5460	300,000	320,910	2034/05/08
26年度4回 愛知県公募公債 20年	1.5420	200,000	213,880	2034/05/15
29回 横浜市公募公債 20年	1.5280	100,000	106,759	2034/05/26
16回 名古屋市公募公債 20年	1.5200	100,000	106,642	2034/06/09
5回 群馬県公募公債 20年	1.5290	100,000	106,745	2034/06/16
17回 北九州市公募公債 20年	1.5290	100,000	106,477	2034/06/20
31回 東京都公募公債 20年	1.2380	200,000	206,890	2034/09/20
15回 埼玉県公募公債 20年	1.1660	100,000	102,444	2035/02/16
2回 横浜市公募公債 30年	2.4900	100,000	117,335	2035/03/20

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	
18回 千葉県公募公債 20年	1.1380	100,000	102,000	2035/04/13
17回 名古屋市公募公債 20年	1.2030	100,000	102,676	2035/05/28
13回 大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	102,213	2035/09/28
14回 大阪府公募公債 20年	0.5400	100,000	93,260	2036/09/29
21回 千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	91,920	2036/10/15
3回 神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	119,692	2037/03/19
29年度2回 広島市公募公債	0.6160	200,000	186,502	2037/08/18
29年度5回 札幌市公募公債 20年	0.5970	300,000	278,595	2037/09/18
30年度2回 仙台市公募公債 20年	0.7290	100,000	93,237	2038/10/18
30年度7回 福岡市公募公債	0.7010	200,000	185,616	2038/10/19
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	0.2860	100,000	85,565	2039/07/29
2回 兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	115,928	2040/03/19
22年度8回 福岡市公募公債	2.2800	100,000	114,581	2040/09/20
令和2年 2回 広島県公募公債	0.4640	100,000	86,483	2040/09/21
23年度7回 札幌市公募公債 30年	2.0970	100,000	111,561	2041/09/20
5回 川崎市公募公債 30年	2.0970	100,000	111,758	2042/03/20
24年度12回 愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	112,081	2042/09/19
14回 東京都公募公債 30年	2.0500	100,000	110,745	2043/06/19
27年度8回 愛知県公募公債 30年	1.5790	150,000	152,100	2045/06/20
27年度 2回 広島県公募公債 30年	0.7110	100,000	84,226	2046/03/22
6回 埼玉県公募公債 30年	0.9570	200,000	176,576	2046/12/20
令和元年度7回 愛知県公募公債	0.3690	300,000	219,747	2049/06/18
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	0.4320	200,000	149,236	2049/06/18
令和元年度1回 島根県公募公債	0.2900	200,000	179,728	2049/09/17
5回 京都市公募公債 30年定時償還	0.2900	200,000	178,096	2049/09/17
12回 埼玉県公募公債 30年	0.4740	300,000	225,567	2049/12/20
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	0.7130	200,000	158,462	2051/06/20
小計	－	32,839,330	32,767,927	－
（特殊債券）	%	千円	千円	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	100,856	2024/05/31
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6440	200,000	201,760	2024/06/28
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	302,556	2024/09/13
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	100,695	2024/09/20
71回 鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	100,810	2024/11/27
21回 政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	100,893	2025/03/17
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	504,500	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	100,790	2025/04/25
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	2.0400	400,000	417,968	2025/06/20
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,197	2025/06/20
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	101,001	2025/08/29
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,780	2025/09/19
85回 中日本高速道路債券	0.0700	300,000	298,959	2025/10/21
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,007	2025/11/20
23回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	105,523	2025/12/19
61回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	104,787	2025/12/19
F538回 地方公共団体金融機構債券	0.0200	500,000	498,430	2025/12/25
40回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,825	2026/03/13
33回 政保日本政策投資銀行社債	0.0200	300,000	299,490	2026/03/16
87回 中日本高速道路債券	0.0600	400,000	397,488	2026/03/18
11回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	107,368	2026/03/20

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	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0200	300,000	299,439	2026/03/31
187回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	99,731	2026/04/20
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	399,108	2026/04/28
80回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	104,878	2026/09/18
321回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,165	2026/09/18
325回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,165	2026/09/18
79回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	314,238	2026/11/06
91回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	99,753	2026/12/14
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	99,783	2027/01/29
F147回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	208,092	2027/03/19
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	298,890	2027/04/13
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	797,992	2027/04/30
96回 地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	497,570	2027/05/28
72回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	197,442	2027/06/18
98回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	99,715	2027/07/16
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	297,405	2027/11/19
103回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	99,450	2027/12/17
124回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	104,912	2027/12/20
77回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	294,948	2027/12/20
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	297,546	2028/02/18
113回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	99,189	2028/10/16
9回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	207,186	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	217,836	2028/12/20
93回 都市再生債券	1.1020	100,000	103,257	2029/06/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	331,575	2029/06/28
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	332,127	2029/08/28
12回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	204,952	2029/09/20
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	219,880	2029/09/20
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	110,813	2029/12/28
78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	101,051	2030/05/28
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	203,616	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	217,810	2030/10/29
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	545,880	2030/10/31
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	110,778	2031/01/28
90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	191,122	2031/05/30
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	386,540	2031/06/13
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	109,804	2031/09/19
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	110,088	2031/12/26
19回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	218,006	2031/12/26
156回 日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	381,724	2032/04/14
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	108,206	2032/07/28
115回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	109,974	2032/09/14
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	109,201	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券20年	1.7020	200,000	217,854	2032/09/28
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	105,581	2033/04/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	592,695	2033/12/20
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	106,286	2034/03/17
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	106,670	2034/04/28
39回 地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	524,325	2034/09/28
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	300,312	2035/01/26

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	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	308,823	2035/02/28
159回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	101,042	2035/05/18
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	102,964	2035/06/20
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	206,116	2035/06/28
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	104,095	2035/06/29
第262回 政保道路債	1.1090	500,000	509,045	2035/11/30
172回 高速道路機構債	0.2880	200,000	179,758	2036/06/20
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.3100	200,000	182,470	2036/08/29
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	93,733	2037/04/28
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	188,402	2037/07/31
26回 高速道路機構債	2.6700	200,000	237,358	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	29,481	29,564	2037/11/10
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	92,927	2038/01/29
233回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	91,085	2038/04/20
F174回 地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	327,294	2038/05/28
210回 高速道路機構債	0.6770	100,000	91,875	2038/09/17
50回 高速道路機構債	0.5000	300,000	265,596	2039/03/18
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	250,305	2039/09/28
125回 日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	425,180	2040/04/24
288回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	303,009	2040/07/27
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	107,738	2040/08/31
40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	44,416	45,090	2041/03/10
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	10,028	10,056	2041/06/10
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	48,395	48,533	2041/07/10
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	28,716	28,785	2042/02/10
4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	9,766	9,791	2042/08/10
148回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	267,802	2043/12/18
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	16,224	16,963	2044/08/10
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	101,085	106,357	2044/10/10
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	153,752	160,563	2045/05/10
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	99,702	2045/06/20
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	21,513	22,364	2045/07/10
1回 高速道路機構債	2.9900	300,000	374,067	2045/09/20
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	197,772	2045/10/31
169回 高速道路機構債	1.2000	100,000	91,630	2045/12/20
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	96,646	2046/01/31
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	18,489	19,253	2046/06/10
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	21,674	22,467	2046/09/10
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	22,728	23,550	2046/10/10
19回 高速道路機構債	2.7500	150,000	180,889	2047/03/20
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	27,955	28,894	2047/05/10
64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	68,544	70,293	2047/09/10
36回 高速道路機構債	2.8400	300,000	367,482	2048/03/20
76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	31,310	32,207	2048/09/10
82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	37,252	37,929	2049/03/10
84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	37,866	38,564	2049/05/10
86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,647	42,347	2049/07/10
90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	43,218	43,641	2049/11/10
398回 政保道路債	0.4220	300,000	225,969	2049/12/28
93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	48,571	48,186	2050/02/10

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	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	0.5170	300,000	222,036	2050/04/28
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	54,967	54,920	2050/05/10
131回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	77,436	2050/06/20
165回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	155,190	2050/06/20
99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	56,873	57,164	2050/08/10
418回 高速道路機構債	0.6300	200,000	157,672	2051/08/31
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	159,878	2051/10/31
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	213,474	206,557	2051/11/10
117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	72,432	70,469	2052/02/10
118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	72,120	70,253	2052/03/10
119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	72,281	70,341	2052/04/10
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	225,873	218,581	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	226,248	218,802	2053/01/10
130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	153,450	148,271	2053/03/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	230,445	222,139	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	229,833	221,568	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	397,340	384,211	2053/10/10
139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	79,465	76,755	2053/12/10
142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	81,727	78,041	2054/03/10
154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	262,260	248,724	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	102,090	2055/03/19
156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	350,088	333,234	2055/05/10
160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	269,238	256,449	2055/09/10
168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	276,114	263,056	2056/05/10
170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	838,701	795,759	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	149,016	2061/02/28
小計	－	28,478,559	28,511,051	－
（金融債券）	%	千円	千円	
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,075	2024/05/27
い第843号 利付商工債	0.1200	100,000	99,912	2025/08/27
369回 利附信金中金債（5年）	0.0600	400,000	399,144	2025/08/27
い第851号 利付商工債	0.0900	300,000	298,761	2026/04/27
377回 利附信金中金債（5年）	0.0400	300,000	298,617	2026/04/27
い第854号 利付商工債	0.0800	300,000	298,308	2026/07/27
い第855号 利付商工債	0.0800	200,000	198,774	2026/08/27
小計	－	1,700,000	1,693,591	－
（普通社債券）	%	千円	千円	
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	100,870	2024/04/25
2回 BPCE SA円貨社債（ソーシャルボンド）	0.3670	100,000	99,582	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	100,989	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	100,732	2024/09/03
25回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,874	2024/09/20
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	103,370	2024/09/20
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	100,756	2024/10/28
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	201,138	2024/10/28
4回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,729	2024/10/31
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.8650	200,000	200,536	2024/11/28
25回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	201,488	2024/12/20
11回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	201,280	2024/12/20
321回 北海道電力社債	0.8860	261,000	264,048	2024/12/25

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	
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	100,834	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,001	2025/05/21
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,306	2025/06/11
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,249	2025/06/20
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	312,741	2025/06/20
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	101,459	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	208,004	2025/06/20
12回 新生銀行社債	0.3600	400,000	398,624	2025/07/09
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	209,534	2025/09/19
27回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	398,188	2025/12/19
14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,478	2025/12/19
26回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	198,834	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	199,008	2026/03/24
96回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,497	2026/04/15
163回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,414	2026/04/15
28回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	296,892	2026/04/21
493回 九州電力社債	0.1000	200,000	197,168	2026/05/25
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,227	2026/05/26
24回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,694	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	99,250	2026/06/03
35回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,038	2026/06/05
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（2016）	0.4000	100,000	98,180	2026/06/10
57回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	99,437	2026/06/19
79回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	297,714	2026/06/19
83回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	198,476	2026/06/19
61回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	496,025	2026/06/19
69回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	297,771	2026/06/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	128,152	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	102,035	2026/06/25
90回 中日本高速道路債券	0.0500	200,000	198,360	2026/07/27
20回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	296,802	2026/07/27
3回 野村ホールディングス社債	0.2800	300,000	295,548	2026/09/04
91回 中日本高速道路債券	0.0400	500,000	495,115	2026/09/17
62回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	495,115	2026/09/18
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,183	2026/09/18
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2200	200,000	198,106	2026/10/16
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,035	2026/10/23
33回 西日本高速道路債券	0.2700	300,000	299,208	2026/12/14
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	199,682	2027/02/16
12回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	106,194	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	107,729	2027/04/20
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	297,735	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	297,435	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	199,384	2027/05/07
30回 東レ社債	0.3750	300,000	298,701	2027/07/16
32回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	108,120	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	100,858	2027/09/24
25回 フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債（2017）	0.5100	300,000	292,086	2027/10/12
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,105	2027/10/22
525回 東北電力社債	0.2200	200,000	195,324	2027/10/25

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	
５４回　電源開発社債	0.3800	100,000	98,587	2027/11/19
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	0.2800	300,000	297,567	2027/12/20
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	0.4550	300,000	297,483	2028/01/18
１２回　ソフトバンク社債	0.4200	400,000	389,612	2028/06/02
7回　ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	198,710	2028/06/06
5回　三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	98,283	2028/10/25
２１回　西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	109,267	2029/03/21
23回　三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	97,601	2029/04/12
１４回　ブリヂストン社債	0.3750	300,000	295,032	2029/04/19
８０回　東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	102,734	2029/04/27
５３０回　関西電力社債	0.4050	400,000	385,108	2029/06/20
７３回　三井物産社債	0.2900	400,000	389,616	2029/07/11
５３２回　中部電力社債	0.2240	200,000	190,862	2029/07/25
7回　ニッコンHD社債	0.2800	300,000	289,911	2029/10/11
８０回　日立キャピタル社債	0.2800	200,000	192,826	2029/10/19
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	109,292	2029/12/21
６７回　東日本高速道路社債	0.2200	200,000	194,078	2030/01/31
１９回　パナソニック社債	0.3700	100,000	96,955	2030/03/05
１４７回　東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	96,435	2030/04/22
６０回　西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	192,592	2030/05/21
５２１回　東北電力社債	0.4500	400,000	382,644	2030/05/24
４２５回　中国電力社債	0.3700	100,000	95,100	2030/06/25
3回　ダイドーグループHD社債	0.5100	300,000	291,630	2030/07/16
31回　三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	192,492	2030/08/09
６回　横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	192,698	2030/09/17
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	0.3800	400,000	389,456	2030/09/20
７１回　東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	107,766	2030/09/27
１７回　ダイセル社債	0.5000	300,000	291,198	2030/12/13
８６回　日立キャピタル社債	0.4000	300,000	287,298	2030/12/20
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	218,502	2030/12/20
２３回　パナソニック社債	0.3900	200,000	191,796	2030/12/24
３０回　光通信社債	0.9800	200,000	181,328	2031/01/31
７４回　西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	94,712	2031/04/22
４９１回　九州電力社債	0.3400	300,000	279,612	2031/04/25
５８回　川崎重工業社債	0.3000	300,000	286,257	2031/07/15
５４１回　関西電力社債	0.3700	300,000	279,180	2031/09/19
５３６回　東北電力社債	0.2900	300,000	277,605	2031/09/25
１６回　武田薬品工業社債	0.4000	500,000	470,495	2031/10/14
７５回　電源開発社債	0.3500	200,000	186,218	2031/10/20
３９６回　中国電力社債	0.5540	200,000	188,732	2032/01/23
３２０回　四国電力社債	0.5340	300,000	282,738	2032/04/23
５０７回　九州電力社債	0.6440	200,000	189,720	2032/05/25
4回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債	0.8340	300,000	295,416	2032/06/15
9回　野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	94,311	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	185,404	2036/06/09
４１回　東京瓦斯社債	0.5700	200,000	180,940	2036/11/28
５２７回　中部電力社債	0.8060	100,000	89,875	2037/10/23
１２７回　東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	90,153	2038/01/26
２６回　豊田通商社債	0.8970	100,000	92,653	2038/03/05
３５０回　北海道電力社債	0.7540	200,000	176,628	2038/03/25
４６３回　九州電力社債	0.7920	100,000	88,572	2038/05/25
8回　ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	184,228	2038/06/04
４３回　京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	89,806	2038/07/12
４６６回　九州電力社債	0.7200	100,000	87,393	2038/07/23
５２回　東京瓦斯社債	0.4860	100,000	85,241	2039/05/23
５３１回　関西電力社債	0.6720	200,000	169,598	2039/06/20
５５回　東京瓦斯社債	0.2800	100,000	81,752	2039/09/13
３７回　成田国際空港社債	0.4240	100,000	83,714	2040/01/27
１６５回　東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	168,538	2041/04/15
７５回　西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	168,014	2041/04/22
４９２回　九州電力社債	0.6500	100,000	81,836	2041/04/25
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	94,254	2045/01/27
１２５回　東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	87,052	2047/07/26
７０回　西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	77,848	2049/12/24
１７１回　東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	153,760	2051/07/14
５７回　東京瓦斯社債	0.6930	300,000	206,034	2057/12/25
７１回　西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	75,020	2059/12/24
４７回　東京地下鉄社債	0.9090	100,000	74,006	2060/09/17
１６０回　東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	74,560	2060/12/17
小計	－	26,381,000	25,503,782	－
合計	－	558,663,889	553,006,886	－

■投資信託財産の構成

2023年２月14日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	553,006,886	99.7
コール・ローン等、その他	1,668,486	0.3
投資信託財産総額	554,675,373	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨てております。％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

(2023年２月14日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**554,675,373,305円**
コール・ローン等	617,814,346
公社債(評価額)	553,006,886,952
未収利息	696,325,613
前払費用	354,346,394
(B) 負債	**160,658,000**
未払解約金	160,658,000
(C) 純資産総額(A－B)	**554,514,715,305**
元本	446,785,885,792
次期繰越損益金	107,728,829,513
(D) 受益権総口数	**446,785,885,792口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**12,411円**

(注１) 期首元本額 429,840,166,151円
追加設定元本額 1,193,021,056,559円
一部解約元本額 1,176,075,336,918円

(注２) 期末における元本の内訳

ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	25,737,106,533円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	57,586,017円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	103,700,225円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	66,758,277円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	754,422,213円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	180,875,125円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	51,325,733円
たわらノーロード　国内債券	17,498,683,959円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,806,010,006円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,251,955,017円
たわらノーロード　バランス（標準型）	2,226,167,410円
たわらノーロード　バランス（積極型）	289,053,050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）	128,198,441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）	1,726,237,986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）	1,815,055,749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）	501,958,943円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	2,448,954円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	27,062,997円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	18,479,351円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	155,346,253円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,911,502円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	62,284円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	13,797,948,481円
Ｏｎｅグローバルバランス	26,722,380円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	9,748,438,004円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	13,721,614,185円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	5,826,988,427円
ＤＩＡＭ　ＤＣバランス30インデックスファンド	2,358,619,228円
ＤＩＡＭ　ＤＣバランス50インデックスファンド	2,427,324,525円
ＤＩＡＭ　ＤＣバランス70インデックスファンド	411,372,305円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	97,387,528円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	3,564,928,239円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	13,441,521円
ＤＩＡＭＤＣ　８資産バランスファンド（新興国10）	4,632,204,263円
ＤＩＡＭＤＣ　８資産バランスファンド（新興国20）	1,967,220,079円
ＤＩＡＭＤＣ　８資産バランスファンド（新興国30）	377,779,353円
投資のソムリエ	80,243,319,715円
クルーズコントロール	973,146,033円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	5,911,038,890円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	5,610,654,070円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,317,826,922円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	6,499,330,383円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	27,485,903,692円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	470,764,235円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	236,380,237円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	45,753,552円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	1,970,386,655円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,435,483,967円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	10,471,865,998円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,499,704,588円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	663,974,989円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	253,415,299円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	155,546,201円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,242,098,929円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	33,649,224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）	1,918,361,466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）	1,966,575,557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）	1,522,865,115円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09（適格機関投資家限定）	1,201,586,453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）	1,897,755,847円
インカム重視マルチアセット運用ファンドＩＩ2021-04（適格機関投資家限定）	4,911,402,998円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	1,872,779,890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）	1,712,759,046円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	1,920,698,394円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	9,123,052,184円
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,647,924,770円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	2,161,052,848円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	572,870,714円
ＤＩＡＭワールドバランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	262,362,220円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドＩＩ（適格機関投資家限定）	5,397,074,453円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドＩＩＩ（適格機関投資家限定）	5,408,411,752円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドＩＶ（適格機関投資家限定）	5,364,968,629円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	3,271,484,674円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	41,605,092円
AMOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,052,664,270円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	74,795,895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）	146,999,752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）	96,492,643円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,332,957円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	72,848,637円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,734,823円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	327,700円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド40ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,873,600円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	107,055,264円
ＤＩＡＭバランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,016,439,998円
ＤＩＡＭバランスファンド37.5ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,100,621,220円
ＤＩＡＭバランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,138,221,952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）	64,082,448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）	143,932,786円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,815,004,927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）	133,615,087円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド55ＶＡ（適格機関投資家限定）	532,578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）	1,989,249,669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）	43,566,296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）	293,969,678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）	445,411,075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）	771,111,794円
ＤＩＡＭ世界バランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	250,595,165円
ＤＩＡＭ国内バランス30ＶＡ（適格機関投資家限定）	95,877,638円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	905,339,373円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	366,377,124円
コア資産形成ファンド	245,142,281円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	46,520,562,169円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	47,766,276,797円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	11,297,006,099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］	1,689,593,873円
期末元本合計	446,785,885,792円

■損益の状況

当期　自2022年２月15日　至2023年２月14日

項目	当期
(A) 配当等収益	**3,860,461,249円**
受取利息	3,866,858,522
支払利息	△6,397,273
(B) 有価証券売買損益	**△31,051,006,500**
売買益	919,953,577
売買損	△31,970,960,077
(C) その他費用	**△20**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**△27,190,545,271**
(E) 前期繰越損益金	**123,463,010,360**
(F) 解約差損益金	**△306,962,982,017**
(G) 追加信託差損益金	**318,419,346,441**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**107,728,829,513**
次期繰越損益金(H)	**107,728,829,513**

(注１) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注２) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
(注３) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■信託金の限度額を１兆円から３兆円に変更しました。

(2022年３月15日)

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21期（決算日　2023年２月15日）

（計算期間　2022年２月16日～2023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21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（ベンチマーク）		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
21期(2023年２月15日)	62,397	9.8	2,036,206.59	10.1	95.5	2.4	856,221

（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）。

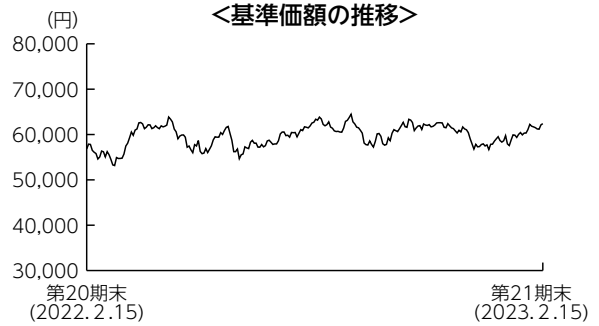
■当期中の基準価額と市況の推移

年　　月　　日	基準価額		MSCIコクサイ・インデックス		株式組入比率	株式先物比率
		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		
(期　首)	円	%	ポイント	%	%	%
2022年2月15日	56,820	－	1,849,569.21	－	93.1	1.8
2月末	56,351	△0.8	1,836,612.20	△0.7	95.5	2.0
3月末	62,337	9.7	2,031,374.00	9.8	95.6	2.1
4月末	59,665	5.0	1,943,470.47	5.1	95.3	2.2
5月末	59,498	4.7	1,941,169.72	5.0	94.5	3.1
6月末	58,103	2.3	1,895,744.26	2.5	95.7	1.9
7月末	60,392	6.3	1,967,771.49	6.4	95.2	2.3
8月末	60,806	7.0	1,982,292.26	7.2	94.6	3.1
9月末	57,818	1.8	1,883,547.10	1.8	95.3	2.5
10月末	63,361	11.5	2,066,941.46	11.8	95.8	1.8
11月末	61,492	8.2	2,007,747.19	8.6	95.4	2.4
12月末	57,722	1.6	1,884,347.09	1.9	95.2	2.6
2023年1月末	59,911	5.4	1,957,032.55	5.8	95.5	2.2
(期　末)						
2023年2月15日	62,397	9.8	2,036,206.59	10.1	95.5	2.4

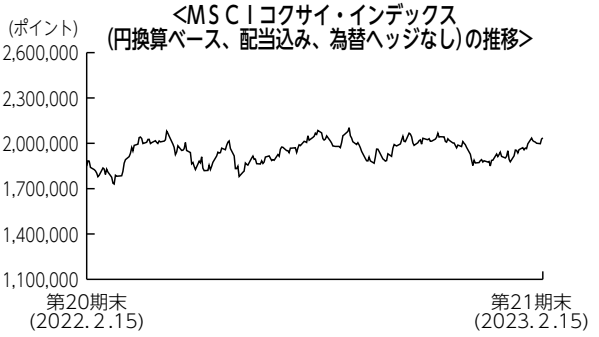
(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年２月16日から2023年２月15日まで）

<基準価額の推移>



<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)の推移>



基準価額の推移

当期末の基準価額は62,397円となり、前期末比で9.8％上昇しました。

基準価額の主な変動要因

インフレ高進に伴う大幅利上げと景気減速観測が嫌気され、米国やドイツなどの市場は下落しましたが、為替市場で円安が進んだことから当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

先進国株式市場は上昇、下落が混在する結果となりました。米国株式市場ではＦＲＢ（米連邦準備理事会）の大幅利上げに伴う景気減速懸念から下落基調となりました。2022年10月後半以降は利上げペースの緩和観測が広がり、持ち直しの動きとなりました。欧州株式市場ではロシアのウクライナ侵攻に伴うインフレ高進やＥＣＢ（欧州中央銀行）の利上げが嫌気され下落しましたが、中国のゼロコロナ政策緩和に伴う景気回復期待や欧州の景況感改善などが好感され反発しました。

為替市場では、円／米ドルレートは高騰する物価抑制のため金融引き締めを急ぐ米国と、金融緩和を維持する日本との政策の違いを背景に大幅に円安米ドル高が進みました。2022年10月後半以降は米国の物価上昇に鈍化傾向が見られたことから利上げペースの緩和観測が広がり、円高米ドル安方向に反転し円の下落幅を縮小しました。ユーロに対してはＥＣＢの利上げ継続が意識され円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.8%
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

期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.6%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.7
3	資本財	6.5
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.2
5	銀行	6.2
6	エネルギー	5.6
7	メディア・娯楽	5.0
8	各種金融	4.8
9	半導体・半導体製造装置	4.8
10	ヘルスケア機器・サービス	4.6

（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10.1％上昇しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■１万口当たりの費用明細

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料	2円	0.003%	(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
(株式)	(1)	(0.002)	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
(先物・オプション)	(1)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	8	0.014	(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
(株式)	(8)	(0.014)	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	13	0.022	(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)	(8)	(0.014)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(その他)	(5)	(0.008)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	23	0.038	
期中の平均基準価額は59,696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（2022年２月16日から2023年２月15日まで）

(1) 株　式

		買 株数	買 金額	売 株数	売 金額
外国	アメリカ	百株 146,429.57 (28,880.34)	千アメリカ・ドル 1,573,779 (△280)	百株 60,698.13	千アメリカ・ドル 623,093
	カナダ	百株 18,266.39 (2,003.25)	千カナダ・ドル 110,136 (−)	百株 7,515.52	千カナダ・ドル 44,724
	オーストラリア	百株 37,539.52 (3,447.3)	千オーストラリア・ドル 83,816 (−)	百株 20,631.98	千オーストラリア・ドル 32,045
	香港	百株 27,339.16 (−)	千香港・ドル 124,405 (−)	百株 12,266	千香港・ドル 43,805
	シンガポール	百株 8,498.47 (−)	千シンガポール・ドル 8,393 (△7)	百株 2,903	千シンガポール・ドル 2,867
	ニュージーランド	百株 1,951.75 (−)	千ニュージーランド・ドル 1,645 (−)	百株 2,042.47	千ニュージーランド・ドル 1,342
	イギリス	百株 106,567.17 (3,741.03)	千イギリス・ポンド 76,417 (△770)	百株 43,039.63	千イギリス・ポンド 39,087
	イスラエル	百株 4,723.42 (−)	千イスラエル・シュケル 10,753 (−)	百株 6.29	千イスラエル・シュケル 430

			買	付	売	付
			株数	金額	株数	金額
外国		スイス	百株 9,648.21 (3,532.6)	千スイス・フラン 66,022 (△346)	百株 7,123.42	千スイス・フラン 27,291
		デンマーク	百株 2,131.07 (−)	千デンマーク・クローネ 118,134 (−)	百株 1,147.15	千デンマーク・クローネ 51,075
		ノルウェー	百株 3,186.11 (−)	千ノルウェー・クローネ 58,164 (−)	百株 1,253.7	千ノルウェー・クローネ 18,394
		スウェーデン	百株 17,412.61 (7,219.23)	千スウェーデン・クローナ 255,477 (−)	百株 11,724.99	千スウェーデン・クローナ 119,230
	ユーロ	アイルランド	百株 3,308.28 (−)	千ユーロ 4,643 (−)	百株 140.45	千ユーロ 978
		オランダ	百株 8,803.64 (−)	千ユーロ 36,103 (△30)	百株 2,759.53	千ユーロ 14,396
		ベルギー	百株 842.99 (29.18)	千ユーロ 5,404 (−)	百株 495.99	千ユーロ 1,930
		ルクセンブルグ	百株 285.39 (−)	千ユーロ 674 (−)	百株 320.77	千ユーロ 345
		フランス	百株 11,204.29 (1,127.33)	千ユーロ 63,276 (△54)	百株 5,503.82	千ユーロ 25,024
		ドイツ	百株 10,320.16 (−)	千ユーロ 50,341 (△418)	百株 4,164.74	千ユーロ 19,120
		ポルトガル	百株 719.53 (−)	千ユーロ 488 (−)	百株 −	千ユーロ −
		スペイン	百株 18,213.25 (20,934.83)	千ユーロ 15,005 (△3)	百株 28,200.45	千ユーロ 6,356
		イタリア	百株 18,552.14 (−)	千ユーロ 10,406 (△5)	百株 8,292.23	千ユーロ 5,518
		フィンランド	百株 4,213.92 (−)	千ユーロ 6,141 (−)	百株 1,545.28	千ユーロ 2,284
		オーストリア	百株 322.73 (−)	千ユーロ 1,108 (−)	百株 363.32	千ユーロ 825

(注1) 金額は受渡代金です。
(注2) ( ) 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 投資信託受益証券、投資証券

	買	付	売	付
	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	8.155 (−)	1,306 (−)	3.108 (−)	468 (−)
BOSTON PROPERTIES INC	6.545 (−)	538 (−)	2.815 (−)	209 (−)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	45.188 (△136.345)	495 (−)	− (−)	− (−)
PROLOGIS INC	37.979 (20.182)	4,878 (−)	15.018 (−)	1,932 (−)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.166 (−)	1,077 (−)	1.59 (−)	318 (−)
CAMDEN PROPERTY TRUST	9.282 (−)	1,317 (−)	6.451 (−)	918 (−)
EQUINIX INC	4.367 (−)	2,935 (−)	1.67 (−)	1,084 (−)
DUKE REALTY TRUST	13.615 (△42.49)	715 (−)	6.431 (−)	318 (−)
CROWN CASTLE INC	18.68 (−)	3,038 (−)	6.544 (−)	1,097 (−)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3.231 (−)	895 (−)	1.018 (−)	291 (−)
EQUITY RESIDENTIAL	19.763 (−)	1,425 (−)	8.106 (−)	565 (−)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36.911 (−)	1,054 (−)	17.886 (−)	467 (−)
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.09 (−)	1,283 (−)	1.057 (−)	341 (−)
WELLTOWER INC	28.536 (−)	2,232 (−)	10.336 (−)	836 (−)
KIMCO REALTY	105.12 (−)	2,406 (−)	25.129 (−)	529 (−)
IRON MOUNTAIN INC	6.074 (−)	314 (−)	− (−)	− (−)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8.332 (−)	611 (−)	4.419 (−)	349 (−)
HOST HOTELS & RESORTS INC	16.161 (−)	274 (−)	− (−)	− (−)
MID AMERICA	3.977 (−)	659 (−)	2.098 (−)	323 (−)
REALTY INCOME CORP	38.458 (−)	2,557 (−)	15.04 (−)	960 (−)
REGENCY CENTERS CORP	4.646 (−)	286 (−)	− (−)	− (−)
UDR INC	17.665 (−)	844 (−)	4.438 (−)	211 (−)
SIMON PROPERTY GROUP INC	11.86 (−)	1,424 (−)	2.837 (−)	335 (−)
PUBLIC STORAGE	5.927 (−)	1,962 (−)	1.886 (−)	654 (−)
SUN COMMUNITIES INC	9.555 (−)	1,493 (−)	5.927 (−)	932 (−)
VENTAS INC	12.719 (−)	576 (−)	5.035 (−)	208 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
VORNADO REALTY TRUST	12.068 (−)	310 (−)	27.191 (−)	687 (−)
WEYERHAEUSER CO	24.493 (−)	908 (−)	6.784 (−)	266 (−)
EXTRA SPACE STORAGE INC	5.935 (−)	1,055 (−)	3.677 (−)	682 (−)
DIGITAL REALTY TRUST INC	10.392 (−)	1,294 (−)	1.494 (−)	199 (−)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	31.645 (−)	592 (−)	13.398 (−)	288 (−)
AGNC INVESTMENT CORP	47.312 (−)	585 (−)	91.632 (−)	1,120 (−)
AMERICAN TOWER CORP	22.373 (−)	5,285 (−)	8.587 (−)	1,995 (−)
WP CAREY INC	12.013 (−)	968 (−)	7.795 (−)	603 (−)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42.371 (−)	1,237 (−)	− (−)	− (−)
AMERICAN HOMES 4 RENT	42.177 (−)	1,528 (−)	− (−)	− (−)
INVITATION HOMES INC	21.439 (−)	759 (−)	− (−)	− (−)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30.095 (−)	1,452 (−)	− (−)	− (−)
VICI PROPERTIES INC	79.168 (−)	2,383 (−)	16.448 (−)	464 (−)
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	0.502 (−)	25 (−)	− (−)	− (−)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	0.957 (−)	24 (−)	− (−)	− (−)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
MIRVAC GROUP	18.677 (−)	48 (−)	− (−)	− (−)
GPT GROUP	11.931 (−)	59 (−)	− (−)	− (−)
STOCKLAND	15.847 (−)	66 (−)	− (−)	− (−)
DEXUS	62.787 (−)	503 (−)	− (−)	− (−)
GOODMAN GROUP	90.284 (−)	1,752 (−)	33.867 (−)	600 (−)
VICINITY CENTRES	173.934 (−)	349 (−)	− (−)	− (−)
SCENTRE GROUP	280.096 (−)	821 (−)	112.275 (−)	305 (−)
香港	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
LINK REIT	93.116 (−)	5,933 (−)	30.3 (−)	1,996 (−)
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	242.054 (−)	484 (△1)	− (−)	− (−)
CAPLAND ASCENDAS REIT	304.272 (−)	876 (△16)	112.2 (−)	312 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	487.1 (−)	838 (△15)	497.5 (−)	896 (−)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	− (6.265)	− (7)	6.265 (−)	7 (−)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	213.2 (−)	366 (△2)	− (−)	− (−)
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	79.077 (−)	413 (−)	35.736 (−)	171 (−)
LAND SECURITIES GROUP PLC	3.064 (−)	23 (−)	− (−)	− (−)
SEGRO PLC	44.721 (−)	425 (−)	− (−)	− (−)
ユーロ（ベルギー）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW	27.206 (−)	846 (−)	− (−)	− (−)
ユーロ（フランス）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
GECINA SA	0.282 (−)	30 (−)	− (−)	− (−)
KLEPIERRE	8.18 (−)	172 (△30)	− (−)	− (−)
COVIVIO	0.403 (−)	28 (−)	− (−)	− (−)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	0.615 (−)	39 (−)	− (−)	− (−)

（注１）金額は受渡代金です。
（注２）（ ）内は、合併、分割等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 223,972	百万円 217,712	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	399,100,709千円
(b)期中の平均組入株式時価総額	716,444,920千円
(c)売買高比率 (a)／(b)	0.55

(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２月16日から2023年２月15日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	0.124	0.124	100.0	0.124	0.124	100.0

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	444.06	11,415.95	113,817	15,113,762	インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,727.2	2,180.54	23,388	3,105,755	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	654.52	795.05	2,090	277,555	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	42.71	–	–	–	ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	873.09	1,124.58	15,295	2,031,077	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,223.07	2,016.32	17,330	2,301,286	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	464.19	584.05	22,071	2,930,841	ソフトウェア
CHUBB LTD	429.3	521.17	11,117	1,476,305	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	216.51	277.73	7,817	1,038,128	化学
ALLEGHANY CORP	12.56	–	–	–	保険
ALLSTATE CORP	305.8	329.39	4,448	590,660	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	674.78	837.7	16,837	2,235,887	コングロマリット
AMGEN INC	552.91	666.76	16,070	2,134,056	バイオテクノロジー
HESS CORP	269.32	352.71	5,219	693,131	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	655.69	795.36	14,397	1,911,858	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	484.16	626.53	5,668	752,765	電力
AFLAC INC	624.14	726.73	5,029	667,893	保険
AMERICAN INTL GROUP	830.45	938.43	5,773	766,626	保険
AMERCO	9.29	–	–	–	陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	518.67	633.36	11,561	1,535,232	半導体・半導体製造装置
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	696.42	864.52	5,635	748,378	建設関連製品
VALERO ENERGY CORP	422.88	484.9	6,773	899,462	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	83.94	108.31	2,970	394,482	ソフトウェア
APPLE INC	16,106.99	20,001.34	306,420	40,689,582	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	881.06	1,068.03	12,649	1,679,759	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	111.8	139.61	3,779	501,845	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	544.75	694.12	5,676	753,784	食品
AMEREN CORP	254.36	316.21	2,694	357,750	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	62.95	99.36	1,253	166,468	電子装置・機器・部品
AUTODESK INC	214.23	269.07	6,135	814,782	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	413.9	518.47	11,644	1,546,248	情報技術サービス
AUTOZONE INC	20.86	24.51	6,240	828,730	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	80.95	95.14	1,752	232,762	容器・包装
BALL CORP	315.98	402.23	2,289	304,075	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,292.71	1,619.51	50,332	6,683,686	各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	794.62	969.68	5,014	665,837	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	484.18	631.74	2,521	334,800	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	280.24	350.61	8,534	1,133,256	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	226.36	289.58	4,180	555,150	電気設備
VERIZON COMM INC	4,048.08	5,240.12	21,133	2,806,304	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	128.04	291.91	1,957	259,942	保険
BEST BUY CO INC	212.38	254.05	2,243	297,916	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	23.24	30.21	1,397	185,543	ライフサイエンス・ツール／サービス
YUM! BRANDS INC	286.66	353.37	4,623	613,906	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	518.27	672.13	2,699	358,525	電力
BOEING CO	542.08	702.82	15,353	2,038,738	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	112.38	144.56	1,209	160,613	専門サービス
BORGWARNER INC	209.23	278	1,381	183,433	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,387.96	1,753.52	8,290	1,100,914	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	123.82	144.94	1,521	202,031	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	107.92	195.29	2,189	290,678	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	22.29	27.31	4,220	560,471	ライフサイエンス・ツール／サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,157.51	2,659.49	19,214	2,551,535	医薬品
ONEOK INC	420.2	569.8	3,975	527,905	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	74.44	97.09	1,276	169,524	保険
UNITED RENTALS INC	69.35	88.83	4,056	538,628	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	310.48	385.67	6,049	803,277	総合公益事業
FEDEX CORP	247.48	309.91	6,590	875,199	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	103.4	118.5	2,533	336,458	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	581.23	743.44	6,001	796,977	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	297.33	384.05	2,508	333,067	飲料
QUANTA SERVICES INC	－	175.6	2,707	359,562	建設・土木
SIRIUS XM HOLDINGS INC	971.36	1,017.65	473	62,837	メディア
CSX CORP	2,203.61	2,635.36	8,285	1,100,241	陸運・鉄道
COTERRA ENERGY INC	785.16	999.16	2,552	338,993	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	203.34	269.78	1,376	182,774	食品
CONSTELLATION BRANDS INC	164.21	193.43	4,366	579,851	飲料
CARDINAL HEALTH INC	290.05	344.21	2,710	359,947	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
CARLISLE COS INC	－	61.19	1,572	208,847	建設関連製品
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	763.02	1,322.91	1,571	208,695	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	532.89	658.5	16,091	2,136,737	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	102.58	126.31	1,591	211,285	ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	115.3	－	－	－	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	921.88	970.73	381	50,658	各種電気通信サービス
CERNER CORP	285.28	－	－	－	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,913.79	3,650.43	52,274	6,941,485	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	245.63	302.36	2,503	332,405	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	144.65	198.78	2,500	332,008	保険
CINTAS CORP	89.31	111.73	4,950	657,366	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	4,107.04	5,161.36	24,619	3,269,248	通信機器
CLEVELAND-CLIFFS INC	－	693.71	1,415	188,012	金属・鉱業
CLOROX COMPANY	114.55	157.94	2,411	320,192	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	4,005.62	5,108.54	30,441	4,042,365	飲料
COPART INC	203.22	540.11	3,741	496,884	商業サービス・用品
COGNEX CORP	162.62	204.32	1,130	150,119	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	784.14	988.65	7,234	960,727	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	265.14	345.46	6,262	831,551	ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	55.04	74.34	2,214	294,085	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
NRG ENERGY, INC.	227.63	283.64	995	132,202	電力
COMCAST CORP-CL A	4,460.29	5,492.1	21,452	2,848,630	メディア
CONAGRA BRANDS INC	454.72	619.81	2,235	296,790	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	340.89	438.55	3,995	530,521	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	272.38	366.03	2,238	297,268	総合公益事業
COOPER COS INC	47.32	63.42	2,140	284,294	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	169.84	252.81	1,305	173,392	飲料
CORNING INC	838.66	957.58	3,388	450,008	電子装置・機器・部品
WOLFSPEED INC	－	156.84	1,269	168,530	半導体・半導体製造装置
SEALED AIR CORP	133.82	176.1	895	118,862	容器・包装
HEICO CORP-CL A	74.77	94.63	1,295	172,014	航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CUMMINS INC	139.26	178.03	4,422	587,256	機械
DARLING INTERNATIONAL INC	−	200.32	1,369	181,867	食品
DR HORTON INC	327.87	406.02	4,026	534,678	家庭用耐久財
DANAHER CORP	625.65	861.23	22,068	2,930,430	ライフサイエンス・ツール／サービス
MOODY'S CORP	163.35	206.82	6,392	848,818	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	512.62	629.06	4,240	563,095	情報技術サービス
TARGET CORP	474.94	577.14	9,878	1,311,819	複合小売り
DEERE & CO	286.89	362.03	14,818	1,967,715	機械
MORGAN STANLEY	1,330.94	1,604.05	16,130	2,141,946	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	215.52	270.24	3,374	448,062	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	412.01	500.52	3,842	510,310	専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,767.79	2,274.04	24,482	3,251,006	娯楽
DOLLAR TREE INC	231.67	281.49	4,136	549,247	複合小売り
DOVER CORP	141.72	178.42	2,777	368,890	機械
OMNICOM GROUP	203.13	265.7	2,475	328,760	メディア
DTE ENERGY CO	184.19	237.92	2,705	359,216	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	753.03	964.73	9,596	1,274,275	電力
DARDEN RESTAURANTS INC	133.37	156.76	2,293	304,561	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	628.16	676.67	3,302	438,492	インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	7,384.33	9,008.68	32,088	4,261,087	銀行
CITIGROUP INC	1,979.43	2,418.65	12,482	1,657,571	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	133.26	167.9	1,483	197,002	化学
EATON CORP PLC	390.25	496.76	8,592	1,140,992	電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	268.13	343.37	6,836	907,772	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	226.45	244.16	342	45,455	メディア
ECOLAB INC	252.97	325.5	5,155	684,654	化学
PERKINELMER INC	118.35	156.49	2,159	286,705	ライフサイエンス・ツール／サービス
ELECTRONIC ARTS INC	275.61	348.38	3,910	519,283	娯楽
SALESFORCE INC	953.48	1,248.76	21,223	2,818,324	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	22.43	33.72	803	106,640	保険
EMERSON ELECTRIC CO	583.88	738.89	6,353	843,709	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	124.29	175.67	2,033	270,059	ガス
ENTERGY CORP	188.13	260.97	2,768	367,646	電力
EOG RESOURCES INC	567.51	734.98	9,784	1,299,322	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	116.63	151.56	3,244	430,809	専門サービス
EQT CORP	−	409.96	1,274	169,195	石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	226.64	289.95	7,408	983,814	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	163.66	199.74	2,259	300,007	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	4,127.07	5,193.82	60,466	8,029,340	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	121.83	155.34	1,998	265,353	化学
NEXTERA ENERGY INC	1,911.83	2,449.25	18,621	2,472,768	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	38.74	47.16	2,027	269,169	資本市場
FAIR ISAAC CORP	28.1	29.62	2,067	274,563	ソフトウェア
ASSURANT INC	55.23	58.23	758	100,714	保険
FASTENAL CO	549.13	729.41	3,846	510,830	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	666.81	843.62	3,137	416,618	銀行
M&T BANK CORP	121.75	207.66	3,335	442,912	銀行
FIRST HORIZON CORP	−	696.34	1,719	228,393	銀行
FISERV INC	576.52	760.76	8,825	1,171,948	情報技術サービス
FORD MOTOR CO	3,805.63	4,943.79	6,412	851,462	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	276.05	379.16	1,202	159,655	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
FREEPORT-MCMORAN INC	1,425.79	1,801.8	7,744	1,028,343	金属・鉱業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	11.92	15.87	1,219	161,930	銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	200.01	262.69	4,945	656,665	保険
DENTSPLY SIRONA INC	202.22	255.99	946	125,739	ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	231.98	287.25	6,666	885,206	航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	588.18	749.19	5,645	749,619	食品
GENUINE PARTS CO	136.11	173.74	3,068	407,455	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,218.49	1,563.88	13,399	1,779,296	バイオテクノロジー
GARTNER INC	88.55	95.64	3,272	434,607	情報技術サービス
MCKESSON CORP	150.01	179.8	6,577	873,490	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	2,433.72	3,102.42	71,265	9,463,370	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	1,070.26	1,369.1	11,437	1,518,780	コングロマリット
WW GRAINGER INC	41.48	54.66	3,643	483,794	商社・流通業
NUANCE COMMUNICATIONS INC	309.23	−	−	−	ソフトウェア
HALLIBURTON CO	838.43	1,115.7	4,346	577,207	エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	386.22	497.39	5,185	688,554	飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	329.9	424.3	15,774	2,094,712	資本市場
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	193.75	243.2	5,176	687,453	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	121.84	154.37	897	119,118	レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	143.58	174.31	1,551	205,958	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	35.96	51.85	907	120,455	航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	152.45	186.95	4,466	593,071	食品
HP INC	1,162.73	1,259.55	3,829	508,457	コンピュータ・周辺機器
F5 INC	55.57	69.24	1,019	135,368	通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	123.36	153.22	1,313	174,365	容器・包装
JUNIPER NETWORKS INC	352.9	437.15	1,370	182,042	通信機器
HOLOGIC INC	243.1	306.95	2,552	338,918	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT INC	1,028.3	1,275.83	40,626	5,394,760	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	198.15	228.8	2,487	330,377	バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	290.21	388.51	1,747	232,104	食品
CENTERPOINT ENERGY INC	611.05	787.91	2,307	306,346	総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	34.21	36.02	952	126,450	建設関連製品
HUBBELL INC	−	69.03	1,694	224,964	電気設備
HUMANA INC	125.74	158.44	7,948	1,055,496	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	87.52	103.48	2,011	267,058	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,419.2	1,814.91	2,785	369,937	銀行
BIOGEN INC	143.44	176.03	5,088	675,725	バイオテクノロジー
IDEX CORP	73.32	90.65	2,042	271,263	機械
ILLINOIS TOOL WORKS	307.86	387.9	9,233	1,226,177	機械
INTUIT INC	266.2	335.01	14,136	1,877,174	ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	82.25	101.62	5,118	679,631	ヘルスケア機器・用品
TRANE TECHNOLOGIES PLC	230.51	292.93	5,439	722,261	建設関連製品
INTEL CORP	3,947.83	5,124.32	14,676	1,948,833	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	239.91	319.79	3,070	407,790	化学
INTERNATIONAL PAPER CO	343.88	441.53	1,728	229,539	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	369.48	456.79	1,716	227,949	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	131.48	−	−	−	専門サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	77.48	95.06	1,583	210,248	情報技術サービス
INCYTE CORP	179.58	244.49	1,940	257,648	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,569.27	3,270.95	53,002	7,038,198	医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	328	394.02	3,056	405,913	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
KLA CORPORATION	147.87	177.34	7,134	947,446	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	624.62	783.84	5,011	665,526	石油・ガス・消耗燃料
KELLOGG CO	265.78	329.41	2,213	293,948	食品
KEYCORP	916.12	1,189.55	2,293	304,547	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	326.7	421.73	5,422	720,067	家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	147.89	188.14	13,718	1,821,643	資本市場
KROGER CO	684.81	827.75	3,611	479,567	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	138.76	172.6	8,909	1,183,130	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	44.17	58.9	2,600	345,272	電子装置・機器・部品
PACKAGING CORP OF AMERICA	105.55	110.29	1,573	208,887	容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	152.64	200.36	1,758	233,572	情報技術サービス
PLUG POWER INC	526.24	561.49	887	117,879	電気設備
LENNAR CORP	264.83	323.61	3,367	447,211	家庭用耐久財
ELI LILLY & CO	791.98	1,006.41	34,978	4,644,832	医薬品
BATH & BODY WORKS INC	269.67	281.56	1,265	167,985	専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	170.02	179.37	622	82,602	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	709.53	911.89	17,031	2,261,595	航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	292.04	371.89	5,691	755,761	ライフサイエンス・ツール／サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	244.24	296.95	14,300	1,898,965	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	223.94	235.3	1,453	193,034	保険
LOWE'S COS INC	674.34	774.78	16,561	2,199,227	専門小売り
DOMINION ENERGY INC	787.03	1,018.28	5,912	785,072	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	387	404.01	1,783	236,804	ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	249.05	320.31	2,399	318,621	食品
MCDONALD'S CORPORATION	727.78	914.13	24,371	3,236,307	ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	233.63	425.05	15,508	2,059,357	資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	42.82	53.53	2,032	269,871	保険
MARKEL CORPORATION	14.47	16.74	2,256	299,616	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	605.91	776.95	5,950	790,188	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	495.58	621.47	10,378	1,378,167	保険
MASCO CORP	232.33	289.37	1,603	212,992	建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	58.93	77.36	2,755	365,911	建設資材
METLIFE INC	714.43	847.99	6,109	811,316	保険
MEDTRONIC PLC	1,313.85	1,660.79	13,850	1,839,272	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	756.57	974.96	7,485	994,031	娯楽
CVS HEALTH CORP	1,287.35	1,636.16	14,483	1,923,235	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	2,465.91	3,156.72	34,326	4,558,172	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	413.6	543.62	4,722	627,163	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	92.82	114.55	2,793	370,952	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	6,957.86	8,819.04	240,027	31,873,293	ソフトウェア
MICRON TECH INC	1,090.85	1,356.54	8,420	1,118,097	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	533.22	695.97	5,907	784,442	半導体・半導体製造装置
3M CO	566.66	693.96	7,925	1,052,455	コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	59.63	63.11	739	98,176	家庭用耐久財
ENTEGRIS INC	136.39	177.09	1,507	200,213	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	54.58	64.45	1,622	215,447	ライフサイエンス・ツール／サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	163.01	205.78	5,564	738,936	通信機器
ILLUMINA INC	142.46	198.33	4,221	560,514	ライフサイエンス・ツール／サービス
XCEL ENERGY INC	516.15	693.25	4,712	625,801	電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	97.13	117.16	1,205	160,119	バイオテクノロジー
NETAPP INC	212.2	282.65	1,914	254,174	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NEWELL BRANDS INC	404.89	419.84	625	83,068	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	774.43	992.87	4,667	619,794	金属・鉱業
NOVAVAX INC	78.86	–	–	–	バイオテクノロジー
NVR INC	3.38	4.05	2,073	275,348	家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	1,245.17	1,574.85	19,874	2,639,149	繊維・アパレル・贅沢品
NORDSON CORP	47.87	64.47	1,565	207,834	機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	242.35	289.97	6,822	905,948	陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	328.72	430.42	3,395	450,899	電力
NISOURCE INC	420.35	532.7	1,434	190,495	総合公益事業
NORTHERN TRUST CORP	200.11	248.36	2,417	320,991	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	148.6	183.61	8,583	1,139,862	航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	4,001.7	4,724.91	22,915	3,042,990	銀行
NUCOR CORP	282.85	316.6	5,422	719,999	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	231.2	285.54	4,248	564,164	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	430.6	466.54	5,381	714,614	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	902.66	1,147.44	7,612	1,010,813	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	95.78	116.3	4,171	553,942	陸運・鉄道
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	66.72	77.57	6,678	886,874	専門小売り
ORACLE CORP	1,632.21	1,992.12	17,747	2,356,729	ソフトウェア
PACCAR INC	359.38	648.01	4,743	629,880	機械
PTC INC	110.92	136.65	1,836	243,806	ソフトウェア
EXELON CORP	956.45	1,216.64	5,113	679,026	電力
PARKER HANNIFIN CORP	125.93	161.01	5,673	753,342	機械
PAYCHEX INC	313.87	405.19	4,616	613,056	情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	73.03	96.51	3,199	424,861	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	734.82	887.37	2,532	336,297	電力
PEPSICO INC	1,349.24	1,714.95	30,143	4,002,778	飲料
PENTAIR PLC	163.39	198.04	1,116	148,319	機械
PFIZER INC	5,460.72	6,989.45	30,557	4,057,780	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	215.43	327.96	1,504	199,806	水道
CONOCOPHILLIPS	1,306.12	1,591.69	18,073	2,399,998	石油・ガス・消耗燃料
PG&E CORP	1,524.96	1,782.57	2,777	368,790	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	222.38	284.45	6,648	882,809	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,796.13	2,244.42	10,640	1,412,991	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	415.17	510.1	8,219	1,091,433	銀行
BROWN & BROWN INC	217.93	306.5	1,755	233,048	保険
GARMIN LTD	145.29	199.11	1,937	257,285	家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	230.64	283.41	3,678	488,414	化学
IPG PHOTONICS CORP	33.53	–	–	–	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	429.9	551.82	27,768	3,687,403	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	218.51	277.07	3,349	444,816	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	124.93	145.36	2,101	279,092	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,369.3	2,967.79	41,335	5,488,924	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	569.36	731.78	10,191	1,353,329	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	490.59	601	3,675	488,098	総合公益事業
PULTE GROUP INC	238.14	290.5	1,640	217,874	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	283.31	336.53	3,909	519,183	情報技術サービス
QUALCOMM INC	1,096.16	1,401.58	18,548	2,463,056	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	197.29	234.37	2,677	355,537	資本市場
EXACT SCIENCES CORP	179.82	233.86	1,532	203,467	バイオテクノロジー
REGENERON PHARMACEUTICALS	101.93	133.97	10,104	1,341,730	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
REPLIGEN CORP	−	67.3	1,267	168,332	ライフサイエンス・ツール／サービス
RESMED INC	140.92	186.28	3,984	529,155	ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,379.88	1,766	8,676	1,152,133	銀行
SEAGEN INC	128.63	168.6	2,374	315,262	バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	370.32	458.51	3,039	403,549	保険
ROSS STORES INC	342.98	441.71	5,159	685,086	専門小売り
ROLLINS INC	191.56	259.2	923	122,669	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	103.18	131.2	5,599	743,503	ソフトウェア
ROCKWELL AUTOMATION INC	111.67	146.33	4,289	569,663	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	212.92	274.77	2,070	275,000	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	128.97	164.67	1,467	194,830	化学
ACCENTURE PLC-CL A	618.55	788.43	22,452	2,981,417	情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,364.94	1,686.45	11,073	1,470,414	食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	124.53	132.32	3,195	424,299	保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	241.52	295.95	5,449	723,616	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	599.27	750.43	5,088	675,723	情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	39.84	49.56	12,246	1,626,215	ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,365.54	1,774.1	10,080	1,338,581	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,406.74	1,813.79	14,649	1,945,371	資本市場
POOL CORP	43.36	46.6	1,749	232,254	販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	200.7	261.44	3,312	439,894	ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	135.81	186.42	1,863	247,448	食品
SEI INVESTMENTS CO	102.94	144.77	904	120,111	資本市場
ELEVANCE HEALTH INC	238.09	299.28	14,709	1,953,209	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	149.22	191.04	3,006	399,194	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	257.42	319.21	2,936	389,883	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	243.75	304.76	7,068	938,680	化学
CENTENE CORP	563.86	700.8	5,142	682,868	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	56.17	73.3	2,277	302,488	銀行
SMITH (A.O.) CORP	140.37	148.56	1,002	133,119	建設関連製品
SNAP-ON INC	57.83	70.68	1,782	236,704	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	375.64	467.76	4,830	641,449	保険
ADVANCE AUTO PARTS	56.94	71.65	1,080	143,439	専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	362.4	485.33	3,277	435,274	電力
SOUTHERN CO	1,035.27	1,360.27	9,066	1,203,900	電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,291.44	1,653.26	8,071	1,071,776	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	132.2	197	699	92,892	旅客航空輸送業
AT&T INC	6,960.38	8,882.01	17,009	2,258,631	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,886.45	2,316.39	39,916	5,300,449	石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	153.85	192.7	1,718	228,148	機械
STATE STREET CORP	351.58	461.98	4,323	574,078	資本市場
STARBUCKS CORP	1,144.57	1,428.19	15,421	2,047,833	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	219.29	229.37	2,901	385,294	金属・鉱業
STRYKER CORP	331.3	426.35	11,283	1,498,373	ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	430.24	554.71	19,967	2,651,463	娯楽
GEN DIGITAL INC	552.31	730.86	1,549	205,747	ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	158.87	203.18	1,236	164,147	陸運・鉄道
SYNOPSYS INC	147.52	187.79	7,059	937,467	ソフトウェア
SYSCO CORP	496.62	625.21	4,862	645,742	食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	346.96	446.32	10,760	1,428,864	ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	44.66	55.32	1,356	180,166	ヘルスケア機器・用品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	1,057.57	1,347.81	1,381	183,450	医薬品
TERADYNE INC	154.54	185.12	1,999	265,511	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	895.92	1,137.01	20,050	2,662,444	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	206.83	258.24	1,926	255,781	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	382.78	487.95	27,885	3,702,897	ライフサイエンス・ツール／サービス
GLOBE LIFE INC	91.68	121.53	1,466	194,769	保険
DAVITA INC	64.97	68.13	564	74,990	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	109.61	136.9	3,258	432,640	専門小売り
BIO-TECHNE CORP	42.2	206.52	1,590	211,163	ライフサイエンス・ツール／サービス
TRIMBLE INC	260.37	286.76	1,594	211,756	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	39.35	53	1,728	229,568	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	277.88	356.84	2,172	288,525	食品
UGI CORP	184.69	241.6	953	126,563	ガス
MARATHON OIL CORP	－	840.59	2,283	303,165	石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	637.38	777.69	15,867	2,107,006	陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,472.36	1,830.61	18,556	2,464,169	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	920.02	1,165.09	57,419	7,624,686	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	77.37	80.96	1,200	159,475	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
VF CORP	356.87	378.87	1,046	138,956	繊維・アパレル・贅沢品
PARAMOUNT GLOBAL	570.34	786.63	1,765	234,505	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	250.92	321.4	9,650	1,281,428	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	126.76	164.52	3,053	405,429	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	704.44	917.06	3,370	447,528	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,502.63	1,878.96	27,336	3,630,078	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	406.53	505.78	7,654	1,016,437	商業サービス・用品
WATERS CORP	57.5	75.11	2,548	338,432	ライフサイエンス・ツール／サービス
WEBSTER FINANCIAL CORP	204.18	222.85	1,228	163,142	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	71.03	96.41	2,661	353,394	ライフサイエンス・ツール／サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	99.44	126.79	1,864	247,563	食品
VAIL RESORTS INC	41.8	52.35	1,338	177,799	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	293.01	407.23	1,777	235,987	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	170.97	202.73	2,097	278,492	機械
WHIRLPOOL CORP	57.37	68.32	1,028	136,600	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	159.24	188.33	2,293	304,526	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	120.04	127.57	1,391	184,781	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	110.34	415.96	2,438	323,789	資本市場
CME GROUP INC	348.92	443.42	8,264	1,097,496	資本市場
WILLIAMS COS INC	1,163.01	1,518.9	4,848	643,809	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	287.85	315.04	1,808	240,211	販売
ALLIANT ENERGY CORP	238.72	339.66	1,810	240,356	電力
WEC ENERGY GROUP INC	305.23	383.18	3,513	466,592	総合公益事業
CARMAX INC	152.87	186.73	1,417	188,225	専門小売り
XILINX INC	253.18	－	－	－	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	1,168.23	1,452.28	11,722	1,556,671	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	56.09	67.3	2,145	284,868	電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,087	1,560.49	749	99,464	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	204	173.28	891	118,385	コングロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	108.82	150.92	3,394	450,734	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	56.1	79.96	1,040	138,191	銀行
CBRE GROUP INC	323.38	410.89	3,652	485,056	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	145.97	157.79	331	44,043	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
REGIONS FINANCIAL CORP	974.23	1,172.22	2,795	371,246	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	38.08	41.15	1,430	189,928	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	40.44	53.87	2,804	372,377	半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CORP	－	41.87	519	69,048	化学
T-MOBILE US INC	607.01	784.34	11,568	1,536,145	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	367.69	429.72	2,473	328,451	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	385.15	425.61	2,126	282,414	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	39.59	48.71	1,734	230,319	資本市場
CELANESE CORP	109.17	138.41	1,689	224,376	化学
DEXCOM INC	93.5	487.1	5,774	766,805	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	130.68	－	－	－	メディア
EXPEDIA GROUP INC	136.45	191.86	2,205	292,859	ホテル・レストラン・レジャー
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	202.05	240.27	2,055	272,887	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	108.96	131.23	4,629	614,685	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	360.34	783	103,977	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	551.66	698.96	7,576	1,006,113	資本市場
LIVE NATION	153.12	204.44	1,596	211,968	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	27.13	34.74	5,713	758,637	ホテル・レストラン・レジャー
TRANSDIGM GROUP INC	50.93	61.48	4,645	616,931	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	858.46	1,074.66	39,758	5,279,480	情報技術サービス
WESTERN UNION CO	448.68	467.12	658	87,460	情報技術サービス
OWENS CORNING	97.4	132.27	1,367	181,630	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	123.03	151.08	1,439	191,089	専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	－	178.61	1,125	149,444	商社・流通業
FIRST SOLAR INC	－	119.03	1,964	260,862	半導体・半導体製造装置
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	－	－	－	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	117.8	153	2,211	293,680	情報技術サービス
DELTA AIR LINES INC	147.23	215.92	844	112,107	旅客航空輸送業
INSULET CORP	64.81	88.34	2,590	343,943	ヘルスケア機器・用品
DISCOVER FINANCIAL	286.45	332.36	3,833	509,086	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	318.46	387.62	5,143	683,034	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	54.04	56.88	939	124,762	ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	114.58	145.47	4,653	617,910	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	213.2	266.9	3,128	415,482	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	43.13	57.15	6,471	859,304	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	52.74	60.73	3,186	423,095	専門小売り
INVESCO LTD	369.04	385.3	732	97,211	資本市場
MSCI INC	79.74	98.07	5,509	731,642	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,520.6	1,930.16	19,631	2,606,887	タバコ
VISA INC	1,644.41	2,035.26	46,686	6,199,544	情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	709.52	928.16	3,284	436,183	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	173.37	228.09	3,405	452,231	水道
DISCOVERY INC-C	303.88	－	－	－	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	618.96	631.37	8,121	1,078,512	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	127.87	161.82	1,052	139,736	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,960.57	2,578.77	4,721	626,998	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	170.83	228.48	2,452	325,668	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	261.91	333.42	3,338	443,323	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.82	47.13	1,018	135,300	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	156.99	208.98	2,227	295,764	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	53.99	70.9	2,563	340,345	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ZILLOW GROUP INC	76.58	－	－	－	不動産管理・開発
HCA HEALTHCARE INC	250.49	287.52	7,443	988,474	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	146.24	189.74	3,354	445,508	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	61.52	77.92	1,174	155,918	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	73.99	88.44	1,857	246,622	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	169.47	224.34	3,036	403,238	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	258.51	321.09	6,093	809,217	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	136.87	163.43	1,550	205,885	専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	－	258.3	1,994	264,861	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	52.16	69.11	981	130,397	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	105.27	127.09	1,608	213,569	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	215.54	310.59	1,939	257,605	情報技術サービス
DOLLAR GENERAL CORP	225.66	278.99	6,455	857,195	複合小売り
FORTINET INC	134.08	811.66	4,966	659,507	ソフトウェア
HORIZON PHARMA PLC	204.15	276.13	3,025	401,690	バイオテクノロジー
TESLA INC	819.66	3,319.53	69,461	9,223,748	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	59.93	69.14	865	114,956	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	122.17	170.46	3,551	471,608	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,267.27	1,712.1	7,264	964,645	自動車
ALLY FINANCIAL INC	374.66	392.3	1,279	169,876	消費者金融
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	－	96.61	2,367	314,332	資本市場
APTIV PLC	260.18	343.1	4,154	551,734	自動車部品
PHILLIPS 66	424.28	594.04	6,412	851,537	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	86.28	－	－	－	ソフトウェア
META PLATFORMS INC	2,321.43	2,845.33	51,067	6,781,317	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	185.72	225.14	5,112	678,856	ライフサイエンス・ツール／サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	157.27	200.87	3,010	399,756	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	192.63	253.33	11,687	1,551,967	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	94.41	369.42	6,285	834,626	ソフトウェア
WORKDAY INC	186.02	255.47	4,842	642,992	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,721.56	2,201.98	33,600	4,461,745	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	460.53	587.56	10,100	1,341,199	医薬品
NEWS CORP/NEW-CL A	383.72	542.11	1,020	135,479	メディア
CDW CORP	129.43	164.65	3,426	454,965	電子装置・機器・部品
HOWMET AEROSPACE INC	404.34	475.9	2,047	271,863	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	158.35	210.9	1,309	173,913	情報技術サービス
COUPA SOFTWARE INC	77.32	－	－	－	ソフトウェア
SNAP INC	1,027.74	1,273.18	1,381	183,436	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	418.52	532.3	2,657	352,855	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	221.57	224.66	1,597	212,169	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	83.24	88.45	310	41,225	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	143.46	198.71	695	92,406	メディア
OKTA INC	116.92	178.28	1,377	182,951	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	167.75	176.53	1,122	149,087	ソフトウェア
BAKER HUGHES CO	779.09	1,262.92	4,099	544,364	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	－	181.67	1,803	239,478	食品
BROADCOM INC	398.94	502.59	30,271	4,019,752	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	73.05	－	－	－	ソフトウェア
ARES MANAGEMENT CORP	－	195.34	1,639	217,707	資本市場
MONGODB INC	61.01	90.21	2,064	274,091	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	68.61	84.53	1,944	258,157	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	404.49	613.21	790	104,960	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	132.96	168.56	2,898	384,832	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	829.81	–	–	–	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	159.85	242.12	1,267	168,375	電気設備
EVERGY INC	223.98	282.26	1,711	227,324	電力
ALLEGION PLC	89.24	101.4	1,215	161,390	建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	133.6	183.14	1,420	188,595	ソフトウェア
STERIS PLC	96.49	125.24	2,440	324,030	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	185.2	263.62	1,677	222,778	ソフトウェア
WIX.COM LTD	55.67	58.55	508	67,586	情報技術サービス
DROPBOX INC	281.7	304.79	731	97,135	ソフトウェア
KKR & CO INC	503.37	674.3	3,951	524,706	資本市場
FUTU HOLDINGS LTD ADR	47.58	50.5	241	32,107	資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	209	279.21	2,175	288,824	ソフトウェア
MODERNA INC	334.13	416.26	7,310	970,742	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	266.16	344.09	5,208	691,635	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	213.87	311.33	1,214	161,273	ホテル・レストラン・レジャー
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	571.24	–	–	–	娯楽
CIGNA CORP	331.11	382.14	11,439	1,519,083	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	277.83	327.7	1,410	187,246	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	722.56	876.67	5,238	695,684	化学
OVINTIV INC	–	316.03	1,540	204,540	石油・ガス・消耗燃料
AMCOR PLC	1,618.22	1,887.89	2,152	285,789	容器・包装
PINTEREST INC	521.77	697.46	1,721	228,575	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PELOTON INTERACTIVE INC	254.18	–	–	–	レジャー用品
FOX CORP-A	346.81	365.01	1,305	173,327	メディア
FOX CORP-B	150.8	155.11	513	68,238	メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	408.46	425.86	462	61,413	専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	182.31	257.23	2,991	397,286	ソフトウェア
CHEWY INC	90.68	96.48	462	61,354	インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	486.39	782.14	1,899	252,172	ライフサイエンス・ツール／サービス
LYFT INC	245.89	–	–	–	陸運・鉄道
DYNATRACE INC	194.17	254.29	1,128	149,824	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	225.54	297.7	2,035	270,316	情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	98.86	138	1,027	136,466	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	798.71	1,018.98	4,598	610,655	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	422.26	528.55	4,457	591,879	機械
INMODE LTD	55.11	–	–	–	ヘルスケア機器・用品
UBER TECHNOLOGIES INC	1,191.09	1,815.6	6,396	849,372	陸運・鉄道
CORTEVA INC	717.05	905.9	5,632	747,990	化学
MATCH GROUP INC	253.22	352.59	1,588	210,879	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FERGUSON PLC	–	257.02	3,789	503,173	商社・流通業
BILL.COM HOLDINGS INC	78.3	119.88	1,163	154,508	ソフトウェア
BLACKSTONE INC	665.78	880.26	8,518	1,131,141	資本市場
FIVERR INTERNATIONAL LTD	32.02	–	–	–	専門サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	–	53.22	1,155	153,398	ソフトウェア
CARLYLE GROUP INC	170.2	245.3	866	115,081	資本市場
10X GENOMICS INC	76.67	–	–	–	ライフサイエンス・ツール／サービス
DATADOG INC	183.67	291.79	2,494	331,207	ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	209.24	256.89	1,861	247,178	コンピュータ・周辺機器
UPSTART HOLDINGS INC	20.8	–	–	–	消費者金融

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	
INGERSOLL RAND INC	405.29	514.79	2,956	392,585	機械
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	−	441.35	3,204	425,544	ヘルスケア機器・用品
PAYCOM SOFTWARE INC	52.5	63.41	2,058	273,395	ソフトウェア
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	177.12	383.42	747	99,232	自動車
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	−	92.67	196	26,087	海運業
ASANA INC	71.34	−	−	−	ソフトウェア
UNITY SOFTWARE INC	53.67	308.39	1,224	162,657	ソフトウェア
AON PLC	220.29	263.41	8,229	1,092,859	保険
SOFI TECHNOLOGIES INC	547.34	−	−	−	消費者金融
WARNER BROS DISCOVERY INC	−	2,917.78	4,297	570,716	娯楽
TEXAS PACIFIC LAND CORP	−	7.36	1,419	188,484	石油・ガス・消耗燃料
BENTLEY SYSTEMS INC	160.02	225.66	924	122,708	ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	39.76	130.94	772	102,638	資本市場
AFFIRM HOLDINGS INC	92.04	185.28	242	32,230	情報技術サービス
IAC INC	72.5	−	−	−	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AIRBNB INC	227.11	471.77	5,702	757,206	ホテル・レストラン・レジャー
ZENDESK INC	119.15	−	−	−	ソフトウェア
CONSTELLATION ENERGY CORP	318.81	412.24	3,547	471,104	電力
ROYALTY PHARMA PLC	355.64	417.75	1,587	210,797	医薬品
ROBLOX CORP	−	450.19	1,605	213,237	娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	235.77	296.56	796	105,814	インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,248.58	1,508.26	1,781	236,532	医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	218.14	264.44	1,409	187,127	ホテル・レストラン・レジャー
DRAFTKINGS INC	334.59	−	−	−	ホテル・レストラン・レジャー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	−	126.87	1,064	141,296	石油・ガス・消耗燃料
HF SINCLAIR CORP	−	202.99	1,123	149,223	石油・ガス・消耗燃料
SNOWFLAKE INC	203.94	285.82	4,888	649,089	情報技術サービス
DOORDASH INC	109.22	295.75	1,822	241,958	インターネット販売・通信販売
OAK STREET HEALTH INC	91.44	−	−	−	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	218.59	293.67	4,154	551,643	通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	371.77	504.82	3,617	480,373	各種金融サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	1,532.71	2,028.24	1,870	248,322	ソフトウェア
IHS MARKIT LTD	367.14	−	−	−	専門サービス
FNF GROUP	254.51	310.04	1,351	179,460	保険
JACOBS SOLUTIONS INC	−	166.15	2,035	270,316	専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	794.17	1,079.89	5,098	676,984	半導体・半導体製造装置
APA CORP	−	409.46	1,738	230,918	石油・ガス・消耗燃料
ROBINHOOD MARKETS INC	198.72	−	−	−	資本市場
LUCID GROUP INC	421.36	449.1	463	61,603	自動車
U-HAUL HOLDING CO	−	119.81	689	91,559	陸運・鉄道
ASPEN TECHNOLOGY INC	−	37.21	799	106,174	ソフトウェア
TOAST INC	−	326.2	819	108,766	情報技術サービス
GRAB HOLDINGS LTD	−	1,683.28	585	77,785	陸運・鉄道
CATALENT INC	174.39	205.64	1,446	192,104	医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	599.85	611.18	2,219	294,768	消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	435.54	633.78	2,748	364,916	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57	52.37	782	103,972	ソフトウェア
WAYFAIR INC	69.59	−	−	−	インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	174.12	222.09	4,113	546,297	電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	43.07	58.02	2,111	280,381	ソフトウェア
QORVO INC	111.07	141.44	1,505	199,894	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	24.25	−	−	−	メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	145.2	153.35	1,422	188,829	メディア
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	49.59	67.28	2,122	281,808	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	165.74	197.13	1,597	212,137	情報技術サービス
KORNIT DIGITAL LTD	49.78	−	−	−	機械
ETSY INC	117.13	156.14	2,088	277,314	インターネット販売・通信販売
TRANSUNION	189.9	257.08	1,753	232,784	専門サービス
ALCOA CORP	−	239.41	1,171	155,554	金属・鉱業
BLOCK INC	489.39	669.1	5,272	700,136	情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	506.8	602.66	4,607	611,888	化学
CARVANA CO	77.35	−	−	−	専門小売り
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	215.37	262.21	1,467	194,811	飲料
TELADOC HEALTH INC	147.9	−	−	−	ヘルスケア・テクノロジー
WESTROCK CO	262.97	342.86	1,131	150,243	容器・包装
KRAFT HEINZ CO	640.01	921.06	3,673	487,762	食品
NOVOCURE LTD	97.72	123.17	1,064	141,329	ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP	329.64	426.08	2,940	390,509	機械
WASTE CONNECTIONS INC	261.86	310.39	4,180	555,106	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	293.14	7,443.29	70,473	9,358,118	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,231.01	1,563.84	2,586	343,473	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	1,086.55	1,375.3	10,625	1,410,969	情報技術サービス
SEA LTD ADR	132.32	439.08	2,820	374,495	娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC	343.46	449.24	1,477	196,144	各種金融サービス
SUNRUN INC	162.13	−	−	−	電気設備
ZILLOW GROUP INC-C	156.65	163.21	743	98,697	不動産管理・開発
ALPHABET INC-CL C	280.94	6,916.6	65,673	8,720,733	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZSCALER INC	77.59	103.1	1,404	186,452	ソフトウェア
CABLE ONE INC	5.42	−	−	−	メディア
LINDE PLC	503.98	620.82	20,735	2,753,452	化学
ROKU INC	119.01	156.6	886	117,782	娯楽
AVALARA INC	78.24	−	−	−	ソフトウェア
CHARTER COMMUNICATIONS INC	124.76	140.85	5,635	748,382	メディア
VISTRA CORP	397.58	496.33	1,142	151,653	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計 株数・金額	309,096.71	423,708.49	4,451,014	591,050,171	
小計 銘柄数<比率>	608銘柄	601銘柄	−	<69.0%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	455.67	570.3	3,886	386,737	金属・鉱業
BARRICK GOLD CORP	1,736.87	2,148.35	5,108	508,425	金属・鉱業
BALLARD POWER SYSTEMS INC	212.72	−	−	−	電気設備
BANK OF MONTREAL	630.76	825.85	11,166	1,111,271	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	1,191.19	1,494.35	11,050	1,099,767	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	326	409.67	4,133	411,413	銀行
BCE INC	72.75	76.97	470	46,841	各種電気通信サービス
BROOKFIELD CORP	1,379.3	1,771.31	8,638	859,721	資本市場
BAUSCH HEALTH COS INC	281.92	−	−	−	医薬品
SAPUTO INC	253.95	345.82	1,269	126,306	食品
BLACKBERRY LTD	466.71	−	−	−	ソフトウェア
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	622.22	923.11	910	90,581	総合公益事業
DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	−	115.08	1,160	115,478	ソフトウェア
CGI INC	229.85	279.18	3,456	343,965	情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC	153.58	210.58	1,314	130,813	容器・包装

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAE INC	304.43	408.08	1,295	128,902	航空宇宙・防衛
CAMECO CORP	346.76	542.64	2,110	210,019	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	373.08	456.07	2,986	297,246	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	436.21	1,145.14	7,152	711,821	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,152.17	1,407.03	11,305	1,125,121	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	58.89	61.24	1,003	99,890	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	97.93	163.3	597	59,497	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	691.09	732.33	11,682	1,162,605	陸運・鉄道
GILDAN ACTIVEWEAR INC	208.15	217.13	856	85,268	繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	258.68	332.17	1,583	157,585	ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	150.93	294.33	1,078	107,324	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	1,185.75	2,199.14	1,216	121,028	金属・鉱業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	94.52	132.86	1,134	112,878	商業サービス・用品
FORTIS INC	452	604.84	3,334	331,847	電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	569.14	742.03	2,019	200,937	金属・鉱業
TELUS CORP	318.9	318.9	873	86,895	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	252.5	342.08	1,228	122,251	保険
IMPERIAL OIL LTD	220.66	272.46	1,925	191,596	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,964.79	2,517.28	13,356	1,329,257	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	53.66	124.78	527	52,516	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,892.5	2,338.61	6,106	607,680	保険
LOBLAW CO LTD	154.86	216	2,535	252,345	食品・生活必需品小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	788.73	1,012.1	6,476	644,534	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	302.02	358.44	2,670	265,720	自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	570.83	758.84	5,172	514,742	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	23.2	27.99	2,441	242,970	保険
METRO INC	227.64	286.29	2,036	202,717	食品・生活必需品小売り
EMERA INC	238.36	369.98	2,004	199,529	電力
ONEX CORP	64.89	101.57	679	67,624	資本市場
PAN AMERICAN SILVER CORP	187.66	193.23	425	42,325	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	564.39	655	2,335	232,451	保険
QUEBECOR INC-B	160.42	171.95	548	54,605	メディア
ROYAL BANK OF CANADA	1,394.86	1,719.47	23,874	2,376,024	銀行
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	906.81	1,163.63	12,375	1,231,580	陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	426.01	598.77	2,357	234,663	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,431.08	1,718.98	7,972	793,436	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	643.1	687.62	616	61,383	金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	438.24	573.26	3,230	321,538	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	167.4	199.79	3,309	329,343	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	93.88	96.65	1,038	103,303	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	1,778.19	2,251.61	20,973	2,087,307	銀行
TC ENERGY CORP	949.79	1,237.53	6,982	694,862	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	92.98	81.02	895	89,081	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	78.86	98.39	1,655	164,756	食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	179.01	215.66	4,295	427,468	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	470.07	585.39	3,372	335,624	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	19.31	25.3	6,086	605,773	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	186.23	231.63	4,204	418,390	金属・鉱業
TOURMALINE OIL CORP	323.64	392.98	2,467	245,567	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	237.72	245.71	767	76,415	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	144.97	156.65	473	47,127	石油・ガス・消耗燃料

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	
ALTAGAS LTD	240.53	338.33	843	83,907	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	564.42	681.79	3,209	319,445	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	264.38	362.04	2,857	284,422	複合小売り
CENOVUS ENERGY INC W/I	1,344.22	1,677.15	4,454	443,312	石油・ガス・消耗燃料
ARC RESOURCES LTD	－	749.61	1,209	120,406	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	234.9	341.52	1,134	112,942	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	－	512.43	978	97,404	各種金融サービス
TMX GROUP LTD	47.97	70.4	962	95,760	資本市場
BRP INC	－	43.07	515	51,264	レジャー用品
IVANHOE MINES LTD	619.3	640.27	773	76,973	金属・鉱業
NUTRIEN LTD	555.64	661.77	6,795	676,243	化学
TFI INTERNATIONAL INC	89.99	93.99	1,602	159,511	陸運・鉄道
LIGHTSPEED COMMERCE INC	113.46	－	－	－	ソフトウェア
WSP GLOBAL INC	129.91	156.81	2,695	268,262	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	116.6	120.11	1,008	100,348	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	164.85	275.77	1,157	115,157	商業サービス・用品
NUVEI CORP	49.6	79.29	347	34,562	情報技術サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	108.45	161.03	641	63,798	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	－	425.01	2,012	200,318	資本市場
AIR CANADA	179.4	188.14	427	42,540	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	264.43	353.84	3,141	312,666	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC	109.46	1,468.23	9,810	976,362	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	32.93	52.37	1,019	101,433	不動産管理・開発
CANOPY GROWTH CORP	186.34	－	－	－	医薬品
HYDRO ONE LTD	357.38	462.25	1,672	166,439	電力
小計 株数・金額	38,115.54	50,869.66	309,487	30,800,200	
小計 銘柄数<比率>	86銘柄	86銘柄	－	<3.6%>	
(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	171.34	217.54	1,388	128,725	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	2,757.53	－	－	－	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION	3,565.97	4,377.12	10,443	968,036	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,622.22	2,101.04	4,660	431,945	金属・鉱業
TELSTRA GROUP LTD	3,896.81	4,828.55	1,999	185,289	各種電気通信サービス
ASX LTD	189.26	236.64	1,638	151,894	資本市場
BHP GROUP LTD	3,064.96	6,313	30,125	2,792,345	金属・鉱業
AMPOL LTD	209.46	318.28	993	92,044	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	516.04	720.81	1,772	164,290	情報技術サービス
CSL LIMITED	464.24	601.03	18,496	1,714,458	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	58.28	61.34	749	69,461	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,937.86	3,796.33	5,295	490,875	運送インフラ
COCHLEAR LTD	58.75	78.36	1,638	151,858	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,463.6	2,132.29	1,505	139,535	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,728.88	2,112.29	23,076	2,138,985	銀行
RIO TINTO LIMITED	359.15	459.36	5,581	517,323	金属・鉱業
APA GROUP	1,182.05	1,643	1,758	162,949	ガス
ARISTOCRAT LEISU	620.13	766.75	2,763	256,136	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,694.3	2,816.64	1,357	125,837	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	462.46	607.67	1,847	171,227	建設資材
IGO LTD	－	919.47	1,324	122,810	金属・鉱業
ORICA LTD	413.11	638.62	1,010	93,703	化学
LEND LEASE CORP LTD	621.16	1,071.81	841	77,986	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
BLUESCOPE STEEL LTD	469.46	503.25	962	89,234	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	1,422.58	−	−	−	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD	337.36	466.42	8,939	828,593	資本市場
SUNCORP GROUP LTD	1,202.9	1,541.62	1,950	180,759	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,188.61	3,928.66	12,418	1,151,070	銀行
NEWCREST MINING LTD	868.79	1,128.15	2,792	258,806	金属・鉱業
QANTAS AIRWAYS LIMITED	1,074.83	1,126.59	726	67,353	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,336.24	1,724.87	2,292	212,478	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	966.92	1,355.78	1,629	151,052	金属・鉱業
REECE LTD	303.19	315.58	520	48,205	商社・流通業
SANTOS LTD	3,333.93	4,173.58	2,967	275,049	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	406.13	527.74	1,513	140,291	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	247.11	259.85	742	68,788	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	2,145.97	−	−	−	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	1,094.81	1,397.2	6,804	630,696	複合小売り
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	906.41	2,354.31	8,529	790,614	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,204.4	1,543.2	5,598	518,946	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	155.53	−	−	−	資本市場
SEEK LTD	361.4	384.05	935	86,751	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	−	−	−	ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES	1,650.66	−	−	−	電力
MINERAL RESOURCES LTD	−	211.79	1,843	170,846	金属・鉱業
BRAMBLES LTD	1,300.28	1,709.29	2,034	188,536	商業サービス・用品
PILBARA MINERALS LTD	−	3,279.47	1,590	147,427	金属・鉱業
CROWN RESORTS LTD	328.61	−	−	−	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD	1,502.3	−	−	−	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD	1,381.66	2,228.49	744	68,990	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	759.03	792.33	1,135	105,241	飲料
XERO LTD	140.63	188.6	1,481	137,298	ソフトウェア
IDP EDUCATION LTD	228.52	237.81	746	69,147	各種消費者サービス
LOTTERY CORP LTD	−	2,912.7	1,453	134,719	ホテル・レストラン・レジャー
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	1,195.74	1,604.7	1,137	105,456	食品・生活必需品小売り
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	−	3,743.53	9,639	893,493	銀行
MEDIBANK PVT LTD	2,831.54	2,985.76	913	84,685	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	4,093.17	5,966.94	2,768	256,627	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	1,227.26	1,716.84	3,095	286,918	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	136.04	148.23	837	77,600	ソフトウェア
小計 株数・金額	66,920.43	87,275.27	209,012	19,373,402	
小計 銘柄数<比率>	55銘柄	52銘柄	−	<2.3%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	2,570	4,060	68,705	不動産管理・開発
CLP HOLDINGS LTD	1,620	1,972.96	11,383	192,616	電力
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	535	933.14	4,105	69,470	電力
HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	1,164.4	1,518.91	51,217	866,602	資本市場
MTR CORP	1,375	1,924.41	7,986	135,128	陸運・鉄道
HANG SENG BANK LTD	758	950.96	11,934	201,932	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,204.5	1,709.72	4,829	81,722	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,460	1,513.2	6,605	111,758	電力
HONG KONG & CHINA GAS	11,754.56	15,364.06	11,861	200,689	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	2,000	2,609.04	13,984	236,616	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,535	4,199.95	11,129	188,317	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	
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,630.66	1,730.66	3,868	65,446	不動産管理・開発
SINO LAND CO		5,054	4,112	4,301	72,775	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,385	1,805.65	20,169	341,261	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A		495	530.2	3,528	59,701	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,320	1,801.56	19,312	326,771	機械
XINYI GLASS HOLDING CO LTD		1,660	1,780	2,837	48,007	建設関連製品
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD		2,172	－	－	－	専門小売り
AIA GROUP LTD		11,750.27	14,933.16	128,873	2,180,534	保険
HKT TRUST / HKT LTD		4,450	4,631.36	4,955	83,847	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		2,520	3,358	9,771	165,338	ホテル・レストラン・レジャー
SITC INTERNATIONAL CO LTD		1,330	1,400	2,405	40,695	海運業
SWIRE PROPERTIES LTD		1,042	2,016	4,324	73,167	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD		1,517.5	1,961.35	8,551	144,691	不動産管理・開発
ESR GROUP LTD		2,038	2,164	3,280	55,508	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD		2,300	2,465	1,281	21,688	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD		1,506	2,650	6,280	106,266	飲料
WH GROUP LTD		8,970	9,315	4,387	74,234	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,563.32	3,104.45	15,289	258,696	コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD		1,863.32	2,661.95	13,669	231,281	不動産管理・開発
小計	株数・金額	82,613.53	97,686.69	396,186	6,703,475	
	銘柄数<比率>	30銘柄	29銘柄	－	<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		1,095	1,442	524	52,483	航空宇宙・防衛
DBS GROUP HOLDINGS LTD		1,766	2,248.1	7,881	788,105	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		364	394	320	32,028	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		－	155	441	44,186	コングロマリット
SINGAPORE EXCHANGE LTD		674	998	916	91,607	資本市場
GENTING SINGAPORE LTD		7,242	7,611.93	776	77,633	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD		1,349	1,849	1,307	130,711	コングロマリット
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		3,209.53	3,981.98	5,164	516,411	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		8,084.22	9,433.3	2,358	235,808	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD		1,580.5	1,627	955	95,495	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD		1,113	1,399.66	4,235	423,494	銀行
UOL GROUP LIMITED		405	436	301	30,124	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD		421	438	811	81,109	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,814	2,585	1,028	102,872	食品
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE		2,952.15	3,065.9	1,180	118,025	不動産管理・開発
小計	株数・金額	32,069.4	37,664.87	28,203	2,820,098	
	銘柄数<比率>	14銘柄	15銘柄	－	<0.3%>	
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		1,102.26	1,643.41	1,401	117,837	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD		494.49	－	－	－	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
FISHER & PAYKEL		573.88	784.6	2,008	168,840	ヘルスケア機器・用品
SPARK NEW ZEALAND LTD		2,629.43	2,190.38	1,160	97,585	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD		617.34	628.34	397	33,433	電力
MERIDIAN ENERGY LTD		1,241.62	1,321.57	708	59,544	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額	6,659.02	6,568.3	5,677	477,242	
	銘柄数<比率>	6銘柄	5銘柄	－	<0.1%>	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC		352.61	459.63	782	126,580	金属・鉱業
ASHTEAD GROUP		430.03	543.04	3,034	490,861	商社・流通業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SEVERN TRENT PLC	294.58	293.97	821	132,861	水道
BARCLAYS PLC	16,512.19	20,224.17	3,787	612,744	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	922.35	1,241.96	571	92,393	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	8,502.62	9,041.98	1,250	202,281	各種電気通信サービス
BHP GROUP LTD	2,059.88	−	−	−	金属・鉱業
BUNZL PLC	355.08	385.93	1,168	189,094	商社・流通業
AVIVA PLC	3,815.43	3,486.83	1,544	249,865	保険
CRODA INTERNATIONAL	136.93	167.82	1,148	185,736	化学
DIAGEO PLC	2,277.84	2,829.74	9,960	1,611,240	飲料
SCHRODERS PLC	113.54	1,103.66	548	88,728	資本市場
DCC PLC	106.84	111.35	515	83,413	コングロマリット
NATIONAL GRID PLC	3,522.37	4,605.69	4,856	785,619	総合公益事業
KINGFISHER PLC	2,114.6	2,253.92	624	101,029	専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	3,096.99	3,796.23	3,285	531,423	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,127.07	2,628.77	8,178	1,322,890	タバコ
HALMA PLC	342.01	510.66	1,133	183,381	電子装置・機器・部品
NEXT PLC	131.97	187.51	1,258	203,585	複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	896.52	1,078.89	2,181	352,881	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	191.07	199.76	445	72,123	化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,255.2	1,574.26	5,058	818,197	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,721.99	2,209.35	4,190	677,779	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	19,905.53	24,887.38	15,161	2,452,506	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,733.2	7,381.79	1,880	304,131	保険
UNILEVER PLC	2,528.12	3,166.86	13,511	2,185,605	パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	677.14	905.69	954	154,342	水道
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	322.09	423.51	808	130,848	食品
PEARSON PLC	637.46	841.59	768	124,319	各種消費者サービス
PERSIMMON PLC	336.88	352.52	496	80,374	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,544.6	3,339.71	4,286	693,387	保険
RIO TINTO PLC	1,091.55	1,408.39	8,475	1,371,027	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	27,067.74	32,204.82	3,130	506,358	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	692.96	886.53	5,088	823,145	家庭用品
RELX PLC	1,892.62	2,404.03	5,820	941,468	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,934.06	3,121.14	1,561	252,538	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	7,958.64	11,219.24	1,215	196,545	航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	5,723.46	6,704.64	2,044	330,785	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	483.93	674.48	842	136,216	資本市場
SSE PLC	999.67	1,315.74	2,275	368,096	電力
BP PLC	19,568.09	23,470.86	13,146	2,126,501	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	924.78	1,288.93	980	158,666	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	354	516.95	916	148,177	コングロマリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	76.48	89.36	1,064	172,157	機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,427.25	3,198.02	2,307	373,292	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	69,189.54	84,778.63	4,552	736,430	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	3,467.94	5,698.63	679	109,971	家庭用耐久財
TESCO PLC	8,098.05	9,342.47	2,296	371,462	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	1,019.75	1,247.51	2,047	331,250	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	880.29	1,076.79	1,239	200,570	ヘルスケア機器・用品
GSK PLC	4,896.01	4,995.5	7,343	1,187,865	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	317.95	414.94	3,177	514,010	資本市場
WPP PLC	1,134.03	1,427.85	1,406	227,458	メディア

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASTRAZENECA PLC		1,508.4	1,930.29	22,233	3,596,423	医薬品
WHITBREAD PLC		187.44	254.7	778	125,990	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC		161.39	233.09	1,030	166,767	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		387.64	522.29	1,256	203,187	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS		162.86	217.52	1,210	195,775	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC		1,828.62	1,920.97	507	82,158	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC		200.87	213.25	474	76,683	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS		105.59	164.89	696	112,611	家庭用耐久財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		180.34	184.55	323	52,287	医薬品
AVEVA GROUP PLC		104.08	－	－	－	ソフトウェア
ABRDN PLC		2,063.13	2,858.31	611	98,945	資本市場
EXPERIAN PLC		893.61	1,127.09	3,346	541,302	専門サービス
MONDI PLC		458.75	588.87	870	140,883	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC		353.12	369.42	350	56,638	資本市場
OCADO GROUP PLC		449.09	697.66	432	69,991	食品・生活必需品小売り
INFORMA PLC		1,515.66	1,861.95	1,235	199,929	メディア
GLENCORE PLC		9,681.28	12,257.76	6,323	1,022,934	金属・鉱業
ENTAIN PLC		581.26	744.51	982	158,970	ホテル・レストラン・レジャー
COCA-COLA HBC AG		202.33	213.38	434	70,344	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		565.61	862.23	544	88,147	保険
FERGUSON PLC		216.07	－	－	－	商社・流通業
M&G PLC		2,591.17	2,704.01	541	87,611	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC		2,354.9	2,521.8	449	72,733	専門小売り
HALEON PLC		－	6,227.66	2,043	330,523	パーソナル用品
SHELL PLC		7,503.11	9,059.72	23,197	3,752,413	石油・ガス・消耗燃料
AUTO TRADER GROUP PLC		1,046.24	1,108.33	670	108,466	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC		4,701.29	4,872.07	689	111,517	コングロマリット
小計	株数・金額	284,167.37	351,435.94	237,063	38,347,464	
	銘柄数<比率>	79銘柄	77銘柄	－	<4.5%>	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円	
BANK HAPOALIM BM		1,077.44	1,467.03	4,442	167,607	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM		1,436.45	1,803.43	5,345	201,686	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD		－	2,877.73	1,576	59,501	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		21.98	36.62	2,123	80,125	航空宇宙・防衛
TOWER SEMICONDUCTOR LTD		－	125.74	1,805	68,128	半導体・半導体製造装置
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD		1,061.43	1,629.44	2,916	110,050	銀行
ICL GROUP LTD		680.48	1,030.67	2,754	103,948	化学
NICE LTD		61.29	76.4	5,898	222,541	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		167.84	174.4	1,993	75,212	銀行
AZRIELI GROUP		44.14	46.72	1,000	37,759	不動産管理・開発
小計	株数・金額	4,551.05	9,268.18	29,857	1,126,561	
	銘柄数<比率>	8銘柄	10銘柄	－	<0.1%>	
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG		2,530.13	4,515.99	1,256	181,054	資本市場
LOGITECH INTL-REG		180.08	237.34	1,270	183,059	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED		2,745.36	3,418.82	38,051	5,481,694	食品
CIE FINANC RICHEMONT		508.16	644.58	9,185	1,323,229	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		680.16	872.21	24,282	3,498,111	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		41.22	52.36	1,049	151,236	機械
SIKA INHABER		138.38	177.93	4,562	657,219	化学
SGS SA-REG		6.13	7.48	1,629	234,694	専門サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
NOVARTIS AG-REG SHS	2,138.86	2,693.94	21,664	3,121,011	医薬品
BALOISE HOLDING AG -R	42.59	56.75	862	124,184	保険
BARRY CALLEBAUT AG	3.29	4.6	885	127,631	食品
CLARIANT AG-REG	199.79	210.72	332	47,932	化学
SWISSCOM AG-REG	24.19	34.31	1,954	281,536	各種電気通信サービス
ABB LTD	1,605.91	1,945.38	6,052	871,862	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	140.95	198.42	685	98,816	専門サービス
GEBERIT AG	35.39	43.77	2,263	326,120	建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG	71.69	90.27	4,935	711,074	ライフサイエンス・ツール／サービス
LINDT & SPRUENGLI PART	1.1	1.37	1,397	201,309	食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.1	0.13	1,340	193,083	食品
GIVAUDAN-REG	9.01	11.73	3,374	486,162	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	147.34	187.71	8,225	1,184,958	保険
ROCHE HOLDING AG-BEARER	36.04	36.12	1,091	157,248	医薬品
HOLCIM LTD	511.47	666.07	3,714	535,039	建設資材
TEMENOS GROUP	67.53	70.82	495	71,355	ソフトウェア
BACHEM HOLDING AG	5	46.73	417	60,217	ライフサイエンス・ツール／サービス
SONOVA HOLDING AG	52.1	69.84	1,601	230,702	ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG	49.34	68.87	1,683	242,479	海運業
STRAUMANN HOLDING AG	11.25	145.31	1,870	269,412	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	29.91	31.3	1,017	146,545	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	92.59	550	79,364	繊維・アパレル・贅沢品
SCHINDLER NAMEN	14.94	27.2	521	75,155	機械
SWISS LIFE HOLDING AG	30.53	39.78	2,183	314,501	保険
BANQUE CANTONALE VAUD	－	49.03	412	59,366	銀行
VIFOR PHARMA AG	52.56	－	－	－	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING	6.16	8.1	575	82,907	化学
SWISS PRIME SITE AG	80.4	83.72	680	98,053	不動産管理・開発
PARTNERS GROUP HOLDING AG	21.76	28.52	2,655	382,509	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD	210.08	260.31	1,588	228,826	資本市場
SWISS RE LTD	292.13	381.39	3,632	523,277	保険
BKW AG	－	31.94	419	60,368	電力
SIG GROUP AG	－	383.22	844	121,675	容器・包装
ALCON INC	485.73	612.85	4,243	611,300	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG	3,427.79	4,189.21	8,483	1,222,082	資本市場
VAT GROUP AG	24.12	33.25	956	137,760	機械
小計 株数・金額	16,704.59	22,761.98	174,900	25,196,133	
小計 銘柄数<比率>	41銘柄	43銘柄	－	<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	104.57	125.49	12,408	237,497	飲料
A P MOLLER A/S	5.27	6.63	10,226	195,740	海運業
AP MOLLER MAERSK A	3.41	3.59	5,463	104,580	海運業
DANSKE BANK A/S	687.25	853.71	12,626	241,668	銀行
GENMAB A/S	62.51	79.26	21,685	415,061	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS	191.32	238.59	8,259	158,096	化学
ROCKWOOL AS	8.13	8.73	1,495	28,614	建設関連製品
NOVO NORDISK A/S-B	1,640.82	2,063.49	205,110	3,925,822	医薬品
GN STORE NORD A/S	104.48	－	－	－	ヘルスケア機器・用品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	979.91	1,254.36	26,115	499,855	電気設備
COLOPLAST-B	119.22	153.43	12,378	236,928	ヘルスケア機器・用品
DSV A/S	198.61	238.42	30,505	583,881	航空貨物・物流サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
DEMANT A/S		107.39	113.67	2,441	46,732	ヘルスケア機器・用品
TRYG A/S		357.84	448.87	7,085	135,614	保険
PANDORA A/S		92.65	124.73	7,902	151,261	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S		89.84	125.38	6,200	118,668	化学
AMBU A/S B		141.56	−	−	−	ヘルスケア機器・用品
ORSTED A/S		192.05	232.4	14,545	278,408	電力
小計	株数・金額	5,086.83	6,070.75	384,453	7,358,435	
	銘柄数<比率>	18銘柄	16銘柄	−	<0.9%>	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
MOWI ASA		432.02	563.75	9,995	131,038	食品
NORSK HYDRO ASA		1,290.36	1,629.71	12,516	164,087	金属・鉱業
TELENOR ASA		674.35	859.54	9,897	129,757	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA		75.37	−	−	−	メディア
KONGSBERG GRUPPEN ASA		−	111.85	4,637	60,795	航空宇宙・防衛
ORKLA ASA		694.4	1,160.68	8,059	105,663	食品
EQUINOR ASA		943.06	1,156.17	37,939	497,389	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA		151.93	198.34	9,153	120,000	化学
AKER BP ASA		152.17	387.23	11,407	149,556	石油・ガス・消耗燃料
SALMAR ASA		−	72.48	3,254	42,664	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		294.84	257.21	4,740	62,146	保険
ADEVINTA ASA		222.65	243.82	2,156	28,272	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DNB BANK ASA		895.96	1,193.19	23,088	302,686	銀行
SCHIBSTED ASA		74.45	−	−	−	メディア
小計	株数・金額	5,901.56	7,833.97	136,846	1,794,058	
	銘柄数<比率>	12銘柄	12銘柄	−	<0.2%>	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS		636.97	3,341.22	42,132	540,563	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS		401.9	1,942.04	21,568	276,721	機械
ERICSSON LM-B SHS		2,794.5	3,665.51	21,978	281,982	通信機器
GETINGE AB-B SHS		244.21	257.55	6,145	78,842	ヘルスケア機器・用品
INVESTOR AB-A SHS		557.33	584.37	12,184	156,322	各種金融サービス
LUNDBERGS B		73.82	78.59	3,887	49,870	各種金融サービス
SKF AB-B SHS		322.28	465.94	9,290	119,201	機械
SANDVIK AB		1,143.71	1,333.5	28,736	368,694	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		1,664.38	1,958.37	24,469	313,947	銀行
SKANSKA AB-B SHS		319.68	439.37	8,424	108,091	建設・土木
SWEDBANK AB		893.78	1,122.96	22,863	293,338	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS		543.82	702.11	10,675	136,967	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		1,340.2	1,844.99	19,510	250,323	銀行
VOLVO AB-A SHS		236.91	241.98	5,192	66,624	機械
VOLVO AB-B SHS		1,342.82	1,916.25	39,350	504,862	機械
HOLMEN AB-B SHS		−	101.42	4,404	56,511	紙製品・林産品
SWEDISH MATCH AB		1,583.29	−	−	−	タバコ
TELE2 AB-B SHS		460.83	644.16	6,022	77,273	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A		142.73	152.92	4,388	56,308	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C		119.4	213.25	6,096	78,222	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B		252.19	269.07	3,426	43,959	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS		483.54	760.85	7,048	90,432	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS		1,694.19	2,263.92	46,150	592,104	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS		662.7	822.87	10,511	134,860	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B		1,010.25	1,246.12	31,738	407,207	建設関連製品

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
TELIA CO AB		2,699.54	3,448.1	9,092	116,658	各種電気通信サービス
ORRON ENERGY AB		207.62	−	−	−	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BOLIDEN AB		240.47	362.6	15,936	204,462	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB		279.3	353.13	12,197	156,488	機械
KINNEVIK AB-B		214.49	362.78	5,918	75,937	各種金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER		114.01	729.42	4,212	54,045	不動産管理・開発
INDUTRADE AB		−	391.78	9,242	118,576	機械
HUSQVARNA AB-B SHS		451.58	477.69	4,326	55,514	機械
NIBE INDUSTRIER AB		1,340.88	1,858.45	21,400	274,562	建設関連製品
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB		−	183.8	4,466	57,303	バイオテクノロジー
HEXAGON AB-B SHS		1,852.43	2,481.63	29,531	378,887	電子装置・機器・部品
SAGAX AB		183.48	280.22	7,577	97,214	不動産管理・開発
EPIROC AB-A		593.63	845.63	17,301	221,979	機械
EPIROC AB-B		389.43	412.05	7,293	93,572	機械
ESSITY AB-B		576.54	751.8	20,907	268,243	家庭用品
EQT AB		300.03	407.16	10,007	128,402	資本市場
EMBRACER GROUP AB		491.42	797.91	4,016	51,533	娯楽
VOLVO CAR AB		−	637.1	3,147	40,379	自動車
LIFCO AB		257.38	268.35	5,825	74,746	コングロマリット
EVOLUTION AB		161.47	223.26	29,648	380,395	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP		3,102.72	4,203.56	52,779	677,166	銀行
INVESTMENT AB LATOUR		149.45	155.39	3,653	46,870	コングロマリット
SINCH AB		562.99	−	−	−	ソフトウェア
小計	株数・金額	33,094.29	46,001.14	674,682	8,656,179	
	銘柄数<比率>	44銘柄	45銘柄	−	<1.0%>	
(ユーロ…アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC		755.8	907.48	3,966	565,715	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		175.84	199.53	2,893	412,626	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A		149.68	207.61	1,766	251,975	食品
KINGSPAN GROUP PLC		143.07	174.51	1,044	148,933	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		242.28	324.22	1,192	170,025	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC		−	1,345.37	1,329	189,650	銀行
AIB GROUP PLC		−	1,475.78	580	82,843	銀行
小計	株数・金額	1,466.67	4,634.5	12,773	1,821,770	
	銘柄数<比率>	5銘柄	7銘柄	−	<0.2%>	
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE		575.35	733.77	8,510	1,213,733	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV		168.59	222.01	2,630	375,207	化学
ING GROEP NV-CVA		3,804.32	4,707.18	6,145	876,498	銀行
ASM INTERNATIONAL NV		42.71	59.78	1,940	276,705	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV		112.39	155.84	921	131,488	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,063.9	1,258.84	3,459	493,364	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV		245.94	320.26	2,921	416,651	飲料
AKZO NOBEL		187.17	226.27	1,565	223,248	化学
ASML HOLDING NV		403.14	506.05	31,430	4,482,655	半導体・半導体製造装置
AEGON NV		1,893.23	2,324.33	1,195	170,521	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV		886.59	1,155.12	1,829	260,986	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA		266.29	320.47	3,280	467,795	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV		650.99	869.19	3,963	565,337	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.		204.27	274.12	1,240	176,865	ライフサイエンス・ツール／サービス
KONINKLIJKE KPN NV		3,414.47	4,757.39	1,500	213,930	各種電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
HEINEKEN HOLDING NV-A		106.67	108.53	831	118,565	飲料
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		553.04	577.75	593	84,664	飲料
OCI NV		−	123.29	360	51,344	化学
FERRARI NV		120.5	154.35	3,792	540,869	自動車
CNH INDUSTRIAL NV		1,061.55	1,246.04	1,885	268,875	機械
PROSUS NV		906.79	1,025.26	7,618	1,086,580	インターネット販売・通信販売
JDE PEET'S BV		73.08	143.85	395	56,336	食品
EXOR NV		−	141.42	1,072	153,004	各種金融サービス
EURONEXT NV		96.19	100.81	776	110,706	資本市場
IMCD NV		53.59	68.23	1,031	147,132	商社・流通業
NN GROUP NV		281.24	362.89	1,449	206,762	保険
ARGENX SE		42.55	67.53	2,358	336,319	バイオテクノロジー
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV		679.41	925.02	2,096	298,945	娯楽
STELLANTIS NV		1,962.48	2,806.95	4,372	623,549	自動車
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV		160.29	226.7	476	67,994	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV		343.82	528.35	853	121,733	銀行
EXOR NV		99.66	−	−	−	各種金融サービス
ADYEN NV		19.2	25.93	3,550	506,348	情報技術サービス
小計	株数・金額	20,479.41	26,523.52	106,049	15,124,722	
	銘柄数<比率>	31銘柄	32銘柄	−	<1.8%>	
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE		177.49	242.9	781	111,409	化学
D'IETEREN TRDG		−	27.36	498	71,056	販売
KBC GROUPE		265.87	322.13	2,279	325,086	銀行
SOFINA		13.82	22.81	531	75,733	各種金融サービス
SOLVAY SA		69.31	90.7	979	139,704	化学
AGEAS		170.55	181.36	792	113,058	保険
UCB SA		127.78	167.32	1,299	185,321	医薬品
COLRUYT NV		46.73	−	−	−	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		107.14	113.18	896	127,874	各種金融サービス
PROXIMUS		137.39	−	−	−	各種電気通信サービス
ELIA GROUP		28.62	40.78	530	75,666	電力
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		740.93	1,053.27	5,762	821,839	飲料
小計	株数・金額	1,885.63	2,261.81	14,351	2,046,752	
	銘柄数<比率>	11銘柄	10銘柄	−	<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)		639.79	668.78	1,862	265,589	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC		139.43	178.24	1,203	171,588	ライフサイエンス・ツール／サービス
TENARIS SA		529.85	558.55	904	129,010	エネルギー設備・サービス
AROUNDTOWN SA		1,060.18	1,132.25	292	41,662	不動産管理・開発
INPOST SA		203.95	−	−	−	航空貨物・物流サービス
小計	株数・金額	2,573.2	2,537.82	4,262	607,850	
	銘柄数<比率>	5銘柄	4銘柄	−	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE		465.78	653.17	9,434	1,345,532	化学
AXA SA		1,895.06	2,280.92	6,436	918,010	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT		674.38	837.2	2,349	335,040	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA		29.5	31.2	498	71,062	航空宇宙・防衛
DANONE		632.31	791.5	4,010	571,981	食品
SAFRAN SA		333.08	425.57	5,522	787,575	航空宇宙・防衛
ACCOR SA		173.8	183.05	551	78,659	ホテル・レストラン・レジャー

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BOUYGUES	202.22	291.23	898	128,177	建設・土木
BNP PARIBAS	1,099.14	1,390.23	8,950	1,276,491	銀行
THALES SA	104.48	128.86	1,642	234,227	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	155.19	198.39	3,669	523,304	情報技術サービス
EIFFAGE	84.77	117.84	1,213	173,021	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	253.45	294.05	2,203	314,278	メディア
FAURECIA	107.74	–	–	–	自動車部品
L'OREAL	245.54	301.22	11,679	1,665,773	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	270.69	344.54	27,924	3,982,658	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	708.07	1,148.08	586	83,588	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	162.26	869.08	2,559	364,965	自動車部品
PERNOD-RICARD	204.47	248.88	4,657	664,293	飲料
RENAULT SA	190.19	279.02	1,174	167,532	自動車
REMY COINTREAU	18.47	28.66	473	67,484	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	491.74	614.6	3,243	462,639	建設関連製品
SEB SA	24.39	25.96	252	35,987	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	788.64	1,004.09	2,661	379,631	銀行
VINCI S.A.	523.44	667.67	7,185	1,024,790	建設・土木
SODEXO	93.25	98.22	846	120,666	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	528.92	678.65	10,280	1,466,160	電気設備
VIVENDI SE	687.46	989.44	965	137,698	メディア
TOTALENERGIES SE	2,445.35	3,100.9	18,599	2,652,617	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	253.93	265.7	548	78,251	自動車部品
ORANGE	1,917.27	2,554.81	2,535	361,634	各種電気通信サービス
HERMES INTL	30.76	39.16	6,706	956,431	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	645.96	819	3,100	442,226	ソフトウェア
KERING	72.93	93.82	5,267	751,187	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	–	–	–	保険
CARREFOUR SA	611.89	755.72	1,240	176,976	食品・生活必需品小売り
SANOFI	1,108.56	1,424.61	12,552	1,790,200	医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	71.51	110.32	219	31,310	娯楽
TELEPERFORMANCE	59.18	78.45	2,020	288,216	専門サービス
EURAZEO	30.08	56.73	366	52,226	各種金融サービス
ESSILORLUXOTTICA	278.64	356.82	6,115	872,248	ヘルスケア機器・用品
CREDIT AGRICOLE SA	1,149.26	1,437.2	1,661	237,031	銀行
ORPEA	49.32	–	–	–	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
WENDEL	22.2	54.49	546	77,946	各種金融サービス
BIOMERIEUX	46.12	48.7	470	67,080	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	24.56	31.09	1,065	151,955	ライフサイエンス・ツール／サービス
ENGIE	1,774.63	2,217.51	2,935	418,729	総合公益事業
ALSTOM	285.33	370.07	995	141,976	機械
ELECTRICITE DE FRANCE	415.49	–	–	–	電力
IPSEN SA	36.46	38.73	408	58,219	医薬品
ARKEMA SA	60.09	63.92	583	83,231	化学
LEGRAND SA	259.78	327.83	2,858	407,611	電気設備
ADP	23.13	39.75	571	81,493	運送インフラ
BUREAU VERITAS SA	298.1	397.29	1,030	146,923	専門サービス
GETLINK	415.25	635.09	1,055	150,538	運送インフラ
EDENRED	248.65	310.91	1,593	227,208	情報技術サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	80.92	172.93	665	94,904	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDLINE SA	235.7	299.16	1,210	172,584	情報技術サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
AMUNDI SA		59.24	104.36	661	94,363	資本市場
小計	株数・金額	24,298.59	31,126.39	199,457	28,446,562	
	銘柄数<比率>	59銘柄	55銘柄	−	<3.3%>	
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG		184.33	219.74	3,050	435,052	繊維・アパレル・贅沢品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		329.21	415.77	4,063	579,570	自動車
COMMERZBANK AG		1,062.15	1,410.36	1,420	202,654	銀行
FRESENIUS SE & CO KGAA		388.3	489.48	1,385	197,561	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET		98.82	100.1	196	28,074	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF		55.46	−	−	−	化学
HANNOVER RUECK SE		53.21	71.05	1,273	181,687	保険
GEA GROUP AG		164.92	174.9	720	102,795	機械
CONTINENTAL AG		97.95	129.21	883	125,973	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		959.37	1,247.72	5,118	729,950	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD		159.12	168.54	931	132,829	自動車
MERCK KGAA		123.64	162.3	3,051	435,167	医薬品
RWE AG		644.26	778.53	3,070	437,917	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SAP SE		1,015.97	1,300.68	14,294	2,038,677	ソフトウェア
E.ON SE		2,086.41	2,802.87	2,812	401,144	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		103.66	133.76	851	121,424	家庭用品
SIEMENS AG-REG		746.31	953.29	13,824	1,971,666	コングロマリット
PUMA AG		104.48	162.1	988	141,024	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG		948.61	1,213.29	7,335	1,046,196	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		175	196.44	1,315	187,652	家庭用品
MERCEDES-BENZ GROUP AG		827.56	995.29	7,114	1,014,646	自動車
BASF SE		895.92	1,164.08	5,943	847,703	化学
BEIERSDORF AG		103.42	129.4	1,461	208,449	パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG		140.32	208.09	1,308	186,554	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO		188.36	238.55	890	127,072	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE		401.57	509.4	11,214	1,599,403	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		702.48	723.42	697	99,439	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		135.09	176.12	5,722	816,091	保険
RHEINMETALL STAMM		−	55.96	1,324	188,910	航空宇宙・防衛
VOLKSWAGEN AG		31.53	33.15	556	79,404	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD		179.03	222.69	2,899	413,515	自動車
NEMETSCHEK SE		48.41	98.78	507	72,355	ソフトウェア
DEUTSCHE BANK AG-REG		2,132.85	2,537.16	2,930	418,008	資本市場
BMW VORZUG		69.57	78.21	703	100,277	自動車
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		3,241.17	4,033.92	8,273	1,179,976	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG		26.86	28.47	1,251	178,535	ライフサイエンス・ツール／サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		1,266.18	1,590.23	5,699	812,846	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG		4.79	5.16	318	45,369	機械
CARL ZEISS MEDITEC AG		35.01	48.66	649	92,612	ヘルスケア機器・用品
BECHTLE AG		75.33	81.39	328	46,907	情報技術サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		196.7	238.84	4,088	583,164	資本市場
LANXESS AG		71.94	−	−	−	化学
MTU AERO ENGINES HOLDING AG		48.07	72.94	1,590	226,778	航空宇宙・防衛
SYMRISE AG		121.06	172.65	1,647	234,955	化学
BRENNTAG SE		163.1	179.34	1,267	180,781	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG		233.4	246.87	496	70,769	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG		983.85	1,054.74	292	41,713	各種電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
LEG IMMOBILIEN SE		61.13	82.09	588	83,920	不動産管理・開発
KION GROUP AG		75.08	−	−	−	機械
VONOVIA SE		700.86	859.37	2,226	317,561	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG		68.6	103.42	650	92,716	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG		284.75	343.18	1,756	250,497	ヘルスケア機器・用品
DR ING HC F PORSCHE AG		−	151.74	1,732	247,142	自動車
SIEMENS ENERGY AG		357.61	590.14	1,121	159,914	電気設備
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		378.31	566.93	1,760	251,016	機械
ZALANDO SE		208.57	313.21	1,241	177,027	インターネット販売・通信販売
SCOUT24 SE		96.7	100.48	525	75,005	インタラクティブ・メディアおよびサービス
COVESTRO AG		191.58	275.58	1,147	163,658	化学
HELLOFRESH SE		169.9	178.56	387	55,287	食品・生活必需品小売り
UNIPER SE		104.27	−	−	−	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE		166.45	225.64	947	135,159	インターネット販売・通信販売
小計	株数・金額	24,688.56	30,843.98	149,853	21,372,171	
	銘柄数<比率>	59銘柄	57銘柄	−	<2.5%>	
(ユーロ…ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		331.35	346.44	671	95,705	食品・生活必需品小売り
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		2,686.36	3,179.56	1,469	209,547	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		382.82	594.06	683	97,433	石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額	3,400.53	4,120.06	2,823	402,687	
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄	−	<0.0%>	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA		5,945.92	7,795.92	8,380	1,195,243	電力
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		212.06	−	−	−	電気設備
REPSOL SA		1,502.89	1,787.13	2,756	393,153	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A		5,375.23	6,649.75	2,435	347,299	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.		286.39	377.01	697	99,446	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		228.77	235.71	645	92,043	建設・土木
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		6,440.62	7,351.18	5,053	720,792	銀行
ACCIONA S.A.		−	26.42	490	69,896	電力
NATURGY ENERGY GROUP SA		162.89	176.77	464	66,279	ガス
BANCO SANTANDER SA		16,741.54	20,668.57	7,233	1,031,713	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA		462.37	490.11	794	113,272	電力
INDITEX		1,042.55	1,363.21	3,856	550,017	専門小売り
ENAGAS		234.77	382.7	645	92,050	ガス
GRIFOLS SA		306.87	319.82	433	61,805	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA		464.37	635.13	1,743	248,648	建設・土木
CAIXABANK		4,097.23	5,660.59	2,263	322,844	銀行
EDP RENOVAVEIS SA		279.72	396.88	765	109,243	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AMADEUS IT GROUP SA		467.67	547.12	3,228	460,378	情報技術サービス
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA		−	98.22	365	52,194	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AENA SME SA		70.76	99.89	1,405	200,516	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU		487.6	695.72	2,678	382,010	各種電気通信サービス
小計	株数・金額	44,810.22	55,757.85	46,338	6,608,848	
	銘柄数<比率>	19銘柄	20銘柄	−	<0.8%>	
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI		1,117.77	1,446.13	2,639	376,400	保険
INTESA SANPAOLO		15,981.58	20,509.73	5,131	731,859	銀行
UNICREDIT SPA		2,056.36	2,411.49	4,563	650,915	銀行
ENI SPA		2,418.13	3,151.96	4,673	666,476	石油・ガス・消耗燃料

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
MEDIOBANCA SPA		574.42	867.92	903	128,857	銀行
ENEL SPA		7,880.51	10,193.43	5,484	782,137	電力
SNAM SPA		1,989.63	2,564.15	1,230	175,498	ガス
TELECOM ITALIA SPA		8,325.8	9,082.86	268	38,343	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA		457.18	－	－	－	運送インフラ
TERNA SPA		1,671.4	1,660.64	1,225	174,740	電力
RECORDATI SPA		103.03	109.08	447	63,861	医薬品
AMPLIFON SPA		113.72	123	336	47,960	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA		218.22	307.28	1,139	162,456	電気設備
DIASORIN ITALIA SPA		22.23	24.29	286	40,912	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA		228.55	250.14	1,418	202,277	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA		435.86	835.76	651	92,972	情報技術サービス
FINECOBANK SPA		652.74	751.8	1,250	178,309	銀行
POSTE ITALIANE SPA		557.49	588.89	600	85,583	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA		232.81	418.79	440	62,833	各種電気通信サービス
小計	株数・金額	45,037.43	55,297.34	32,691	4,662,399	
	銘柄数<比率>	19銘柄	18銘柄	－	<0.5%>	
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B		238.04	352.52	717	102,262	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ		486.12	509.56	480	68,531	機械
UPM-KYMMENE OYJ		559.82	677.58	2,362	336,971	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS		555.48	749.6	1,040	148,334	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		499.85	583.96	2,647	377,528	保険
FORTUM OYJ		408.2	541.94	783	111,686	電力
NOKIA OYJ		5,106.9	6,795.69	2,964	422,862	通信機器
ELISA OYJ		136.42	202.42	1,074	153,237	各種電気通信サービス
NESTE OYJ		432.9	505.99	2,342	334,120	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ		319.56	438.14	2,149	306,501	機械
ORION OYJ		81.06	135.59	632	90,269	医薬品
小計	株数・金額	8,824.35	11,492.99	17,194	2,452,304	
	銘柄数<比率>	11銘柄	11銘柄	－	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG		170.07	172.58	811	115,682	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG		69.16	73.2	570	81,325	電力
VOEST-ALPINE AG		98.75	105.93	351	50,157	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		315.46	456.86	1,634	233,133	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		195.72	－	－	－	銀行
小計	株数・金額	849.16	808.57	3,367	480,299	
	銘柄数<比率>	5銘柄	4銘柄	－	<0.1%>	
合計	株数・金額	1,063,294.07	1,372,550.07	－	817,729,794	
	銘柄数<比率>	1,228銘柄	1,212銘柄	－	<95.5%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。
(注3) 金額の単位未満は切捨てであります。%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) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
不動産ファンド		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(アメリカ)						
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		13.788	18.835	3,109	412,881	0.0
BOSTON PROPERTIES INC		14.801	18.531	1,340	178,009	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT		150.15	58.993	1,280	170,069	0.0
PROLOGIS INC		72.03	115.173	14,711	1,953,479	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC		13.356	16.932	3,049	404,891	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST		10.44	13.271	1,622	215,435	0.0
EQUINIX INC		8.702	11.399	8,303	1,102,589	0.1
DUKE REALTY TRUST		35.306	–	–	–	–
CROWN CASTLE INC		42.028	54.164	7,530	1,000,036	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC		6.132	8.345	1,993	264,655	0.0
EQUITY RESIDENTIAL		34.397	46.054	3,053	405,458	0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		49.946	68.971	1,789	237,575	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP		10.551	13.584	3,901	518,092	0.1
WELLTOWER INC		40.744	58.944	4,465	592,908	0.1
KIMCO REALTY		–	79.991	1,713	227,523	0.0
IRON MOUNTAIN INC		28.44	34.514	1,835	243,775	0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		16.573	20.486	1,468	195,048	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		75.616	91.777	1,700	225,826	0.0
MID AMERICA		11.699	13.578	2,320	308,082	0.0
REALTY INCOME CORP		53.267	76.685	5,038	669,125	0.1
REGENCY CENTERS CORP		14.665	19.311	1,269	168,603	0.0
UDR INC		28.289	41.516	1,853	246,151	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		31.871	40.894	5,128	681,015	0.1
PUBLIC STORAGE		15.276	19.317	5,812	771,788	0.1
SUN COMMUNITIES INC		11.066	14.694	2,335	310,087	0.0
VENTAS INC		40.408	48.092	2,444	324,671	0.0
VORNADO REALTY TRUST		15.123	–	–	–	–
WEYERHAEUSER CO		72.184	89.893	2,945	391,171	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC		13.998	16.256	2,600	345,295	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC		27.36	36.258	4,090	543,242	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST		54.08	72.327	875	116,212	0.0
AGNC INVESTMENT CORP		44.32	–	–	–	–
AMERICAN TOWER CORP		44.301	58.087	12,497	1,659,532	0.2
WP CAREY INC		19.446	23.664	1,982	263,296	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		–	42.371	870	115,623	0.0
AMERICAN HOMES 4 RENT		–	42.177	1,443	191,711	0.0
INVITATION HOMES INC		55.207	76.646	2,533	336,478	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN		–	30.095	1,600	212,563	0.0
VICI PROPERTIES INC		57.882	120.602	4,122	547,383	0.1
小計	口数・金額	1,233.442	1,612.427	124,635	16,550,295	–
	銘柄数<比率>	35銘柄<1.8%>	36銘柄<1.9%>	–	–	1.9
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
CANADIAN APT PPTYS REIT		8.22	8.722	431	42,984	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		13.467	14.424	320	31,881	0.0
小計	口数・金額	21.687	23.146	752	74,865	–
	銘柄数<比率>	2銘柄<0.0%>	2銘柄<0.0%>	–	–	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
MIRVAC GROUP		414.125	432.802	960	89,058	0.0
GPT GROUP		207.292	219.223	1,008	93,470	0.0
STOCKLAND		243.481	259.328	1,011	93,744	0.0
DEXUS		101.202	163.989	1,393	129,201	0.0
GOODMAN GROUP		158.185	214.602	4,268	395,641	0.0
VICINITY CENTRES		371.711	545.645	1,096	101,657	0.0
SCENTRE GROUP		479.376	647.197	1,922	178,166	0.0
小計	口数・金額	1,975.372	2,482.786	11,661	1,080,940	－
	銘柄数<比率>	7銘柄<0.1%>	7銘柄<0.1%>	－	－	0.1
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT		199.7	262.516	14,175	239,855	0.0
小計	口数・金額	199.7	262.516	14,175	239,855	－
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.0%>	1銘柄<0.0%>	－	－	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		545.177	787.231	1,542	154,281	0.0
CAPLAND ASCENDAS REIT		248.606	440.678	1,225	122,496	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		484.5	474.1	787	78,692	0.0
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL		192.3	405.5	701	70,144	0.0
小計	口数・金額	1,470.583	2,107.509	4,256	425,615	－
	銘柄数<比率>	4銘柄<0.0%>	4銘柄<0.0%>	－	－	0.0
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC		75.77	119.111	533	86,260	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		74.028	77.092	541	87,641	0.0
SEGRO PLC		120.36	165.081	1,370	221,692	0.0
小計	口数・金額	270.158	361.284	2,445	395,594	－
	銘柄数<比率>	3銘柄<0.1%>	3銘柄<0.0%>	－	－	0.0
(ベルギー)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
WAREHOUSES DE PAUW		－	27.206	806	115,006	0.0
小計	口数・金額	－	27.206	806	115,006	－
	銘柄数<比率>	－銘柄<－%>	1銘柄<0.0%>	－	－	0.0
(フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA		4.763	5.045	556	79,362	0.0
KLEPIERRE		17.099	25.279	607	86,707	0.0
COVIVIO		4.663	5.066	323	46,168	0.0
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		12.92	13.535	822	117,269	0.0
小計	口数・金額	39.445	48.925	2,310	329,508	－
	銘柄数<比率>	4銘柄<0.0%>	4銘柄<0.0%>	－	－	0.0
合計	口数・金額	5,210.387	6,925.799	－	19,211,682	－
	銘柄数<比率>	56銘柄<2.1%>	58銘柄<2.2%>	－	－	2.2

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) 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であります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		末	
		買建額		売建額	
			百万円		百万円
外国	S&P500 EMINI FUT		14,918		－
	S&P/TSE 60 IX FUT		770		－
	SPI 200 FUTURES		767		－
	FTSE 100 INDEX FUTURE		949		－
	DJ EURO STOXX 50		3,157		－

（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

2023年２月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	817,729,794	95.5
投資信託受益証券、投資証券	19,211,682	2.2
コール・ローン等、その他	19,565,080	2.3
投資信託財産総額	856,506,557	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨てであります。％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、856,083,494千円、100.0％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、2023年２月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝132.79円、１カナダ・ドル＝99.52円、１オーストラリア・ドル＝92.69円、１香港・ドル＝16.92円、１シンガポール・ドル＝99.99円、１ニュージーランド・ドル＝84.06円、１イギリス・ポンド＝161.76円、１イスラエル・シュケル＝37.731円、１スイス・フラン＝144.06円、１デンマーク・クローネ＝19.14円、１ノルウェー・クローネ＝13.11円、１スウェーデン・クローナ＝12.83円、１ユーロ＝142.62円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年２月15日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**858,116,339,350円**
コール・ローン等	12,369,982,821
株式(評価額)	817,729,794,487
投資信託受益証券(評価額)	1,506,555,624
投資証券(評価額)	17,705,126,582
未収入金	2,253,291,522
未収配当金	828,275,858
差入委託証拠金	5,723,312,456
(B) 負債	**1,894,762,474**
未払金	1,620,859,674
未払解約金	273,902,800
(C) 純資産総額(A－B)	**856,221,576,876**
元本	137,221,085,885
次期繰越損益金	719,000,490,991
(D) 受益権総口数	**137,221,085,885口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**62,397円**

(注１) 期首元本額 113,101,593,550円
追加設定元本額 64,603,879,550円
一部解約元本額 40,484,387,215円

(注２) 期末における元本の内訳

ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,359,545,916円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,537,466円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,392,849円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	27,472,521円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	20,134,515円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	14,285,405円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	21,312,714円
たわらノーロード　先進国株式	43,143,503,610円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	371,248,659円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	3,124,755,370円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	812,932,249円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	86,757,879円
たわらノーロード　バランス（標準型）	734,337,287円
たわらノーロード　バランス（積極型）	932,352,496円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	1,335円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	72,512,085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）	283,171,853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）	250,978,945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）	420,410,827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）	661,599円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	20,654,116円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,497,348円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,796,669円
たわらノーロード　全世界株式	612,427,800円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	55,311,292,707円
Ｏｎｅ ＤＣ 先進国株式インデックスファンド	2,776,530,848円
Ｏｎｅグローバルバランス	5,702,978円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	154,579,488円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	796,155,072円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,045,740,545円
ＤＩＡＭ ＤＣ バランス30インデックスファンド	93,160,102円
ＤＩＡＭ ＤＣ バランス50インデックスファンド	255,168,934円
ＤＩＡＭ ＤＣ バランス70インデックスファンド	248,526,364円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	17,255,462円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	629,832,963円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	123,209,099円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国10）	166,603,009円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国20）	197,017,429円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国30）	318,946,273円
投資のソムリエ	5,236,697,696円
クルーズコントロール	101,484,005円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	385,311,092円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	204,497,778円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	236,289,352円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	318,178,464円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,347,351,737円
ワールドアセットバランス（基本コース）	144,201,865円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	187,755,370円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	21,116,295円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	10,603,461円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,240,319円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	42,119,092円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	140,118,314円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	279,203,327円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	151,235,864円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	22,279,679円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	11,365,527円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	6,977,782円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	103,657,957円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	1,508,385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）	39,207,354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）	39,983,263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）	24,499,490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）	38,551,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンドＩＩ2021-04（適格機関投資家限定）	98,803,834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）	34,816,455円
ＭＳＣＩコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	381,034,312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）	40,471,840円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,108,533,199円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	201,337,819円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,060,739,404円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	140,711,864円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	1,328,457円
ＤＩＡＭワールドバランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,043,021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）	66,464,123円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	2,713,784円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	3,660,019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）	25,277,114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）	49,829,008円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,710,694円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,007,497円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,142,119円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,882円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド40ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,280,399円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,060,605円
ＤＩＡＭバランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	154,952,415円
ＤＩＡＭバランスファンド37.5ＶＡ（適格機関投資家限定）	252,239,956円
ＤＩＡＭバランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	852,113,757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）	43,796,613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）	35,704,735円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	248,901,994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）	9,152,563円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド55ＶＡ（適格機関投資家限定）	164,151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）	102,331,680円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド40ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,974,317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）	30,241,885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）	45,713,613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）	95,203,048円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	9,895,958円
コア資産形成ファンド	6,569,591円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,688,753,509円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	140,194,356円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	6,728,106円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,261,770,351円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,390,845,054円
期末元本合計	137,221,085,885円

■損益の状況

当期　自2022年２月16日　至2023年２月15日

項目	当期
(A) 配当等収益	**13,816,691,400円**
受取配当金	13,694,195,113
受取利息	30,845,985
その他収益金	92,260,263
支払利息	△609,961
(B) 有価証券売買損益	**54,267,691,472**
売買益	136,086,810,742
売買損	△81,819,119,270
(C) 先物取引等取引損益	**102,052,001**
取引益	5,493,726,731
取引損	△5,391,674,730
(D) その他費用	**△165,932,544**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**68,020,502,329**
(F) 前期繰越損益金	**529,540,902,616**
(G) 解約差損益金	**△195,178,469,975**
(H) 追加信託差損益金	**316,617,556,021**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**719,000,490,991**
次期繰越損益金(I)	**719,000,490,991**

(注１) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注２) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
(注３) (H)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日　2023年２月21日）

（計算期間　2022年２月22日～2023年２月21日）

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

■最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（ベンチマーク）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
16期（2019年２月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	－	197,670
17期（2020年２月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	－	130,803
18期（2021年２月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	－	137,037
19期（2022年２月21日）	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	－	141,964
20期（2023年２月21日）	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	－	186,822

（注１）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注４）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

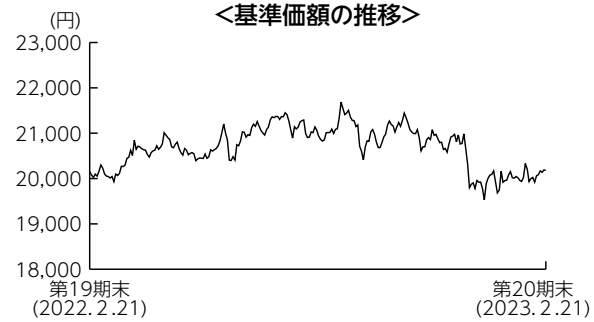
■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)(ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2022年2月21日	20,152	－	126,280.23	－	98.9	－
2月末	20,052	△0.5	125,907.80	△0.3	98.8	－
3月末	20,713	2.8	129,775.21	2.8	98.3	－
4月末	20,758	3.0	129,955.37	2.9	99.0	－
5月末	20,634	2.4	129,451.47	2.5	98.7	－
6月末	21,122	4.8	132,579.22	5.0	99.0	－
7月末	21,267	5.5	133,117.57	5.4	98.9	－
8月末	21,015	4.3	131,430.25	4.1	98.7	－
9月末	20,830	3.4	130,076.63	3.0	99.0	－
10月末	21,443	6.4	134,355.57	6.4	99.0	－
11月末	20,802	3.2	130,450.40	3.3	98.7	－
12月末	19,782	△1.8	123,946.23	△1.8	98.6	－
2023年1月末	20,018	△0.7	125,559.33	△0.6	98.8	－
(期末)						
2023年2月21日	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	－

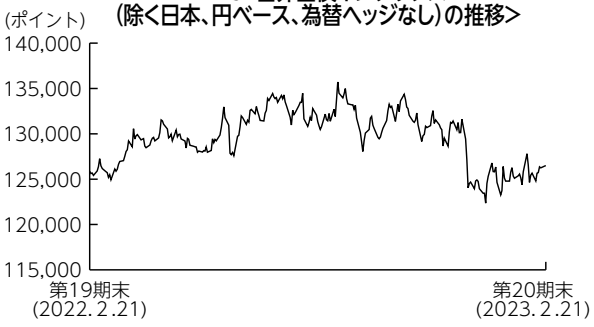
(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年２月22日から2023年２月21日まで）

<基準価額の推移>



<FTSE世界国債インデックス
(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)の推移>



基準価額の推移

当期末の基準価額は20,182円となり、前期末比で0.1％上昇しました。

基準価額の主な変動要因

ＦＯＭＣ（米連邦公開市場委員会）による複数回の利上げやインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもＦＯＭＣによる複数回の利上げと日銀の金融緩和策を堅持する姿勢から、日米金利差拡大が意識されて円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも大きく為替が円安に動いたことから、基準価額は若干上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、インフレ率が加速する中でＦＯＭＣの複数回の利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についても米国債の金利上昇やＥＣＢ（欧州中央銀行）の複数回の利上げを受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、ＦＯＭＣにおいて複数回の利上げを実施しましたが、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

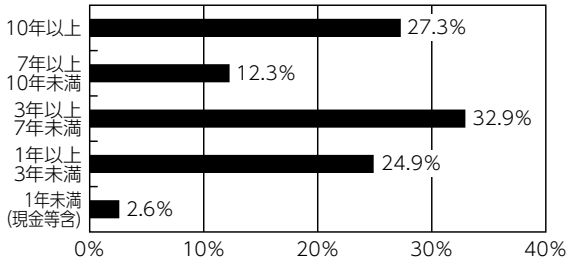
ベンチマークであるＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

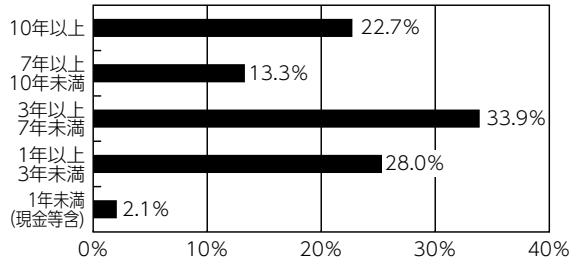
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

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

期末

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

（注）世界国債インデックスとはＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で0.2%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他費用	3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)	(3)	(0.015)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	3	0.016	
期中の平均基準価額は20,688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（2022年２月22日から2023年２月21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 536,386	千アメリカ・ドル 350,573
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 26,736	千カナダ・ドル 16,227
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 19,961	千オーストラリア・ドル 11,123
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 4,947	千シンガポール・ドル 3,149
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 4,867	千ニュージーランド・ドル －
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 42,306	千イギリス・ポンド 23,277
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シュケル 9,417	千イスラエル・シュケル 7,354
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 15,932	千デンマーク・クローネ 12,094
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 16,915	千ノルウェー・クローネ 14,888
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 13,712	千スウェーデン・クローナ 12,914
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 111,333	千メキシコ・ペソ 63,692
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 369,093	千オフショア・人民元 18,682
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 15,418	千マレーシア・リンギット 8,762
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 13,489	千ポーランド・ズロチ 7,291
	ユーロ アイルランド	国債証券	千ユーロ 5,238	千ユーロ 3,823
	ユーロ オランダ	国債証券	15,082	10,731
	ユーロ ベルギー	国債証券	17,985	11,988
	ユーロ フランス	国債証券	79,108	52,916
	ユーロ ドイツ	国債証券	67,768	45,631
	ユーロ スペイン	国債証券	46,170	31,229
	ユーロ イタリア	国債証券	74,616	52,932
	ユーロ フィンランド	国債証券	4,741	3,163
	ユーロ オーストリア	国債証券	12,167	8,398

（注）金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

■利害関係人との取引状況等（2022年２月22日から2023年２月21日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	0.032	0.032	100.0	0.032	0.032	100.0

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BB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 774,590	千アメリカ・ドル 689,046	千円 92,552,791	% 49.5	% －	% 21.4	% 18.2	% 9.9
カナダ	千カナダ・ドル 41,990	千カナダ・ドル 38,354	千円 3,827,785	2.0	－	1.1	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 35,405	千オーストラリア・ドル 31,922	千円 2,963,084	1.6	－	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 8,895	千シンガポール・ドル 8,486	千円 853,411	0.5	－	0.2	0.2	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 5,560	千ニュージーランド・ドル 4,858	千円 408,149	0.2	－	0.1	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 65,284	千イギリス・ポンド 55,908	千円 9,037,014	4.8	－	3.4	0.9	0.5
イスラエル	千イスラエル・シュケル 17,540	千イスラエル・シュケル 16,376	千円 614,774	0.3	－	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 33,220	千デンマーク・クローネ 31,156	千円 600,381	0.3	－	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 29,010	千ノルウェー・クローネ 27,010	千円 354,646	0.2	－	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 29,770	千スウェーデン・クローナ 28,193	千円 366,227	0.2	－	0.1	0.1	－
メキシコ	千メキシコ・ペソ 234,607	千メキシコ・ペソ 217,394	千円 1,589,526	0.9	－	0.4	0.3	0.1
中国	千オフショア・人民元 419,720	千オフショア・人民元 419,249	千円 8,205,585	4.4	－	1.9	2.0	0.4
マレーシア	千マレーシア・リンギット 33,550	千マレーシア・リンギット 34,072	千円 1,032,254	0.6	－	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 32,170	千ポーランド・ズロチ 27,310	千円 826,099	0.4	－	0.1	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	9,450	8,192	1,175,166	0.6	－	0.4	0.2	0.0
オランダ	21,490	19,601	2,811,844	1.5	－	0.9	0.5	0.1
ベルギー	26,630	24,128	3,461,253	1.9	－	1.3	0.4	0.1
フランス	120,130	109,930	15,769,556	8.4	－	5.2	2.6	0.7
ドイツ	91,020	84,475	12,118,072	6.5	－	3.4	2.0	1.1
スペイン	69,860	64,753	9,288,912	5.0	－	2.8	1.5	0.7
イタリア	106,807	97,750	14,022,270	7.5	－	4.2	2.3	1.0
フィンランド	7,640	6,508	933,600	0.5	－	0.3	0.2	0.1
オーストリア	17,370	15,259	2,188,922	1.2	－	0.6	0.4	0.1
合計	－	－	千円 185,001,333	99.0	－	50.1	33.3	15.7

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

（注2）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	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,460	2,346	315,144	2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	500	480	64,520	2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	710	691	92,923	2024/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	2,550	2,490	334,501	2024/01/31
US T N/B 0.875 01/31/24	国債証券	0.8750	200	192	25,837	2024/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	4,940	4,463	599,597	2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	3,969	533,182	2029/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	705	94,711	2025/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,739	502,279	2028/01/31
US T N/B 1.125 01/15/25	国債証券	1.1250	4,880	4,570	613,950	2025/01/15
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	3,700	3,302	443,558	2026/01/31
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	800	790	106,129	2026/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	400	418	56,275	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,860	1,635	219,679	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,740	1,516	203,634	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,770	1,358	182,433	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	500	476	64,069	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	860	947	127,274	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	400	431	57,917	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	830	918	123,374	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,527	205,189	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,310	2,790	374,852	2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	4,300	3,071	412,560	2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	636	85,440	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	890	969	130,285	2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,807	377,043	2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	4,920	3,221	432,653	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	2,890	2,674	359,252	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,310	1,781	239,230	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,960	1,644	220,856	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,223	298,606	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	2,090	2,043	274,533	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,939	260,547	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,330	4,011	538,848	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	3,370	3,174	426,418	2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,518	472,624	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,650	1,602	215,212	2024/02/29
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,164	290,721	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,891	254,052	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	7,890	6,465	868,443	2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	4,700	3,401	456,856	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,720	2,528	339,658	2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	7,280	6,208	833,960	2032/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	979	131,533	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	3,730	3,194	429,149	2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	3,610	3,306	444,114	2027/02/28
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	4,800	4,574	614,488	2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,782	373,724	2025/02/28

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.5 02/29/24	国債証券	1.5000	4,000	3,860	518,517	2024/02/29
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	3,860	3,351	450,202	2028/02/29
US T N/B 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750	4,000	3,551	477,024	2029/02/28
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	5,170	4,618	620,325	2026/02/28
US T N/B 1.5 02/15/25	国債証券	1.5000	4,550	4,282	575,202	2025/02/15
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	3,340	3,241	435,345	2024/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	1,790	1,721	231,172	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	1,300	1,224	164,418	2026/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	2,200	1,912	256,880	2027/03/31
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	3,910	3,720	499,752	2024/03/15
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	2,860	2,630	353,302	2025/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	3,610	3,148	422,881	2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	3,220	2,894	388,853	2026/03/31
US T N/B 2.375 03/31/29	国債証券	2.3750	3,000	2,736	367,590	2029/03/31
US T N/B 2.25 03/31/24	国債証券	2.2500	4,750	4,609	619,178	2024/03/31
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	2,650	2,486	333,923	2027/03/31
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	4,000	3,777	507,456	2025/03/15
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	2,000	1,931	259,405	2025/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	4,720	4,567	613,484	2024/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,260	1,190	159,855	2026/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,194	429,092	2024/04/30
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	4,010	3,491	468,917	2028/04/30
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	4,140	3,935	528,671	2024/04/15
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,370	2,043	274,492	2027/04/30
US T N/B 2.5 04/30/24	国債証券	2.5000	4,010	3,895	523,179	2024/04/30
US T N/B 2.875 04/30/29	国債証券	2.8750	3,000	2,815	378,184	2029/04/30
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	3,700	3,314	445,169	2026/04/30
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,560	2,341	314,469	2025/04/30
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	3,000	2,840	381,552	2027/04/30
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	3,000	2,882	387,156	2025/04/15
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	759	869	116,791	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	910	960	128,992	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	230	243	32,641	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	1,080	928	124,733	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	950	990	133,106	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,290	1,914	257,152	2043/05/15
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	5,560	4,092	549,728	2051/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,430	1,287	172,974	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	400	337	45,270	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,620	1,358	182,510	2047/05/15
US T N/B 2.875 05/15/52	国債証券	2.8750	4,510	3,701	497,215	2052/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	2,230	1,713	230,090	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,830	2,430	326,521	2048/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,300	2,117	284,480	2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,300	2,715	364,751	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	600	644	86,516	2038/05/15
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	3,420	2,627	352,892	2041/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	5,100	4,950	664,909	2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,950	3,751	503,911	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,860	4,593	617,044	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	3,470	3,161	424,615	2029/05/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,430	4,129	554,640	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	555	627	84,238	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	3,670	3,379	453,980	2026/05/15
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	800	770	103,535	2024/05/31
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	3,870	2,161	290,275	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	1,550	1,450	194,825	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	9,240	7,821	1,050,585	2031/05/15
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	1,570	1,515	203,534	2025/05/31
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	3,760	3,360	451,421	2042/05/15
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	6,650	6,155	826,829	2032/05/15
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,980	1,702	228,647	2027/05/31
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	3,300	2,867	385,217	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	7,500	7,079	950,969	2024/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	5,650	4,505	605,229	2030/05/15
US T N/B 2.5 05/31/24	国債証券	2.5000	4,180	4,052	544,394	2024/05/31
US T N/B 2.625 05/31/27	国債証券	2.6250	3,410	3,210	431,193	2027/05/31
US T N/B 2.75 05/31/29	国債証券	2.7500	3,300	3,072	412,678	2029/05/31
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	3,630	3,243	435,623	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	3,890	3,537	475,152	2025/05/31
US T N/B 2.75 05/15/25	国債証券	2.7500	4,000	3,849	517,090	2025/05/15
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	290	279	37,531	2024/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,040	999	134,312	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	1,880	1,743	234,223	2026/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,283	172,381	2024/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	2,780	2,384	320,330	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,710	3,217	432,220	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,500	3,176	426,615	2025/06/30
US T N/B 3.25 06/30/27	国債証券	3.2500	3,500	3,379	453,886	2027/06/30
US T N/B 0.25 06/15/24	国債証券	0.2500	3,780	3,555	477,543	2024/06/15
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	3,310	2,964	398,176	2026/06/30
US T N/B 3.25 06/30/29	国債証券	3.2500	3,000	2,874	386,101	2029/06/30
US T N/B 2.875 06/15/25	国債証券	2.8750	4,920	4,748	637,776	2025/06/15
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	380	366	49,207	2024/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	2,200	2,123	285,253	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,000	1,852	248,827	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	1,990	1,903	255,644	2024/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	3,770	3,215	431,892	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,780	3,213	431,669	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	3,800	3,437	461,727	2025/07/31
US T N/B 2.625 07/31/29	国債証券	2.6250	2,570	2,373	318,786	2029/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	3,900	3,452	463,687	2026/07/31
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	3,820	3,611	485,042	2027/07/31
US T N/B 0.375 07/15/24	国債証券	0.3750	4,000	3,755	504,413	2024/07/15
US T N/B 3.0 07/31/24	国債証券	3.0000	3,820	3,719	499,593	2024/07/31
US T N/B 3.0 07/15/25	国債証券	3.0000	3,200	3,094	415,670	2025/07/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	820	794	106,691	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,290	1,279	171,824	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,540	1,267	170,217	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,090	1,804	242,413	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	980	1,051	141,238	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,470	1,381	185,618	2043/08/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,110	3,439	462,016	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,457	195,769	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	4,050	3,831	514,671	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,784	239,650	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	3,040	2,193	294,573	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	3,640	3,067	411,995	2052/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	4,610	4,444	596,962	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,070	1,506	202,297	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,810	2,360	317,078	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,922	526,825	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,730	3,404	457,331	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	4,530	4,273	573,981	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,759	236,357	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,960	3,448	463,216	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	820	783	105,289	2024/08/31
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,658	357,068	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	4,930	3,452	463,693	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	3,160	2,013	270,388	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,870	2,799	375,976	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	5,840	5,341	717,415	2032/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,130	6,636	891,362	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	6,340	5,024	674,950	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	998	134,165	2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,870	2,719	365,229	2024/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,242	435,570	2025/08/31
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	4,100	3,835	515,216	2024/08/15
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,200	429,932	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,611	350,731	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	2,950	2,616	351,465	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,938	394,652	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,957	397,289	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,784	508,341	2027/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,689	226,869	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	590	565	75,973	2024/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,310	2,801	376,311	2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,417	190,418	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	3,980	3,432	461,003	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,349	449,937	2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	4,310	4,091	549,611	2024/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	2,000	2,002	268,986	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	3,110	2,764	371,360	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,934	394,200	2025/09/15
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	2,000	1,866	250,758	2024/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	3,250	3,230	433,930	2029/09/30
US T N/B 4.25 09/30/24	国債証券	4.2500	2,200	2,181	292,958	2024/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	2,350	2,254	302,779	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,270	1,223	164,362	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	1,710	1,562	209,840	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,082	548,376	2028/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,760	2,614	351,231	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,108	417,485	2027/10/31

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	3,390	3,034	407,622	2026/10/31
US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	0.6250	4,000	3,739	502,314	2024/10/15
US T N/B 4.0 10/31/29	国債証券	4.0000	2,000	2,003	269,059	2029/10/31
US T N/B 4.375 10/31/24	国債証券	4.3750	2,070	2,056	276,239	2024/10/31
US T N/B 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	3,940	3,947	530,223	2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	4,000	3,587	481,831	2025/10/31
US T N/B 4.25 10/15/25	国債証券	4.2500	2,800	2,789	374,678	2025/10/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	903	121,383	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	200	217	29,227	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,560	1,317	177,027	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	600	623	83,803	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,556	1,277	171,593	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,020	899	120,822	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,460	1,396	187,573	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,250	1,801	241,941	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	4,780	2,935	394,308	2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	4,670	3,041	408,512	2051/11/15
US T N/B 4.0 11/15/52	国債証券	4.0000	2,460	2,519	338,378	2052/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	860	724	97,267	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	1,080	886	119,135	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	3,080	2,954	396,785	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,000	1,057	142,106	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,200	2,883	387,345	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	3,290	2,438	327,498	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	3,620	3,423	459,875	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	4,380	4,180	561,571	2028/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,830	2,616	351,452	2026/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,015	405,100	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	1,780	1,702	228,629	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	1,360	1,307	175,567	2025/11/30
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	1,200	1,196	160,705	2042/11/15
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	3,190	2,120	284,839	2040/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	4,250	3,102	416,683	2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,651	221,798	2026/11/30
US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	4.1250	4,500	4,605	618,606	2032/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,050	1,797	241,409	2029/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	7,990	6,549	879,702	2031/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	8,280	6,665	895,296	2030/11/15
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	3,900	3,324	446,539	2027/11/30
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	3,700	3,322	446,256	2026/11/30
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	4,000	3,484	468,084	2028/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	3,190	2,862	384,544	2025/11/30
US T N/B 3.875 11/30/29	国債証券	3.8750	2,300	2,286	307,149	2029/11/30
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	2,610	2,438	327,486	2024/11/15
US T N/B 3.875 11/30/27	国債証券	3.8750	3,000	2,978	400,016	2027/11/30
US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	4.5000	3,570	3,581	481,011	2025/11/15
US T N/B 4.5 11/30/24	国債証券	4.5000	4,200	4,183	561,929	2024/11/30
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	1,000	955	128,317	2025/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	2,871	385,645	2024/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	2,110	1,931	259,380	2026/12/31
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	3,890	3,488	468,519	2026/12/31

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,990	1,887	253,493	2024/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,500	3,888	522,344	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,688	361,168	2025/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	3,320	2,823	379,294	2027/12/31
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	4,610	4,314	579,498	2024/12/15
US T N/B 4.0 12/15/25	国債証券	4.0000	4,140	4,104	551,371	2025/12/15
小計	－	－	774,590	689,046	92,552,791	－
(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	200	193	19,261	2024/02/01
CANADA 3.75 02/01/25	国債証券	3.7500	1,160	1,151	114,920	2025/02/01
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	420	410	40,980	2024/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	662	66,097	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,410	1,271	126,871	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	1,210	1,108	110,592	2027/03/01
CANADA 3.5 03/01/28	国債証券	3.5000	480	482	48,142	2028/03/01
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,432	142,914	2024/04/01
CANADA 1.5 04/01/25	国債証券	1.5000	1,100	1,043	104,188	2025/04/01
CANADA 1.5 05/01/24	国債証券	1.5000	940	907	90,610	2024/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	655	65,387	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	740	842	84,063	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	610	737	73,611	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	280	332	33,171	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	970	947	94,560	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	570	621	62,003	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	850	797	79,553	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,320	1,273	127,124	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	550	498	49,729	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	430	405	40,463	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	1,850	1,608	160,516	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,470	2,151	214,768	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	1,940	1,741	173,827	2032/06/01
CANADA 2.75 08/01/24	国債証券	2.7500	590	576	57,579	2024/08/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	440	422	42,143	2024/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,910	1,755	175,177	2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	850	825	82,361	2027/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,270	1,161	115,930	2026/09/01
CANADA 0.75 10/01/24	国債証券	0.7500	810	766	76,518	2024/10/01
CANADA 3.0 10/01/25	国債証券	3.0000	500	489	48,838	2025/10/01
CANADA 3.0 11/01/24	国債証券	3.0000	860	842	84,120	2024/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	700	719	71,803	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	630	571	57,018	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,820	2,152	214,810	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	2,200	1,560	155,691	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	390	345	34,442	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,800	1,458	145,555	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	2,020	1,746	174,312	2031/12/01
CANADA 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,300	1,215	121,266	2032/12/01
CANADA 2.25 12/01/29	国債証券	2.2500	500	469	46,853	2029/12/01
小計	－	－	41,990	38,354	3,827,785	－
(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	880	719	66,774	2047/03/21

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	
(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 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	1,380	1,372	127,357	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	840	877	81,455	2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	970	959	89,073	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	1,200	1,225	113,742	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,500	1,466	136,143	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	1,230	1,301	120,771	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	830	804	74,696	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	880	822	76,347	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,810	1,671	155,113	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	900	736	68,400	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	1,890	1,517	140,866	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	1,200	1,187	110,260	2034/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	820	735	68,266	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	1,610	1,350	125,353	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	650	574	53,337	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	1,200	716	66,507	2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	1,815	1,629	151,265	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	960	916	85,049	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,230	1,183	109,875	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,400	1,320	122,592	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	1,170	1,084	100,627	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	1,850	1,542	143,147	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	2,170	1,722	159,897	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,360	1,244	115,518	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	1,990	1,878	174,356	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,670	1,360	126,286	2030/12/21
小計	－	－	35,405	31,922	2,963,084	－
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	280	276	27,762	2024/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	800	810	81,493	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	500	482	48,469	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	490	402	40,454	2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	340	325	32,749	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	420	410	41,263	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	780	764	76,828	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	370	357	35,923	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	590	580	58,381	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	190	169	17,081	2039/07/01
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	350	310	31,180	2031/07/01
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国債証券	3.0000	125	133	13,468	2072/08/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	590	528	53,119	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	720	717	72,120	2024/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	620	606	61,025	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	330	335	33,709	2033/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国債証券	2.8750	200	198	19,950	2027/09/01
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	410	342	34,462	2051/10/01
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500	410	382	38,467	2026/11/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	380	353	35,499	2025/11/01
小計	－	－	8,895	8,486	853,411	－
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	700	704	59,147	2027/04/15

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	
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	350	326	27,388	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	330	269	22,671	2037/04/15
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	570	548	46,062	2025/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	350	325	27,343	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	440	320	26,955	2051/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	400	261	21,933	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	580	467	39,248	2031/05/15
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	130	128	10,762	2034/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	350	288	24,274	2032/05/15
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	350	284	23,880	2028/05/15
NEW ZEALAND 0.5 05/15/24	国債証券	0.5000	650	616	51,759	2024/05/15
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国債証券	0.5000	360	318	26,719	2026/05/15
小計	－	－	5,560	4,858	408,149	－
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	1,140	1,024	165,561	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,450	1,349	218,056	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	900	935	151,164	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	630	407	65,817	2049/01/22
UK TREASURY 3.75 01/29/38	国債証券	3.7500	400	393	63,654	2038/01/29
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	1,670	895	144,822	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	760	511	82,633	2039/01/31
UK TREASURY 1.0 01/31/32	国債証券	1.0000	2,370	1,911	308,921	2032/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	1,800	1,739	281,174	2024/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	680	571	92,378	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,040	886	143,227	2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25	国債証券	0.2500	2,400	2,245	362,991	2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,150	1,048	169,427	2026/01/30
UK TREASURY 4.125 01/29/27	国債証券	4.1250	800	815	131,800	2027/01/29
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,095	1,127	182,246	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	1,700	1,782	288,153	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	950	920	148,822	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,440	1,527	246,876	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	1,060	996	161,098	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,000	616	99,579	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	1,630	889	143,790	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	970	940	152,076	2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53	国債証券	1.5000	1,110	638	103,220	2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,130	685	110,865	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	1,250	922	149,098	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	930	882	142,612	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	1,100	1,033	167,081	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	1,600	1,461	236,203	2027/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	900	686	111,006	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,770	1,352	218,668	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	1,350	936	151,303	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	1,260	1,311	211,965	2039/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	810	798	129,072	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	1,190	1,150	185,901	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	900	971	157,087	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,390	1,066	172,392	2037/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	870	515	83,279	2054/10/22

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	1,460	511	82,741	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	830	451	72,904	2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73	国債証券	1.1250	740	317	51,393	2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	1,600	1,036	167,567	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	450	202	32,747	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	1,130	1,028	166,269	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	2,260	1,922	310,711	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	1,220	969	156,774	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	1,390	1,244	201,133	2026/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	680	770	124,599	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	980	1,080	174,681	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,265	1,362	220,223	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,080	1,122	181,458	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,212	1,294	209,168	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	910	944	152,599	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,070	1,113	179,988	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,395	1,521	245,866	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	1,017	1,065	172,151	2049/12/07
小計	－	－	65,284	55,908	9,037,014	－
(イスラエル)		%	千イスラエル・シュケル	千イスラエル・シュケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	1,090	1,342	50,386	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国債証券	0.5000	310	280	10,514	2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	2,090	2,078	78,013	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	2,230	2,076	77,940	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	1,320	1,311	49,247	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	2,860	2,380	89,364	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	1,890	1,749	65,680	2025/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	1,450	1,096	41,155	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,300	2,176	81,698	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	1,460	1,347	50,569	2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	220	237	8,917	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	国債証券	0.4000	320	300	11,286	2024/10/31
小計	－	－	17,540	16,376	614,774	－
(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	3,760	2,037	39,256	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	7,860	9,812	189,081	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	4,040	3,926	75,669	2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	6,350	5,749	110,795	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	4,830	4,202	80,975	2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	4,180	3,337	64,317	2031/11/15
DENMARK 0.0 11/15/24	国債証券	0.0000	2,200	2,090	40,284	2024/11/15
小計	－	－	33,220	31,156	600,381	－
(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	4,480	4,252	55,831	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	2,400	2,266	29,760	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	2,370	2,358	30,962	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	6,130	5,931	77,883	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	1,950	25,605	2028/04/26
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	1,980	1,805	23,710	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	4,310	3,788	49,745	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	2,620	2,396	31,459	2029/09/06

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	
(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 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,650	2,260	29,686	2031/09/17
小計	－	－	29,010	27,010	354,646	－
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,420	3,860	50,146	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	2,890	2,632	34,192	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	6,120	6,057	78,681	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	5,420	4,469	58,060	2031/05/12
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	2,654	34,482	2032/06/01
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	6,210	5,833	75,777	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,010	2,685	34,885	2029/11/12
小計	－	－	29,770	28,193	366,227	－
(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	29,842	26,541	194,062	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	10,580	9,121	66,691	2027/03/04
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	9,180	8,225	60,143	2025/03/06
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	20,159	19,594	143,272	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,648	28,407	207,710	2031/05/29
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	5,790	5,244	38,343	2033/05/26
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	24,746	23,052	168,555	2027/06/03
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	6,290	5,645	41,276	2053/07/31
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	22,070	21,098	154,263	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	17,277	15,096	110,380	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	16,161	14,508	106,083	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,807	108,271	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,931	43,367	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	4,835	4,411	32,257	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	15,902	15,707	114,846	2024/12/05
小計	－	－	234,607	217,394	1,589,526	－
(中国)		%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	20,000	19,779	387,117	2032/02/17
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	34,500	34,380	672,902	2025/02/24
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	5,100	5,167	101,145	2050/03/16
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	10,997	215,235	2029/03/24
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	国債証券	2.2800	12,000	12,005	234,970	2024/03/17
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	14,320	14,442	282,676	2052/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	2,100	2,255	44,148	2051/04/12
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	30,100	29,875	584,732	2027/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	1,000	1,013	19,830	2031/05/27
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	3,000	2,969	58,114	2032/05/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,600	6,522	127,660	2030/05/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,452	165,436	2025/05/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	7,500	7,549	147,767	2027/06/04
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	20,000	19,904	389,565	2029/06/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	450	460	9,015	2026/06/06
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	国債証券	2.1800	4,200	4,193	82,076	2024/06/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,256	396,471	2027/07/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	13,000	12,764	249,819	2032/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	30,000	29,770	582,671	2025/08/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	26,600	26,675	522,102	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	国債証券	3.5900	5,000	5,236	102,489	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	国債証券	2.6000	7,300	7,120	139,358	2032/09/01

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(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 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	15,300	15,328	300,017	2024/09/02
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	国債証券	2.6200	17,500	17,269	338,002	2029/09/25
CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	国債証券	1.9900	10,000	9,952	194,784	2024/09/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	18,950	19,723	386,034	2051/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	15,600	15,727	307,828	2028/10/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	国債証券	2.4400	11,000	10,892	213,183	2027/10/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	国債証券	2.8000	17,300	17,178	336,224	2032/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	4,100	4,107	80,384	2031/11/18
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	国債証券	2.2800	14,800	14,705	287,825	2025/11/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	国債証券	2.7900	9,000	8,959	175,359	2029/12/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	3,500	3,608	70,632	2027/12/03
小計	－	－	419,720	419,249	8,205,585	－
(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	600	606	18,376	2027/03/15
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	300	316	9,589	2046/03/15
MALAYSIA 3.882 03/14/25	国債証券	3.8820	300	302	9,173	2025/03/14
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,050	1,077	32,645	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,200	1,253	37,974	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,660	1,632	49,455	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,700	1,806	54,730	2037/04/07
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,000	913	27,676	2031/04/15
MALAYSIA 4.504 04/30/29	国債証券	4.5040	300	312	9,471	2029/04/30
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	650	646	19,599	2027/05/31
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	1,500	1,413	42,811	2040/05/22
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	600	608	18,440	2035/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,004	60,726	2028/06/15
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	670	683	20,720	2031/06/30
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	620	672	20,372	2038/06/08
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,000	1,003	30,395	2024/06/14
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	400	377	11,430	2050/06/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	1,030	1,041	31,556	2024/07/15
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	1,990	2,145	65,000	2048/07/06
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	920	931	28,222	2026/07/15
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,820	1,778	53,865	2034/07/05
MALAYSIA 3.582 07/15/32	国債証券	3.5820	1,400	1,366	41,392	2032/07/15
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	700	702	21,286	2029/08/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	2,400	2,429	73,614	2025/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,600	1,725	52,286	2043/09/30
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	900	909	27,561	2024/09/30
MALAYSIA 4.696 10/15/42	国債証券	4.6960	1,200	1,272	38,537	2042/10/15
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,660	1,683	51,001	2026/11/30
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	1,430	1,447	43,851	2027/11/16
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	950	1,006	30,484	2033/11/07
小計	－	－	33,550	34,072	1,032,254	－
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,391	42,100	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,480	2,923	88,426	2028/04/25
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	2,370	1,609	48,679	2032/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	780	748	22,634	2024/04/25
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	3,370	2,995	90,600	2025/04/25
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	1,450	1,303	39,438	2027/05/25

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,790	2,456	74,295	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	3,830	3,562	107,763	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,360	2,007	60,709	2027/07/25
POLAND 07/25/24	国債証券	0.0000	1,710	1,571	47,534	2024/07/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	630	504	15,259	2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	2,150	2,015	60,979	2024/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	3,930	2,716	82,172	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,880	1,504	45,504	2026/10/25
小計	－	－	32,170	27,310	826,099	－
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	840	678	97,320	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	360	321	46,147	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	240	241	34,614	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	850	893	128,106	2025/03/13
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	250	159	22,810	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	580	402	57,806	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	390	331	47,564	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	590	574	82,454	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	610	555	79,654	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	730	659	94,564	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	950	899	129,077	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	350	292	41,922	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	370	270	38,782	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	520	467	67,011	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	870	679	97,428	2031/10/18
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	400	314	45,125	2032/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	550	451	64,775	2030/10/18
小計	－	－	9,450	8,192	1,175,166	－
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,320	1,510	216,714	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,540	1,567	224,837	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,000	488	70,076	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	780	881	126,470	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,280	1,454	208,697	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,110	1,087	156,000	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	550	364	52,258	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,110	775	111,308	2040/01/15
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	360	313	44,992	2054/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	1,110	948	136,123	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,080	972	139,514	2027/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	640	590	84,697	2026/01/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,420	1,317	189,022	2026/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,140	1,124	161,327	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,490	1,402	201,127	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,240	1,121	160,908	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,160	1,068	153,227	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,060	911	130,746	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	700	575	82,581	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,200	960	137,748	2031/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	200	163	23,462	2032/07/15
小計	－	－	21,490	19,601	2,811,844	－

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	1,570	1,769	253,826	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,280	1,440	206,696	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,070	1,122	161,070	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	630	678	97,342	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,220	1,440	206,598	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	810	684	98,207	2033/04/22
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500	220	205	29,452	2039/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	740	787	112,920	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	780	556	79,875	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	980	697	100,014	2050/06/22
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	710	453	65,042	2053/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	390	307	44,168	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	450	342	49,111	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	670	275	39,451	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,030	971	139,373	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	840	834	119,770	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,570	1,348	193,449	2031/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	1,010	909	130,468	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	450	278	40,016	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,430	1,272	182,594	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	680	670	96,134	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	610	510	73,245	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,980	1,888	270,861	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	960	881	126,503	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	380	302	43,460	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	1,300	1,066	153,048	2030/06/22
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500	600	471	67,607	2032/06/22
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	750	720	103,373	2024/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	940	728	104,517	2031/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	580	509	73,051	2027/10/22
小計	－	－	26,630	24,128	3,461,253	－
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	2,450	2,192	314,456	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	2,910	2,672	383,300	2026/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	1,220	1,183	169,796	2024/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	国債証券	0.0000	1,990	1,876	269,117	2025/02/25
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500	1,980	1,789	256,749	2028/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	3,020	2,923	419,317	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	3,320	3,122	447,954	2025/03/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	3,000	3,058	438,763	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,640	3,099	444,621	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,530	1,756	252,027	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,170	1,372	196,903	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	3,880	4,463	640,344	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,930	2,252	323,055	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	2,470	2,486	356,634	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,950	1,548	222,122	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	2,470	1,719	246,634	2050/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	2,040	1,112	159,652	2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	1,950	1,038	148,975	2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	990	678	97,377	2066/05/25

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	790	303	43,504	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	2,500	2,475	355,131	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	4,550	4,467	640,891	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,110	4,602	660,267	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,480	3,152	452,258	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	4,230	4,008	574,961	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	3,590	3,123	448,037	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,860	2,380	341,450	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	3,460	3,210	460,508	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	2,360	2,191	314,327	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,650	1,065	152,893	2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	3,190	2,551	365,992	2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	500	384	55,135	2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国債証券	2.5000	250	222	31,949	2043/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	2,290	1,757	252,091	2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	2,070	1,706	244,852	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,150	680	97,578	2044/06/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,170	2,340	335,802	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	3,890	3,882	556,952	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,940	2,134	306,132	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,510	3,108	445,887	2032/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,380	2,330	334,287	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,740	2,606	373,927	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,620	2,382	341,795	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	3,400	3,033	435,169	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	3,270	2,556	366,670	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	3,780	3,048	437,298	2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国債証券	2.0000	1,600	1,476	211,757	2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,890	2,399	344,241	2029/11/25
小計	－	－	120,130	109,930	15,769,556	－
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,310	1,493	214,254	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	780	965	138,430	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,520	1,847	265,041	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,830	2,144	307,667	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,900	1,815	260,429	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	2,660	2,496	358,117	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	2,080	1,828	262,241	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,940	1,761	252,687	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,430	1,413	202,749	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,120	1,937	277,926	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	1,840	1,521	218,263	2031/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	2,900	2,340	335,782	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	2,620	2,215	317,775	2030/02/15
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	国債証券	0.0000	1,500	1,455	208,741	2024/03/15
BUNDESOBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,260	1,220	175,013	2024/04/05
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,590	1,498	214,963	2025/04/11
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	2,110	1,943	278,846	2026/04/10
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	1,360	1,224	175,662	2027/04/16
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,520	1,493	214,299	2024/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,660	1,223	175,440	2035/05/15

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000	350	282	40,482	2038/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,580	1,133	162,637	2036/05/15
BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	国債証券	0.2000	1,250	1,206	173,032	2024/06/14
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	850	985	141,339	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	560	622	89,277	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,700	2,093	300,283	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,330	1,480	212,336	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,070	2,084	298,951	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,410	1,847	265,047	2040/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,820	2,227	319,477	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,170	2,205	316,314	2046/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	1,040	525	75,360	2052/08/15
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	500	434	62,328	2053/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	2,430	1,914	274,671	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	2,420	2,317	332,464	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	1,910	1,749	250,924	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,980	1,810	259,750	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,770	1,570	225,347	2028/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,820	1,770	253,925	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,990	1,702	244,286	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	2,230	1,182	169,652	2050/08/15
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000	1,430	1,342	192,628	2032/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	2,190	1,789	256,743	2031/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	710	376	54,038	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,430	2,032	291,544	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	590	494	70,887	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	800	654	93,934	2031/08/15
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	国債証券	0.4000	900	865	124,202	2024/09/13
BUNDESOBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,590	1,516	217,554	2024/10/18
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	1,360	1,238	177,641	2026/10/09
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,750	1,630	233,851	2025/10/10
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	1,880	1,780	255,344	2027/10/15
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	450	419	60,243	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,620	1,440	206,670	2027/11/15
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,060	1,792	257,198	2028/11/15
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000	800	781	112,076	2029/11/15
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	国債証券	2.2000	1,350	1,333	191,285	2024/12/12
小計	－	－	91,020	84,475	12,118,072	－
(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	1,460	1,682	241,329	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,200	1,219	174,885	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,400	1,480	212,407	2037/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	2,050	1,932	277,228	2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	1,610	1,426	204,579	2027/01/31
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,160	996	142,881	2028/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	1,960	1,789	256,768	2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,630	1,580	226,690	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,470	1,483	212,736	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,210	2,073	297,511	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,330	1,284	184,311	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,170	1,073	153,970	2028/04/30

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,400	1,266	181,616	2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,550	1,226	176,010	2032/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,500	1,242	178,240	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,380	1,066	153,023	2031/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	1,110	1,068	153,206	2024/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	670	624	89,589	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,630	1,778	255,064	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,290	1,477	211,882	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,630	1,834	263,149	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,120	1,020	146,328	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,135	1,176	168,776	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,770	1,620	232,436	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,815	2,167	310,970	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,470	1,325	190,206	2033/07/30
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	250	236	33,860	2043/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,510	1,380	198,013	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,840	1,521	218,249	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	1,080	1,037	148,864	2024/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	600	408	58,668	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	540	336	48,220	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,750	1,580	226,787	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	700	603	86,557	2029/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	2,190	2,180	312,749	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,830	2,014	288,987	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,210	1,458	209,176	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,180	1,026	147,252	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,190	983	141,024	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	670	439	63,062	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	410	196	28,229	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,590	846	121,393	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	2,010	1,964	281,833	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,560	1,448	207,740	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,730	1,625	233,239	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,530	1,295	185,780	2029/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,640	1,294	185,709	2031/10/31
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,720	1,597	229,206	2032/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,260	845	121,305	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,750	1,514	217,197	2030/10/31
小計	－	－	69,860	64,753	9,288,912	－
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,310	1,181	169,475	2027/01/15
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	300	300	43,125	2026/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,460	1,635	234,590	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	2,170	2,094	300,422	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,350	1,249	179,236	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,800	1,697	243,575	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,610	1,475	211,666	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	1,500	1,231	176,723	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,090	825	118,364	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,190	1,025	147,101	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,710	1,729	248,084	2024/03/01

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	700	485	69,607	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	360	209	30,091	2072/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	560	577	82,809	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,910	1,963	281,716	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	1,790	1,466	210,341	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	2,350	1,981	284,218	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,020	922	132,392	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,870	1,828	262,352	2030/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,120	805	115,517	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	1,150	785	112,672	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	1,080	705	101,182	2037/03/01
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国債証券	3.2500	600	522	74,992	2038/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,460	1,229	176,429	2028/03/15
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国債証券	4.0000	660	637	91,495	2035/04/30
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	810	486	69,716	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,550	1,306	187,389	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,610	1,268	181,937	2031/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国債証券	0.0000	1,400	1,348	193,479	2024/04/15
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国債証券	3.4000	550	540	77,564	2028/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	1,520	1,363	195,585	2026/04/01
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	1,100	996	142,922	2027/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,480	2,836	406,842	2031/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	990	972	139,517	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,280	1,228	176,239	2025/05/15
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国債証券	4.4000	200	201	28,948	2033/05/01
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,350	1,271	182,328	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,460	1,400	200,836	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	1,290	1,219	175,002	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	1,380	1,048	150,371	2032/06/01
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国債証券	2.8000	1,200	1,129	162,052	2029/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,290	1,231	176,614	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,174	168,428	2024/07/01
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,100	927	133,115	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	1,240	1,196	171,670	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,660	1,757	252,057	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,170	1,246	178,813	2039/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,500	1,404	201,465	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,610	1,535	220,254	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,520	1,150	165,069	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,350	1,090	156,378	2030/08/01
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	国債証券	0.0000	1,460	1,389	199,277	2024/08/15
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国債証券	1.2000	1,360	1,287	184,674	2025/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	1,250	1,108	159,050	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	1,810	1,525	218,828	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	1,110	1,156	165,911	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	1,180	986	141,559	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,680	1,765	253,286	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,250	1,337	191,918	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	1,150	806	115,658	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	1,020	595	85,400	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,330	1,126	161,584	2033/09/01

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	510	326	46,792	2052/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,620	1,628	233,638	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	850	776	111,363	2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	860	680	97,558	2036/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,680	1,493	214,269	2027/09/15
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	350	395	56,749	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,510	1,698	243,685	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	2,140	2,329	334,212	2029/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	680	658	94,459	2024/11/15
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	1,350	1,317	188,940	2025/11/15
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	1,660	1,596	228,985	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,530	1,406	201,823	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	1,637	1,613	231,494	2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,740	1,656	237,564	2028/12/01
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	1,700	1,312	188,276	2031/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,740	1,470	210,955	2030/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,340	1,161	166,670	2032/12/01
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国債証券	3.8500	800	795	114,082	2029/12/15
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	国債証券	0.0000	1,360	1,279	183,569	2024/12/15
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国債証券	2.6500	1,220	1,165	167,238	2027/12/01
小計	－	－	106,807	97,750	14,022,270	－
(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	320	148	21,335	2052/04/15
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	370	366	52,545	2024/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	200	168	24,206	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	390	286	41,101	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	460	429	61,648	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	480	392	56,370	2034/04/15
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券	0.5000	380	235	33,842	2043/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	290	197	28,384	2036/04/15
FINLAND 1.375 04/15/27	国債証券	1.3750	110	103	14,905	2027/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	410	422	60,548	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	490	488	70,016	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	430	404	57,984	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	300	257	36,986	2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	350	333	47,855	2025/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	550	483	69,295	2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	420	379	54,371	2027/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	290	178	25,651	2040/09/15
FINLAND 1.5 09/15/32	国債証券	1.5000	50	43	6,298	2032/09/15
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	300	236	33,990	2031/09/15
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	210	168	24,221	2030/09/15
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	410	392	56,286	2024/09/15
FINLAND 0.0 09/15/26	国債証券	0.0000	430	388	55,752	2026/09/15
小計	－	－	7,640	6,508	933,600	－
(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	240	279	40,061	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	640	471	67,598	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	920	799	114,719	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	835	754	108,210	2028/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	710	561	80,597	2031/02/20

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000	900	751	107,806	2032/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	930	759	108,894	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	710	753	108,052	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	990	1,106	158,759	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	590	340	48,873	2051/03/20
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	210	94	13,571	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	1,070	974	139,748	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	580	544	78,164	2025/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	770	720	103,422	2034/05/23
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	290	228	32,749	2049/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	310	127	18,336	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	540	545	78,195	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	415	472	67,713	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	520	499	71,615	2024/07/15
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	160	155	22,342	2026/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	285	40,901	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	930	910	130,642	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,190	1,104	158,454	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	940	902	129,412	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	380	259	37,176	2036/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	450	258	37,104	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	570	484	69,568	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	190	113	16,225	2086/11/02
小計	－	－	17,370	15,259	2,188,922	－
合計	－	－	－	－	185,001,333	－

■投資信託財産の構成

2023年２月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	185,001,333	98.3
コール・ローン等、その他	3,186,068	1.7
投資信託財産総額	188,187,402	100.0

(注１) 評価額の単位未満は切捨てております。%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、186,640,391千円、99.2%です。
(注３) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年２月21日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝134.32円、１カナダ・ドル＝99.80円、１オーストラリア・ドル＝92.82円、１シンガポール・ドル＝100.56円、１ニュージーランド・ドル＝84.00円、１イギリス・ポンド＝161.64円、１イスラエル・シュケル＝37.54円、１デンマーク・クローネ＝19.27円、１ノルウェー・クローネ＝13.13円、１スウェーデン・クローナ＝12.99円、１メキシコ・ペソ＝7.311円、１オフショア・人民元＝19.572円、１マレーシア・リンギット＝30.295円、１ポーランド・ズロチ＝30.248円、１ユーロ＝143.45円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年２月21日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**188,187,402,199円**
コール・ローン等	1,927,378,048
公社債(評価額)	185,001,333,837
未収利息	1,090,149,276
前払費用	168,541,038
(B) 負債	**1,365,031,536**
未払金	1,352,244,536
未払解約金	12,787,000
(C) 純資産総額(A－B)	**186,822,370,663**
元本	92,568,430,085
次期繰越損益金	94,253,940,578
(D) 受益権総口数	**92,568,430,085口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**20,182円**

(注１) 期首元本額 70,448,298,510円
追加設定元本額 63,457,547,851円
一部解約元本額 41,337,416,276円

(注２) 期末における元本の内訳

ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	8,063,618,127円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（安定型）	4,664,534円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（中立型）	25,013,145円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（積極型）	61,798,332円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	61,093,331円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	42,637,226円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	48,023,427円
たわらノーロード 先進国債券	17,008,425,615円
たわらノーロード 先進国債券＜ラップ向け＞	245,317,778円
たわらノーロード バランス（８資産均等型）	2,489,017,308円
たわらノーロード バランス（堅実型）	65,360,184円
たわらノーロード バランス（標準型）	335,170,560円
たわらノーロード バランス（積極型）	71,793,070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）	16,208,215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）	982,389,497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）	1,586,938,015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）	725,563,344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）	429,869,427円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	2,046,942円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,848,744円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	179,191,650円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	14,908,588円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	24,576,579円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,613,575,783円
Ｏｎｅ ＤＣ 先進国債券インデックスファンド	837,273,305円
Ｏｎｅグローバルバランス	18,428,191円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	743,440,279円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,368,236,637円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,625,122,028円
ＤＩＡＭ ＤＣバランス30インデックスファンド	419,973,327円
ＤＩＡＭ ＤＣバランス50インデックスファンド	846,255,978円
ＤＩＡＭ ＤＣバランス70インデックスファンド	741,934,563円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	14,015,594円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	512,673,651円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	36,330,259円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）	146,595,885円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）	150,866,647円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）	231,293,861円
クルーズコントロール	895,480,870円
ＤＩＡＭ ８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	180,603,325円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	600,448,211円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	610,839,468円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	181,820,147円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	318,874,880円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,051,013,220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）	259,574,682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）	265,741,005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）	128,786,227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）	162,358,218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）	256,453,982円
インカム重視マルチアセット運用ファンドＩＩ2021−04（適格機関投資家限定）	618,270,983円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021−06（適格機関投資家限定）	198,620,020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）	231,445,712円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022−05（適格機関投資家限定）	208,546,866円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	5,554,465,372円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	2,585,064,790円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,555,775,823円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,282,640,293円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	81,242,436円
ＤＩＡＭワールドバランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,166,703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）	442,107,851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）	362,944,405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）	238,451,787円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,931,845円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,911,489円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,822,125円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,876円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド40ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,713,798円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	43,966,666円
ＤＩＡＭバランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,620,938,828円
ＤＩＡＭバランスファンド37.5ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,399,685,001円
ＤＩＡＭバランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,546,932,972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）	65,747,358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）	124,222,256円
ＤＩＡＭアクサ グローバル バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,489,912,024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）	300,752,649円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド55ＶＡ（適格機関投資家限定）	163,842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）	305,817,896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）	273,773,162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）	379,947,236円
ＤＩＡＭ世界バランス25ＶＡ（適格機関投資家限定）	46,662,175円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	56,505,520円
コア資産形成ファンド	37,769,335円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	756,300,586円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	514,130,947円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	7,052,612,220円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,364,933,377円
期末元本合計	92,568,430,085円

■損益の状況

当期　自2022年２月22日　至2023年２月21日

項目	当期
(A) 配当等収益	**3,630,658,528円**
受取利息	3,630,482,398
その他収益金	573,045
支払利息	△396,915
(B) 有価証券売買損益	**△4,048,984,550**
売買益	22,763,661,538
売買損	△26,812,646,088
(C) その他費用	**△27,916,414**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**△446,242,436**
(E) 前期繰越損益金	**71,516,620,489**
(F) 解約差損益金	**△44,647,207,624**
(G) 追加信託差損益金	**67,830,770,149**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**94,253,940,578**
次期繰越損益金(H)	**94,253,940,578**

(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15期（決算日　2023年４月18日）

（計算期間　2022年４月19日～2023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
		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				
	円	%	ポイント	%	%	%	%	百万円
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
15期(2023年４月18日)	14,206	△2.1	339,863.92	△1.0	92.1	7.4	0.7	91,982

（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）。

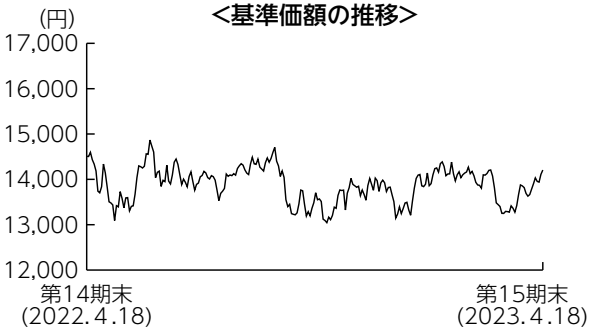
■当期中の基準価額と市況の推移

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、為替ヘッジなし)(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			
(期　首)	円	%	ポイント	%	%	%	%
2022年 4 月18日	14,507	－	343,415.90	－	84.0	15.2	0.6
4　月　末	13,836	△4.6	327,760.51	△4.6	84.0	15.4	0.6
5　月　末	14,037	△3.2	333,778.54	△2.8	88.5	10.8	0.7
6　月　末	14,327	△1.2	340,671.86	△0.8	91.5	7.8	0.6
7　月　末	13,982	△3.6	332,143.76	△3.3	90.4	9.1	0.6
8　月　末	14,331	△1.2	341,873.80	△0.4	89.6	9.9	0.6
9　月　末	13,229	△8.8	314,971.95	△8.3	92.4	7.0	0.6
10　月　末	13,110	△9.6	312,435.75	△9.0	90.8	8.6	0.7
11　月　末	13,862	△4.4	330,416.09	△3.8	86.8	12.5	0.7
12　月　末	13,325	△8.1	318,158.50	△7.4	92.4	6.9	0.7
2023年 1　月　末	14,285	△1.5	341,260.67	△0.6	91.1	8.2	0.7
2　月　末	13,869	△4.4	330,583.66	△3.7	88.6	10.9	0.7
3　月　末	13,877	△4.3	331,122.24	△3.6	91.8	7.7	0.7
(期　末)							
2023年 4 月18日	14,206	△2.1	339,863.92	△1.0	92.1	7.4	0.7

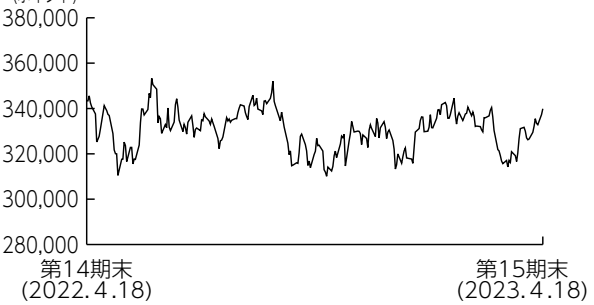
(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年４月19日から2023年４月18日まで）

<基準価額の推移>



<MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の推移>



基準価額の推移

当期末の基準価額は14,206円となり、前期末比で2.1％下落しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場では米ドルなど一部の通貨に対して円安となりプラスの寄与となったものの、株式市場で中国や台湾、インドなどの市場が下落したことから、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。中国市場はゼロコロナ政策により各地で地域別ロックダウンが実施され、経済活動の低迷が嫌気されたうえ、大手不動産会社の信用不安などが重なり下落しました。その他の市場では、新興財閥に対する不正会計疑惑が浮上したインドや、原油価格が2022年６月以降下落基調となった影響からサウジアラビアも下落したほか、米国の金利上昇や米ドル高が重石となり台湾などの市場も下落しました。

為替市場では、円／ドルレートは高騰する物価抑制のため引き締めを急ぐ米国と緩和を維持する日本の金融政策の違いを背景に、大幅に円安ドル高が進みました。2022年10月後半以降は米国の物価上昇に鈍化傾向が見られたことから利上げペースの緩和観測が広がり、円高ドル安方向に反転し円の下落幅は縮小しました。一方で、トルコリラ、南アフリカランドなどに対しては円高となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるＭＳＣＩ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。

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

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	組入比率
1	銀行	14.2%
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

期末

No.	業種	組入比率
1	銀行	14.4%
2	半導体・半導体製造装置	8.6
3	素材	8.3
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.8
5	メディア・娯楽	6.6
6	一般消費財・サービス流通・小売り	5.2
7	エネルギー	4.6
8	食品・飲料・タバコ	3.7
9	資本財	3.7
10	自動車・自動車部品	3.1

（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1.0％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	8円	0.057%	(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
(株式)	(5)	(0.039)	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
(先物・オプション)	(2)	(0.018)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	8	0.061	(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
(株式)	(8)	(0.061)	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	24	0.176	(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)	(23)	(0.166)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(その他)	(1)	(0.010)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	41	0.294	
期中の平均基準価額は13,878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（2022年４月19日から2023年４月18日まで）

(1) 株　式

		買		売	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 8,209.55 (3,050,723.12)	千アメリカ・ドル 12,198 (－)	百株 4,276.63	千アメリカ・ドル 8,689
	香港	百株 467,435.1 (1,137.03)	千香港・ドル 712,922 (△243)	百株 176,370.23	千香港・ドル 206,562
	台湾	百株 189,923.9 (△194.43)	千台湾・ドル 1,518,613 (△8,362)	百株 52,690.57	千台湾・ドル 422,578
	トルコ	百株 14,351.56 (1,927.07)	千トルコ・リラ 44,883 (－)	百株 4,866.8	千トルコ・リラ 12,940
	メキシコ	百株 26,412.45 (1,368.69)	千メキシコ・ペソ 115,950 (－)	百株 12,014.94	千メキシコ・ペソ 42,668
	フィリピン	百株 25,589.55 (1,031.81)	千フィリピン・ペソ 143,430 (－)	百株 25,082.01	千フィリピン・ペソ 55,922
	チリ	百株 87,083 (3.93)	千チリ・ペソ 1,815,768 (－)	百株 20,580.24	千チリ・ペソ 425,428
	コロンビア	百株 2,585.87 (－)	千コロンビア・ペソ 2,280,549 (－)	百株 5,274.14	千コロンビア・ペソ 1,934,829
	クウェート	百株 13,602.38 (1,463.02)	千クウェート・ディナール 1,094 (－)	百株 3,811.15	千クウェート・ディナール 292

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	カタール	百株 16,286.86 (−)	千カタール・リアル 15,716 (−)	百株 3,209.13	千カタール・リアル 3,349
	サウジアラビア	百株 12,081.54 (1,684.13)	千サウジアラビア・リアル 60,492 (−)	百株 3,900.62	千サウジアラビア・リアル 14,175
	インド	百株 54,163.22 (9,988.51)	千インド・ルピー 4,061,187 (−)	百株 15,529.07	千インド・ルピー 1,157,962
	インドネシア	百株 209,141.14 (18,202.99)	千インドネシア・ルピア 100,706,695 (−)	百株 67,827.14	千インドネシア・ルピア 31,356,723
	アラブ首長国連邦	百株 22,802.06 (135.86)	千アラブ首長国連邦・ディルハム 20,049 (−)	百株 4,705.77	千アラブ首長国連邦・ディルハム 4,589
	ブラジル	百株 40,285 (1,154.57)	千ブラジル・レアル 93,679 (291)	百株 12,121.34	千ブラジル・レアル 25,536
	チェコ	百株 279.93 (−)	千チェコ・コルナ 12,386 (−)	百株 195.96	千チェコ・コルナ 3,795
	韓国	百株 8,395.5 (190.81)	千韓国・ウォン 53,954,057 (−)	百株 2,974.54	千韓国・ウォン 15,694,066
	中国	百株 87,073 (933.65)	千オフショア・人民元 136,977 (−)	百株 30,591.63	千オフショア・人民元 42,650
	マレーシア	百株 47,771 (528)	千マレーシア・リンギット 23,704 (−)	百株 17,162	千マレーシア・リンギット 7,274
	南アフリカ	百株 15,883.76 (305.18)	千南アフリカ・ランド 204,496 (△220)	百株 4,264.67	千南アフリカ・ランド 63,752
	タイ	百株 78,086 (△5,655.27)	千タイ・バーツ 266,196 (−)	百株 17,012.5	千タイ・バーツ 70,845
	ポーランド	百株 3,203.7 (△1,634.05)	千ポーランド・ズロチ 10,781 (−)	百株 1,691.59	千ポーランド・ズロチ 3,539
	ハンガリー	百株 345.23 (−)	千ハンガリー・フォリント 220,979 (−)	百株 67.12	千ハンガリー・フォリント 55,858
	ユーロ ギリシャ	百株 3,964.61 (−)	千ユーロ 1,333 (△11)	百株 1,331.27	千ユーロ 351
	ユーロ キプロス	百株 − (73.64)	千ユーロ − (−)	百株 73.64	千ユーロ 0.91983

（注１）金額は受渡代金です。
（注２）（ ）内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 投資信託受益証券、投資証券

	買	付	売	付
	口数	金額	口数	金額
メキシコ	千口	千メキシコ・ペソ	千口	千メキシコ・ペソ
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	100.5 (−)	13,573 (−)	28.5 (−)	4,567 (−)
GRUPO TELEVISA SAB	126.1 (−)	3,891 (−)	− (−)	− (−)
CEMEX SAB DE CV	770.8 (−)	6,454 (−)	172.5 (−)	1,579 (−)
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	− (−)	− (−)	25 (−)	1,395 (−)
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	178.2 (−)	3,813 (−)	49.9 (−)	1,195 (−)
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	31.1 (−)	3,850 (−)	9.9 (−)	1,293 (−)
ブラジル	千口	千ブラジル・レアル	千口	千ブラジル・レアル
BANCO SANTANDER BRASIL SA	13.1 (−)	383 (−)	7.4 (−)	248 (−)
ENERGISA SA	16.2 (−)	704 (−)	8.2 (−)	317 (−)
KLABIN SA	29.1 (−)	556 (−)	1.4 (−)	31 (−)
BANCO INTER SA	− (△23.7)	− (△391)	− (−)	− (−)
BANCO BTG PACTUAL SA	58.7 (−)	1,431 (−)	15.2 (−)	306 (−)
南アフリカ	千口	千南アフリカ・ランド	千口	千南アフリカ・ランド
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	190.554 (−)	2,617 (−)	59.255 (−)	795 (−)

(注1) 金額は受渡代金です。
(注2) ( ) 内は合併、分割等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 100,346	百万円 102,860	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	64,377,726千円
(b)期中の平均組入株式時価総額	74,470,591千円
(c)売買高比率 (a)／(b)	0.86

(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４月19日から2023年４月18日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	0.022	0.022	100.0	0.022	0.022	100.0

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	
TRIP.COM GROUP LTD ADR	289.44	517.04	1,889	254,118	ホテル・レストラン・レジャー
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	127.55	179.59	142	19,150	金属・鉱業
SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF (※1)	242.1	242.1	0	0	石油・ガス・消耗燃料
CREDICORP LTD	38.93	68.17	903	121,460	銀行
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR (※1)	423.11	423.11	0	0	無線通信サービス
SOUTHERN COPPER CORP	51.98	82.72	661	88,942	金属・鉱業
LUKOIL SPON ADR	338.45	−	−	−	石油・ガス・消耗燃料
GAZPROM PJSC (※2)	−	9,669.42	0	0	石油・ガス・消耗燃料
LUKOIL PJSC (※2)	−	338.45	0	0	石油・ガス・消耗燃料
GAZPROM PAO ADR	4,834.71	−	−	−	石油・ガス・消耗燃料
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	1,284.21	3,060.34	376	50,617	銀行
INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	−	827	123	16,603	石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	963.88	864.88	66	8,885	不動産管理・開発
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	125	574.4	196	26,415	ソフトウェア
EFG-HERMES HOLDINGS GDR	−	502.59	40	5,406	資本市場
SURGUTNEFTEGAZ ADR (※1)	710.84	710.84	0	0	石油・ガス・消耗燃料
51JOB INC ADR	21.01	−	−	−	専門サービス
X5 RETAIL GROUP NV GDR	160.03	160.03	0	0	生活必需品流通・小売り
NOVATEK PJSC GDR (※1)	74.13	74.13	0	0	石油・ガス・消耗燃料
BAIDU INC -SPON ADR	161.28	−	−	−	インタラクティブ・メディアおよびサービス
NOVOLIPETSK STEEL GDR (※1)	132.6	132.6	0	0	金属・鉱業
MMC NORILSK NICKEL ADR (※1)	539.53	539.53	0	0	金属・鉱業
MAGNIT PJSC (※2)	−	75.74	0	0	生活必需品流通・小売り
ROSNEFT OIL CO GDR	1,079.51	−	−	−	石油・ガス・消耗燃料
ROSNEFT OIL CO PJSC (※2)	−	1,079.51	0	0	石油・ガス・消耗燃料
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	127.33	−	−	−	各種消費者サービス
SEVERSTAL GDR (※1)	186.08	186.08	0	0	金属・鉱業
TATNEFT ADR (※1)	195.09	195.09	0	0	石油・ガス・消耗燃料
VTB BANK OJSC GDR	1,520	−	−	−	銀行
VTB BANK PJSC (※2)	−	3,040,000	0	0	銀行
MAGNIT PJSC GDR	378.7	−	−	−	生活必需品流通・小売り
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	246.13	396.53	607	81,688	大規模小売り
TAL EDUCATION GROUP-ADR	246.28	461.95	300	40,376	各種消費者サービス
VK CO LTD GDR	98.58	98.58	0	0	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SBERBANK OF RUSSIA PJSC (※2)	−	8,971.12	0	0	銀行
YANDEX NV	256.01	256.01	0	0	インタラクティブ・メディアおよびサービス
NOAH HOLDINGS LTD ADR	6.8	−	−	−	資本市場
SBERBANK ADR	2,242.78	−	−	−	銀行
PHOSAGRO PJSC GDR (※1)	181.63	181.63	0	0	化学
H WORLD GROUP LTD ADR	97.48	181.69	896	120,595	ホテル・レストラン・レジャー
JOYY INC-ADR	28.36	43.68	130	17,603	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	30.17	59.96	274	36,976	半導体・半導体製造装置
GDS HOLDINGS LTD ADR	46.54	−	−	−	情報技術サービス
ZAI LAB LTD ADR	39.33	89.02	344	46,266	バイオテクノロジー
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	99.61	99.61	0	0	銀行
360 DIGITECH INC ADR	58.13	126.87	241	32,516	消費者金融
BILIBILI INC ADR	91.62	−	−	−	娯楽
NIO INC ADR	763.43	1,294.54	1,272	171,117	自動車
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	342.05	704.12	565	76,030	娯楽
AUTOHOME INC ADR	38.67	78.01	236	31,816	インタラクティブ・メディアおよびサービス
I-MAB ADR	34.03	−	−	−	バイオテクノロジー
MINISO GROUP HOLDING LTD ADR	−	83.23	140	18,925	大規模小売り
WEIBO CORP ADR	43.86	62.61	111	14,944	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	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	29.11	–	–	–	情報技術サービス
KANZHUN LTD ADR	56.5	169.73	291	39,142	インタラクティブ・メディアおよびサービス
RLX TECHNOLOGY INC ADR	490.92	–	–	–	タバコ
DIDI GLOBAL INC ADR	268.13	–	–	–	陸上運輸
KE HOLDINGS INC ADR	205.47	627.96	1,139	153,261	不動産管理・開発
CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	63.36	–	–	–	情報技術サービス
DADA NEXUS LTD ADR	41.79	–	–	–	生活必需品流通・小売り
LEGEND BIOTECH CORP ADR	33.09	50.58	276	37,238	バイオテクノロジー
LI AUTO INC ADR	320.49	–	–	–	自動車
XPENG INC ADR	224.58	–	–	–	自動車
OZON HOLDINGS PLC ADR	45.37	45.37	0	0	大規模小売り
LUFAX HOLDING LTD ADR	328.01	604.38	122	16,498	消費者金融
HELLO GROUP INC ADR	126.41	–	–	–	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PDD HOLDINGS INC ADR	253.68	482.84	3,329	447,675	大規模小売り
YUM CHINA HOLDINGS INC	243.75	396.96	2,526	339,705	ホテル・レストラン・レジャー
IQIYI INC ADR	154.4	404.57	291	39,169	娯楽
POLYUS PJSC GDR (※1)	67.87	67.87	0	0	金属・鉱業
HUTCHMED CHINA LTD ADR	61.36	–	–	–	医薬品
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	245.84	396.34	1,140	153,385	航空貨物・物流サービス
BEIGENE LTD ADR	25.97	–	–	–	バイオテクノロジー
小計 株数・金額	22,283.08	3,076,939.12	18,640	2,506,533	
小計 銘柄数<比率>	64銘柄	50銘柄	–	<2.7%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
JIANGXI COPPER CO LTD	670	910	1,337	22,914	金属・鉱業
JIANGSU EXPRESS	900	1,440	1,134	19,437	運送インフラ
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	1,800	2,060	1,209	20,713	旅客航空輸送
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	64	120	1,667	28,570	飲料
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	735	1,090	2,861	49,013	建設資材
BEIJING ENTERPRISES	150	415	1,267	21,717	ガス
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	3,420	3,900	1,774	30,397	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	1,980	4,420	2,603	44,595	生活必需品流通・小売り
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	1,080	1,540	4,158	71,226	石油・ガス・消耗燃料
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	515.9	–	–	–	不動産管理・開発
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	330	675	2,453	42,030	パーソナルケア用品
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,420	–	–	–	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	5,036	8,436	6,866	117,630	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	2,321.2	3,541.2	7,648	131,027	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,908.88	3,008.88	11,870	203,333	不動産管理・開発
CITIC LTD	3,300	5,720	5,536	94,848	コングロマリット
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	680	1,480	880	15,084	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	4,120	6,760	5,948	101,902	コンピュータ・周辺機器
PETRO CHINA CO LTD	11,920	19,920	10,617	181,875	石油・ガス・消耗燃料
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	1,105.9	1,227.9	1,076	18,446	保険
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONIC	–	290	829	14,207	半導体・半導体製造装置
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	13,872	23,952	12,263	210,072	石油・ガス・消耗燃料
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	370	770	1,190	20,391	ホテル・レストラン・レジャー
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	1,430	2,570	3,484	59,696	ソフトウェア
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	451	743	7,912	135,548	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	2,760	3,580	2,280	39,064	ガス
COSCO SHIPPING PORTS LTD	740	2,160	1,056	18,093	運送インフラ
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,252	1,522	2,005	34,362	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	740	1,160	1,368	23,447	運送インフラ
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	2,440	3,800	1,862	31,896	金属・鉱業
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	760	–	–	–	不動産管理・開発
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	965	1,305	921	15,782	運送インフラ
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,570	2,878	3,010	51,567	ガス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	350	585	1,415	24,250	電子装置・機器・部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	3,350	5,690	5,985	102,538	自動車
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	500	882	2,416	41,397	ガス
BYD CO LTD	485	785	18,196	311,702	自動車
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	1,180	2,000	1,718	29,429	エネルギー設備・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	10,300	–	–	–	娯楽
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	1,745.92	4,115.92	1,370	23,478	商業サービス・用品
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	2,080	3,000	1,614	27,647	情報技術サービス
MMG LTD	1,840	–	–	–	金属・鉱業
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	–	130	2,154	36,899	海上運輸
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	700	–	–	–	紙製品・林産品
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	3,917.88	6,497.88	5,685	97,395	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	1,350	2,190	906	15,531	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	1,312	1,932	3,469	59,438	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	1,645	2,860	2,974	50,951	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	4,370	7,200	9,921	169,957	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	3,170	5,470	7,865	134,742	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	1,224	2,264	3,056	52,356	ヘルスケア機器・用品
WEICHAI POWER CO LTD	1,274.4	1,894.4	2,303	39,460	機械
TINGYI HOLDING CORP	1,040	2,020	2,698	46,229	食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	400	580	4,880	83,606	飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	1,540	2,540	2,006	34,373	水道
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	2,380	3,160	1,365	23,384	医薬品
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	813.33	1,533.33	9,575	164,030	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	540	1,000	672	11,511	運送インフラ
HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	710	–	–	–	化学
SINO BIOPHARMACEUTICAL	5,562.5	10,222.5	4,722	80,901	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,820	2,980	10,012	171,519	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	3,375	5,942	220,448	3,776,277	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	3,710	6,060	32,784	561,600	保険
LI NING CO LTD	1,350	2,240	13,406	229,651	繊維・アパレル・贅沢品
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	3,620	2,660	526	9,022	水道
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	6,892.4	–	–	–	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	3,490	5,430	1,715	29,393	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	580	1,960	1,466	25,113	旅客航空輸送
ZTE CORP	442.88	706.88	1,707	29,242	通信機器
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	2,015	3,210	8,201	140,492	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	1,772.5	2,852.5	2,729	46,762	海上運輸
BANK OF COMMUNICATIONS	5,182.05	8,052.05	4,154	71,172	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	1,242.5	2,162.5	2,026	34,709	建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	600	645	1,044	17,899	電子装置・機器・部品
BAIDU INC	–	2,105.5	27,582	472,480	インタラクティブ・メディアおよびサービス
CHINA CONSTRUCTION BANK	56,795.3	91,335.3	49,138	841,740	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	466	778	6,391	109,482	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,060	2,440	919	15,757	自動車
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	980	–	–	–	不動産管理・開発
MINTH GROUP LTD	440	820	1,910	32,728	自動車用部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	1,380	1,620	994	17,038	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	2,280	3,700	2,234	38,282	建設資材
BANK OF CHINA LTD	47,872	75,262	23,707	406,109	銀行
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	600	840	915	15,684	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	2,299.7	3,724.7	15,587	267,020	銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H	33,392.35	54,302.35	23,458	401,846	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	–	970	1,303	22,332	金属・鉱業
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	535	1,125	970	16,631	電子装置・機器・部品
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	1,676	2,856	1,165	19,960	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	1,020	2,090	1,304	22,340	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	250	500	1,060	18,157	機械

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	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	446	535	1,848	31,663	機械
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	4,741.42	12,801.42	3,033	51,971	不動産管理・開発
CMOC GROUP LIMITED	2,370	3,030	1,551	26,574	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	5,798	8,418	3,535	60,564	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	1,380	–	–	–	不動産管理・開発
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	403	671	6,347	108,735	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	610	1,156	12,577	215,448	繊維・アパレル・贅沢品
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	200	350	784	13,429	家庭用品
FOSUN INTERNATIONAL	1,080.28	2,130.28	1,246	21,347	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	3,060	5,580	926	15,867	不動産管理・開発
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	2,640	2,840	1,204	20,627	繊維・アパレル・贅沢品
KINGSOFT CORP LTD	492	988	3,566	61,097	娯楽
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	–	19,060	3,926	67,258	半導体・半導体製造装置
SINOTRUK HONG KONG LTD	340	–	–	–	機械
CHINA RAILWAY GROUP LTD	2,350	3,950	2,255	38,635	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	1,110	1,520	1,184	20,283	食品
DONGYUE GROUP	780	1,590	1,332	22,824	化学
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	475	710	1,686	28,885	通信機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	2,520	4,920	2,558	43,825	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	1,570	2,494	5,761	98,688	保険
CRRC CORP LTD - H	2,390	3,960	1,928	33,035	機械
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	–	1,145	1,122	19,221	繊維・アパレル・贅沢品
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	610	1,430	1,953	33,461	医薬品
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,265	–	–	–	生活必需品流通・小売り
SINOPHARM GROUP CO	672	1,224	3,133	53,675	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	–	–	–	石油・ガス・消耗燃料
CHINA RESOURCES CEMENT	1,040	1,920	727	12,465	建設資材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	1,865.27	2,905.27	1,467	25,132	自動車
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,505	2,090	1,766	30,252	金属・鉱業
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	1,900	3,100	2,762	47,314	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	466	613	953	16,339	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	–	1,850	2,960	50,704	専門小売り
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	1,250	–	–	–	機械
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	900	990	827	14,177	機械
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,075	1,710	4,206	72,059	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	650	883	1,805	30,932	保険
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	3,556.56	6,281.56	1,765	30,236	銀行
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	688	–	–	–	電気設備
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	810	1,060	751	12,873	建設関連製品
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,500	2,270	558	9,565	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	15,850	28,560	8,767	150,194	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	410	615	2,275	38,979	専門小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,030	1,200	836	14,327	金融サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	446	612	1,193	20,442	ヘルスケア機器・用品
CITIC SECURITIES CO LTD	1,405	1,950	3,424	58,656	資本市場
SEAZEN GROUP LIMITED	980	–	–	–	不動産管理・開発
HAITONG SECURITIES CO LTD	1,940	2,604	1,374	23,552	資本市場
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	6,750	8,360	2,315	39,668	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	345	460	1,097	18,793	医薬品
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	1,960	–	–	–	不動産管理・開発
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	2,165	3,480	1,482	25,394	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 HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	3,230	3,230	0	0	食品
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	1,360	1,760	915	15,677	不動産管理・開発
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	4,490	7,140	3,591	61,521	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	360	410	936	16,048	食品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	780	1,140	2,308	39,544	ライフサイエンス・ツール／サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
EAST BUY HOLDING LTD	–	425	1,285	22,022	各種消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	1,170	2,020	3,050	52,249	不動産管理・開発
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	330	561	1,122	19,219	生活必需品流通・小売り
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	520	–	–	–	各種消費者サービス
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	375	617.5	1,088	18,638	金属・鉱業
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	442.5	–	–	–	不動産管理・開発
CHINA TOWER CORP LTD	22,560	42,920	4,163	71,316	各種電気通信サービス
XIAOMI CORP	8,246	14,496	18,351	314,368	コンピュータ・周辺機器
BEIGENE LTD	–	582	9,370	160,511	バイオテクノロジー
WUXI APPTEC CO LTD	207.12	344.12	3,035	51,991	ライフサイエンス・ツール／サービス
WEIMOB INC	1,660	–	–	–	ソフトウェア
MEITUAN	2,391	4,712.1	63,896	1,094,539	ホテル・レストラン・レジャー
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	712	1,280	2,260	38,722	ホテル・レストラン・レジャー
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	870	1,020	2,085	35,731	ホテル・レストラン・レジャー
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,760	4,900	4,439	76,046	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	610	1,030	4,217	72,251	バイオテクノロジー
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	820	–	–	–	不動産管理・開発
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	6,650	9,970	987	16,907	資本市場
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	400	520	762	13,058	専門小売り
LOGAN GROUP COMPANY LTD	1,030	–	–	–	不動産管理・開発
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	1,055	1,435	1,942	33,283	建設・土木
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1,075	–	–	–	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
CANSINO BIOLOGICS INC	62	–	–	–	医薬品
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	1,160	1,520	1,174	20,127	専門小売り
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	860	1,280	2,007	34,380	医薬品
CHINA FEIHE LTD	1,850	3,740	2,221	38,055	食品
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	8,894.68	14,176.68	135,245	2,316,755	大規模小売り
PHARMARON BEIJING CO LTD	74	193	733	12,563	ライフサイエンス・ツール／サービス
JD.COM INC	1,169.35	2,063.85	30,833	528,185	大規模小売り
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	980	1,840	1,876	32,149	タバコ
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	155	–	–	–	ヘルスケア機器・用品
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	–	76	1,450	24,839	専門小売り
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	500	690	1,284	22,008	ホテル・レストラン・レジャー
KUAISHOU TECHNOLOGY	263	1,672	9,170	157,097	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HAIER SMART HOME CO LTD	1,234	2,202	5,516	94,489	家庭用耐久財
BILIBILI INC	–	194.2	3,311	56,719	娯楽
AKESO INC	200	410	1,793	30,726	バイオテクノロジー
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	770	–	–	–	不動産管理・開発
NETEASE INC	1,202	1,876	27,558	472,076	娯楽
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	250	–	–	–	ソフトウェア
GDS HOLDINGS LTD	–	905	1,545	26,478	情報技術サービス
NONGFU SPRING CO LTD	1,010	1,656	7,220	123,681	飲料
CHINA BOHAI BANK CO LTD	1,340	–	–	–	銀行
LI AUTO INC	–	1,058	10,749	184,135	自動車
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	176.5	1,047	6,172	105,727	生活必需品流通・小売り
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	298	302	1,834	31,427	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	692	3,030	51,920	不動産管理・開発
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	96	126	1,023	17,526	ライフサイエンス・ツール／サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	1,065.61	1,746.61	2,270	38,895	不動産管理・開発
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	–	1,504	4,579	78,449	各種消費者サービス
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	–	496	991	16,975	専門小売り
XPENG INC	–	786	3,458	59,242	自動車
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	370	530	2,011	34,454	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD	6,090	10,430	2,065	35,375	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GF SECURITIES CO LTD	682	1,060	1,284	22,007	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	276	616	2,051	35,138	自動車用部品
HUATAI SECURITIES CO LTD	924	1,494	1,511	25,899	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	
3SBIO INC	905	1,465	1,189	20,377	バイオテクノロジー
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	－	1,825	1,206	20,664	医薬品
CHINA LITERATURE LTD	284	386	1,540	26,382	メディア
FLAT GLASS GROUP CO LTD	340	430	976	16,720	半導体・半導体製造装置
DALI FOODS GROUP CO LTD	1,465	2,615	891	15,275	食品
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	650	1,450	1,339	22,950	不動産管理・開発
BOC AVIATION LTD	105	236	1,460	25,024	商社・流通業
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	340	617	1,619	27,744	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	900	1,240	2,480	42,482	自動車
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	796	1,440	2,433	41,687	資本市場
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2,070	3,410	18,448	316,015	ライフサイエンス・ツール／サービス
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	－	4,360	867	14,862	娯楽
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	132	372.4	1,930	33,076	化学
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	－	700	1,820	31,176	不動産管理・開発
小計 株数・金額	518,431.88	810,633.78	1,215,723	20,825,351	
小計 銘柄数<比率>	200銘柄	191銘柄	－	<22.6%>	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	270	489.06	15,307	67,451	通信機器
ACER INC	1,515.32	2,573.85	7,567	33,343	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	415.54	668.28	18,778	82,746	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	246.16	425.9	17,036	75,067	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	1,159.28	2,361.05	10,329	45,516	建設資材
TAIWAN BUSINESS BANK	－	5,515.58	7,694	33,903	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	480	960	9,004	39,678	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	450	700	10,325	45,496	コンピュータ・周辺機器
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	700	1,185.01	16,471	72,580	電子装置・機器・部品
QUANTA COMPUTER INC	1,558.58	2,535.29	20,611	90,824	コンピュータ・周辺機器
EVA AIRWAYS CORP	－	2,550	6,897	30,394	旅客航空輸送
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	387.6	657.6	12,132	53,461	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,262.08	4,354.21	7,619	33,576	銀行
CHINA AIRLINES	－	2,900	5,655	24,918	旅客航空輸送
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	1,371.69	1,781.69	6,752	29,754	自動車用部品
CHINA STEEL CORP	6,900.58	11,182.31	34,385	151,516	金属・鉱業
ADVANTECH CO LTD	216.75	386.68	14,539	64,065	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS INC	2,283.04	3,902.91	9,815	43,252	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,136.63	1,859.04	57,630	253,941	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CORP	900	1,340	9,112	40,151	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,304.27	3,672.99	46,096	203,117	各種電気通信サービス
AUO CORP	4,671.94	6,186.49	11,816	52,066	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,158	1,681	17,650	77,775	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP	1,478.2	948.26	16,547	72,913	海上運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,658.24	3,013.39	9,597	42,291	コングロマリット
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	317.68	447.68	8,528	37,579	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE CO LTD	103.22	193.22	9,477	41,761	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	322.85	545.64	24,990	110,117	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	2,236.33	3,939.52	37,031	163,175	化学
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	2,065.94	3,339.38	23,342	102,855	化学
GIANT MANUFACTURING	211.51	312.44	5,873	25,882	レジャー用品
MEDIATEK INC	895.07	1,449.75	102,787	452,921	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	4,459.42	7,123.07	41,669	183,614	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	4,927.52	8,260.67	18,751	82,627	銀行
HOTAI MOTOR CO LTD	170	280.81	18,673	82,284	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	890	1,650	12,820	56,492	無線通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,381.46	9,464.4	21,294	93,833	金融サービス
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,699.41	8,249.24	35,636	157,029	保険
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	8,940.11	14,338.46	18,998	83,714	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	7,067.98	12,089.06	30,524	134,504	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	7,372.25	12,017.73	124,984	550,731	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	6,454.95	10,509.83	35,155	154,908	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	62.2	95.66	20,327	89,572	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	5,861.32	9,990.73	17,184	75,719	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	6,763.45	12,453.81	10,672	47,029	保険
INVENTEC CO LTD	1,300.05	2,700.05	8,559	37,715	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,178.45	1,913.35	14,407	63,485	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	5,654.43	10,494.72	17,631	77,689	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	11,000.48	16,741.73	37,668	165,984	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	6,098.06	9,941.62	26,593	117,183	銀行
NAN YA PLASTICS CORP	3,038.28	4,511.51	35,054	154,463	化学
POU CHEN CORP	1,209.9	2,339.9	7,440	32,787	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	2,832.97	4,625.95	33,908	149,413	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	323.92	523.09	14,175	62,463	生活必需品流通・小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	864.8	1,127.06	9,884	43,554	石油・ガス・消耗燃料
E INK HOLDINGS INC	490	839.2	14,434	63,603	電子装置・機器・部品
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	762.24	1,743.36	6,267	27,616	不動産管理・開発
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	735.88	－	－	－	電子装置・機器・部品
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	678.99	1,161.74	7,214	31,789	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT CORP	3,011.71	5,712.01	21,677	95,517	建設資材
TAIWAN SEMICONDUCTOR	14,450.83	23,548.79	1,224,537	5,395,800	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	6,875.25	11,311.88	58,821	259,192	半導体・半導体製造装置
WAN HAI LINES LTD	395	787.47	5,551	24,462	海上運輸
WALSIN LIHWA CORP	－	2,461.63	12,775	56,295	電気設備
WINBOND ELECTRONICS CORP	1,580	2,580.59	6,851	30,190	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORP	251.6	329.04	17,833	78,583	電子装置・機器・部品
YANG MING MARINE TRANSPORT	1,010	1,656.08	11,211	49,403	海上運輸
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,610	1,930	6,011	26,491	運送インフラ
INNOLUX CORPORATION	5,433.45	9,107.42	13,570	59,795	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD	1,182.03	1,652.03	8,293	36,543	電子装置・機器・部品
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	160	200.79	5,310	23,401	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	179.69	－	－	－	機械
EMEMORY TECHNOLOGY INC	40	60.64	12,643	55,712	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	1,165.54	1,918.8	13,565	59,776	コンピュータ・周辺機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	83.71	130.87	15,377	67,758	機械
WIN SEMICONDUCTORS CORP	230	304.7	5,652	24,905	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	745.93	1,350.42	31,059	136,861	金融サービス
ONENESS BIOTECH CO LTD	180	－	－	－	医薬品
PARADE TECHNOLOGIES LTD	50	80	8,920	39,305	半導体・半導体製造装置
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	20	－	－	－	半導体・半導体製造装置
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	353.85	629.23	7,110	31,330	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	5,573.93	9,165.76	24,335	107,230	銀行
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	2,029.93	3,834.37	18,079	79,663	銀行
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	40	59.93	10,787	47,533	電気設備
WIWYNN CORP	50	80	9,400	41,420	コンピュータ・周辺機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	1,879.03	3,129.76	33,175	146,184	半導体・半導体製造装置
SILERGY CORP	50	303.33	15,591	68,700	半導体・半導体製造装置
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	－	2,630.9	8,655	38,140	半導体・半導体製造装置
PHARMAESSENTIA CORP	－	205.76	8,785	38,714	バイオテクノロジー
MOMO.COM INC	30	66	5,537	24,399	大規模小売り
GLOBALWAFERS CO LTD	120	200.53	10,166	44,799	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	110	151.7	5,059	22,292	家庭用耐久財
小計 株数・金額	187,786.5	324,825.4	2,887,690	12,724,317	
小計 銘柄数<比率>	86銘柄	88銘柄	－	<13.8%>	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
AKBANK TAS	2,388.37	2,866.08	5,124	35,593	銀行
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	448.98	738.27	3,842	26,689	航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	891.95	1,257.64	4,419	30,695	金属・鉱業
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	46.68	74.1	4,398	30,550	自動車
HEKTAS TICARET TAS	−	1,211.18	3,526	24,496	化学
KOC HOLDING AS	537.7	715.98	5,684	39,484	コングロマリット
SASA POLYESTER SANAYI	−	469.86	5,088	35,343	化学
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	510.26	1,445.86	6,272	43,563	コングロマリット
TURK HAVA YOLLARI	−	496.83	6,741	46,827	旅客航空輸送
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	486.15	1,060.83	3,944	27,394	無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI AS	1,814.55	−	−	−	銀行
TURKIYE IS BANKASI	911.35	3,158.42	3,793	26,346	銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	59.02	948.78	7,073	49,127	石油・ガス・消耗燃料
YAPI VE KREDI BANKASI AS	−	3,137.27	3,184	22,117	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING AS	−	923.61	3,736	25,955	銀行
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	217.03	399.99	6,483	45,034	生活必需品流通・小売り
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	−	784.29	1,932	13,422	金属・鉱業
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	−	34.88	1,703	11,832	旅客航空輸送
小計 株数・金額	8,312.04	19,723.87	76,951	534,473	
小計 銘柄数<比率>	11銘柄	17銘柄	−	<0.6%>	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
ALFA SAB DE CV	2,223	2,346	2,763	20,613	コングロマリット
GRUPO BIMBO SAB DE CV	869	1,304	12,029	89,724	食品
GRUMA SAB DE CV	103.6	182.7	4,691	34,989	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	178.6	226.6	4,226	31,521	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV	349	485	4,759	35,498	コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	1,514	2,474	37,179	277,312	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	784.25	842.25	3,493	26,058	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	83.35	123.1	3,421	25,520	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	753	1,364	5,417	40,410	家庭用品
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	112.9	187.55	10,298	76,814	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV	1,832.52	2,938.52	27,022	201,556	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE CV	18,088.78	−	−	−	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	1,227	2,199	8,672	64,689	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	235	447	7,331	54,682	飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	3,093	4,998	35,120	261,960	生活必需品流通・小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	202.95	348.65	12,285	91,636	運送インフラ
OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	773	1,014	1,793	13,379	各種電気通信サービス
AMERICA MOVIL SAB DE CV	−	26,406.78	51,862	386,835	無線通信サービス
BECLE SAB DE CV	384	−	−	−	飲料
BANCO DEL BAJIO SA	−	686	4,330	32,296	銀行
小計 株数・金額	32,806.95	48,573.15	236,700	1,765,500	
小計 銘柄数<比率>	18銘柄	18銘柄	−	<1.9%>	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
AYALA LAND INC	4,567	7,555	20,171	48,561	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	1,133.3	1,581.2	8,309	20,003	コングロマリット
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	937.2	2,049.93	20,704	49,843	銀行
AYALA CORP	153.73	210.83	13,809	33,244	コングロマリット
GLOBE TELECOM INC	25.7	−	−	−	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	550.3	963.7	20,256	48,766	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,578.4	3,182.9	15,548	37,431	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORP	339.4	469.6	10,312	24,826	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST	800.15	1,433.05	8,211	19,768	銀行
BDO UNIBANK INC	1,088.33	2,300.62	29,516	71,059	銀行
PLDT INC	52.6	89.85	11,536	27,773	無線通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	5,967.75	10,577.75	35,964	86,580	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	425.5	736.1	10,474	25,216	食品
SM INVESTMENTS CORP	130.43	241.33	21,719	52,288	コングロマリット
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	9,019	−	−	−	金融サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(フィリピン)		百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
MANILA ELECTRIC COMPANY		177.1	247.2	7,885	18,983	電力
GT CAPITAL HOLDINGS INC		66.01	－	－	－	コングロマリット
ACEN CORP		6,894	461.19	286	689	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MONDE NISSIN CORP		3,147	6,492	6,070	14,612	食品
小計	株数・金額	37,052.9	38,592.25	240,778	579,650	
	銘柄数<比率>	19銘柄	16銘柄	－	<0.6%>	
(チリ)		百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE		36,020.92	68,685.1	259,629	43,586	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES		30.95	57.09	135,297	22,713	銀行
BANCO DE CHILE		25,409.25	46,141.1	364,514	61,193	銀行
EMPRESAS CMPC SA		630.23	1,192.58	159,805	26,827	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA		191.38	404.23	236,393	39,685	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		105.81	105.16	66,776	11,210	飲料
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA		－	11,784.8	103,105	17,309	海上運輸
ENEL AMERICAS SA		15,968.88	21,331.52	235,713	39,571	電力
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA		78.85	133.94	881,860	148,045	化学
FALABELLA SA		488.73	807.36	145,082	24,356	大規模小売り
CENCOSUD SA		759.72	1,169.08	188,689	31,676	生活必需品流通・小売り
ENEL CHILE SA		29,777.57	24,157.02	105,131	17,649	電力
小計	株数・金額	109,462.29	175,968.98	2,882,000	483,824	
	銘柄数<比率>	11銘柄	12銘柄	－	<0.5%>	
(コロンビア)		百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP		212.84	485.42	844,630	25,613	電力
ECOPETROL SA		3,126.78	－	－	－	石油・ガス・消耗燃料
BANCOLOMBIA SA		120.06	203.22	802,922	24,348	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		270.16	456.92	1,475,851	44,755	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA		103.99	－	－	－	金融サービス
小計	株数・金額	3,833.83	1,145.56	3,123,404	94,717	
	銘柄数<比率>	5銘柄	3銘柄	－	<0.1%>	
(クエート)		百株	百株	千クウェート・ディナール	千円	
KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP		3,443.16	7,714.53	572	250,971	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC		1,229.02	1,997	110	48,593	無線通信サービス
GULF BANK KSCP		－	1,363.55	38	16,858	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP		4,310.49	7,175.18	711	311,757	銀行
AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC		688.52	1,379.27	84	37,190	航空貨物・物流サービス
MABANEE CO KPSC		272.82	727.04	53	23,524	不動産管理・開発
BOUBYAN BANK KSCP		602.72	1,444.41	94	41,606	銀行
小計	株数・金額	10,546.73	21,800.98	1,666	730,503	
	銘柄数<比率>	6銘柄	7銘柄	－	<0.8%>	
(カタール)		百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR NATIONAL BANK		2,704.78	4,414.61	6,661	245,215	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC		1,090.64	3,122.67	1,708	62,875	銀行
OOREDOO QSC		438.16	860.85	826	30,420	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC		295.91	513.75	845	31,108	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO		271.76	384.78	637	23,483	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC		340.3	866.84	866	31,908	銀行
INDUSTRIES QATAR QSC		874.25	1,384.6	1,737	63,963	コングロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ		682.74	1,556.84	2,794	102,866	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO LTD		1,453.82	2,494.88	933	34,346	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN		2,715.27	5,542.59	1,482	54,576	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		1,384.49	2,038.13	513	18,905	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO		2,367.31	4,516.62	885	32,586	化学
小計	株数・金額	14,619.43	27,697.16	19,892	732,256	
	銘柄数<比率>	12銘柄	12銘柄	－	<0.8%>	
(サウジアラビア)		百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO		142.5	260.55	1,132	40,687	化学
JARIR MARKETING CO		38.7	61.27	1,029	36,994	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	
(サウジアラビア)	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	41.55	－	－	－	保険
ETIHAD ETISALAT CO	206.59	385.69	1,685	60,575	無線通信サービス
SAUDI BRITISH BANK	480.31	856.85	3,140	112,864	銀行
AL RAJHI BANK	723.19	1,867.14	14,283	513,353	銀行
ARAB NATIONAL BANK	340.28	584.12	1,582	56,891	銀行
BANK ALBILAD	276.49	479.8	2,000	71,907	銀行
BANK AL-JAZIRA	217.93	417.43	815	29,314	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	340.18	536.56	2,114	75,978	銀行
RIYAD BANK	793.52	1,246.58	3,851	138,438	銀行
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	－	525.54	881	31,693	銀行
SAUDI TELECOM CO	353.7	1,439.07	6,123	220,069	各種電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	123	198.15	2,544	91,440	化学
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	536.93	857.18	7,886	283,424	化学
SAUDI ELECTRICITY CO	472.84	756.74	1,805	64,892	電力
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	222.02	388.56	1,004	36,099	化学
SAVOLA GROUP	128.55	215.55	670	24,092	食品
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	166.21	240.22	318	11,430	化学
ALMARAI CO JSC	140.57	239.32	1,368	49,198	食品
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	15.13	39.87	837	30,091	メディア
EMAAR ECONOMIC CITY	283.11	224.94	223	8,035	不動産管理・開発
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	201.64	339.39	1,354	48,668	化学
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	63.3	143.97	690	24,810	化学
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	413.78	759.12	979	35,194	化学
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	310.11	473.34	751	27,014	不動産管理・開発
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	129.65	333.39	367	13,204	石油・ガス・消耗燃料
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	187.22	328.21	501	18,024	無線通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	30.41	65.5	1,159	41,667	保険
ALINMA BANK	579.56	914.69	2,931	105,361	銀行
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	35.16	－	－	－	生活必需品流通・小売り
SAUDI ARABIAN MINING CO	253.35	812.99	5,617	201,902	金属・鉱業
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	33.77	50.36	1,234	44,379	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
DALLAH HEALTHCARE CO	－	41.27	679	24,414	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO	1,290.7	2,300.08	7,969	286,433	石油・ガス・消耗燃料
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	42.12	85.1	2,372	85,270	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
ACWA POWER CO	－	79.4	1,238	44,516	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	－	26.27	719	25,869	情報技術サービス
NAHDI MEDICAL CO	－	42.79	765	27,497	生活必需品流通・小売り
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	－	52.02	872	31,371	資本市場
ELM CO	－	24.2	1,057	37,990	情報技術サービス
THE SAUDI NATIONAL BANK	1,299.16	2,085.06	10,508	377,682	銀行
小計 株数・金額	10,913.23	20,778.28	97,071	3,488,750	
小計 銘柄数<比率>	35銘柄	40銘柄	－	<3.8%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,675.92	2,915.11	690,137	1,138,727	石油・ガス・消耗燃料
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	473.6	886.86	29,771	49,123	石油・ガス・消耗燃料
ASIAN PAINTS LTD	223.52	362.3	103,005	169,959	化学
BANK OF BARODA	－	942.2	16,615	27,415	銀行
EICHER MOTORS LTD	76.15	133.32	43,049	71,030	自動車
GRASIM INDUSTRIES LTD	146.14	241.84	41,684	68,779	建設資材
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	504.69	831.51	100,858	166,415	自動車
SHREE CEMENT LTD	7.56	11.1	28,340	46,762	建設資材
ICICI BANK LTD	3,017.09	4,955.54	446,642	736,960	銀行
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	322.22	689.31	15,640	25,806	石油・ガス・消耗燃料
STATE BANK OF INDIA LTD	1,050.57	1,718.79	93,502	154,278	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	188.88	282.93	17,118	28,245	陸上運輸
TATA STEEL LTD	418.51	7,003.46	75,042	123,819	金属・鉱業
TATA MOTORS LTD	971.29	1,582.84	74,733	123,310	自動車

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
JSW STEEL LTD	485.58	716.65	51,684	85,279	金属・鉱業
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	332.8	521.02	37,159	61,312	食品
BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	－	28.95	17,651	29,125	金融サービス
TATA POWER CO LTD	810.66	1,496.77	29,478	48,640	電力
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	57.68	106.84	46,353	76,483	食品
NESTLE INDIA LTD	19.01	31.63	64,033	105,654	食品
GAIL INDIA LTD	828.72	2,149.62	23,667	39,051	ガス
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	324.21	534.17	101,233	167,034	銀行
VEDANTA LTD	646.34	748.77	20,890	34,469	金属・鉱業
AXIS BANK LTD	1,329.94	2,180.25	188,493	311,014	銀行
TITAN COMPANY LTD	204.85	337.01	87,811	144,888	繊維・アパレル・贅沢品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,403.09	2,328.74	37,294	61,536	石油・ガス・消耗燃料
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	62.95	102.6	15,997	26,395	パーソナルケア用品
BHARAT ELECTRONICS LTD	656.79	3,517.92	35,671	58,858	航空宇宙・防衛
LUPIN LTD	170.03	175.11	11,524	19,016	医薬品
MPHASIS LTD	45.93	88.86	15,430	25,461	情報技術サービス
ACC LTD	57.06	51.68	9,221	15,215	建設資材
BAJAJ FINANCE LTD	157.42	260.02	155,009	255,765	消費者金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	1,008.69	1,657.1	454,385	749,735	金融サービス
INFOSYS LTD	1,978.88	3,216.1	404,681	667,725	情報技術サービス
WIPRO LTD	801.12	1,290.52	46,632	76,944	情報技術サービス
TATA ELXSI LTD	－	34.06	21,422	35,347	ソフトウェア
MRF LTD	0.84	1.65	14,087	23,243	自動車用部品
INDIAN OIL CORP LTD	1,024.14	2,588.17	19,993	32,989	石油・ガス・消耗燃料
HINDUSTAN UNILEVER LTD	484.22	783.39	199,909	329,850	パーソナルケア用品
TRENT LTD	98.34	182.69	24,906	41,095	専門小売り
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	56.86	93.66	41,085	67,791	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	636.55	899.89	93,786	154,747	情報技術サービス
DABUR INDIA LTD	337.81	635.91	33,328	54,991	パーソナルケア用品
HERO MOTOCORP LTD	64.18	105.49	26,013	42,921	自動車
SRF LTD	81.95	134.32	33,064	54,557	化学
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	63.57	65.4	13,626	22,483	自動車用部品
DR REDDYS LABORATORIES LTD	64.32	109.56	53,161	87,716	医薬品
BHARTI AIRTEL LTD	1,450.7	2,128.84	161,717	266,833	無線通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	159.19	268.7	20,567	33,936	飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	482.55	901.88	90,070	148,616	医薬品
DIVI'S LABORATORIES LTD	73.97	121.65	38,473	63,481	ライフサイエンス・ツール／サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	79.74	115.59	100,270	165,445	自動車
AUROBINDO PHARMA LTD	147.88	211.02	11,786	19,447	医薬品
HAVELLS INDIA LTD	130.47	227.29	27,620	45,573	電気設備
TVS MOTOR COMPANY LTD	－	193.01	22,575	37,249	自動車
INDRAPRASTHA GAS LTD	220.37	305.76	15,020	24,783	ガス
JINDAL STEEL & POWER LTD	－	327.7	18,365	30,303	金属・鉱業
BIOCON LTD	183.06	－	－	－	バイオテクノロジー
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	885.01	2,104.54	14,489	23,908	自動車用部品
SHRIRAM FINANCE LTD	140.71	211.63	27,963	46,140	消費者金融
PETRONET LNG LTD	527.03	652.33	15,228	25,127	石油・ガス・消耗燃料
CIPLA LTD/INDIA	268.78	449.87	40,778	67,284	医薬品
LARSEN & TOUBRO LTD	402.05	656.38	145,322	239,782	建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	57.7	95.68	74,079	122,231	建設資材
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	546.28	875.62	274,900	453,586	情報技術サービス
ADANI ENTERPRISES LTD	159.22	149.72	28,128	46,412	商社・流通業
NTPC LTD	2,758.8	3,671.12	62,262	102,732	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	78.99	－	－	－	金融サービス
YES BANK LTD	7,148.5	12,307.92	18,892	31,172	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	414.63	531.17	20,797	34,316	建設資材
BHARAT FORGE LTD	180.24	266.09	20,700	34,155	自動車用部品

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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	924.72	1,277.64	54,772	90,374	金属・鉱業
ITC LTD	1,739.81	2,851.79	114,114	188,288	タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	84.2	151.13	35,813	59,091	化学
UNITED PHOSPHORUS LTD	279.32	492.94	36,337	59,956	化学
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	39.29	98.51	15,622	25,776	医薬品
SIEMENS INDIA LTD	36.01	71.73	23,955	39,526	コングロマリット
INFO EDGE INDIA LTD	52.47	65.9	24,146	39,842	インタラクティブ・メディアおよびサービス
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	–	536.06	16,140	26,632	電気設備
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	229.9	412.11	40,170	66,281	パーソナルケア用品
TECH MAHINDRA LTD	366.01	548.61	56,504	93,231	情報技術サービス
INDIAN HOTELS CO LTD	–	787	26,159	43,163	ホテル・レストラン・レジャー
MINDTREE LTD	36.05	–	–	–	情報技術サービス
MARICO LTD	362.41	530.87	25,452	41,996	食品
PAGE INDUSTRIES LTD	2.91	5.89	22,521	37,160	繊維・アパレル・贅沢品
ABB LTD/INDIA	–	44.73	14,443	23,831	電気設備
DLF LTD	354.05	548.7	22,790	37,603	不動産管理・開発
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,788.14	2,940.62	69,589	114,823	電力
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	322.22	482.12	32,046	52,876	運送インフラ
BAJAJ FINSERV LTD	21.74	359.61	48,229	79,578	金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	49.14	68.64	29,201	48,183	自動車
JUBILANT FOODWORKS LTD	40.89	405.48	17,476	28,835	ホテル・レストラン・レジャー
ADANI POWER LTD	–	774.37	14,670	24,206	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MUTHOOT FINANCE LTD	88.1	115.65	12,129	20,014	消費者金融
COAL INDIA LTD	845.19	1,560.07	35,819	59,101	石油・ガス・消耗燃料
INDUS TOWERS LTD	549.46	643.46	8,821	14,556	各種電気通信サービス
PI INDUSTRIES LTD	43.11	74.18	22,562	37,228	化学
VARUN BEVERAGES LTD	–	205.55	29,847	49,249	飲料
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	–	94.03	25,458	42,006	自動車用部品
LTIMINDTREE LTD	35.87	81.99	35,522	58,612	情報技術サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	224.36	278.84	26,839	44,285	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	507.11	908.35	48,451	79,944	保険
AU SMALL FINANCE BANK LTD	–	157.99	10,879	17,951	銀行
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	40.12	–	–	–	資本市場
BANDHAN BANK LTD	377.5	589.28	12,180	20,097	銀行
ADANI TOTAL GAS LTD	158.08	279.88	26,499	43,723	ガス
GODREJ PROPERTIES LTD	69.71	126.88	16,231	26,782	不動産管理・開発
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	222.29	395.47	33,079	54,580	消費者金融
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	166.24	238.9	18,207	30,042	消費者金融
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	129.53	267.75	15,975	26,359	商業サービス・用品
ZOMATO LTD	1,256.44	3,322.58	17,925	29,576	ホテル・レストラン・レジャー
BERGER PAINTS INDIA LTD	109.81	186.55	10,833	17,875	化学
ADANI TRANSMISSIONS LTD	157.9	252.73	26,271	43,347	電力
AVENUE SUPERMARTS LTD	92.95	151.32	52,918	87,314	生活必需品流通・小売り
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	113.49	239.26	26,416	43,587	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	276.04	366.67	16,523	27,264	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	77.33	96.62	18,715	30,880	旅客航空輸送
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	251.49	417.01	47,762	78,807	保険
小計 株数・金額	52,387.94	101,010.6	6,790,883	11,204,958	
小計 銘柄数<比率>	106銘柄	114銘柄	–	<12.2%>	
(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	9,022	1,912,664	17,405	金属・鉱業
BARITO PACIFIC TBK PT	14,484	28,850.85	2,351,344	21,397	化学
UNITED TRACTORS TBK PT	905.01	1,697.01	5,175,880	47,100	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	3,529	3,570	2,258,025	20,548	食品
UNILEVER INDONESIA TBK PT	4,854	8,225	3,396,925	30,912	家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	11,683	18,907	11,769,607	107,103	自動車
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	28,718	46,469	19,842,263	180,564	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	3,830	7,526	3,416,804	31,092	食品
GUDANG GARAM TBK PT	324	−	−	−	タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	758	−	−	−	建設資材
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	1,908	2,924	2,200,310	20,022	紙製品・林産品
BANK MANDIRI	10,904	34,760	17,814,500	162,111	銀行
BANK RAKYAT INDONESIA	39,992	64,553	32,211,947	293,128	銀行
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	4,001	7,179	6,784,155	61,735	銀行
KALBE FARMA TBK PT	10,083	18,101	3,692,604	33,602	医薬品
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	1,257	2,744.32	1,660,313	15,108	建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	32,729	52,483	47,365,907	431,029	銀行
VALE INDONESIA TBK PT	−	2,877	1,855,665	16,886	金属・鉱業
ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	9,341	13,809	3,949,374	35,939	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	1,650	2,593	2,651,342	24,127	食品
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	5,333	−	−	−	各種電気通信サービス
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	−	16,979	4,618,288	42,026	生活必需品流通・小売り
SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	17,183	22,186	2,185,321	19,886	各種電気通信サービス
BANK JAGO TBK PT	2,702	−	−	−	銀行
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	6,378	12,324.82	5,139,449	46,768	金属・鉱業
小計 株数・金額	218,263.01	377,780	182,252,690	1,658,499	
小計 銘柄数<比率>	23銘柄	21銘柄	−	<1.8%>	
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千アラブ首長国連邦・ディルハム	千円	
ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	732.54	1,498.1	1,647	60,445	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	1,553.05	2,790.91	1,495	54,870	銀行
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	2,033.41	3,311.06	7,880	289,050	各種電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	1,582.72	2,742.84	2,410	88,433	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,606.27	4,173.2	5,617	206,036	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	2,686.91	6,291.31	3,869	141,920	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,215.52	3,530.66	1,853	67,989	不動産管理・開発
EMIRATES NBD BANK PJSC	1,448.03	1,792.41	2,348	86,126	銀行
Q HOLDING PJSC	−	2,229.15	588	21,586	コングロマリット
MULTIPLY GROUP	−	3,134.48	977	35,871	コングロマリット
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	1,523.4	3,119.88	1,366	50,123	専門小売り
小計 株数・金額	16,381.85	34,614	30,056	1,102,454	
小計 銘柄数<比率>	9銘柄	11銘柄	−	<1.2%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
BRF SA	472.92	−	−	−	食品
VALE SA	2,405.89	3,657.89	28,483	774,548	金属・鉱業
RAIA DROGASIL SA	599	1,066	2,748	74,728	生活必需品流通・小売り
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	130.5	239.5	896	24,389	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	197	1,147	3,858	104,922	電力
BANCO DO BRASIL SA	519	825	3,591	97,654	銀行
ITAUSA SA	2,729.88	4,900.26	4,228	114,994	銀行
GERDAU SA	652.3	1,102.81	2,868	77,998	金属・鉱業
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,100.1	3,503.1	10,488	285,201	石油・ガス・消耗燃料
VIBRA ENERGIA SA	673	1,166	1,610	43,786	専門小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,885.12	4,599.12	12,284	334,038	石油・ガス・消耗燃料
CCR SA	909.2	1,210.2	1,582	43,043	運送インフラ
WEG SA	961.44	1,582.44	6,247	169,883	電気設備
BANCO BRADESCO SA PREF	2,950.93	5,205.02	7,146	194,330	銀行
BANCO BRADESCO SA	753.57	1,395.92	1,728	46,992	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	368.06	646.06	948	25,789	金属・鉱業
SUZANO SA	426.75	743.75	3,009	81,827	紙製品・林産品
CPFL ENERGIA SA	−	236	788	21,427	電力
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2,871.47	4,657.47	12,090	328,777	銀行
AMERICANAS SA	361.71	−	−	−	大規模小売り
BRASKEM SA	123	−	−	−	化学
ENGIE BRASIL SA	73.87	154.87	637	17,346	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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
ALPARGATAS SA	194	−	−	−	繊維・アパレル・贅沢品
LOCALIZA RENT A CAR	352.89	689.89	3,993	108,581	陸上運輸
LOJAS RENNER SA	563.2	937.2	1,568	42,661	専門小売り
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	559.04	663.04	958	26,070	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA	575	1,093	1,724	46,900	石油・ガス・消耗燃料
TOTVS SA	279	534	1,448	39,380	ソフトウェア
EQUATORIAL ENERGIA SA	560	941	2,676	72,772	電力
JBS SA	483	714	1,216	33,083	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	588.17	1,379.62	1,714	46,631	電力
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	188.98	317.98	1,556	42,333	水道
ENEVA SA	−	711	804	21,885	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HYPERA SA	195	412	1,558	42,370	医薬品
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	3,546.48	5,786.48	6,955	189,132	資本市場
MAGAZINE LUIZA SA	1,682	2,715	993	27,020	大規模小売り
HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	386	709	2,563	69,695	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA BRASIL SA	286.28	505.28	2,064	56,126	各種電気通信サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	458	653	2,259	61,437	保険
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	2,456.61	4,686.61	1,190	32,369	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	551	609	16,571	生活必需品流通・小売り
AMBEV SA	2,773.95	4,534.95	6,689	181,891	飲料
NATURA &CO HOLDING SA	498	927	1,038	28,232	パーソナルケア用品
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	−	888	1,178	32,042	生活必需品流通・小売り
TIM SA	466	765	1,053	28,644	無線通信サービス
LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	−	3.08	5	143	陸上運輸
REDE D'OR SAO LUIZ SA	222	607	1,335	36,312	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
RUMO SA	855	1,188	2,340	63,640	陸上運輸
小計 株数・金額	41,632.31	70,950.54	154,734	4,207,615	
小計 銘柄数<比率>	44銘柄	44銘柄	−	<4.6%>	
(チェコ)	百株	百株	千チェコ・コルナ	千円	
KOMERCNI BANKA AS	36.64	80.62	6,062	38,064	銀行
CEZ	88.2	147.52	17,422	109,384	電力
MONETA MONEY BANK AS	269.89	250.56	2,142	13,450	銀行
小計 株数・金額	394.73	478.7	25,627	160,899	
小計 銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄	−	<0.2%>	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
SKC CO LTD	14.72	23.57	257,855	26,327	化学
CHEIL WORLDWIDE INC	50.14	46.13	89,538	9,141	メディア
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	22.26	34.98	342,804	35,000	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	16.95	29.79	615,163	62,808	保険
DB INSURANCE CO LTD	34.5	40.39	316,253	32,289	保険
COWAY CO LTD	36.97	58.33	297,483	30,373	家庭用耐久財
KT&G CORP	66.64	103.26	870,481	88,876	タバコ
S-1 CORPORATION	1.07	15.57	87,970	8,981	商業サービス・用品
CJ CORP	10.01	9.39	104,416	10,660	コングロマリット
KAKAO CORP	180.92	295.75	1,777,457	181,478	インタラクティブ・メディアおよびサービス
CJ ENM CO LTD	7.61	−	−	−	娯楽
SK TELECOM CO LTD	22.04	−	−	−	無線通信サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	200.59	312.28	214,848	21,936	資本市場
NCSOFT CORPORATION	9.06	15.42	581,334	59,354	娯楽
LG UPLUS CORP	146.06	177.16	199,659	20,385	各種電気通信サービス
DOOSAN ENERBILITY	200.52	391.12	754,861	77,071	電気設備
LG H&H CO LTD	5.29	8.66	560,302	57,206	パーソナルケア用品
LG CHEM LTD	26.33	47.04	3,786,720	386,624	化学
LG CHEM LTD	4.99	7.33	301,263	30,758	化学
LG H&H CO LTD	1.02	−	−	−	パーソナルケア用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	255.17	436.85	1,550,817	158,338	銀行
HYUNDAI MERCHANT MARINE	151.96	257.38	549,506	56,104	海上運輸

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	
S-OIL CORP	23.35	46.49	378,893	38,685	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	83.1	114.38	598,207	61,076	化学
MERITZ SECURITIES CO LTD	202.52	–	–	–	資本市場
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	46.18	62.76	215,894	22,042	資本市場
POSCO FUTURE M CO LTD	20.82	25.09	964,710	98,496	建設資材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	8.75	19	342,760	34,995	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	13.99	27.51	229,708	23,453	専門小売り
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	19.26	43.83	367,295	37,500	機械
HYUNDAI MOBIS	38.05	58.44	1,332,432	136,041	自動車用部品
SK HYNIX INC	318.1	520.44	4,605,894	470,261	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	42.06	69.3	274,081	27,983	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	15.15	20.64	198,144	20,230	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	80.41	135.05	2,633,475	268,877	自動車
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	–	26.94	197,200	20,134	機械
HYUNDAI STEEL CO	60.59	78.56	290,279	29,637	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	183.71	280.33	283,693	28,965	銀行
KIA CORPORATION	153.03	250.43	2,116,133	216,057	自動車
KOREA ZINC CO LTD	4.7	8.17	454,252	46,379	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER CORP	142.75	244.75	463,311	47,304	電力
KOREAN AIR CO LTD	94.37	166.09	387,820	39,596	旅客航空輸送
CJ LOGISTICS	1.29	–	–	–	航空貨物・物流サービス
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	11.99	15.44	213,844	21,833	化学
HLB INC	67.89	100.07	361,753	36,934	ヘルスケア機器・用品
LG ELECTRONICS INC	60.7	101.53	1,139,166	116,308	家庭用耐久財
LG CORP	48.25	94.86	838,562	85,617	コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	91.63	152.9	142,961	14,596	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	46.31	–	–	–	建設・土木
NAVER CORP	71.42	125.28	2,468,016	251,984	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	21.69	685,404	69,979	電子装置・機器・部品
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	29.32	37.39	212,375	21,683	資本市場
AMOREPACIFIC GROUP	23.47	–	–	–	パーソナルケア用品
KANGWON LAND INC	43.02	92.45	180,092	18,387	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO HOLDINGS INC	42.5	68.68	2,908,598	296,967	金属・鉱業
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	82.93	140.98	433,513	44,261	建設・土木
SAMSUNG SDI CO LTD	31.92	52.32	3,950,160	403,311	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	30.59	54.94	833,989	85,150	電子装置・機器・部品
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	4.1	–	–	–	バイオテクノロジー
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,802.68	4,571.21	29,850,001	3,047,685	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	354.68	547.49	309,879	31,638	機械
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	485.33	787.43	4,385,985	447,809	コンピュータ・周辺機器
YUHAN CORP	21.27	43.95	255,349	26,071	医薬品
HANON SYSTEMS	80.78	191.41	176,097	17,979	自動車用部品
GS HOLDINGS CORP	26.22	42.59	173,341	17,698	コングロマリット
LG DISPLAY CO LTD	125.69	237.42	385,807	39,390	電子装置・機器・部品
CELLTRION INC	56.12	97.18	1,705,509	174,132	バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL GROUP	172.18	280.57	1,164,365	118,881	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	11.38	19.28	314,456	32,106	航空貨物・物流サービス
CELLTRION PHARM INC	10.17	17.64	161,229	16,461	医薬品
LOTTE SHOPPING CO	4.57	10.25	84,767	8,654	大規模小売り
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	24.99	–	–	–	保険
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	37.28	77.04	498,448	50,891	保険
AMOREPACIFIC CORP	17.9	30.32	404,165	41,265	パーソナルケア用品
SK INNOVATION CO LTD	29.24	51.89	1,004,071	102,515	石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	3.85	8.9	283,910	28,987	食品
STX PAN OCEAN CO LTD	201.72	312.93	190,887	19,489	海上運輸
LG INNOTEK CO LTD	7.85	14.36	371,924	37,973	電子装置・機器・部品
SK INC	24.01	36.19	615,230	62,814	コングロマリット

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
KB FINANCIAL GROUP INC	229.45	370.99	1,795,591	183,329	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	34.39	74.26	400,261	40,866	航空宇宙・防衛
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	19.49	25.08	171,045	17,463	電子装置・機器・部品
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	28	61.86	270,018	27,568	金融サービス
HANMI PHARM CO LTD	2.35	8.1	264,465	27,001	医薬品
SEEGENE INC	19.58	–	–	–	バイオテクノロジー
E-MART CO LTD	14.26	17.3	173,000	17,663	生活必需品流通・小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	52.61	76.97	273,243	27,898	自動車用部品
HD HYUNDAI CO LTD	20.56	40.06	241,962	24,704	石油・ガス・消耗燃料
BGF RETAIL CO LTD	4.13	7.15	128,342	13,103	生活必需品流通・小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	17.6	21.29	287,202	29,323	食品
SK CHEMICALS CO LTD	6.13	–	–	–	化学
NETMARBLE CORP	14.78	25.97	184,127	18,799	娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	284.88	508.23	588,022	60,037	銀行
ECOPRO BM CO LTD	5.86	45.55	1,339,170	136,729	電気設備
SD BIOSENSOR INC	30.95	42.88	93,049	9,500	ヘルスケア機器・用品
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	20.02	29.49	215,866	22,040	医薬品
KRAFTON INC	12.16	27.1	512,732	52,349	娯楽
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	–	15.06	159,184	16,252	機械
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	13.12	27.2	228,480	23,327	化学
SK SQUARE CO LTD	53.81	101.44	411,339	41,997	半導体・半導体製造装置
SK BIOSCIENCE CO LTD	16.72	19.81	155,706	15,897	バイオテクノロジー
KAKAO GAMES CORP	25.15	32.64	135,945	13,880	娯楽
HYBE CO LTD	11.58	19.2	499,200	50,968	娯楽
LG ENERGY SOLUTION	11.97	33.27	1,966,257	200,754	電気設備
KAKAOBANK CORP	67.67	129.07	307,186	31,363	銀行
F&F CO LTD / NEW	13.7	18.75	268,312	27,394	繊維・アパレル・贅沢品
KAKAOPAY CORP	–	22.37	132,206	13,498	金融サービス
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD-RTS	0.87	–	–	–	ライフサイエンス・ツール／サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	18.25	36.4	429,156	43,816	情報技術サービス
ALTEOGEN INC	20.26	–	–	–	バイオテクノロジー
SAMSUNG C&T CORP	46.39	79.98	867,783	88,600	コングロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	9.96	16.61	1,348,732	137,705	ライフサイエンス・ツール／サービス
PEARL ABYSS CORP	20.8	34.27	158,670	16,200	娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	28.05	46	218,270	22,285	機械
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	47.15	90.33	672,055	68,616	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
小計 株数・金額	9,438.09	15,049.86	101,193,373	10,331,843	
小計 銘柄数<比率>	112銘柄	102銘柄	–	<11.2%>	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
EVE ENERGY CO LTD	88.32	130.32	898	17,575	電気設備
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	–	58	262	5,124	電気設備
LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	–	227	311	6,090	化学
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	59.4	59.4	132	2,593	電子装置・機器・部品
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	34	30	274	5,360	電子装置・機器・部品
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	–	51	169	3,312	化学
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD	–	483	339	6,630	資本市場
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	30	–	–	–	飲料
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	120	120	126	2,463	半導体・半導体製造装置
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	52	120.8	837	16,367	化学
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	52	122	194	3,805	金属・鉱業
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	–	175	290	5,683	航空宇宙・防衛
UNISPLENDOUR CORP LTD	75.4	212.4	670	13,107	電子装置・機器・部品
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	163	–	–	–	電子装置・機器・部品
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	–	105	158	3,098	電気設備
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	191	191	228	4,459	紙製品・林産品
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	40	–	–	–	通信機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12	12	127	2,487	ライフサイエンス・ツール／サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	39	162	315	6,161	電気設備
HUAGONG TECH CO LTD	75	–	–	–	電子装置・機器・部品
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	21	21	354	6,931	医薬品
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	103.3	–	–	–	機械
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	–	89	177	3,466	機械
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	53	81	282	5,523	娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	59	–	–	–	電子装置・機器・部品
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	191	139	378	7,406	電子装置・機器・部品
YINTAI GOLD CO LTD	–	239	317	6,206	金属・鉱業
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	–	315	286	5,592	建設資材
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	–	618	244	4,785	電気設備
GEM CO LTD	291	291	219	4,296	金属・鉱業
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	26	26	263	5,157	ソフトウェア
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	69	69	241	4,731	バイオテクノロジー
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	186	186	115	2,258	娯楽
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	–	169	230	4,514	石油・ガス・消耗燃料
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	65	98	1,006	19,676	電気設備
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	85.68	119.95	144	2,831	電子装置・機器・部品
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	59.04	59.04	163	3,189	家庭用耐久財
ZHEJIANG NHU CO LTD	32.6	273.12	493	9,645	医薬品
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	–	296	295	5,782	不動産管理・開発
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	26.6	133.6	419	8,208	医薬品
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	66	66	151	2,969	食品
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	34	–	–	–	機械
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	51	51	137	2,693	建設関連製品
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	15	–	–	–	情報技術サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	26	–	–	–	情報技術サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	46	93	516	10,091	食品
GOTION HIGH-TECH CO LTD	30	104	303	5,942	電気設備
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	110	–	–	–	航空宇宙・防衛
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	–	115	359	7,036	ヘルスケア機器・用品
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	196	333	1,621	31,698	食品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	72	113	936	18,317	バイオテクノロジー
CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD	–	57	230	4,511	電子装置・機器・部品
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	40	180	188	3,681	石油・ガス・消耗燃料
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	180	180	211	4,132	コングロマリット
ADDSINO CO LTD	102	–	–	–	通信機器
TIANQI LITHIUM CORP	–	101	831	16,250	化学
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	112	112	144	2,816	コンピュータ・周辺機器
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	–	29	39	772	飲料
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	101	101	107	2,099	電子装置・機器・部品
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	314	–	–	–	化学
NAVINFO CO LTD	56	56	76	1,503	ソフトウェア
BY-HEALTH CO LTD	–	141	318	6,222	パーソナルケア用品
DAAN GENE CO LTD	–	139	224	4,389	バイオテクノロジー
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	143	–	–	–	不動産管理・開発
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	27.3	–	–	–	ヘルスケア・テクノロジー
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	26	21	64	1,263	医薬品
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	78	78	192	3,767	バイオテクノロジー
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	502.5	717.5	1,059	20,708	化学
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	60	60	347	6,788	医薬品
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	32	61.39	701	13,711	半導体・半導体製造装置
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	35.7	35.7	142	2,789	コンピュータ・周辺機器
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	127	127	162	3,176	コンピュータ・周辺機器
O-FILM TECH CO LTD	86	–	–	–	電子装置・機器・部品
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	367	367	165	3,229	金属・鉱業
FAW JIEFANG GROUP CO LTD	–	320	273	5,350	機械

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	233.81	373.67	1,140	22,307	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	108	108	356	6,962	電子装置・機器・部品
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	5.6	35.84	148	2,909	飲料
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	–	111	423	8,271	医薬品
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	69	69	168	3,296	ヘルスケア機器・用品
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	382	375	260	5,096	機械
DONG-E-E-JIAO CO LTD	49	49	254	4,980	医薬品
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	153	153	153	3,009	通信機器
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	210	–	–	–	繊維・アパレル・贅沢品
HUADONG MEDICINE CO LTD	75	75	337	6,595	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	50	50	141	2,767	エネルギー設備・サービス
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	62	991	341	6,685	金属・鉱業
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	66	66	178	3,494	娯楽
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	119	98	228	4,476	航空宇宙・防衛
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	45	81	1,890	36,971	飲料
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	111	178	1,205	23,571	機械
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	149.5	149.5	108	2,131	食品
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	177	–	–	–	資本市場
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	153	223	1,019	19,932	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	59.4	87.4	141	2,760	ホテル・レストラン・レジャー
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	53.2	74.48	160	3,129	ソフトウェア
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	160	–	–	–	不動産管理・開発
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	21	21	419	8,198	資本市場
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	364.8	364.8	235	4,601	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	143	143	153	3,000	娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	271.54	450.54	1,337	26,156	電子装置・機器・部品
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	–	299	666	13,038	化学
SHANXI SECURITIES CO LTD	275	275	163	3,188	資本市場
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	838	713	454	8,881	メディア
NEW HOPE LIUHE CO LTD	199	199	267	5,233	食品
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	239	191	458	8,963	電子装置・機器・部品
DHC SOFTWARE CO LTD	38	–	–	–	情報技術サービス
IFLYTEK CO LTD	135	118	687	13,436	ソフトウェア
HESTEEL CO LTD	1,047	934	222	4,346	金属・鉱業
GOERTEK INC	78	251	566	11,072	電子装置・機器・部品
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	213	213	151	2,953	資本市場
BANK OF NINGBO CO LTD	192	326	933	18,250	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD	124	396	524	10,252	電子装置・機器・部品
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	474	1,352	604	11,817	家庭用耐久財
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	283	283	161	3,154	資本市場
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	376	376	191	3,742	ホテル・レストラン・レジャー
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	416.6	404.88	493	9,643	自動車
WESTERN SECURITIES CO LTD	227	227	150	2,942	資本市場
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	47	274	712	13,941	食品
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	38	105.2	586	11,476	医薬品
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	267.08	843.49	1,841	36,006	資本市場
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	44	81	1,236	24,178	飲料
WULIANGYE YIBIN CO LTD	128	229	4,080	79,787	飲料
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	208	40	26	515	バイオテクノロジー
SUNING.COM CO LTD	237	–	–	–	専門小売り
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	855	2,181	950	18,594	電子装置・機器・部品
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	253	459	693	13,552	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	34	187	752	14,721	家庭用耐久財
GUOSEN SECURITIES CO LTD	–	423	416	8,147	資本市場
PING AN BANK CO LTD	601	1,070	1,383	27,053	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	155.8	291.8	611	11,948	食品
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	712	1,463	658	12,873	資本市場

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
CHINA VANKE CO LTD	319	551	877	17,163	不動産管理・開発
ZTE CORP	243	197	663	12,974	通信機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	285	285	182	3,572	機械
WEICHAI POWER CO LTD	47	481	574	11,239	機械
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	42	42	160	3,147	医薬品
GF SECURITIES CO LTD	219	387	656	12,842	資本市場
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	211	211	239	4,691	電気設備
BYD CO LTD	59	104	2,594	50,727	自動車
YOUNGY CO LTD	－	21	163	3,198	金属・鉱業
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	－	302	213	4,181	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	341	341	207	4,054	電子装置・機器・部品
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	48.3	96.6	415	8,124	化学
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	29	52.2	280	5,486	化学
LB GROUP CO LTD	110	110	224	4,390	化学
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	179	179	235	4,613	化学
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	－	84	177	3,475	化学
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	－	21	113	2,212	半導体・半導体製造装置
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	－	96	242	4,745	化学
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	129	117	297	5,811	化学
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	－	64	299	5,863	電気設備
CHACHA FOOD CO LTD	29	－	－	－	食品
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	80	80	176	3,446	医薬品
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	－	127	300	5,878	建設関連製品
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	27	35	1,151	22,509	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	36	－	－	－	食品
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	－	301	257	5,044	化学
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	－	128	290	5,679	半導体・半導体製造装置
HUAFON CHEMICAL CO LTD	342	342	253	4,948	化学
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	－	573	331	6,476	金属・鉱業
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	55.5	55.5	107	2,094	娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	30	16	445	8,709	飲料
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	156	156	136	2,669	化学
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	66	66	460	9,001	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	6	6	31	624	家庭用耐久財
NINESTAR CORP	57	45	194	3,803	コンピュータ・周辺機器
YUNDA HOLDING CO LTD	70.2	254.2	296	5,790	航空貨物・物流サービス
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	338	－	－	－	半導体・半導体製造装置
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	120	－	－	－	娯楽
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	67.2	－	－	－	機械
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	16	16	113	2,214	医薬品
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	－	169	323	6,335	金属・鉱業
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	－	107	278	5,452	容器・包装
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	15	18.2	276	5,398	医薬品
JIUGUI LIQUOR CO LTD	23	18	216	4,223	飲料
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	151	151	106	2,081	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	－	－	－	ソフトウェア
SF HOLDING CO LTD	142	320	1,820	35,591	航空貨物・物流サービス
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	18	18	146	2,866	建設関連製品
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	236	236	143	2,810	資本市場
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	－	40	235	4,613	電気設備
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	25	25	255	4,996	半導体・半導体製造装置
GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD	－	47	254	4,968	電気設備
BANK OF SHANGHAI CO LTD	637.9	517.9	320	6,268	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	389	389	629	12,299	ソフトウェア
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	－	730	397	7,779	保険
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	23	23	190	3,722	家庭用耐久財
CSC FINANCIAL CO LTD	136	261	700	13,688	資本市場

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	29.4	121.8	645	12,618	化学
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	126	91	147	2,880	医薬品
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	133	332	572	11,192	化学
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	31	31	212	4,151	飲料
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	225	225	240	4,712	資本市場
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	15.6	103.72	377	7,372	生活必需品流通・小売り
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	115	388	352	6,896	金属・鉱業
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	−	37	132	2,581	化学
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	52	52	129	2,525	食品
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	102	152.78	250	4,890	化学
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	−	30	425	8,323	自動車用部品
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	31.5	31.5	194	3,812	通信機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	32	39	449	8,785	化学
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	27	27	193	3,774	電子装置・機器・部品
JUEWEI FOOD CO LTD	31	31	133	2,612	食品
OPPEIN HOME GROUP INC	21	21	260	5,084	家庭用耐久財
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	43.2	91.16	511	10,000	金属・鉱業
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	95	95	126	2,472	食品
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	30	30	194	3,794	通信機器
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	−	103	163	3,198	商社・流通業
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	−	47	311	6,087	化学
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	−	69	269	5,262	化学
C&S PAPER CO LTD	78	−	−	−	家庭用品
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	8.4	45.4	401	7,854	電子装置・機器・部品
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	7	30	348	6,816	自動車用部品
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	27	27	131	2,565	医薬品
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	13.3	80.3	254	4,974	ヘルスケア機器・用品
BGI GENOMICS CO LTD	13	13	94	1,845	バイオテクノロジー
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	30	30	161	3,161	化学
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	−	31	118	2,321	金属・鉱業
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	20	32	107	2,101	バイオテクノロジー
CAITONG SECURITIES CO LTD	127	127	99	1,942	資本市場
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	38	24	198	3,882	化学
BANK OF CHENGDU CO LTD	270	213	302	5,906	銀行
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	−	132	201	3,946	金属・鉱業
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	−	42	281	5,503	自動車用部品
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	19	19	161	3,164	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	−	−	−	資本市場
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	59	561	1,005	19,669	電子装置・機器・部品
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	38	74	2,318	45,329	ヘルスケア機器・用品
HUAXI SECURITIES CO LTD	155	155	129	2,533	資本市場
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	12	16	218	4,276	ソフトウェア
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	−	85	159	3,111	化学
OVCTEK CHINA INC	40.6	40.6	141	2,758	ヘルスケア機器・用品
SG MICRO CORP	9	31.5	527	10,324	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	80	138	5,628	110,066	電気設備
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	34.16	30.16	409	8,014	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTEC CO LTD	76.72	129.72	1,110	21,718	ライフサイエンス・ツール／サービス
FLAT GLASS GROUP CO LTD	3	103	340	6,666	半導体・半導体製造装置
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	−	921	343	6,717	銀行
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	23	73	469	9,174	電子装置・機器・部品
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	16	25.6	329	6,447	電子装置・機器・部品
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	363	297	435	8,513	化学
PHARMARON BEIJING CO LTD	33	49.5	275	5,385	ライフサイエンス・ツール／サービス
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	−	6	131	2,563	化学
BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	−	29	228	4,464	電子装置・機器・部品
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	−	11	216	4,226	電子装置・機器・部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	–	11	102	1,996	半導体・半導体製造装置
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	–	39	252	4,932	商社・流通業
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	–	18	150	2,944	金属・鉱業
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	38	30	572	11,197	半導体・半導体製造装置
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	64	54	388	7,602	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	–	750	438	8,579	電子装置・機器・部品
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	7	27	193	3,778	電気設備
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY INC CO	–	35	162	3,168	電気設備
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	–	82	271	5,315	通信機器
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	–	263	335	6,562	不動産管理・開発
WILL SEMICONDUCTOR LTD	38	91.3	945	18,494	半導体・半導体製造装置
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD	17	23.8	242	4,743	機械
JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD	–	32.2	187	3,672	ライフサイエンス・ツール／サービス
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	171	128	287	5,614	電気設備
BANK OF CHANGSHA CO LTD	–	437	350	6,853	銀行
TIANFENG SECURITIES CO LTD	9	–	–	–	資本市場
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	–	1,143	340	6,660	銀行
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	817	707	351	6,870	金属・鉱業
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	107	107	307	6,021	電子装置・機器・部品
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	287	248	217	4,262	資本市場
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	–	22	245	4,806	半導体・半導体製造装置
PROYA COSMETICS CO LTD	9	12.6	217	4,245	パーソナルケア用品
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	–	29	133	2,601	電気設備
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	1,737	–	–	–	陸上運輸
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	10	8	224	4,388	半導体・半導体製造装置
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	9.6	9.6	280	5,484	電気設備
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	1,077	1,850	952	18,630	銀行
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	–	210	234	4,578	資本市場
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	23	23	122	2,392	バイオテクノロジー
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD	–	9	122	2,387	半導体・半導体製造装置
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	–	435	367	7,187	金属・鉱業
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	–	39	209	4,087	化学
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	–	14	175	3,440	電気設備
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	61	61	262	5,132	食品
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	16	16	56	1,100	医薬品
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	12	–	–	–	ヘルスケア機器・用品
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD	–	63	291	5,693	化学
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	–	60	346	6,770	半導体・半導体製造装置
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	39	22	203	3,970	金属・鉱業
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	62	104.8	584	11,437	半導体・半導体製造装置
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	506	356	278	5,436	資本市場
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	19	50.55	601	11,768	バイオテクノロジー
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	–	29	172	3,370	ヘルスケア機器・用品
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD	–	38	123	2,405	半導体・半導体製造装置
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	6	26	393	7,702	食品
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	109	75	316	6,181	資本市場
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	–	46	228	4,461	機械
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	–	29	224	4,399	金属・鉱業
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	10	16	901	17,637	バイオテクノロジー
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	43	22	240	4,712	コンピュータ・周辺機器
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	24.47	32.47	1,387	27,128	ソフトウェア
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	164	–	–	–	半導体・半導体製造装置
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	4.55	–	–	–	家庭用耐久財
SHANGHAI MEDICILON INC	–	8	150	2,940	ライフサイエンス・ツール／サービス
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	660	1,856	501	9,799	建設・土木
PETROCHINA CO LTD	1,109	1,221	896	17,524	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	2,118	3,737	1,767	34,564	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	2,744	5,112	1,686	32,987	銀行
BANK OF CHINA LTD	840	1,960	701	13,720	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	1,585	2,273	1,443	28,223	石油・ガス・消耗燃料
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	100	138	485	9,498	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	175	334	969	18,966	石油・ガス・消耗燃料
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	701	1,186	4,174	81,633	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	370	626	2,972	58,120	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD	686	1,299	2,249	43,994	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	1,020	1,513	1,118	21,863	銀行
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	1,382	2,177	766	14,984	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD	257	425	614	12,025	自動車
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	44	72	12,621	246,806	飲料
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	1,265	2,257	1,234	24,141	銀行
CITIC SECURITIES CO LTD	565	703	1,531	29,940	資本市場
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	162	407	1,167	22,825	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	383	383	216	4,231	運送インフラ
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	738	1,254	2,671	52,229	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DAQIN RAILWAY CO LTD	189	826	631	12,356	陸上運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	784	2,151	677	13,249	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	1,223	2,715	1,786	34,933	建設・土木
HAITONG SECURITIES CO LTD	–	555	525	10,266	資本市場
HUAXIA BANK CO LTD	829	707	394	7,714	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	190	325	915	17,908	食品
BANK OF BEIJING CO LTD	879	1,664	772	15,097	銀行
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	407	1,912	1,124	21,984	無線通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	548	1,081	759	14,860	金属・鉱業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	97	232	663	12,965	建設資材
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	335	283	410	8,029	資本市場
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	78	590	541	10,590	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR CO LTD	141	117	340	6,657	自動車
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	451	544	808	15,807	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD	770	1,417	964	18,869	機械
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	172.52	347.52	1,712	33,495	医薬品
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	189	174	475	9,305	金属・鉱業
HUATAI SECURITIES CO LTD	52	495	721	14,102	資本市場
CHINA RAILWAY GROUP LTD	1,111	1,004	873	17,080	建設・土木
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	–	163	533	10,422	保険
HAIER SMART HOME CO LTD	278	321	751	14,688	家庭用耐久財
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	193	482	834	16,324	機械
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	1,273	1,013	398	7,784	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	103	562	354	6,923	銀行
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	79	174	590	11,554	医薬品
GUANGHUI ENERGY CO LTD	72	264	261	5,121	石油・ガス・消耗燃料
GEMDALE CORP	106	397	352	6,901	不動産管理・開発
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	124	200	1,945	38,040	化学
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	970	787	369	7,232	電気設備
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	927	1,135	1,578	30,872	金属・鉱業
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	316	–	–	–	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NARI TECHNOLOGY CO LTD	136.2	323.44	863	16,880	電気設備
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	298	298	200	3,921	エネルギー設備・サービス
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	62	111	1,995	39,028	専門小売り
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	–	309	343	6,725	自動車
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	2,359	2,225	427	8,353	金属・鉱業
TSINGTAO BREWERY CO LTD	–	44	512	10,019	飲料
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	250	250	100	1,970	金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	261	1,020	676	13,223	金属・鉱業
AIR CHINA LTD	284	607	685	13,412	旅客航空輸送

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
TBEA CO LTD	267	186	409	7,997	電気設備
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	–	435	459	8,982	建設・土木
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	457	636	276	5,409	建設・土木
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	843	1,173	919	17,982	建設・土木
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	69	337	835	16,342	機械
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	33	104	578	11,309	運送インフラ
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	69	69	237	4,634	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD	172	149	320	6,264	金属・鉱業
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	343	343	135	2,649	資本市場
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	83	285	479	9,384	自動車用部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD	148	–	–	–	資本市場
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	48	–	–	–	化学
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	237	237	337	6,594	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	6	114	248	4,857	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	112	486	9,515	航空宇宙・防衛
BANK OF NANJING CO LTD	291	573	526	10,297	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	76	76	120	2,359	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	599.7	896.7	1,025	20,059	海上運輸
CMOC GROUP LIMITED	641	1,197	760	14,863	金属・鉱業
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	282	338	234	4,580	資本市場
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	–	90	495	9,679	医薬品
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	229.2	201.2	539	10,551	金属・鉱業
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	76	78	211	4,128	電気設備
BBMG CORP	542	542	133	2,607	建設資材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	294	–	–	–	生活必需品流通・小売り
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	–	140	478	9,359	石油・ガス・消耗燃料
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	386	306	167	3,267	旅客航空輸送
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	150.19	150.19	274	5,362	電気設備
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	–	580	357	6,986	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	77	264	508	9,947	石油・ガス・消耗燃料
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	78.96	102.64	514	10,053	ソフトウェア
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	162.5	162.5	389	7,622	ソフトウェア
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD	–	1,275	331	6,482	商社・流通業
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	33	33	69	1,360	金属・鉱業
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	327	364	297	5,808	旅客航空輸送
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	590	590	169	3,311	建設・土木
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	109	102	349	6,825	自動車用部品
XIAMEN C & D INC	189	189	242	4,737	商社・流通業
YOUNGOR GROUP CO LTD	256	256	169	3,318	不動産管理・開発
AVIC HELICOPTER CO LTD	46	46	195	3,821	航空宇宙・防衛
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	168	168	119	2,332	資本市場
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	–	151	435	8,512	医薬品
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	–	495	394	7,704	不動産管理・開発
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	–	149	211	4,137	石油・ガス・消耗燃料
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	394	394	172	3,374	化学
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	196	196	129	2,529	電気設備
WESTERN MINING CO LTD	–	233	327	6,401	金属・鉱業
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	17	39	1,067	20,880	医薬品
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	–	341	288	5,647	金属・鉱業
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	48.8	74.8	1,832	35,835	飲料
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	12	–	–	–	通信機器
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	–	126	179	3,503	機械
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	–	568	415	8,119	石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	250	250	203	3,969	専門小売り
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	–	65	430	8,426	ソフトウェア
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	226	203	371	7,272	化学
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	–	194	194	3,812	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	262	292	103	2,026	金属・鉱業
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	54	−	−	−	バイオテクノロジー
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	−	319	331	6,474	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	126	126	202	3,966	電気設備
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	300	261	369	7,226	石油・ガス・消耗燃料
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	42	42	151	2,956	食品
DALIAN PORT PDA CO LTD	−	1,732	278	5,452	運送インフラ
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	56	339	514	10,056	建設・土木
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	−	127	263	5,145	化学
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	58.3	58.3	119	2,341	医薬品
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	118	118	163	3,193	医薬品
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	45	33	62	1,213	電子装置・機器・部品
TONGWEI CO LTD	210	290	1,176	23,000	半導体・半導体製造装置
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	78.3	88.79	509	9,969	ソフトウェア
JCET GROUP CO LTD	109	109	382	7,487	半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	68	68	262	5,139	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO LTD	25	25	279	5,469	飲料
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	53	53	310	6,070	ホテル・レストラン・レジャー
HUAXIN CEMENT CO LTD	56	56	90	1,760	建設資材
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	120.9	104.9	357	6,986	化学
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1	17	249	4,870	電子装置・機器・部品
CHINA JUSHI CO LTD	267.46	202.46	315	6,175	建設資材
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	−	624	184	3,611	化学
NINGBO SHANSHAN CO LTD	29	132	222	4,344	化学
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	73.24	45.24	296	5,793	機械
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	196	196	229	4,495	建設関連製品
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	308	196	302	5,921	通信機器
SAILUN GROUP CO LTD	−	197	204	3,998	自動車用部品
TONGKUN GROUP CO LTD	157	157	223	4,374	化学
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	17	17	161	3,159	化学
ANGEL YEAST CO LTD	49	49	196	3,832	食品
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	−	56	150	2,944	化学
BTG HOTELS GROUP CO LTD	−	148	366	7,168	ホテル・レストラン・レジャー
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	−	42	279	5,474	半導体・半導体製造装置
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	−	15	100	1,965	化学
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	−	9	108	2,116	パーソナルケア用品
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	−	8	212	4,161	機械
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	−	26	153	3,005	半導体・半導体製造装置
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	−	16	176	3,458	バイオテクノロジー
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	−	10	276	5,416	電気設備
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	12	71	440	8,621	半導体・半導体製造装置
TRINA SOLAR CO LTD	59	111	558	10,917	半導体・半導体製造装置
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	1,215	1,817	1,015	19,861	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ZANGGE MINING CO LTD	−	116	276	5,398	化学
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	−	290	169	3,323	銀行
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	−	10	257	5,025	電気設備
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	−	6	229	4,488	ヘルスケア機器・用品
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	−	16	292	5,716	半導体・半導体製造装置
3PEAK INC	−	12	332	6,499	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	−	48	467	9,136	電子装置・機器・部品
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	172.2	469.68	1,860	36,388	半導体・半導体製造装置
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	−	127	171	3,362	金属・鉱業
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	18	18	213	4,174	自動車用部品
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	−	102	330	6,468	医薬品
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	246.51	632.51	1,268	24,798	石油・ガス・消耗燃料
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	129.24	240.16	1,769	34,610	食品
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	50	50	302	5,916	飲料

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	12	–	–	–	自動車用部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	58	70	228	4,477	電気設備
DONGXING SECURITIES CO LTD	132	132	111	2,178	資本市場
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	20	70	413	8,090	自動車用部品
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	–	223	425	8,315	旅客航空輸送
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	6	407	624	12,216	資本市場
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	597	1,050	722	14,126	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	34	34	202	3,951	飲料
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	–	53	330	6,458	飲料
SKSHU PAINT CO LTD	38	20	226	4,434	化学
BANK OF JIANGSU CO LTD	334	832	607	11,876	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD	236	454	553	10,830	銀行
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	114	114	253	4,951	自動車用部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	14.3	14	84	1,649	ヘルスケア機器・用品
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	20	20	40	801	医薬品
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	96	283	521	10,193	航空貨物・物流サービス
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	12	–	–	–	半導体・半導体製造装置
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	15	88.5	362	7,088	家庭用耐久財
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	392	304	323	6,319	資本市場
SDIC CAPITAL CO LTD	0.16	63	45	896	資本市場
TOPCHOICE MEDICAL CORP	8	32	405	7,921	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
ENN NATURAL GAS CO LTD	–	213	446	8,721	ガス
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	47	105.8	549	10,737	半導体・半導体製造装置
TOLY BREAD CO LTD	50.4	70.56	101	1,981	食品
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	28.6	28.6	152	2,986	生活必需品流通・小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	29.4	29.4	163	3,199	機械
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	87	113.1	209	4,093	商業サービス・用品
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	194	493	567	11,095	資本市場
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	160	160	255	4,999	資本市場
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	60	45	206	4,045	商業サービス・用品
GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	306.6	–	–	–	不動産管理・開発
FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	107	107	180	3,538	不動産管理・開発
小計 株数・金額	82,390.45	139,805.47	230,657	4,510,348	
小計 銘柄数<比率>	388銘柄	464銘柄	–	<4.9%>	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
AMMB HOLDINGS BHD	803	1,652	611	18,549	銀行
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,731	6,808	3,581	108,675	銀行
CELCOMDIGI BHD	1,540	2,852	1,257	38,169	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	479.2	559.2	399	12,116	運送インフラ
RHB BANK BHD	1,408.8	1,463.8	812	24,654	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	317	600	290	8,812	コングロマリット
TOP GLOVE CORP BHD	3,823	5,007	525	15,954	ヘルスケア機器・用品
GAMUDA BHD	–	1,498	614	18,638	建設・土木
GENTING BHD	1,049	2,098	981	29,797	ホテル・レストラン・レジャー
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	202.56	180.56	328	9,972	銀行
HONG LEONG BANK BHD	339.08	655.08	1,338	40,635	銀行
IOI CORP BHD	1,908.13	2,182.13	835	25,363	食品
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	221	385	829	25,167	食品
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	116	–	–	–	飲料
MALAYAN BANKING BHD	2,859.75	4,764.75	4,145	125,801	銀行
MISC BHD	1,008.8	1,098.8	797	24,209	海上運輸
NESTLE MALAYSIA BHD	41	63	863	26,193	食品
PPB GROUP BHD	462.6	594.6	988	29,990	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	223	344	786	23,864	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	554	795	1,343	40,773	ガス
GENTING MALAYSIA BHD	2,198	2,542	671	20,365	ホテル・レストラン・レジャー
TELEKOM MALAYSIA BHD	595	981	490	14,885	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
TENAGA NASIONAL BHD	1,463.5	2,500.5	2,295	69,661	電力
QL RESOURCES BHD	254.5	1,154.5	669	20,321	食品
DIALOG GROUP BHD	1,837.44	3,100.44	734	22,299	エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	8,512.5	14,244.5	5,655	171,618	銀行
SIME DARBY BERHAD	2,348	2,340	505	15,338	コングロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,058	−	−	−	ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD	1,345	2,353	705	21,422	無線通信サービス
MAXIS BHD	1,052	2,060	881	26,756	無線通信サービス
INARI AMERTRON BHD	1,313	2,347	551	16,738	半導体・半導体製造装置
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,350	2,320	1,716	52,100	化学
IHH HEALTHCARE BHD	1,266	1,777	1,044	31,709	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	176	−	−	−	運送インフラ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	1,825	3,761	1,936	58,780	金属・鉱業
SIME DARBY PLANTATION BHD	1,064	2,208	929	28,210	食品
MR DIY GROUP M BHD	−	2,592	422	12,821	専門小売り
小計 株数・金額	48,744.86	79,881.86	40,542	1,230,373	
小計 銘柄数<比率>	35銘柄	34銘柄	−	<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	100	2,357	17,303	金属・鉱業
BIDVEST GROUP LTD	160.66	278.47	7,005	51,422	コングロマリット
CLICKS GROUP LTD	134.09	242.86	6,378	46,821	生活必需品流通・小売り
DISCOVERY LTD	249.05	491.2	7,107	52,166	保険
GOLD FIELDS LTD	515.31	838.89	23,156	169,970	金属・鉱業
REMGRO LTD	283.02	508.32	7,087	52,022	金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	−	329.91	3,215	23,602	専門小売り
HARMONY GOLD MINING CO LTD	363.08	608.94	5,042	37,008	金属・鉱業
EXXARO RESOURCES LTD	154.24	247.34	4,650	34,136	石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	47.36	81.51	14,256	104,639	銀行
MTN GROUP LTD	992.79	1,610.39	20,545	150,802	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	241.13	394.98	19,514	143,238	金属・鉱業
FIRSTRAND LTD	2,949.79	4,859.72	30,883	226,685	金融サービス
NASPERS LTD	126.73	208.43	70,037	514,075	大規模小売り
NEDBANK GROUP LTD	268.1	445.78	9,355	68,666	銀行
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	31.16	48.23	4,823	35,400	金属・鉱業
SASOL LTD	330.95	542.4	13,069	95,927	化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD	294.74	475.6	10,479	76,922	生活必需品流通・小売り
MR PRICE GROUP LTD	142.2	260.25	3,984	29,245	専門小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	794.67	1,286.35	21,759	159,717	銀行
SPAR GROUP LTD/THE	95.11	−	−	−	生活必需品流通・小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	560.8	901.73	5,817	42,697	大規模小売り
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	217.55	385.63	7,103	52,138	医薬品
ABSA GROUP LTD	420.97	811.22	14,880	109,220	銀行
TIGER BRANDS LTD	129.81	−	−	−	食品
SANLAM LTD	1,091.85	1,698.04	9,519	69,871	保険
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	475.83	811.33	13,973	102,565	金属・鉱業
KUMBA IRON ORE LTD	44.97	70.79	3,412	25,048	金属・鉱業
OUTSURANCE GROUP LTD	393.52	646.4	2,236	16,416	保険
VODACOM GROUP PTY LTD	367.03	595.48	7,357	54,005	無線通信サービス
NEPI ROCKCASTLE NV	333.57	407.69	4,423	32,465	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	2,992.44	4,792.38	5,487	40,276	保険
REINET INVESTMENTS SCA	64.7	125.15	4,691	34,439	資本市場
PEPKOR HOLDINGS LTD	1,003.74	1,661.42	2,885	21,182	専門小売り
MULTICHOICE GROUP LTD	270.72	345.85	3,918	28,764	メディア
SIBANYE STILLWATER LTD	1,547.9	2,808.77	10,889	79,929	金属・鉱業
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	287.27	324.04	5,327	39,101	金属・鉱業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
BID CORP LTD	192.56	319.82	12,952	95,072	生活必需品流通・小売り
小計 株数・金額	18,641.04	30,565.31	399,587	2,932,970	
小計 銘柄数<比率>	37銘柄	36銘柄	−	<3.2%>	
(タイ)	百株	百株	千タイ・バーツ	千円	
BERLI JUCKER PCL NVDR	1,037	947	3,669	14,311	生活必需品流通・小売り
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	1,538	3,085	5,337	20,814	銀行
RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	27	1,243	4,878	19,027	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	470	−	−	−	銀行
TRUE CORP PCL NVDR	6,857.55	−	−	−	各種電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL NVDR	−	570	7,609	29,677	銀行
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	−	6,721	6,586	25,687	石油・ガス・消耗燃料
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	184	294	4,777	18,632	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHIN CORP PCL	570	972	7,265	28,336	無線通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	2,008	3,922	8,118	31,662	食品
ADVANCED INFO SERVICE PCL	696	1,187	25,283	98,604	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	3,124.2	5,190.2	7,421	28,945	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	210	293.5	28,293	110,344	電子装置・機器・部品
PTT PCL	5,815	9,327	29,380	114,582	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,665	2,650	3,630	14,158	食品
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	677	831	4,736	18,473	消費者金融
LAND AND HOUSES PCL NVDR	4,641	8,261	8,219	32,056	不動産管理・開発
SIAM CEMENT PCL NVDR	451.5	729.5	22,979	89,619	建設資材
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	2,511	4,084	29,711	115,873	運送インフラ
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	1,455	1,934	13,731	53,552	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	5,386	9,628	29,124	113,586	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	225	525	12,442	48,525	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,642.1	3,281.1	10,253	39,988	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL NVDR	831	1,247	6,484	25,289	石油・ガス・消耗燃料
CP ALL PCL NVDR	3,422	5,488	34,300	133,770	生活必需品流通・小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL	4,271	8,669	6,718	26,202	陸上運輸
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	770.45	1,388.45	22,423	87,451	石油・ガス・消耗燃料
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	1,313.22	1,411.22	4,798	18,712	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,175.08	2,349.08	10,218	39,852	化学
JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR	−	543	2,362	9,211	消費者金融
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	807	1,676	13,072	50,983	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	3,021	6,124	5,542	21,614	運送インフラ
B GRIMM POWER PCL NVDR	566	982	3,928	15,319	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	1,969	2,910	15,786	61,568	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
OSOTSPA PCL NVDR	386	1,428	4,141	16,150	飲料
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	1,053	−	−	−	資本市場
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	3,536	8,172	4,576	17,847	ホテル・レストラン・レジャー
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	1,120.33	1,584.33	7,089	27,650	大規模小売り
SCG PACKAGING PCL NVDR	904	1,433	6,269	24,450	容器・包装
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	236	690	3,915	15,271	消費者金融
SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	419	−	−	−	ヘルスケア機器・用品
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	1,966	2,953	6,437	25,106	専門小売り
SCB X PCL NVDR	−	903	9,165	35,745	銀行
TRUE CORP PCL NVDR	−	8,489.28	6,961	27,148	各種電気通信サービス
CARABAO GROUP PCL NVDR	262	325	2,819	10,995	飲料
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	611	554	2,049	7,994	消費者金融
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	491	744	5,059	19,730	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計 株数・金額	70,320.43	125,738.66	457,570	1,784,526	
小計 銘柄数<比率>	42銘柄	43銘柄	−	<1.9%>	
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
MBANK	6.34	13.44	478	15,172	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	79.89	132.82	1,622	51,448	金属・鉱業
BANK PEKAO SA	98.56	171.77	1,613	51,180	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	
(ポーランド)		百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
ORANGE POLSKA SA		589.32	–	–	–	各種電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		166.5	600.93	3,707	117,577	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA		0.61	1.12	1,072	34,024	繊維・アパレル・贅沢品
SANTANDER BANK POLSKA SA		19.52	32.41	1,055	33,484	銀行
CD PROJEKT RED SA		46.78	70.01	776	24,629	娯楽
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA		489.95	859.44	2,698	85,577	銀行
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA		1,293.98	–	–	–	石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA		200	200.87	341	10,828	メディア
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA		521.92	800.42	533	16,904	電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA		332.7	585	2,174	68,954	保険
DINO POLSKA SA		26.31	46.92	1,846	58,548	生活必需品流通・小売り
ALLEGRO.EU SA		276.48	345.9	1,100	34,914	大規模小売り
PEPCO GROUP NV		–	165.87	657	20,850	大規模小売り
小計	株数・金額	4,148.86	4,026.92	19,680	624,096	
	銘柄数<比率>	15銘柄	14銘柄	–	<0.7%>	
(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		82.72	137.96	109,540	43,229	医薬品
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT		283.77	407.81	110,679	43,679	石油・ガス・消耗燃料
OTP BANK NYRT		124.13	222.96	221,265	87,321	銀行
小計	株数・金額	490.62	768.73	441,485	174,230	
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄	–	<0.2%>	
(ユーロ…ギリシャ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ALPHA BANK A.E.		1,036.65	2,124.73	250	36,835	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		–	515.07	244	35,869	銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		113.34	208.5	292	42,947	各種電気通信サービス
FF GROUP		31.3	31.3	0	0	繊維・アパレル・贅沢品
EUROBANK ERGASIAS SERVICES		1,819.4	2,404.41	306	45,075	銀行
MYTILINEOS HOLDINGS		–	90.56	253	37,254	コングロマリット
MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN		–	46.96	110	16,185	石油・ガス・消耗燃料
OPAP SA		155.54	178.33	271	39,902	ホテル・レストラン・レジャー
JUMBO SA		45.83	120.11	252	37,057	専門小売り
PUBLIC POWER CORP		160	214.41	174	25,673	電力
TERNA ENERGY SA		–	61.02	123	18,216	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額	3,362.06	5,995.4	2,280	335,018	
	銘柄数<比率>	7銘柄	11銘柄	–	<0.4%>	
合計	株数・金額	1,522,645.11	5,553,344.58	–	84,723,717	
	銘柄数<比率>	1,291銘柄	1,354銘柄	–	<92.1%>	

(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であります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。
(注4) 銘柄コード等の変更があった銘柄や普通株と優先株は、別銘柄として掲載しております。
(※1) 当該銘柄はロシア株式を原資産とする預託証券です。市場での取引の停止・制限が継続されているため、評価額をゼロとしています。(ファンド監査人と協議の上、企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」及び社団法人投資信託協会「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」に則り、委託会社が適切と判断した価格を採用しております。)
(※2) 当該銘柄はロシア株式です。市場での取引の停止・制限が継続されているため、評価額をゼロとしています。(ファンド監査人と協議の上、企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」及び社団法人投資信託協会「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」に則り、委託会社が適切と判断した価格を採用しております。)

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額
(メキシコ)		千口	千口	千メキシコ・ペソ	千円
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D		114.1	186.1	31,337	233,739
GRUPO TELEVISA SAB		120.8	246.9	4,760	35,505
CEMEX SAB DE CV		854.975	1,453.275	15,753	117,502
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV		25	−	−	−
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		168	296.3	7,348	54,809
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		28.3	49.5	7,444	55,529
小計	口数・金額	1,311.175	2,232.075	66,644	497,085
	銘柄数<比率>	6銘柄<0.4%>	5銘柄<0.5%>	−	−
(ブラジル)		千口	千口	千ブラジル・レアル	千円
BANCO SANTANDER BRASIL SA		32.3	38	1,047	28,478
ENERGISA SA		8.1	16.1	699	19,022
KLABIN SA		50.5	78.2	1,455	39,573
BANCO INTER SA		23.7	−	−	−
BANCO BTG PACTUAL SA		67.5	111	2,530	68,818
小計	口数・金額	182.1	243.3	5,732	155,892
	銘柄数<比率>	5銘柄<0.2%>	4銘柄<0.2%>	−	−
(南アフリカ)		千口	千口	千南アフリカ・ランド	千円
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		190.305	321.604	4,103	30,120
小計	口数・金額	190.305	321.604	4,103	30,120
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.0%>	1銘柄<0.0%>	−	−
合計	口数・金額	1,683.58	2,796.979	−	683,098
	銘柄数<比率>	12銘柄<0.6%>	10銘柄<0.7%>	−	−

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) 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であります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		末	
		買建額		売建額	
外国	MINI MSCI EMG MKT	百万円 6,763		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

2023年４月18日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	84,723,717	92.1
投資信託受益証券、投資証券	683,098	0.7
コール・ローン等、その他	6,596,949	7.2
投資信託財産総額	92,003,764	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨てております。％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、91,852,387千円、99.8％です。
（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年４月18日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝134.47円、１香港・ドル＝17.13円、１台湾・ドル＝4.406円、１イギリス・ポンド＝166.37円、１トルコ・リラ＝6.945円、１メキシコ・ペソ＝7.458円、１フィリピン・ペソ＝2.407円、100チリ・ペソ＝16.787円、100コロンビア・ペソ＝3.032円、１クウェート・ディナール＝438.44円、１カタール・リアル＝36.81円、１サウジアラビア・リアル＝35.94円、１インド・ルピー＝1.65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＝36.68円、１ブラジル・レアル＝27.192円、１チェコ・コルナ＝6.278円、100韓国・ウォン＝10.21円、１オフショア・人民元＝19.554円、１マレーシア・リンギット＝30.347円、１南アフリカ・ランド＝7.34円、１タイ・バーツ＝3.90円、１ポーランド・ズロチ＝31.711円、100ハンガリー・フォリント＝39.464円、１ユーロ＝146.92円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年４月18日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**92,214,752,343円**
コール・ローン等	4,075,348,214
株式(評価額)	84,723,717,105
投資信託受益証券(評価額)	598,168,392
投資証券(評価額)	84,929,969
未収入金	448,967,919
未収配当金	129,899,153
差入委託証拠金	2,153,721,591
(B) 負債	**231,901,818**
未払金	211,097,018
未払解約金	20,804,800
(C) 純資産総額(A－B)	**91,982,850,525**
元本	64,749,710,350
次期繰越損益金	27,233,140,175
(D) 受益権総口数	**64,749,710,350口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**14,206円**

(注１) 期首元本額　43,349,645,868円
追加設定元本額　54,595,264,708円
一部解約元本額　33,195,200,226円

(注２) 期末における元本の内訳

ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド<ＤＣ年金>	9,193,707,551円
ＤＩＡＭ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）	5,656,124,163円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,988,235円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	14,042,191円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	35,896,979円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	39,846,275円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	27,514,357円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	31,301,154円
たわらノーロード　新興国株式	11,476,984,769円
たわらノーロード　新興国株式<ラップ向け>	2,952,638,052円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,772,122,320円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	32,935,046円
たわらノーロード　バランス（標準型）	126,438,775円
たわらノーロード　バランス（積極型）	216,261,269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）	54,263,548円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	183,597,143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）	149,589,429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）	282,438,182円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	738,428円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	9,449,063円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,502,251円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	7,552,202円
たわらノーロード　全世界株式	404,033,034円
Ｏｎｅ ＤＣ 新興国株式インデックスファンド	841,411,221円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	374,552,081円
ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）	401,972,605円
ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）	590,895,258円
ＤＩＡＭＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）	1,072,021,205円
投資のソムリエ	12,735,011,767円
クルーズコントロール	384,934,440円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>	975,612,401円
ＤＩＡＭ８資産バランスファンドＮ<ＤＣ年金>	458,074,216円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>リスク抑制型	1,233,206,315円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	5,023,886,319円
ワールドアセットバランス（基本コース）	594,531,654円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,216,129,910円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	58,245,017円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	28,896,334円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	8,707,497円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	192,404,036円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,722,233,426円
９資産分散投資・スタンダード<ＤＣ年金>	337,580,035円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	62,142,083円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	31,730,467円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	19,009,359円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	4,079,621円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	27,353,689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）	11,070,276円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	333,931,723円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	5,171,233円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	14,009,387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）	219,198,223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）	98,651,045円
期末元本合計	64,749,710,350円

■損益の状況

当期　自2022年４月19日　至2023年４月18日

項目	当期
(A) 配当等収益	**2,158,823,802円**
受取配当金	2,032,460,496
受取利息	76,767,412
その他収益金	49,735,061
支払利息	△139,167
(B) 有価証券売買損益	**△2,880,060,895**
売買益	8,175,847,519
売買損	△11,055,908,414
(C) 先物取引等取引損益	**△460,554,724**
取引益	1,563,112,487
取引損	△2,023,667,211
(D) その他費用	**△146,522,073**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**△1,328,313,890**
(F) 前期繰越損益金	**19,538,571,124**
(G) 解約差損益金	**△12,714,571,051**
(H) 追加信託差損益金	**21,737,453,992**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**27,233,140,175**
次期繰越損益金(I)	**27,233,140,175**

(注１) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注２) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
(注３) (H)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日　2023年４月18日）

（計算期間　2022年４月19日～2023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		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率	(円換算ベース・為替ヘッジなし)(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
15期（2023年４月18日）	20,300	1.8	93,922.40	1.0	96.8	－	136,262

（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）。

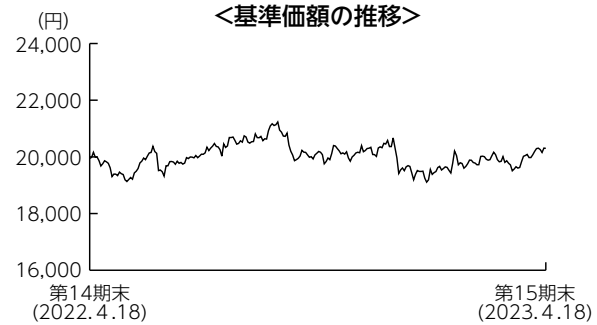
■当期中の基準価額と市況の推移

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		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2022年4月18日	19,947	－	93,033.64	－	97.6	－
4月末	19,862	△0.4	92,576.69	△0.5	89.4	－
5月末	19,786	△0.8	92,459.15	△0.6	95.1	－
6月末	19,804	△0.7	91,281.84	△1.9	106.6	－
7月末	20,351	2.0	92,775.28	△0.3	98.2	－
8月末	20,674	3.6	94,565.38	1.6	96.1	－
9月末	19,902	△0.2	91,316.39	△1.8	87.7	－
10月末	20,399	2.3	94,582.69	1.7	102.9	－
11月末	20,338	2.0	95,040.31	2.2	98.1	－
12月末	19,433	△2.6	91,280.18	△1.9	96.1	－
2023年1月末	19,630	△1.6	92,718.79	△0.3	97.3	－
2月末	20,024	0.4	93,863.42	0.9	97.3	－
3月末	20,020	0.4	92,948.19	△0.1	98.1	－
(期末)						
2023年4月18日	20,300	1.8	93,922.40	1.0	96.8	－

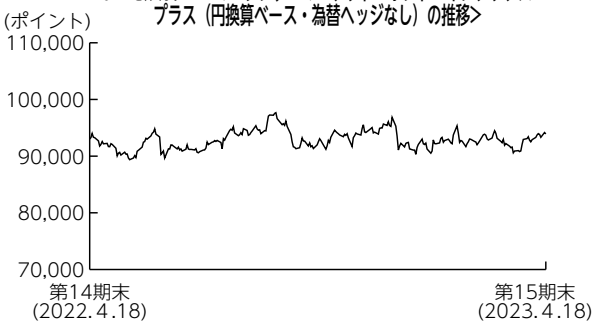
(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年４月19日から2023年４月18日まで）

<基準価額の推移>



<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）の推移>



基準価額の推移

当期末の基準価額は20,300円となり、前期末比で1.8％上昇しました。

基準価額の主な変動要因

円安の進行を主因に、基準価額は上昇しました。

投資環境

新興国債券市場は下落しました。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、2022年10月にかけて下落基調で推移しました。その後は米物価統計が一時落ち着いたことなどにより反発しました。しかしその後も米銀破綻など金融機関への懸念などを受け、荒い展開となりました。対米国債スプレッドは拡大しました。インフレや各国中央銀行の金融政策動向をにらみながら、大きく上下しました。

為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。2022年10月にかけては、米国が利上げを続ける一方で日銀は緩和を続けたことにより、日米金融政策の差が意識され、大幅に円安が進みました。その後は米国の利上げペースの鈍化観測や日銀が長期金利の許容変動幅の拡大を決めたことなどにより円高ドル安となったものの、期を通じては円安ドル高となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである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。

【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	－	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%	－

期末

国		ファンド	ベンチマーク	差
中南米	アルゼンチン	－	3.5%	△3.5%
	ブラジル	5.1%	4.2%	0.8%
	チリ	6.4%	5.5%	0.9%
	メキシコ	9.2%	7.9%	1.3%
	パナマ	5.7%	4.8%	0.9%
	ペルー	3.8%	2.9%	0.9%
	ベネズエラ	－	0.0%	△0.0%
	エクアドル	－	2.2%	△2.2%
	コロンビア	5.9%	5.0%	0.9%
	ドミニカ共和国	5.8%	4.9%	1.0%
	ウルグアイ	2.6%	1.8%	0.7%
	計	44.5%	42.8%	1.6%
欧州	ハンガリー	4.6%	3.2%	1.4%
	トルコ	－	10.0%	△10.0%
	ウクライナ	－	0.4%	△0.4%
	ルーマニア	2.9%	1.2%	1.7%
	計	7.4%	14.8%	△7.4%
アジア・オセアニア	中国	0.6%	3.4%	△2.8%
	インドネシア	4.4%	3.0%	1.4%
	フィリピン	2.9%	1.6%	1.2%
	スリランカ	－	0.4%	△0.4%
	計	7.9%	8.4%	△0.6%
中近東	カタール	9.7%	8.5%	1.2%
	アラブ首長国連邦	8.7%	7.3%	1.4%
	サウジアラビア	11.4%	10.1%	1.3%
	オマーン	3.3%	2.8%	0.5%
	計	33.1%	28.6%	4.5%
アフリカ	南アフリカ	3.9%	2.1%	1.9%
	エジプト	－	2.8%	△2.8%
	ナイジェリア	－	0.4%	△0.4%
	計	3.9%	5.3%	△1.4%
現金など		3.2%	－	－
合計		100.0%	100.0%	－

（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、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1.0%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.8%上回りました。運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

■１万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a)その他費用	3円	0.013%	(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)	(3)	(0.013)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	3	0.013	
期中の平均基準価額は20,011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（2022年４月19日から2023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 1,967,735	千アメリカ・ドル 1,944,831 (－)

（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（2022年４月19日から2023年４月18日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	0.072	0.072	100.0	0.072	0.072	100.0

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BB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	1,108,380	980,917	131,904,021	96.8	18.1	82.5	8.1	6.1
合計	－	－	131,904,021	96.8	18.1	82.5	8.1	6.1

（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					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	国債証券	3.1000	7,000	4,556	612,727	2061/01/22
PANAMA 4.5 01/19/63	国債証券	4.5000	6,000	4,348	584,744	2063/01/19
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	1,000	1,058	142,308	2026/01/29
ROMANIA 6.125 01/22/44	国債証券	6.1250	4,600	4,425	595,055	2044/01/22
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	国債証券	3.7500	5,400	4,140	556,780	2055/01/21
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	国債証券	5.8750	19,000	14,587	1,961,629	2060/01/30
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	国債証券	5.0000	7,000	6,555	881,461	2053/01/18
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	2,500	3,172	426,542	2038/01/17
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	2,200	2,200	295,882	2025/01/15
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	3,600	3,600	484,187	2027/01/08
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	国債証券	3.7500	7,200	6,983	939,084	2029/01/14
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国債証券	4.5000	6,000	5,735	771,266	2026/01/28
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	2,000	2,027	272,601	2026/01/08
INDONESIA 3.5 01/11/28	国債証券	3.5000	4,200	4,059	545,920	2028/01/11
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	国債証券	5.2500	6,000	5,879	790,605	2050/01/16
PERU 3.0 01/15/34	国債証券	3.0000	13,000	10,651	1,432,285	2034/01/15
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	国債証券	3.5000	8,000	5,975	803,583	2050/01/25
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	国債証券	3.5000	8,200	7,323	984,814	2034/01/31
PANAMA 3.16 01/23/30	国債証券	3.1600	9,000	7,894	1,061,569	2030/01/23
BRAZIL 4.75 01/14/50	国債証券	4.7500	16,000	11,727	1,577,003	2050/01/14
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	国債証券	2.5500	11,200	9,625	1,294,319	2032/01/27
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国債証券	4.5000	7,000	5,620	755,824	2050/01/31
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	3,200	2,785	374,538	2031/01/31
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	国債証券	5.6250	11,000	11,074	1,489,228	2028/01/17
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	国債証券	4.3750	13,000	13,001	1,748,356	2031/01/23
ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	7.1250	13,000	13,874	1,865,740	2033/01/17
PERU 2.783 01/23/31	国債証券	2.7830	16,000	13,716	1,844,413	2031/01/23

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 3.0 01/30/30	国債証券	3.0000	5,000	3,901	524,637	2030/01/30
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	国債証券	6.2500	6,000	6,201	833,916	2031/01/25
PERU 2.392 01/23/26	国債証券	2.3920	3,000	2,826	380,030	2026/01/23
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	国債証券	4.5000	3,000	2,647	356,013	2030/01/30
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	国債証券	2.7500	9,200	8,681	1,167,387	2027/01/31
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	国債証券	4.7500	10,000	10,207	1,372,568	2028/01/18
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国債証券	3.7000	3,000	2,524	339,493	2042/02/02
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	国債証券	3.4500	5,000	3,588	482,601	2061/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	国債証券	4.4000	7,000	5,437	731,157	2052/02/12
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	国債証券	3.5000	9,000	7,609	1,023,250	2034/02/12
ROMANIA 4.0 02/14/51	国債証券	4.0000	11,000	7,583	1,019,702	2051/02/14
COLOMBIA 7.5 02/02/34	国債証券	7.5000	10,000	9,681	1,301,875	2034/02/02
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	国債証券	3.0000	2,000	1,890	254,263	2028/02/01
PANAMA 6.4 02/14/35	国債証券	6.4000	13,000	13,538	1,820,504	2035/02/14
UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	国債証券	6.3500	10,000	10,575	1,422,066	2035/02/09
ROMANIA 3.0 02/14/31	国債証券	3.0000	4,000	3,327	447,404	2031/02/14
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	国債証券	2.2500	7,000	5,812	781,554	2033/02/02
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	国債証券	6.0000	21,200	19,618	2,638,138	2033/02/22
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	5.5000	19,000	18,105	2,434,707	2029/02/22
COLOMBIA 4.5 03/15/29	国債証券	4.5000	9,000	7,896	1,061,866	2029/03/15
HUNGARY 5.375 03/25/24	国債証券	5.3750	5,380	5,388	724,573	2024/03/25
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	国債証券	4.1500	1,400	1,375	185,025	2027/03/28
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	4.8170	16,000	15,780	2,122,037	2049/03/14
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	国債証券	4.3400	7,000	6,182	831,377	2042/03/07
PERU 3.55 03/10/51	国債証券	3.5500	8,000	5,893	792,472	2051/03/10
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	国債証券	4.0000	13,000	13,025	1,751,588	2029/03/14
INDONESIA 3.05 03/12/51	国債証券	3.0500	9,000	6,805	915,117	2051/03/12
INDONESIA 1.85 03/12/31	国債証券	1.8500	4,200	3,482	468,233	2031/03/12
ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	国債証券	1.7000	5,000	4,257	572,485	2031/03/02
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	国債証券	3.3750	6,000	5,913	795,201	2024/03/14
PANAMA 4.5 04/16/50	国債証券	4.5000	10,300	7,872	1,058,670	2050/04/16
PANAMA 4.5 04/01/56	国債証券	4.5000	10,000	7,438	1,000,284	2056/04/01
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	国債証券	3.7500	7,000	4,637	623,649	2071/04/19
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	国債証券	4.5000	5,000	4,422	594,707	2060/04/22
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	国債証券	3.5000	6,000	4,453	598,812	2053/04/15
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	国債証券	5.0000	7,000	5,978	803,962	2051/04/27
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	国債証券	7.3000	10,000	8,555	1,150,401	2052/04/20
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	国債証券	4.5000	8,000	7,807	1,049,873	2029/04/22
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	国債証券	4.7500	7,000	6,718	903,404	2032/04/27
COLOMBIA 3.25 04/22/32	国債証券	3.2500	9,000	6,632	891,900	2032/04/22
COLOMBIA 8.0 04/20/33	国債証券	8.0000	8,000	8,108	1,090,379	2033/04/20
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	1,400	1,358	182,723	2026/04/14
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	国債証券	5.1030	16,000	16,344	2,197,777	2048/04/23
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49	国債証券	5.0000	6,000	5,651	759,986	2049/04/17

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55	国債証券	4.9750	13,000	12,839	1,726,500	2055/04/20
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	4.3750	19,000	19,142	2,574,091	2029/04/16
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	国債証券	4.5000	7,000	7,050	948,105	2030/04/17
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	国債証券	3.2500	6,000	5,371	722,281	2030/04/16
COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	3.1250	10,000	7,560	1,016,594	2031/04/15
STATE OF QATAR 4.5 04/23/28	国債証券	4.5000	10,000	10,268	1,380,805	2028/04/23
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25	国債証券	4.0000	12,000	11,862	1,595,163	2025/04/17
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	国債証券	4.4000	14,000	13,123	1,764,730	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	国債証券	3.8750	10,000	8,553	1,150,212	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	国債証券	3.1250	10,000	9,515	1,279,609	2030/04/16
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	国債証券	3.7500	10,000	9,868	1,327,057	2030/04/16
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	国債証券	3.9000	4,600	4,542	610,844	2025/04/27
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	国債証券	3.4000	14,000	13,720	1,844,928	2025/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	国債証券	2.5000	13,000	12,552	1,687,975	2025/04/16
COLOMBIA 4.125 05/15/51	国債証券	4.1250	6,000	3,583	481,844	2051/05/15
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	国債証券	3.7710	7,000	4,714	633,974	2061/05/24
COLOMBIA 5.2 05/15/49	国債証券	5.2000	10,000	6,811	915,960	2049/05/15
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	国債証券	3.1000	10,000	7,508	1,009,676	2041/05/07
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	国債証券	2.6590	8,000	6,679	898,175	2031/05/24
UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	国債証券	4.8750	7,000	6,682	898,590	2033/05/19
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	10,000	9,482	1,275,065	2029/05/30
HUNGARY 6.125 05/22/28	国債証券	6.1250	8,000	8,239	1,107,925	2028/05/22
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	8,000	7,512	1,010,173	2030/06/22
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	国債証券	6.4000	2,000	1,677	225,579	2049/06/05
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	国債証券	1.6480	3,600	2,935	394,691	2031/06/10
BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	3.8750	14,000	12,513	1,682,664	2030/06/12
ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	国債証券	1.6250	7,000	6,290	845,843	2028/06/02
BRAZIL 2.875 06/06/25	国債証券	2.8750	12,000	11,509	1,547,638	2025/06/06
HUNGARY 5.25 06/16/29	国債証券	5.2500	9,000	8,820	1,186,103	2029/06/16
PANAMA 3.87 07/23/60	国債証券	3.8700	11,000	7,193	967,374	2060/07/23
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	国債証券	2.5500	10,000	8,261	1,110,872	2033/07/27
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	国債証券	3.2000	11,000	8,389	1,128,089	2046/07/06
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	国債証券	4.8750	8,000	8,179	1,099,904	2033/07/18
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	国債証券	4.0500	7,000	7,017	943,644	2032/07/07
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	国債証券	4.2800	11,000	8,971	1,206,457	2041/08/14
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	国債証券	6.0000	16,000	16,300	2,191,932	2029/08/01
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	国債証券	2.7000	4,000	2,510	337,619	2070/09/02
HUNGARY 3.125 09/21/51	国債証券	3.1250	11,000	6,752	907,972	2051/09/21
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	2,200	2,071	278,604	2029/09/18
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	国債証券	4.8750	3,000	2,585	347,727	2032/09/23
PANAMA 2.252 09/29/32	国債証券	2.2520	11,000	8,423	1,132,651	2032/09/29
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	国債証券	3.1250	11,000	8,264	1,111,344	2049/09/30
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	5.7500	16,000	11,533	1,550,923	2049/09/30
HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証券	6.2500	9,000	9,233	1,241,574	2032/09/22

銘柄	当期末					
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	3.7500	7,000	6,046	813,023	2031/09/12
HUNGARY 2.125 09/22/31	国債証券	2.1250	10,000	7,702	1,035,795	2031/09/22
ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	国債証券	1.8750	6,000	5,117	688,215	2031/09/15
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	国債証券	2.5000	11,000	10,116	1,360,423	2029/09/30
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	国債証券	4.8500	12,000	10,756	1,446,447	2029/09/30
ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	10,000	9,635	1,295,697	2024/09/30
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	国債証券	3.2500	6,000	4,507	606,083	2061/10/19
INDONESIA 4.2 10/15/50	国債証券	4.2000	9,000	7,948	1,068,850	2050/10/15
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	国債証券	5.5000	8,000	8,625	1,159,884	2032/10/25
INDONESIA 3.85 10/15/30	国債証券	3.8500	9,400	9,060	1,218,361	2030/10/15
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	国債証券	1.2000	2,000	1,680	226,030	2030/10/21
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	国債証券	3.2500	6,200	5,765	775,265	2030/10/22
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	国債証券	2.9000	9,000	8,704	1,170,534	2025/10/22
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	国債証券	1.2500	4,000	3,630	488,151	2026/10/26
PERU 2.78 12/01/60	国債証券	2.7800	9,000	5,370	722,108	2060/12/01
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	国債証券	2.6500	9,000	6,320	849,933	2045/12/10
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	国債証券	1.9500	1,000	962	129,450	2024/12/03
合計	－	－	1,108,380	980,917	131,904,021	－

■投資信託財産の構成

2023年４月18日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	131,904,021	95.7
コール・ローン等、その他	5,916,735	4.3
投資信託財産総額	137,820,757	100.0

(注１) 評価額の単位未満は切捨てております。%は、小数点第２位を四捨五入しています。
(注２) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、136,016,133千円、98.7%です。
(注３) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年４月18日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝134.47円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年４月18日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**137,820,757,117円**
コール・ローン等	4,509,516,223
公社債(評価額)	131,904,021,888
未収利息	1,006,214,615
前払費用	401,004,391
(B) 負債	**1,558,161,598**
未払金	1,556,452,598
未払解約金	1,709,000
(C) 純資産総額(A－B)	**136,262,595,519**
元本	67,123,867,342
次期繰越損益金	69,138,728,177
(D) 受益権総口数	**67,123,867,342口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**20,300円**

(注１) 期首元本額 68,830,241,594円
追加設定元本額 123,910,183,291円
一部解約元本額 125,616,557,543円

(注２) 期末における元本の内訳

ＤＩＡＭ新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>	97,403,368円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,594,684,372円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	183,042,550円
たわらノーロード　バランス（標準型）	527,327,514円
たわらノーロード　バランス（積極型）	224,809,045円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	928,023円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	5,613,842円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	65,320,668円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,608,566円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	6,518,501円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	64,865,239円
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国10）	271,810,079円
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国20）	401,041,112円
ＤＩＡＭＤＣ８資産バランスファンド（新興国30）	730,749,125円
投資のソムリエ	17,722,855,370円
クルーズコントロール	264,427,903円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>	1,358,904,418円
ＤＩＡＭ８資産バランスファンドＮ<ＤＣ年金>	309,625,511円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>リスク抑制型	1,393,530,117円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	5,664,430,474円
ワールドアセットバランス（基本コース）	441,610,114円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	873,750,483円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	63,053,419円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	31,199,558円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	9,823,913円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	207,037,744円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,753,328,555円
９資産分散投資・スタンダード<ＤＣ年金>	233,286,363円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	81,019,243円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	34,114,129円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	20,547,297円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	4,309,870円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	4,507,694円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	23,612,925円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	26,069,579,957円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	465,427,198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）	1,387,494,881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）	367,784,786円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	7,075,595円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	15,798,541円
エマージング債券パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	7,537,009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）	151,047,276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）	68,195,043円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,910,229,952円
期末元本合計	67,123,867,342円

■損益の状況

当期　自2022年４月19日　至2023年４月18日

項目	当期
(A) 配当等収益	**5,555,118,222円**
受取利息	5,550,901,043
その他収益金	5,061,018
支払利息	△843,839
(B) 有価証券売買損益	**△5,682,587,946**
売買益	13,086,747,180
売買損	△18,769,335,126
(C) その他費用	**△16,112,496**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**△143,582,220**
(E) 前期繰越損益金	**68,462,531,728**
(F) 解約差損益金	**△122,629,560,140**
(G) 追加信託差損益金	**123,449,338,809**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**69,138,728,177**
次期繰越損益金(H)	**69,138,728,177**

(注１) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注２) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
(注３) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日　2023年６月６日）

（計算期間　2022年６月７日～2023年６月６日）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2006年８月４日から無期限です。
運用方針	東証ＲＥＩＴ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。
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ＲＥＩＴ指数		投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
		期中騰落率	(配当込み)(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
17期（2023年６月６日）	23,686	△2.9	4,437.30	△2.9	97.8	2.2	200,500

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

（注３）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

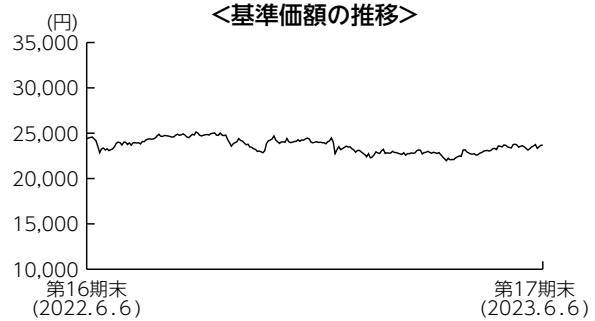
■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		東証REIT指数		投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	(配当込み)(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2022年6月6日	24,389	−	4,567.99	−	97.6	2.3
6月末	23,959	△1.8	4,487.40	△1.8	97.6	2.4
7月末	24,713	1.3	4,628.79	1.3	97.6	2.3
8月末	25,003	2.5	4,683.62	2.5	97.6	2.2
9月末	23,964	△1.7	4,488.86	△1.7	97.4	2.5
10月末	24,369	△0.1	4,564.72	△0.1	97.4	2.3
11月末	24,373	△0.1	4,565.38	△0.1	97.8	2.2
12月末	23,509	△3.6	4,403.82	△3.6	97.6	2.3
2023年1月末	22,762	△6.7	4,263.06	△6.7	97.8	2.2
2月末	23,116	△5.2	4,331.37	△5.2	97.9	2.1
3月末	22,445	△8.0	4,204.73	△8.0	97.6	2.3
4月末	23,595	△3.3	4,420.34	△3.2	97.8	2.1
5月末	23,748	△2.6	4,448.91	△2.6	97.9	2.1
(期末)						
2023年6月6日	23,686	△2.9	4,437.30	△2.9	97.8	2.2

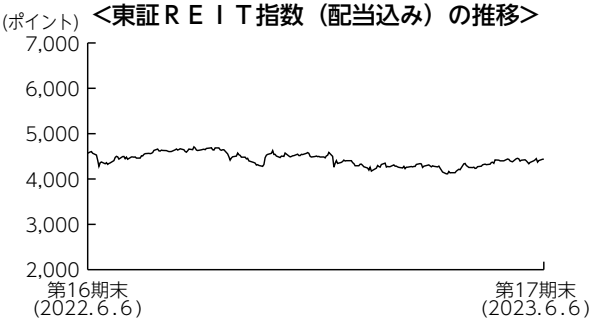
(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率−売建比率です。

■**当期の運用経過**（2022年６月７日から2023年６月６日まで）

<基準価額の推移>



<東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の推移>



基準価額の推移

当期末の基準価額は23,686円となり、前期末比で2.9％下落しました。

基準価額の主な変動要因

米国の金融引き締め加速懸念や日銀による長期金利の許容変動幅拡大などにより東証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。期の前半は米国の金融引き締めペースを巡る思惑などから不安定な相場展開となりました。後半は日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことや米国の銀行破綻等による金融システム不安などが相場の下落要因となりましたが、期末にかけては日銀による追加政策修正への警戒感や米国の利上げ観測が後退し、やや値を戻しました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.9％下落しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、リー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	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(b) その他費用	0	0.000	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は23,630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（2022年６月７日から2023年６月６日まで）

(1) 投資証券

	買		売	
	口数	金額	口数	金額
国内	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	2.446 (−)	283,598 (−)	2.216 (−)	257,405 (−)
サンケイリアルエステート投資法人	3.866 (−)	352,134 (−)	3.493 (−)	317,841 (−)
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	5.863 (−)	817,652 (−)	4.818 (−)	676,465 (−)
東海道リート投資法人	3.155 (−)	382,649 (−)	1.42 (−)	166,089 (−)
日本アコモデーションファンド投資法人	4.108 (−)	2,608,591 (−)	3.774 (−)	2,386,905 (−)
森ヒルズリート投資法人	13.988 (−)	2,164,435 (−)	12.853 (−)	1,953,913 (−)
産業ファンド投資法人	19.547 (−)	3,155,155 (−)	16.212 (−)	2,579,137 (−)
アドバンス・レジデンス投資法人	11.888 (−)	4,058,437 (−)	10.922 (−)	3,707,214 (−)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8.925 (−)	1,889,757 (−)	7.904 (−)	1,647,056 (−)
アクティビア・プロパティーズ投資法人	6.202 (−)	2,550,773 (−)	5.78 (−)	2,337,835 (−)
ＧＬＰ投資法人	43.091 (−)	6,649,002 (−)	37.508 (−)	5,829,268 (−)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5.825 (−)	1,843,548 (−)	5.135 (−)	1,642,415 (−)
日本プロロジスリート投資法人	20.572 (−)	6,454,889 (−)	17.09 (−)	5,347,590 (−)
星野リゾート・リート投資法人	2.191 (−)	1,509,542 (−)	1.894 (−)	1,279,408 (−)
Ｏｎｅリート投資法人	2.089 (−)	520,643 (−)	1.905 (−)	477,606 (−)
イオンリート投資法人	14.23 (−)	2,174,340 (−)	13.613 (−)	2,058,639 (−)
ヒューリックリート投資法人	11.164 (−)	1,806,029 (−)	10.213 (−)	1,620,993 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
日本リート投資法人	4.109 (−)	1,439,715 (−)	3.51 (−)	1,222,524 (−)
積水ハウス・リート投資法人	35.816 (−)	2,783,839 (−)	33.45 (−)	2,587,705 (−)
トーセイ・リート投資法人	2.838 (−)	382,704 (−)	2.397 (−)	316,989 (−)
ケネディクス商業リート投資法人	5.673 (−)	1,478,817 (−)	4.631 (−)	1,199,302 (−)
ヘルスケア＆メディカル投資法人	2.957 (−)	519,642 (−)	2.691 (−)	454,549 (−)
サムティ・レジデンシャル投資法人	3.604 (−)	434,109 (−)	2.767 (−)	329,919 (−)
野村不動産マスターファンド投資法人	38.457 (−)	6,248,196 (−)	35.334 (−)	5,628,241 (−)
いちごホテルリート投資法人	1.97 (−)	205,309 (−)	1.81 (−)	184,359 (−)
ラサールロジポート投資法人	14.561 (−)	2,344,829 (−)	13.379 (−)	2,163,123 (−)
スターアジア不動産投資法人	18.174 (−)	1,036,955 (−)	13.194 (−)	740,952 (−)
マリモ地方創生リート投資法人	2.233 (−)	293,864 (−)	1.46 (−)	189,773 (−)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4.717 (−)	2,314,991 (−)	4.316 (−)	2,114,375 (−)
大江戸温泉リート投資法人	1.917 (−)	127,795 (−)	1.761 (−)	114,887 (−)
投資法人みらい	14.501 (−)	684,775 (−)	13.265 (−)	622,025 (−)
森トラスト・ホテルリート投資法人	2.037 (△4.547)	270,595 (△605,985)	1.606 (−)	206,963 (−)
三菱地所物流リート投資法人	4.793 (−)	2,069,388 (−)	3.531 (−)	1,511,139 (−)
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	5.366 (−)	1,012,098 (−)	4.23 (−)	817,373 (−)
ザイマックス・リート投資法人	1.934 (−)	231,896 (−)	1.763 (−)	207,929 (−)
タカラレーベン不動産投資法人	5.999 (−)	605,375 (−)	4.193 (−)	417,993 (−)
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5.756 (−)	819,073 (−)	4.529 (−)	647,371 (−)
日本ビルファンド投資法人	13.885 (−)	8,689,760 (−)	12.745 (−)	7,856,097 (−)
ジャパンリアルエステイト投資法人	12.396 (−)	7,315,592 (−)	10.959 (−)	6,406,081 (−)
日本都市ファンド投資法人	60.003 (−)	6,249,714 (−)	55.131 (−)	5,682,475 (−)
オリックス不動産投資法人	23.695 (−)	4,374,650 (−)	21.771 (−)	3,935,320 (−)
日本プライムリアルティ投資法人	8.141 (−)	3,095,395 (−)	7.471 (−)	2,804,919 (−)
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	11.474 (−)	1,627,364 (−)	10.498 (−)	1,477,795 (−)
東急リアル・エステート投資法人	7.976 (−)	1,572,545 (−)	7.328 (−)	1,415,154 (−)
グローバル・ワン不動産投資法人	9.294 (−)	1,008,519 (−)	7.692 (−)	825,667 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ユナイテッド・アーバン投資法人	26.549 (−)	3,953,038 (−)	24.639 (−)	3,596,230 (−)
森トラストリート投資法人	12.178 (22.21648)	1,313,130 (605,985)	12.48448 (−)	1,221,207 (−)
インヴィンシブル投資法人	52.339 (−)	2,518,208 (−)	48.088 (−)	2,296,723 (−)
フロンティア不動産投資法人	4.732 (−)	2,417,417 (−)	4.015 (−)	2,027,849 (−)
平和不動産リート投資法人	8.152 (−)	1,238,187 (−)	7.07 (−)	1,069,645 (−)
日本ロジスティクスファンド投資法人	8.02 (−)	2,503,490 (−)	7.369 (−)	2,271,758 (−)
福岡リート投資法人	6.15 (−)	1,033,114 (−)	5.65 (−)	931,445 (−)
ケネディクス・オフィス投資法人	5.664 (4.946)	2,289,568 (−)	5.268 (−)	2,323,567 (−)
いちごオフィスリート投資法人	9.748 (−)	853,933 (−)	8.957 (−)	771,258 (−)
大和証券オフィス投資法人	2.427 (−)	1,593,944 (−)	2.302 (−)	1,485,390 (−)
阪急阪神リート投資法人	5.37 (−)	797,151 (−)	4.933 (−)	723,099 (−)
スターツプロシード投資法人	2.282 (−)	540,786 (−)	1.806 (−)	429,891 (−)
大和ハウスリート投資法人	18.014 (−)	5,317,512 (−)	16.455 (−)	4,839,564 (−)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	40.847 (−)	3,025,354 (−)	34.904 (−)	2,481,629 (−)
大和証券リビング投資法人	16.924 (−)	1,948,306 (−)	14.981 (−)	1,710,910 (−)
ジャパンエクセレント投資法人	10.914 (−)	1,386,912 (−)	10.028 (−)	1,261,550 (−)

(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	18,032	18,204	−	−

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2022年６月７日から2023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	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資証券	131,188	34,238	26.1	115,808	9,371	8.1
不動産投信指数先物取引	18,032	8,688	48.2	18,204	4,241	23.3
金銭信託	0.406	0.406	100.0	0.406	0.406	100.0

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	当期
	買付額
	百万円
投資証券	7,433

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	2,071千円
うち利害関係人への支払額（B）	771千円
（B）／（A）	37.3%

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

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	口数	口数	評価額	比率
不動産ファンド	千口	千口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	3.532	3.762	441,282	0.2
サンケイリアルエステート投資法人	5.556	5.929	510,486	0.3
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	8.161	9.206	1,242,810	0.6
東海道リート投資法人	1.343	3.078	368,744	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	6.057	6.391	4,224,451	2.1
森ヒルズリート投資法人	20.628	21.763	3,244,863	1.6
産業ファンド投資法人	24.904	28.239	4,408,107	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人	17.539	18.505	6,615,537	3.3
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	12.552	13.573	2,840,828	1.4
アクティビア・プロパティーズ投資法人	9.349	9.771	3,962,140	2.0
ＧＬＰ投資法人	56.814	62.397	9,247,235	4.6
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	8.16	8.85	3,022,275	1.5
日本プロロジスリート投資法人	28.7	32.182	9,944,238	5.0
星野リゾート・リート投資法人	2.94	3.237	2,184,975	1.1
Ｏｎｅリート投資法人	3.044	3.228	773,428	0.4
イオンリート投資法人	20.63	21.247	3,320,906	1.7
ヒューリックリート投資法人	16.365	17.316	2,765,365	1.4
日本リート投資法人	5.413	6.012	2,005,002	1.0
積水ハウス・リート投資法人	53.248	55.614	4,504,734	2.2
トーセイ・リート投資法人	3.665	4.106	538,296	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	7.004	8.046	2,030,005	1.0
ヘルスケア＆メディカル投資法人	4.297	4.563	746,050	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人	3.974	4.811	557,594	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人	56.727	59.85	9,839,340	4.9
いちごホテルリート投資法人	2.906	3.066	306,293	0.2
ラサールロジポート投資法人	21.475	22.657	3,715,748	1.9
スターアジア不動産投資法人	18.128	23.108	1,356,439	0.7
マリモ地方創生リート投資法人	2.054	2.827	377,969	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6.91	7.311	3,651,844	1.8
大江戸温泉リート投資法人	2.831	2.987	195,051	0.1
投資法人みらい	21.249	22.485	1,035,434	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人	4.116	－	－	－
三菱地所物流リート投資法人	5.096	6.358	2,714,866	1.4
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	6.794	7.93	1,516,216	0.8
ザイマックス・リート投資法人	2.831	3.002	332,621	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	6.918	8.724	826,162	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人	6.84	8.067	1,114,859	0.6

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
不動産ファンド		千口	千口	千円	%
日本ビルファンド投資法人		20.451	21.591	12,090,960	6.0
ジャパンリアルエステイト投資法人		17.542	18.979	10,077,849	5.0
日本都市ファンド投資法人		88.509	93.381	9,170,014	4.6
オリックス不動産投資法人		34.952	36.876	6,619,242	3.3
日本プライムリアルティ投資法人		11.987	12.657	4,436,278	2.2
ＮＴＴ都市開発リート投資法人		16.815	17.791	2,353,749	1.2
東急リアル・エステート投資法人		11.761	12.409	2,363,914	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人		12.018	13.62	1,461,426	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人		39.49	41.4	6,110,640	3.0
森トラストリート投資法人		12.537	34.447	2,431,958	1.2
インヴィンシブル投資法人		77.209	81.46	4,773,556	2.4
フロンティア不動産投資法人		6.15	6.867	3,354,529	1.7
平和不動産リート投資法人		11.958	13.04	2,023,808	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人		11.828	12.479	4,036,956	2.0
福岡リート投資法人		9.072	9.572	1,544,920	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人		5.427	10.769	3,322,236	1.7
いちごオフィスリート投資法人		14.374	15.165	1,373,949	0.7
大和証券オフィス投資法人		3.709	3.834	2,277,396	1.1
阪急阪神リート投資法人		7.923	8.36	1,220,560	0.6
スターツプロシード投資法人		2.732	3.208	743,614	0.4
大和ハウスリート投資法人		26.339	27.898	8,196,432	4.1
ジャパン・ホテル・リート投資法人		53.741	59.684	4,607,604	2.3
大和証券リビング投資法人		23.703	25.646	2,895,433	1.4
ジャパンエクセレント投資法人		16.092	16.978	2,045,849	1.0
合計	口数・金額	1,025.069	1,128.309	196,015,084	－
	銘柄数<比率>	61銘柄<97.6%>	60銘柄<97.8%>	－	97.8

(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であります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	東証REIT	4,383	－

■投資信託財産の構成

2023年6月6日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	196,015,084	97.5
コール・ローン等、その他	5,050,590	2.5
投資信託財産総額	201,065,675	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨てであります。%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

(2023年６月６日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**201,065,675,835円**
コール・ローン等	3,315,269,486
投資証券(評価額)	196,015,084,850
未収入金	365,658,895
未収配当金	1,275,504,874
差入委託証拠金	94,157,730
(B) 負債	**564,883,025**
未払金	51,945,706
未払解約金	512,937,319
(C) 純資産総額(A－B)	**200,500,792,810**
元本	84,649,761,469
次期繰越損益金	115,851,031,341
(D) 受益権総口数	**84,649,761,469口**
１万口当たり基準価額(C／D)	**23,686円**

(注１) 期首元本額 81,973,373,034円
追加設定元本額 57,914,110,381円
一部解約元本額 55,237,721,946円

(注２) 期末における元本の内訳

ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	236,896円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	1,070,098円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	2,794,505円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	3,280,530円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	2,494,276円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	2,607,089円
たわらノーロード　国内リート	5,669,747,226円
たわらノーロード　国内リート<ラップ向け>	1,107,613,678円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,409,625,816円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	41,133,949円
たわらノーロード　バランス（標準型）	801,212,486円
たわらノーロード　バランス（積極型）	889,719,642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）	230,708,597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）	557,228,467円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	373,374,712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）	424,568,977円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,576,131円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	46,569,948円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,007,008円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,774,791円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	12,819,640円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	473,699,700円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,270,803円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国10）	143,513,616円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国20）	211,185,463円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国30）	394,778,673円
投資のソムリエ	8,362,909,666円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>	666,581,590円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ<ＤＣ年金>	162,621,843円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>リスク抑制型	649,975,211円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,538,132,409円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	42,151,167円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	20,782,609円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,700,816円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	125,275,722円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	121,839,567円
９資産分散投資・スタンダード<ＤＣ年金>	120,874,973円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	49,724,250円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	22,871,627円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	14,066,729円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	3,323,065円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	43,418,572円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	67,255,589円
ＤＩＡＭＪ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド201401（適格機関投資家限定）	694,470,884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）	309,507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）	159,755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）	30,130,099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）	130,110円
固定比率マルチアセット戦略ファンド（米ドル建日本政府保証債活用型）（適格機関投資家限定）	188,600,781円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	79,681,678円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）21－03（適格機関投資家限定）	66,237,972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）	387,982円
インカム重視マルチアセット運用ファンドＩＩ2021－04（適格機関投資家限定）	465,704円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021－05（適格機関投資家限定）	33,968,236円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021－07（適格機関投資家限定）	58,420,541円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021－08（適格機関投資家限定）	41,811,325円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021－09（適格機関投資家限定）	79,204,348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）	198,008円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021－09（適格機関投資家限定）	41,563,452円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021－12（適格機関投資家限定）	59,063,740円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（旧米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022－10（適格機関投資家限定）	3,724,997円
ＤＩＡＭＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,470,360,133円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	226,204,320円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	81,931,359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）（適格機関投資家限定）	435,975,434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）	394,647円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	3,419,398円
日米資産配分戦略ファンド（ＴＩＰＳ活用型）（為替ヘッジ比率調整型）（適格機関投資家限定）	136,151,078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）	1,084,557,096円
ＭＨＡＭＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド<ＤＣ年金>	7,772,942,184円
ＭＨＡＭＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	36,562,726,908円
ＭＨＡＭＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,663,434,070円
ＭＨＡＭＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ファンドラップ）	3,992,981,440円
期末元本合計	84,649,761,469円

■損益の状況

当期　自2022年６月７日　至2023年６月６日

項目	当期
(A) 配当等収益	**7,616,435,397円**
受取配当金	7,618,410,769
受取利息	60,047
その他収益金	1,037
支払利息	△2,036,456
(B) 有価証券売買損益	**△14,437,084,878**
売買益	3,000,792,575
売買損	△17,437,877,453
(C) 先物取引等取引損益	**△138,373,770**
取引益	263,426,640
取引損	△401,800,410
(D) その他費用	**△1**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**△6,959,023,252**
(F) 前期繰越損益金	**117,948,373,616**
(G) 解約差損益金	**△74,084,393,742**
(H) 追加信託差損益金	**78,946,074,719**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**115,851,031,341**
次期繰越損益金(I)	**115,851,031,341**

(注１) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注２) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
(注３) (H)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日　2023年６月22日）

（対象期間　2022年６月23日～2023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	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）		投資信託受益証券、投資証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率		
	円	%	ポイント	%	%	百万円
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
16期(2023年６月22日)	17,096	2.5	177,832.19	2.9	99.4	81,199

（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（「ＳＰＤＪＩ」）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、ＳＰＤＪＩ、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）。

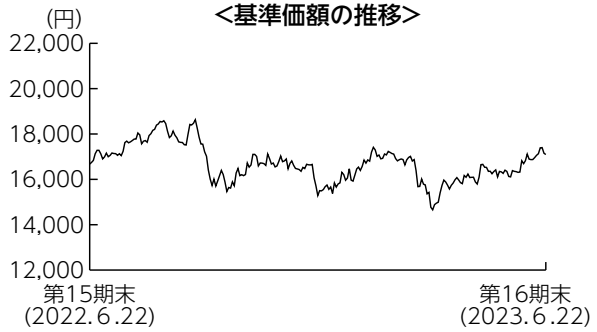
■当期中の基準価額と市況の推移

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）		投資信託受益証券、投資証券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率	
(期首)	円	%	ポイント	%	%
2022年6月22日	16,673	－	172,787.99	－	99.3
6月末	17,127	2.7	177,552.22	2.8	102.6
7月末	18,045	8.2	187,036.58	8.2	99.6
8月末	17,654	5.9	183,143.17	6.0	99.4
9月末	15,704	△5.8	162,709.12	△5.8	99.2
10月末	17,102	2.6	177,452.85	2.7	100.8
11月末	16,704	0.2	173,502.90	0.4	99.7
12月末	15,662	△6.1	162,761.28	△5.8	99.2
2023年1月末	16,716	0.3	173,922.95	0.7	99.6
2月末	16,899	1.4	175,688.04	1.7	99.6
3月末	15,731	△5.6	163,587.88	△5.3	99.2
4月末	16,096	△3.5	167,414.44	△3.1	99.6
5月末	16,341	△2.0	170,042.31	△1.6	99.7
(期末)					
2023年6月22日	17,096	2.5	177,832.19	2.9	99.4

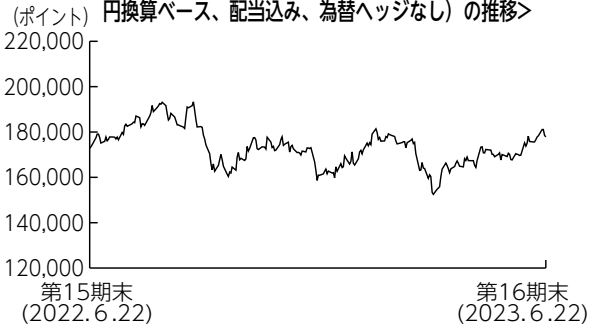
（注）騰落率は期首比です。

■**当期の運用経過**（2022年６月23日から2023年６月22日まで）

<基準価額の推移>



<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）の推移>



基準価額の推移

当期末の基準価額は17,096円となり、前期末比で2.5％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が続くことへの警戒感などから欧州リート市場が軒並み下落しマイナスの影響となったものの、利上げサイクルが終盤に近付いていると見られる米国リート市場やオーストラリアリート市場は上昇しプラスの寄与となりました。為替市場で日銀が金融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もプラスの寄与となり、基準価額は上昇しました。

投資環境

米国リート市場は小幅に上昇しました。期前半はインフレ指標を受け大きく変動しましたが、2022年10月以降はインフレ鈍化を好感して反発しました。その後は米地銀破綻に端を発した金融システム不安から下落し、期末にかけては持ち直しました。欧州リート市場はＥＣＢ（欧州中央銀行）が大幅利上げを行ったことや、英国の経済対策への懸念に伴う金利急騰などを背景に下落しました。オーストラリアリート市場は利上げサイクルの終了が近いとの見方から上昇しました。

為替市場では日銀の金融緩和解除に対する思惑が広がったものの、各国との金融政策の方向性の違いから多くの通貨に対して円安となりました。米ドルはＦＲＢ（米連邦準備理事会）の金融引き締めを受け米ドル高が進みましたが、インフレの鈍化から長期金利が低下すると米ドル安基調となりました。年明け以降はＦＲＢのタカ派姿勢を受けて再び米ドル高が進み、期を通じては米ドル高円安となりました。ユーロはＥＣＢのタカ派姿勢からユーロ高円安が進みました。

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2.9％上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.4％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	3円	0.019%	(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
(投資信託受益証券)	(1)	(0.003)	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)	(3)	(0.015)	
(b) 有価証券取引税	7	0.044	(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
(投資信託受益証券)	(1)	(0.003)	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
(投資証券)	(7)	(0.041)	
(c) その他費用	9	0.057	(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)	(9)	(0.053)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(その他)	(1)	(0.004)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	20	0.120	
期中の平均基準価額は16,690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（2022年６月23日から2023年６月22日まで）

投資信託受益証券、投資証券

	買		売	
	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	72.842	10,247	47.748	6,445
	(−)	(−)	(−)	(−)
ALEXANDER'S INC.	0.624	139	0.264	54
	(−)	(−)	(−)	(−)
BOSTON PROPERTIES INC	63.931	4,438	44.28	2,798
	(−)	(−)	(−)	(−)
CEDAR REALTY TRUST INC	1.301	37	5.082	48
	(−)	(−)	(−)	(−)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	102.766	2,940	70.287	2,033
	(−)	(−)	(−)	(−)
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	51.797	379	36.542	285
	(−)	(−)	(−)	(−)
AGREE REALTY CORP	44.258	3,103	25.648	1,784
	(−)	(−)	(−)	(−)
BRT APARTMENTS CORP	4.203	84	2.264	44
	(−)	(−)	(−)	(−)
SL GREEN	23.666	851	15.316	485
	(−)	(−)	(−)	(−)
EPR PROPERTIES	31.674	1,304	20.836	836
	(−)	(−)	(−)	(−)
PROLOGIS INC	400.494	47,797	268.34	31,801
	(54.791)	(−)	(−)	(−)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	64.999	11,537	44.2	7,890
	(−)	(−)	(−)	(−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
LXP INDUSTRIAL TRUST	124.7 (−)	1,290 (−)	80.461 (−)	801 (−)
CAMDEN PROPERTY TRUST	48.34 (−)	5,629 (−)	33.306 (−)	3,804 (−)
VERIS RESIDENTIAL INC	29.001 (−)	442 (−)	20.686 (−)	297 (−)
EQUINIX INC	41.915 (−)	27,961 (−)	27.945 (−)	18,739 (−)
NNN REIT INC	78.81 (−)	3,474 (−)	50.82 (−)	2,205 (−)
CTO REALTY GROUTH INC	6.122 (3.716)	115 (−)	2.34 (−)	47 (−)
COUSINS PROPERTIES INC	65.41 (−)	1,625 (−)	43.182 (−)	989 (−)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12.216 (−)	214 (−)	7.882 (−)	131 (−)
SITE CENTERS CORP	73.922 (−)	957 (−)	47.074 (−)	581 (−)
SAFEHOLD INC	55.173 (△19.409)	674 (△112)	17.982 (−)	164 (−)
DUKE REALTY TRUST	34.61 (△115.35)	1,968 (−)	38.193 (−)	2,076 (−)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	− (−)	− (−)	3.185 (−)	29 (−)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	29.746 (−)	6,859 (−)	21.108 (−)	4,823 (−)
EQUITY RESIDENTIAL	156.299 (−)	10,070 (−)	108.88 (−)	6,976 (−)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	35.705 (−)	3,589 (−)	24.358 (−)	2,354 (−)
FIRST INDUSTRIAL RT	59.533 (−)	3,002 (−)	40.803 (−)	2,066 (−)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	244.285 (−)	5,866 (−)	166.041 (−)	3,815 (−)
EQUITY COMMONWEALTH	45.749 (−)	1,106 (−)	31.471 (−)	722 (−)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11.251 (△56.675)	309 (−)	− (−)	− (−)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	49.569 (−)	1,361 (−)	33.628 (−)	844 (−)
SERVICE PROPERTIES TRUST	59.525 (−)	518 (−)	37.697 (−)	312 (−)
WELLTOWER INC	226.642 (−)	16,445 (−)	143.012 (−)	10,271 (−)
EAST GROUP	20.618 (−)	3,302 (−)	13.156 (−)	2,105 (−)
KIMCO REALTY	273.196 (−)	5,567 (−)	187.177 (−)	3,644 (−)
KILROY REALTY CORP	46.442 (−)	1,875 (−)	31.673 (−)	1,166 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
LTC PROPERTIES INC	15.961 (−)	584 (−)	9.01 (−)	332 (−)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57.263 (−)	53 (−)	36.971 (−)	59 (−)
BRANDYWINE REALTY TRUST	65.34 (−)	430 (−)	36.173 (−)	216 (−)
IRON MOUNTAIN INC	139.638 (−)	7,171 (−)	97.875 (−)	4,971 (−)
THE MACERICH COMPANY	92.234 (−)	986 (−)	61.366 (−)	611 (−)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	77.159 (−)	5,190 (−)	52.414 (−)	3,491 (−)
ACADIA REALTY TRUST	34.535 (−)	507 (−)	17.036 (−)	235 (−)
HOST HOTELS & RESORTS INC	310.15 (−)	5,243 (−)	212.64 (−)	3,491 (−)
MID AMERICA	52.713 (−)	8,400 (−)	36.012 (−)	5,622 (−)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.425 (−)	90 (−)	5.022 (−)	40 (−)
NATIONAL HEALTH INVS INC	18.158 (−)	1,010 (−)	12.793 (−)	706 (−)
CENTERSPACE	5.745 (−)	373 (−)	4.164 (−)	261 (−)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5.41 (−)	122 (−)	2.887 (−)	64 (−)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	− (−)	− (−)	1.938 (−)	7 (−)
GETTY REALTY CORP	19.02 (−)	622 (−)	12.038 (−)	403 (−)
PS BUSINESS PARKS	1.353 (−)	253 (−)	7.546 (−)	1,375 (−)
RPT REALTY	32.419 (−)	321 (−)	16.968 (−)	152 (−)
REALTY INCOME CORP	304.999 (−)	19,566 (−)	187.637 (−)	11,896 (−)
REGENCY CENTERS CORP	68.99 (−)	4,227 (−)	47.956 (−)	2,842 (−)
UDR INC	136.309 (−)	5,749 (−)	90.309 (−)	3,756 (−)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	47.5 (−)	1,204 (−)	31.57 (−)	774 (−)
SAUL CENTERS INC	4.099 (−)	175 (−)	3.246 (−)	126 (−)
SIMON PROPERTY GROUP INC	148.93 (−)	16,599 (−)	103.043 (−)	10,919 (−)
LIFE STORAGE INC	37.442 (−)	4,429 (−)	25.406 (−)	3,055 (−)
PUBLIC STORAGE	72.478 (−)	21,903 (−)	48.383 (−)	14,330 (−)

	買	付	売	付
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
SUN COMMUNITIES INC	57.042 (−)	8,238 (−)	38.506 (−)	5,446 (−)
TANGER FACTORY OUTLET	44.377 (−)	783 (−)	29.5 (−)	507 (−)
UMH PROPERTIES INC	25.296 (−)	415 (−)	12.756 (−)	198 (−)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13.936 (−)	225 (−)	8.241 (−)	109 (−)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5.398 (−)	275 (−)	3.028 (−)	138 (−)
VENTAS INC	184.117 (−)	8,456 (−)	127.952 (−)	5,784 (−)
VORNADO REALTY TRUST	70.609 (−)	1,550 (−)	47.773 (−)	950 (−)
ELME COMMUNITIES	35.978 (−)	682 (−)	21.081 (−)	385 (−)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	11.032 (−)	714 (−)	54.098 (−)	3,541 (−)
KITE REALTY GROUP TRUST	97.304 (−)	1,972 (−)	64.964 (−)	1,284 (−)
EXTRA SPACE STORAGE INC	61.89 (−)	10,151 (−)	42.661 (−)	7,030 (−)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	20.374 (−)	48 (−)	− (−)	− (−)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	80.037 (−)	820 (−)	53.08 (−)	530 (−)
CUBESMART	99.36 (−)	4,394 (−)	68.127 (−)	3,024 (−)
DIGITAL REALTY TRUST INC	132.225 (−)	14,163 (−)	88.89 (−)	9,413 (−)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	84.648 (−)	725 (−)	57.491 (−)	471 (−)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	265.438 (−)	3,028 (−)	183.617 (−)	1,932 (−)
DOUGLAS EMMETT INC	84.385 (−)	1,351 (−)	62.359 (−)	929 (−)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	51.408 (−)	755 (−)	32.857 (−)	465 (−)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	42.678 (−)	431 (−)	22.065 (−)	203 (−)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	43.526 (−)	323 (−)	24.375 (−)	171 (−)
TERRENO REALTY CORP	32.065 (−)	1,944 (−)	22.438 (−)	1,353 (−)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	21.165 (−)	546 (−)	14.359 (−)	321 (−)
RLJ LODGING TRUST	65.667 (−)	736 (−)	45.748 (−)	494 (−)
AMERICOLD REALTY TRUST	120 (−)	3,404 (−)	81.325 (−)	2,315 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	50.231 (−)	767 (−)	35.352 (−)	523 (−)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	18.849 (−)	284 (−)	11.357 (−)	157 (−)
CHATHAM LODGING TRUST	9.39 (−)	115 (−)	3.736 (−)	36 (−)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	98.795 (−)	1,266 (−)	65.472 (−)	811 (−)
WHITESTONE REIT	8.935 (−)	85 (−)	5.719 (−)	48 (−)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	47.682 (−)	491 (−)	33.367 (−)	342 (−)
STAG INDUSTRIAL INC	81.108 (−)	2,657 (−)	55.526 (−)	1,783 (−)
WP CAREY INC	99.36 (−)	7,882 (−)	62.628 (−)	4,890 (−)
ALEXANDER & BALDWIN INC	29.287 (−)	551 (−)	17.433 (−)	316 (−)
GLADSTONE LAND CORP	15.157 (−)	286 (−)	8.777 (−)	148 (−)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	161.973 (56.675)	3,387 (−)	119.299 (−)	2,452 (−)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24.236 (−)	2,100 (−)	16.11 (−)	1,376 (−)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	27.571 (−)	338 (−)	18.027 (−)	211 (−)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	65.011 (−)	2,599 (−)	42.843 (−)	1,698 (−)
PHYSICIANS REALTY TRUST	105.527 (−)	1,617 (−)	66.519 (−)	1,007 (−)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	91.388 (−)	5,257 (−)	52.165 (−)	3,019 (−)
AMERICAN HOMES 4 RENT	140.037 (−)	4,581 (−)	90.657 (−)	2,927 (−)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	96.164 (−)	1,713 (−)	63.082 (−)	1,090 (−)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	12.725 (−)	1,165 (−)	8.239 (−)	700 (−)
JBG SMITH PROPERTIES	36.942 (−)	720 (−)	26.894 (−)	492 (−)
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	52.881 (−)	359 (−)	25.969 (−)	163 (−)
INVITATION HOMES INC	271.124 (−)	8,879 (−)	198.6 (−)	6,606 (−)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	389 (−)	195 (△6)	224.6 (−)	111 (−)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	43.312 (−)	309 (−)	28.056 (−)	185 (−)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	14.515 (−)	289 (−)	10.977 (−)	220 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
SAFEHOLD INC	6.458 (△7.428)	197 (−)	4.015 (−)	115 (−)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	64.005 (−)	1,512 (−)	37.703 (−)	884 (−)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	12.441 (−)	94 (−)	7.363 (−)	43 (−)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	121.811 (−)	6,131 (−)	76.249 (−)	3,779 (−)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	132.258 (−)	2,856 (−)	88.148 (−)	1,844 (−)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	12.663 (−)	59 (−)	10.153 (−)	40 (−)
PRIME US REIT	217.8 (−)	112 (△5)	60 (−)	32 (−)
POSTAL REALTY TRUST INC	1.889 (−)	29 (−)	− (−)	− (−)
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	6.172 (−)	106 (−)	2.105 (−)	33 (−)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	28.479 (−)	690 (−)	19.868 (−)	455 (−)
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	− (−)	− (−)	4.068 (−)	27 (−)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	2.56 (△9.507)	66 (△247)	1.39 (−)	37 (−)
FARMLAND PARTNERS INC	22.818 (−)	288 (−)	9.008 (−)	96 (−)
CITY OFFICE REIT INC	14.622 (−)	127 (−)	12.785 (−)	100 (−)
ORION OFFICE REIT INC	28.876 (−)	241 (−)	17.489 (−)	128 (−)
NETSTREIT CORP	25.528 (−)	485 (−)	12.169 (−)	227 (−)
CARETRUST REIT INC	41.764 (−)	794 (−)	27.189 (−)	521 (−)
INDUS REALTY TRUST INC	1.891 (−)	120 (−)	2.1 (−)	136 (−)
PHILLIPS EDISON & CO INC	49.566 (−)	1,612 (−)	31.798 (−)	998 (−)
BLUEROCK HOMES TRUST INC	− (1.188)	− (16)	− (−)	− (−)
APARTMENT INCOME REIT CORP	68.664 (−)	2,600 (−)	49.503 (−)	1,856 (−)
BROADSTONE NET LEASE INC	83.494 (−)	1,486 (−)	51.751 (−)	897 (−)
STAR HOLDINGS	− (5.322)	− (112)	− (−)	− (−)
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	10.61 (−)	268 (−)	6.315 (−)	162 (−)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	89.7 (−)	61 (△2)	49.3 (−)	34 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
STORE CAPITAL CORP	62.982 (−)	1,904 (−)	140.748 (−)	4,486 (−)
PARAMOUNT GROUP INC	64.095 (−)	370 (−)	40.652 (−)	225 (−)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26.797 (−)	267 (−)	18.197 (−)	161 (−)
URBAN EDGE PROPERTIES	50.559 (−)	753 (−)	32.044 (−)	463 (−)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	31.428 (−)	499 (−)	18.136 (−)	273 (−)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	41.788 (−)	604 (−)	27.269 (−)	382 (−)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8.434 (−)	423 (−)	5.313 (−)	242 (−)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	35.545 (−)	1,534 (−)	24.383 (−)	1,022 (−)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9.548 (−)	350 (−)	6.217 (−)	218 (−)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	91.151 (−)	1,455 (−)	60.79 (−)	926 (−)
GLOBAL NET LEASE INC	35.909 (−)	486 (−)	18.858 (−)	242 (−)
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	14.638 (−)	179 (−)	− (−)	− (−)
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	842.4 (−)	290 (△2)	529.7 (−)	175 (−)
PARK HOTELS & RESORTS INC	94.933 (−)	1,248 (−)	71.108 (−)	907 (−)
VICI PROPERTIES INC	462.717 (−)	14,884 (−)	307.756 (−)	9,914 (−)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	39.174 (−)	1,041 (−)	23.16 (−)	618 (−)
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	32.342 (−)	877 (−)	22.51 (−)	599 (−)
CANADIAN APT PPTYS REIT	42.562 (−)	1,959 (−)	31.627 (−)	1,453 (−)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	51.894 (−)	642 (−)	36.568 (−)	442 (−)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	48.237 (−)	777 (−)	33.91 (−)	533 (−)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	69.863 (−)	1,443 (−)	50.288 (−)	1,011 (−)
ALLIED PROPERTIES REIT	27.336 (−)	776 (−)	17.809 (−)	483 (−)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	10.822 (−)	166 (−)	10.502 (−)	158 (−)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7.441 (−)	391 (−)	5.249 (−)	284 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.677 (−)	167 (−)	10.602 (−)	91 (−)
CROMBIE REAL ESTATE INV	22.644 (−)	350 (−)	14.744 (−)	221 (−)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	29.499 (−)	388 (−)	19.784 (−)	253 (−)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	54.186 (−)	541 (−)	31.563 (−)	313 (−)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2.247 (−)	40 (−)	− (−)	− (−)
DREAM INDUSTRIAL REIT	57.905 (−)	759 (−)	37.374 (−)	489 (−)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	24.603 (−)	465 (−)	52.136 (−)	521 (−)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14.218 (−)	1,121 (−)	10.069 (−)	802 (−)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10.425 (−)	64 (−)	5.794 (−)	32 (−)
CHOICE PROPERTIES REIT	78.323 (−)	1,106 (−)	55.181 (−)	772 (−)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11.878 (−)	172 (−)	7.797 (−)	109 (−)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23.52 (−)	374 (−)	15.579 (−)	242 (−)
PLAZA RETAIL REIT	− (−)	− (−)	16.376 (−)	65 (−)
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.76 (−)	27 (−)	− (−)	− (−)
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.769 (−)	102 (−)	− (−)	− (−)
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13.322 (−)	276 (−)	5.218 (−)	101 (−)
SLATE GROCERY REIT	15.919 (−)	226 (−)	11.822 (−)	161 (−)
NEXUS INDUSTRIAL REIT	17.694 (−)	173 (−)	10.697 (−)	97 (−)
PRIMARIS REIT	18.413 (−)	256 (−)	10.359 (−)	137 (−)
SLATE OFFICE REIT	8.835 (−)	41 (−)	6.752 (−)	29 (−)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3.521 (−)	41 (−)	2.665 (−)	34 (−)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21.082 (−)	361 (−)	14.043 (−)	238 (−)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	197.973 (−)	776 (−)	133.395 (−)	513 (−)
MIRVAC GROUP	1,853.463 (−)	3,976 (−)	1,294.797 (−)	2,746 (−)

	買	付	売	付
	口数	金額	口数	金額
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
CROMWELL PROPERTY GROUP	529.883 (−)	353 (−)	364.294 (−)	233 (−)
CHARTER HALL RETAIL REIT	221.455 (−)	867 (−)	149.106 (−)	572 (−)
GPT GROUP	860.435 (−)	3,779 (−)	598.664 (−)	2,541 (−)
CENTURIA CAPITAL GROUP	255.065 (−)	452 (−)	142.322 (−)	245 (−)
ABACUS PROPERTY GROUP	161.194 (−)	433 (−)	92.044 (−)	241 (−)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	120.864 (−)	394 (−)	58.558 (−)	180 (−)
STOCKLAND	1,111.398 (−)	4,244 (−)	776.907 (−)	2,914 (−)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	147.838 (−)	606 (−)	95.082 (−)	372 (−)
DEXUS	486.473 (−)	4,002 (−)	339.622 (−)	2,713 (−)
GOODMAN GROUP	793.35 (−)	14,901 (−)	547.239 (−)	10,238 (−)
VICINITY CENTRES	1,719.112 (−)	3,382 (−)	1,153.673 (−)	2,222 (−)
CHARTER HALL GROUP	196.126 (−)	2,421 (−)	128.874 (−)	1,545 (−)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	121.253 (−)	390 (−)	92.022 (−)	288 (−)
REGION RE LTD	526.897 (−)	1,374 (−)	352.981 (−)	872 (−)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	211.007 (−)	655 (−)	133.287 (−)	402 (−)
ARENA REIT	134.203 (−)	526 (−)	72.751 (−)	280 (−)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	310.383 (−)	1,360 (−)	197.223 (−)	849 (−)
DEXUS INDUSTRIA REIT	71.755 (−)	207 (−)	44.504 (−)	122 (−)
NATIONAL STORAGE REIT	542.744 (−)	1,322 (−)	333.186 (−)	813 (−)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	62.468 (−)	209 (−)	42.272 (−)	138 (−)
GDI PROPERTY GROUP	180.531 (−)	140 (−)	137.075 (−)	100 (−)
RURAL FUNDS GROUP	138.817 (−)	318 (−)	91.137 (−)	196 (−)
IRONGATE GROUP	32.043 (−)	60 (−)	213.237 (−)	405 (−)
SCENTRE GROUP	2,407.532 (−)	6,824 (−)	1,674.489 (−)	4,670 (−)
HMC CAPITAL LTD	98.428 (−)	441 (−)	43.001 (−)	175 (−)

	買	付	売	付
	口数	金額	口数	金額
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
HOMECO DAILY NEEDS REIT	615.8 (−)	776 (−)	345.471 (−)	422 (−)
HEALTHCO REIT	130.128 (−)	184 (−)	18.996 (−)	33 (−)
CENTURIA OFFICE REIT	185.682 (−)	290 (−)	102.641 (−)	149 (−)
WAYPOINT REIT LTD	281.739 (−)	741 (−)	194.093 (−)	492 (−)
香港	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
LINK REIT DUMMY	156.3 (−)	8,084 (−)	− (−)	− (−)
LINK REIT	1,035.3 (−)	56,476 (13)	694.9 (−)	36,819 (−)
PROSPERITY REIT	527 (−)	1,131 (−)	342 (−)	666 (−)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,068 (−)	2,420 (−)	765 (−)	1,519 (−)
CHAMPION REIT	611 (−)	2,011 (−)	347 (−)	1,144 (−)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338 (−)	1,111 (−)	235 (−)	761 (−)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	629 (−)	3,979 (−)	387 (−)	2,469 (−)
LINK REIT-RTS	− (225.244)	− (△13)	225.244 (−)	900 (−)
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,344.8 (−)	4,700 (△2)	1,672.1 (−)	3,283 (−)
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,543.1 (−)	4,297 (△50)	1,075.5 (−)	2,989 (−)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	980.7 (−)	1,428 (△7)	643.9 (−)	945 (−)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,486.3 (−)	2,469 (△51)	1,003.1 (−)	1,660 (−)
STARHILL GLOBAL REIT	531.2 (−)	292 (−)	328.7 (−)	174 (−)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	908.2 (−)	935 (△15)	500.5 (−)	509 (−)
KEPPEL REIT	838.6 (−)	799 (−)	546.8 (−)	510 (−)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	478 (−)	1,058 (−)	323.9 (−)	720 (−)
ESR LOGOS REIT	2,856.3 (−)	1,013 (△7)	1,512.7 (−)	522 (−)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	346.6 (−)	419 (△1)	229.2 (−)	274 (−)
CAPITALAND CHINA TRUST	456.5 (−)	513 (△23)	246.2 (−)	265 (−)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	544.5 (−)	143 (△6)	334.1 (−)	87 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	151.3 (−)	201 (△7)	86.5 (−)	116 (−)
PARKWAY LIFE REIT	166.2 (−)	693 (△5)	110.4 (−)	448 (−)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	907.6 (−)	2,161 (△0.82883)	592.6 (−)	1,405 (−)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,014.3 (−)	1,776 (△6)	648.6 (−)	1,135 (−)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	− (−)	− (△0.67549)	124.4 (−)	148 (−)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	451.3 (−)	278 (−)	273.7 (−)	164 (−)
PARAGON REIT	481.5 (−)	447 (−)	300.7 (−)	279 (−)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	149.5 (−)	112 (−)	84.1 (−)	61 (−)
OUE COMMERCIAL REIT	930.2 (−)	320 (△2)	679 (−)	227 (−)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	763.4 (−)	547 (−)	489.2 (−)	358 (−)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	319.9 (−)	197 (△9)	197.1 (−)	115 (−)
IREIT GLOBAL	− (−)	− (△2)	168.6 (−)	85 (−)
KEPPEL DC REIT	584.4 (−)	1,133 (△12)	393.5 (−)	771 (−)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,328.8 (−)	1,677 (△20)	918.7 (−)	1,178 (−)
ニュージーランド	千口	千ニュージーランド・ドル	千口	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	509.611 (−)	653 (−)	290.797 (−)	368 (−)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	222.906 (−)	551 (−)	155.612 (−)	378 (−)
GOODMAN PROPERTY TRUST	516.012 (−)	1,075 (−)	357.07 (−)	742 (−)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	721.983 (−)	671 (−)	478.656 (−)	436 (−)
ARGOSY PROPERTY LTD	275.903 (−)	319 (−)	189.331 (−)	218 (−)
STRIDE STAPLED GROUP	370.694 (−)	604 (−)	137.344 (−)	194 (−)
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	434.208 (−)	1,815 (−)	305.397 (−)	1,197 (−)
DERWENT LONDON PLC	52.718 (−)	1,297 (−)	37.483 (−)	873 (−)
BIG YELLOW GROUP PLC	75.861 (−)	922 (−)	50.084 (−)	583 (−)
HAMMERSON PLC	1,508.537 (−)	373 (−)	706.246 (−)	164 (−)

	買	付	売	付
	口数	金額	口数	金額
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
LAND SECURITIES GROUP PLC	366.408 (−)	2,381 (−)	257.226 (−)	1,562 (−)
WORKSPACE GROUP PLC	53.606 (−)	271 (−)	34.927 (−)	163 (−)
UNITE GROUP PLC	187.678 (−)	1,831 (−)	132.727 (−)	1,245 (−)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	554.181 (−)	643 (−)	361.233 (−)	411 (−)
SHAFTESBURY PLC	78.702 (△131.131)	337 (−)	35.621 (−)	141 (−)
SEGRO PLC	570.257 (−)	4,819 (−)	390.076 (−)	3,137 (−)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	104.225 (−)	571 (−)	67.641 (−)	344 (−)
ASSURA PLC	1,245.215 (−)	695 (−)	829.528 (−)	441 (−)
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	167.963 (−)	108 (−)	99.031 (−)	56 (−)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	173.703 (−)	84 (−)	78.272 (−)	33 (−)
HELICAL PLC	48.089 (−)	132 (−)	− (−)	− (−)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	216.96 (−)	173 (−)	148.03 (−)	117 (−)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	352.394 (−)	212 (−)	212.48 (−)	119 (−)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	97.634 (−)	973 (−)	65.858 (−)	626 (−)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	451.633 (−)	887 (−)	310.201 (−)	579 (−)
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	307.731 (−)	287 (−)	195.694 (−)	173 (−)
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	615.951 (440.075)	748 (−)	440.359 (−)	520 (−)
WAREHOUSE REIT PLC	287.7 (−)	370 (−)	103.341 (−)	108 (−)
NEWRIVER REIT PLC	120.548 (−)	99 (−)	85.737 (−)	68 (−)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	274.289 (−)	177 (−)	163.453 (−)	100 (−)
PRS REIT PLC/THE	196.87 (−)	179 (−)	128.075 (−)	113 (−)
CLS HOLDINGS PLC	83.611 (−)	125 (−)	− (−)	− (−)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	89.136 (−)	70 (−)	41.253 (−)	31 (−)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	508.013 (−)	518 (−)	336.62 (−)	324 (−)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	819.933 (−)	1,267 (−)	551.355 (−)	789 (−)

	買	付	売	付
	口数	金額	口数	金額
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
CUSTODIAN REIT PLC	193.557 (−)	180 (−)	132.181 (−)	119 (−)
HOME REIT PLC	174.692 (−)	185 (−)	74.149 (−)	71 (−)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	240.146 (−)	209 (−)	150.055 (−)	130 (−)
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	165.764 (−)	116 (−)	61.787 (−)	37 (−)
AEW UK REIT PLC	89.174 (−)	87 (−)	68.854 (−)	64 (−)
LXI REIT PLC	1,111.121 (−)	1,377 (−)	620.948 (−)	719 (−)
REGIONAL REIT LTD	167.475 (−)	101 (−)	137.217 (−)	79 (−)
URBAN LOGISTICS REIT PLC	330.767 (−)	504 (−)	109.087 (−)	143 (−)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	119.991 (−)	120 (−)	70.745 (−)	67 (−)
イスラエル	千口	千イスラエル・シュケル	千口	千イスラエル・シュケル
REIT 1 LTD	69.118 (−)	1,166 (−)	43.431 (−)	746 (−)
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	80.834 (−)	689 (−)	52.096 (−)	426 (−)
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314.331 (−)	606 (−)	− (−)	− (−)
韓国	千口	千韓国・ウォン	千口	千韓国・ウォン
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	34.658 (−)	146,210 (−)	24.14 (−)	102,277 (−)
KOREA ASSET IN TRUST CO LTD	20.195 (−)	69,188 (−)	20.195 (−)	65,850 (−)
E KOCREF CR-REIT CO LTD	17.156 (−)	94,585 (−)	6.021 (−)	33,257 (−)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	15.023 (−)	104,263 (−)	4.736 (−)	37,583 (−)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	14.759 (−)	70,762 (−)	7.437 (−)	33,005 (−)
LOTTE REIT CO LTD	59.659 (−)	244,534 (−)	43.308 (−)	178,793 (−)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	28.054 (−)	146,125 (−)	18.676 (−)	92,921 (−)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	5.728 (−)	29,587 (−)	− (−)	− (−)
JR REIT XXVII	60.111 (−)	268,849 (19)	38.919 (−)	171,125 (−)
SK REITS CO LTD	33.006 (−)	168,861 (△768)	18.906 (−)	94,584 (−)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	− (5.465)	− (−)	5.465 (−)	1,066 (−)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	70.841 (−)	295,417 (△2,206)	40.489 (−)	169,257 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
韓国	千口	千韓国・ウォン	千口	千韓国・ウォン
D&D PLATFORM REIT CO LTD	24.986 (−)	98,366 (△417)	13.214 (−)	52,217 (−)
SK REITS CO LTD-RTS	− (4.739)	− (△3)	4.739 (−)	222 (−)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	17.936 (−)	70,562 (△542)	8.211 (−)	34,740 (−)
JR GLOBAL REIT-RTS	− (10.483)	− (△19)	10.483 (−)	− (−)
ユーロ（シンガポール）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	152.8 (−)	266 (△1)	91.5 (−)	159 (−)
ユーロ（アイルランド）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	176.964 (−)	204 (−)	104.581 (−)	114 (−)
ユーロ（オランダ）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
VASTNED RETAIL	7.516 (−)	163 (−)	4.729 (−)	95 (−)
WERELDHAVE NV	15.224 (−)	207 (−)	10.227 (−)	131 (−)
NSI NV	8.003 (−)	194 (−)	5.165 (−)	115 (−)
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18.992 (−)	424 (−)	11.788 (−)	259 (−)
ユーロ（ベルギー）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
BEFIMMO	1.948 (−)	92 (−)	9.279 (−)	438 (−)
COFINIMMO SA	12.196 (−)	1,096 (−)	7.486 (−)	650 (−)
RETAIL ESTATES	3.74 (−)	243 (−)	1.986 (−)	122 (−)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9.762 (−)	206 (−)	4.114 (−)	85 (−)
WAREHOUSES DE PAUW	74.256 (−)	2,085 (−)	48.101 (−)	1,309 (−)
MONTEA SCA	6.113 (−)	482 (−)	3.163 (−)	247 (−)
AEDIFICA	19.056 (−)	1,553 (−)	12.573 (−)	982 (−)
CARE PROPERTY INVEST NV	17.34 (−)	265 (−)	10.177 (−)	154 (−)
CARE PROPERTY INVEST NV-RTS	− (10.525)	− (−)	10.525 (−)	6 (−)
XIOR STUDENT HOUSING NV	9.298 (−)	287 (−)	6.001 (−)	189 (−)
ユーロ（フランス）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
GECINA SA	24.441 (−)	2,397 (−)	16.79 (−)	1,571 (−)
ICADE	13.296 (−)	585 (△11)	8.653 (−)	380 (−)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
ユーロ（フランス）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
ALTAREA	1.833 (−)	234 (−)	0.998 (−)	121 (−)
KLEPIERRE	87.765 (−)	1,895 (−)	61.026 (−)	1,303 (−)
COVIVIO	19.493 (−)	1,111 (−)	13.199 (−)	721 (−)
MERCIALYS	34.454 (−)	319 (−)	16.738 (−)	148 (−)
CARMILA SA	25.9 (−)	367 (△30)	12.842 (−)	177 (−)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.751 (49.493)	82 (−)	3.061 (−)	137 (−)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	48.794 (△49.493)	2,559 (−)	35.157 (−)	1,783 (−)
ユーロ（ドイツ）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	23.841 (−)	178 (−)	14.982 (−)	112 (−)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4.046 (−)	42 (△25)	3.777 (−)	26 (−)
ユーロ（スペイン）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	129.781 (−)	785 (△17)	78.618 (−)	448 (−)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	19.613 (−)	95 (△11)	12.25 (−)	59 (−)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	144.464 (−)	1,266 (−)	98.211 (−)	817 (−)
ユーロ（イタリア）	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	12.141 (−)	39 (−)	5.946 (−)	16 (−)
COIMA RES SPA	− (−)	− (−)	7.596 (−)	75 (−)

（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（2022年６月23日から2023年６月22日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当期					
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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	0.012	0.012	100.0	0.012	0.012	100.0

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、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	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	227.5	391.9	121	17,247	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	72.7	72.7	0	0	0.0
PRIME US REIT	159.8	317.6	65	9,243	0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE	104.2	144.6	67	9,648	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME	526.3	839	144	20,487	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	45.455	70.549	7,986	1,133,893	1.4
ALEXANDER'S INC.	0.661	1.021	186	26,411	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	44.04	63.691	3,450	489,907	0.6
CEDAR REALTY TRUST INC	3.781	–	–	–	–
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	72.072	104.551	3,213	456,277	0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	50.727	65.982	533	75,689	0.1
AGREE REALTY CORP	23.151	41.761	2,722	386,499	0.5
BRT APARTMENTS CORP	4.22	6.159	121	17,304	0.0
SL GREEN	19.707	28.057	729	103,564	0.1
EPR PROPERTIES	23.004	33.842	1,501	213,225	0.3
PROLOGIS INC	227.981	414.926	50,077	7,109,491	8.8
AVALONBAY COMMUNITIES INC	43.06	63.859	12,093	1,716,930	2.1
LXP INDUSTRIAL TRUST	86.864	131.103	1,301	184,824	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	32.805	47.839	5,307	753,539	0.9
VERIS RESIDENTIAL INC	26.897	35.212	588	83,584	0.1
EQUINIX INC	28.058	42.028	32,277	4,582,437	5.6
NNN REIT INC	54.298	82.288	3,437	487,974	0.6
CTO REALTY GROUTH INC	1.858	9.356	155	22,075	0.0
COUSINS PROPERTIES INC	45.843	68.071	1,463	207,776	0.3
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	9.712	14.046	288	40,919	0.1
SITE CENTERS CORP	54.965	81.813	1,053	149,601	0.2
SAFEHOLD INC	–	17.782	412	58,619	0.1
DUKE REALTY TRUST	118.933	–	–	–	–
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15.107	11.922	42	6,008	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20.121	28.759	6,691	950,012	1.2
EQUITY RESIDENTIAL	105.387	152.806	10,010	1,421,165	1.8
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21.871	33.218	3,068	435,613	0.5
FIRST INDUSTRIAL RT	40.254	58.984	3,090	438,711	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	166.168	244.412	4,856	689,472	0.8
EQUITY COMMONWEALTH	34.761	49.039	1,017	144,462	0.2
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	45.424	–	–	–	–
HIGHWOODS PROPERTIES INC	32.282	48.223	1,075	152,670	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	55.097	76.925	661	93,920	0.1
WELLTOWER INC	139.809	223.439	17,649	2,505,691	3.1
EAST GROUP	12.57	20.032	3,458	490,949	0.6
KIMCO REALTY	191.008	277.027	5,291	751,193	0.9

銘柄	期首(前期末)	当期			末
	口数	口数	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	%
KILROY REALTY CORP	32.424	47.193	1,417	201,267	0.2
LTC PROPERTIES INC	11.949	18.9	627	89,137	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80.9	101.192	197	28,014	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	52.781	81.948	358	50,957	0.1
IRON MOUNTAIN INC	89.485	131.248	7,290	1,035,078	1.3
THE MACERICH COMPANY	65.088	95.956	1,048	148,898	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53.477	78.222	5,310	753,930	0.9
ACADIA REALTY TRUST	26.852	44.351	624	88,654	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	221.191	318.701	5,303	752,893	0.9
MID AMERICA	35.548	52.249	7,926	1,125,353	1.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.122	13.525	80	11,367	0.0
NATIONAL HEALTH INVS INC	14.064	19.429	1,029	146,219	0.2
CENTERSPACE	5.041	6.622	404	57,441	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5.609	8.132	170	24,267	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1.938	–	–	–	–
GETTY REALTY CORP	13.2	20.182	675	95,928	0.1
PS BUSINESS PARKS	6.193	–	–	–	–
RPT REALTY	25.143	40.594	397	56,421	0.1
REALTY INCOME CORP	185.275	302.637	18,040	2,561,165	3.2
REGENCY CENTERS CORP	47.683	68.717	4,098	581,833	0.7
UDR INC	92.65	138.65	5,885	835,591	1.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	34.498	50.428	1,202	170,676	0.2
SAUL CENTERS INC	4.594	5.447	195	27,723	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	101.12	147.007	16,278	2,310,999	2.8
LIFE STORAGE INC	25.982	38.018	4,956	703,715	0.9
PUBLIC STORAGE	47.03	71.125	20,466	2,905,690	3.6
SUN COMMUNITIES INC	37.453	55.989	7,392	1,049,474	1.3
TANGER FACTORY OUTLET	31.61	46.487	989	140,508	0.2
UMH PROPERTIES INC	13.569	26.109	419	59,529	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11.025	16.72	204	29,054	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3.781	6.151	289	41,147	0.1
VENTAS INC	123.095	179.26	8,059	1,144,211	1.4
VORNADO REALTY TRUST	49.038	71.874	1,113	158,059	0.2
ELME COMMUNITIES	25.835	40.732	645	91,656	0.1
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	43.066	–	–	–	–
KITE REALTY GROUP TRUST	67.449	99.789	2,096	297,649	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	41.354	60.583	8,845	1,255,827	1.5
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33.176	53.55	75	10,719	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67.157	94.114	922	130,941	0.2
CUBESMART	69.12	100.353	4,521	641,975	0.8
DIGITAL REALTY TRUST INC	87.671	131.006	13,669	1,940,611	2.4
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	64.291	91.448	717	101,915	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	184.696	266.517	2,379	337,888	0.4
DOUGLAS EMMETT INC	54.064	76.09	955	135,679	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	37.066	55.617	738	104,858	0.1

銘柄	期首(前期末)	当期			末
	口数	口数	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	%
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	37.982	58.595	407	57,815	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	31.732	50.883	317	45,004	0.1
TERRENO REALTY CORP	23.266	32.893	1,914	271,736	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	16.216	23.022	439	62,427	0.1
RLJ LODGING TRUST	50.885	70.804	705	100,218	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	82.511	121.186	3,868	549,176	0.7
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40.287	55.166	707	100,405	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	16.172	23.664	185	26,339	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	17.214	22.868	213	30,258	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	70.265	103.588	1,215	172,505	0.2
WHITESTONE REIT	16.382	19.598	188	26,710	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	46.744	61.059	290	41,175	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	54.404	79.986	2,847	404,259	0.5
WP CAREY INC	59.552	96.284	6,571	932,939	1.1
ALEXANDER & BALDWIN INC	21.978	33.832	617	87,657	0.1
GLADSTONE LAND CORP	9.216	15.596	254	36,090	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	70.549	169.898	3,166	449,604	0.6
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16.978	25.104	2,331	331,061	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	20.128	29.672	353	50,171	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	41.363	63.531	2,480	352,121	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST	67.816	106.824	1,481	210,349	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	50.822	90.045	4,775	678,046	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT	91.409	140.789	4,917	698,174	0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	68.065	101.147	1,826	259,338	0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	8.362	12.848	951	135,069	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	33.048	43.096	643	91,346	0.1
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	36.884	63.796	421	59,776	0.1
INVITATION HOMES INC	187.961	260.485	8,903	1,264,012	1.6
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	47.245	62.501	434	61,669	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13.541	17.079	384	54,555	0.1
SAFEHOLD INC	4.985	－	－	－	－
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	40.391	66.693	1,589	225,632	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	21.803	26.881	76	10,876	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	72.71	118.272	5,761	817,893	1.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	92.007	136.117	2,902	411,998	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20.173	22.683	88	12,591	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC	5.42	7.309	106	15,129	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2.685	6.752	108	15,471	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20.754	29.365	661	93,843	0.1
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST	4.068	－	－	－	－
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	8.337	－	－	－	－
FARMLAND PARTNERS INC	9.907	23.717	278	39,563	0.0
CITY OFFICE REIT INC	15.394	17.231	92	13,063	0.0
ORION OFFICE REIT INC	16.725	28.112	183	26,061	0.0
NETSTREIT CORP	14.759	28.118	504	71,694	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	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	%
CARETRUST REIT INC		29.882	44.457	864	122,759	0.2
INDUS REALTY TRUST INC		2.312	2.103	140	19,952	0.0
PHILLIPS EDISON & CO INC		34.925	52.693	1,732	245,894	0.3
BLUEROCK HOMES TRUST INC		−	1.188	18	2,653	0.0
APARTMENT INCOME REIT CORP		48.505	67.666	2,419	343,433	0.4
BROADSTONE NET LEASE INC		52.141	83.884	1,312	186,376	0.2
STAR HOLDINGS		−	5.322	73	10,494	0.0
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC		7.54	11.835	267	37,922	0.0
STORE CAPITAL CORP		77.766	−	−	−	−
PARAMOUNT GROUP INC		55.259	78.702	346	49,162	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC		17.822	26.422	248	35,260	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES		33.994	52.509	779	110,702	0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I		29.19	42.482	610	86,728	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC		35.217	49.736	606	86,073	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC		6.895	10.016	454	64,585	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS		25.232	36.394	1,270	180,426	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC		6.99	10.321	340	48,397	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC		65.286	95.647	1,409	200,154	0.2
GLOBAL NET LEASE INC		31.417	48.468	490	69,566	0.1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE		−	14.638	167	23,794	0.0
CLIPPER REALTY INC		5.086	5.086	27	3,891	0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC		72.797	96.622	1,214	172,428	0.2
VICI PROPERTIES INC		296.576	451.537	14,060	1,996,220	2.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC		23.62	39.634	1,011	143,653	0.2
小計	口数・金額	7,979.351	11,681.835	440,278	62,506,354	−
	銘柄数<比率>	151銘柄<76.0%>	145銘柄<77.0%>	−	−	77.0
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
SMARTCENTRES REIT		21.535	31.367	756	81,683	0.1
CANADIAN APT PPTYS REIT		26.099	37.034	1,789	193,120	0.2
H & R REAL ESTATE INVESTMENT		42.878	58.204	593	64,070	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST		32.504	46.831	675	72,929	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		46.43	66.005	1,258	135,769	0.2
ALLIED PROPERTIES REIT		19.099	28.626	612	66,111	0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU		8.213	8.533	109	11,833	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		7.546	9.738	589	63,570	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU		17.493	24.568	168	18,161	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INV		16.748	24.648	339	36,681	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		22.588	32.303	405	43,751	0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES		33.05	55.673	380	41,096	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT		6.458	8.705	139	15,049	0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT		4.643	4.643	15	1,653	0.0
DREAM INDUSTRIAL REIT		36.406	56.937	757	81,723	0.1
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		15.423	15.423	47	5,076	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT		27.533	−	−	−	−
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T		9.835	13.984	1,046	112,929	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期			末
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT		16.803	21.434	51	5,505	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		48.913	72.055	955	103,112	0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE		5.26	9.341	134	14,465	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		17.147	25.088	362	39,069	0.0
PLAZA RETAIL REIT		16.376	－	－	－	－
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE		10.116	17.876	50	5,459	0.0
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		－	15.769	82	8,934	0.0
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		－	8.104	132	14,343	0.0
SLATE GROCERY REIT		7.969	12.066	154	16,706	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT		7.458	14.455	119	12,869	0.0
PRIMARIS REIT		13.944	21.998	274	29,627	0.0
SLATE OFFICE REIT		15.735	17.818	36	3,922	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT		7.481	8.337	93	10,094	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV		17.944	24.983	430	46,481	0.1
小計	口数・金額	579.627	792.546	12,563	1,355,806	－
	銘柄数<比率>	30銘柄<1.9%>	30銘柄<1.7%>	－	－	1.7
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
BWP TRUST		144.478	209.056	773	74,651	0.1
MIRVAC GROUP		1,217.477	1,776.143	4,138	399,398	0.5
CROMWELL PROPERTY GROUP		466.932	632.521	338	32,658	0.0
CHARTER HALL RETAIL REIT		157.855	230.204	849	81,980	0.1
GPT GROUP		591.472	853.243	3,617	349,149	0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP		189.484	302.227	513	49,585	0.1
ABACUS PROPERTY GROUP		126.389	195.539	527	50,952	0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU		98.14	160.446	482	46,608	0.1
STOCKLAND		737.402	1,071.893	4,544	438,621	0.5
INGENIA COMMUNITIES GROUP		109.543	162.299	655	63,280	0.1
DEXUS		332.461	479.312	3,925	378,856	0.5
GOODMAN GROUP		523.576	769.687	15,755	1,520,562	1.9
VICINITY CENTRES		1,193.493	1,758.932	3,350	323,382	0.4
CHARTER HALL GROUP		145.638	212.89	2,356	227,444	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA		96.915	126.146	370	35,792	0.0
REGION RE LTD		341.231	515.147	1,200	115,840	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		162.422	240.142	756	73,004	0.1
ARENA REIT		103.753	165.205	642	62,021	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		186.309	299.469	1,260	121,676	0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT		63.933	91.184	245	23,672	0.0
NATIONAL STORAGE REIT		329.249	538.807	1,287	124,280	0.2
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD		65.661	85.857	285	27,509	0.0
GDI PROPERTY GROUP		178.986	222.442	151	14,598	0.0
RURAL FUNDS GROUP		126.29	173.97	300	28,962	0.0
IRONGATE GROUP		181.194	－	－	－	－
SCENTRE GROUP		1,606.393	2,339.436	6,269	605,087	0.7
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY		140.343	140.343	95	9,210	0.0
HMC CAPITAL LTD		53.607	109.034	541	52,298	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
HOMECO DAILY NEEDS REIT		439.583	709.912	841	81,188	0.1
HEALTHCO REIT		71.487	182.619	257	24,850	0.0
CENTURIA OFFICE REIT		127.89	210.931	302	29,212	0.0
WAYPOINT REIT LTD		212.662	300.308	837	80,861	0.1
小計	口数・金額	10,522.248	15,265.344	57,477	5,547,201	－
	銘柄数<比率>	32銘柄<6.4%>	31銘柄<6.8%>	－	－	6.8
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT		648.62	1,145.32	51,825	940,636	1.2
PROSPERITY REIT		353	538	914	16,599	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR		682	985	1,654	30,034	0.0
CHAMPION REIT		632.07	896.07	2,455	44,562	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		342	445	1,303	23,664	0.0
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T		436	678	3,823	69,404	0.1
小計	口数・金額	3,093.69	4,687.39	61,978	1,124,903	－
	銘柄数<比率>	6銘柄<1.6%>	6銘柄<1.4%>	－	－	1.4
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		1,573.909	2,246.609	4,448	471,162	0.6
CAPLAND ASCENDAS REIT		1,037.96	1,505.56	4,140	438,539	0.5
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		668.49	1,005.29	1,306	138,424	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		985.82	1,469.02	2,482	262,961	0.3
STARHILL GLOBAL REIT		412.4	614.9	310	32,890	0.0
CAPITALAND ASCOTT TRUST		588.116	995.816	1,095	116,024	0.1
KEPPEL REIT		598.9	890.7	792	83,965	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		326.6	480.7	1,076	114,051	0.1
ESR LOGOS REIT		1,558.24	2,901.84	972	102,966	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		277.1	394.5	477	50,560	0.1
CAPITALAND CHINA TRUST		338.18	548.48	553	58,675	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU		327.7	538.1	139	14,818	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		163.795	228.595	278	29,539	0.0
PARKWAY LIFE REIT		117.4	173.2	654	69,345	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		597.62	912.62	2,053	217,495	0.3
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL		673.1	1,038.8	1,734	183,749	0.2
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		124.4	－	－	－	－
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		303.8	481.4	291	30,848	0.0
PARAGON REIT		313	493.8	469	49,688	0.1
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT		112.4	112.4	35	3,809	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T		194.5	259.9	184	19,545	0.0
OUE COMMERCIAL REIT		787.955	1,039.155	348	36,872	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT		573	847.2	563	59,674	0.1
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST		103.9	226.7	137	14,527	0.0
IREIT GLOBAL		168.6	－	－	－	－
KEPPEL DC REIT		403.5	594.4	1,230	130,324	0.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T		894.764	1,304.864	1,657	175,528	0.2
小計	口数・金額	14,225.149	21,304.549	27,435	2,905,990	－
	銘柄数<比率>	27銘柄<3.5%>	25銘柄<3.6%>	－	－	3.6

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(ニュージーランド)		千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
PRECINCT PROPERTIES		391.694	610.508	775	68,331	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		142.269	209.563	490	43,216	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		317.48	476.422	1,026	90,482	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD		467.188	710.515	646	56,982	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		289.87	376.442	419	36,991	0.0
STRIDE STAPLED GROUP		−	233.35	324	28,585	0.0
小計	口数・金額	1,608.501	2,616.8	3,683	324,588	−
	銘柄数<比率>	5銘柄<0.4%>	6銘柄<0.4%>	−	−	0.4
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC		288.115	416.926	1,372	248,755	0.3
DERWENT LONDON PLC		34.55	49.785	1,037	188,040	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC		53.044	78.821	848	153,855	0.2
HAMMERSON PLC		1,047.969	1,850.26	475	86,182	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC		230.251	339.433	1,940	351,764	0.4
WORKSPACE GROUP PLC		41.816	60.495	294	53,373	0.1
INTU PROPERTIES PLC		231.04	231.04	0	0	0.0
UNITE GROUP PLC		123.179	178.13	1,595	289,105	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC		407.879	600.827	581	105,409	0.1
SHAFTESBURY PLC		88.05	−	−	−	−
SEGRO PLC		370.318	550.499	4,037	731,731	0.9
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		77.506	114.09	495	89,823	0.1
ASSURA PLC		903.196	1,318.883	610	110,672	0.1
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI		115.909	184.841	91	16,649	0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT		160.85	256.281	113	20,483	0.0
HELICAL PLC		−	48.089	129	23,532	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD		179.543	248.473	187	34,000	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD		256.076	395.99	205	37,319	0.0
SAFESTORE HOLDINGS LTD		64.657	96.433	829	150,306	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		300.333	441.765	753	136,591	0.2
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU		239.019	351.056	252	45,810	0.1
SHAFTESBURY CAPITAL PLC		259.531	875.198	1,054	191,138	0.2
WAREHOUSE REIT PLC		−	184.359	151	27,499	0.0
NEWRIVER REIT PLC		113.346	148.157	128	23,200	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		182.937	293.773	233	42,328	0.1
PRS REIT PLC/THE		181.169	249.964	197	35,835	0.0
CLS HOLDINGS PLC		−	83.611	112	20,396	0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT		105.686	153.569	78	14,250	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		381.587	552.98	416	75,567	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC		575.519	844.097	1,109	201,021	0.2
CUSTODIAN REIT PLC		128.872	190.248	165	29,963	0.0
HOME REIT PLC		186.078	286.621	108	19,739	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		197.945	288.036	252	45,730	0.1
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO P		−	103.977	63	11,419	0.0
AEW UK REIT PLC		58.66	78.98	78	14,314	0.0
LXI REIT PLC		277.287	767.46	681	123,515	0.2

銘柄		期首(前期末)	当期			末
		口数	口数	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		150.233	180.491	84	15,309	0.0
URBAN LOGISTICS REIT PLC		−	221.68	264	47,971	0.1
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		136.07	185.316	168	30,463	0.0
小計	口数・金額	8,148.22	13,500.634	21,204	3,843,073	−
	銘柄数<比率>	34銘柄<5.5%>	38銘柄<4.7%>	−	−	4.7
(イスラエル)		千口	千口	千イスラエル・シュケル	千円	%
REIT 1 LTD		61.727	87.414	1,429	56,044	0.1
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD		63.623	92.361	730	28,662	0.0
MENIVIM- THE NEW REIT LTD		−	314.331	539	21,139	0.0
小計	口数・金額	125.35	494.106	2,699	105,846	−
	銘柄数<比率>	2銘柄<0.1%>	3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		28.835	39.353	169,021	18,643	0.0
E KOCREF CR-REIT CO LTD		−	11.135	59,572	6,570	0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		19.52	29.807	181,822	20,055	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		11.032	18.354	86,080	9,494	0.0
LOTTE REIT CO LTD		39.603	55.954	217,101	23,946	0.0
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		11.152	20.53	111,683	12,318	0.0
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD		4.123	9.851	36,005	3,971	0.0
JR REIT XXVII		45.194	66.386	301,060	33,206	0.0
SK REITS CO LTD		17.691	31.791	164,041	18,093	0.0
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD		43.616	73.968	308,076	33,980	0.0
D&D PLATFORM REIT CO LTD		14.329	26.101	86,394	9,529	0.0
NH ALL-ONE REIT CO LTD		11.162	20.887	75,610	8,339	0.0
小計	口数・金額	246.257	404.117	1,796,470	198,150	−
	銘柄数<比率>	11銘柄<0.3%>	12銘柄<0.2%>	−	−	0.2
(ユーロ…シンガポール)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
CROMWELL REIT EUR		101.34	162.64	256	40,087	0.0
小計	口数・金額	101.34	162.64	256	40,087	−
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	−	−	0.0
(ユーロ…アイルランド)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI		125.78	198.163	191	29,800	0.0
小計	口数・金額	125.78	198.163	191	29,800	−
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.0%>	1銘柄<0.0%>	−	−	0.0
(ユーロ…オランダ)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
VASTNED RETAIL		5.188	7.975	157	24,633	0.0
WERELDHAVE NV		13.152	18.149	250	39,014	0.0
NSI NV		5.696	8.534	168	26,359	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		11.992	19.196	390	60,849	0.1
小計	口数・金額	36.028	53.854	967	150,857	−
	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		7.331	−	−	−	−
COFINIMMO SA		9.07	13.78	979	152,842	0.2
RETAIL ESTATES		3.376	5.13	324	50,577	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期			末
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(ユーロ…ベルギー)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		6.965	12.613	188	29,357	0.0
WAREHOUSES DE PAUW		43.839	69.994	1,777	277,344	0.3
MONTEA SCA		3.06	6.01	441	68,816	0.1
AEDIFICA		11.176	17.659	1,079	168,456	0.2
CARE PROPERTY INVEST NV		8.849	16.012	199	31,123	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV		6.95	10.247	293	45,797	0.1
小計	口数・金額	100.616	151.445	5,284	824,315	－
	銘柄数<比率>	9銘柄<1.3%>	8銘柄<1.0%>	－	－	1.0
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA		16.786	24.437	2,360	368,255	0.5
ICADE		9.819	14.462	568	88,753	0.1
ALTAREA		1.248	2.083	213	33,339	0.0
KLEPIERRE		60.076	86.815	1,924	300,251	0.4
COVIVIO		14.518	20.812	918	143,308	0.2
MERCIALYS		17.947	35.663	291	45,453	0.1
CARMILA SA		13.198	26.256	364	56,933	0.1
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		－	48.183	2,236	348,918	0.4
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		35.856	－	－	－	－
小計	口数・金額	169.448	258.711	8,879	1,385,213	－
	銘柄数<比率>	8銘柄<1.7%>	8銘柄<1.7%>	－	－	1.7
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
HAMBORNER REIT AG		23.534	32.393	217	33,857	0.0
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		3.67	3.939	20	3,133	0.0
小計	口数・金額	27.204	36.332	237	36,991	－
	銘柄数<比率>	2銘柄<0.1%>	2銘柄<0.0%>	－	－	0.0
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		82.605	133.768	742	115,816	0.1
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		18.955	26.318	144	22,539	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		102.599	148.852	1,155	180,194	0.2
小計	口数・金額	204.159	308.938	2,041	318,550	－
	銘柄数<比率>	3銘柄<0.4%>	3銘柄<0.4%>	－	－	0.4
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		14.36	20.555	51	8,064	0.0
COIMA RES SPA		7.596	－	－	－	－
小計	口数・金額	21.956	20.555	51	8,064	－
	銘柄数<比率>	2銘柄<0.0%>	1銘柄<0.0%>	－	－	0.0
合計	口数・金額	47,314.924	71,937.959	－	80,705,796	－
	銘柄数<比率>	328銘柄<99.3%>	324銘柄<99.4%>	－	－	99.4

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。
(注3) 金額の単位未満は切捨てております。%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

2023年６月22日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券、投資証券	80,705,796	99.0
コール・ローン等、その他	810,337	1.0
投資信託財産総額	81,516,134	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨てであります。％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、81,117,389千円、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、2023年６月22日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝141.97円、１カナダ・ドル＝107.92円、１オーストラリア・ドル＝96.51円、１香港・ドル＝18.15円、１シンガポール・ドル＝105.92円、１ニュージーランド・ドル＝88.13円、１イギリス・ポンド＝181.24円、１イスラエル・シュケル＝39.213円、100韓国・ウォン＝11.03円、１ユーロ＝156.00円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年6月22日)現在

項目	当期末
(A) 資産	**81,532,357,135円**
コール・ローン等	493,052,220
投資信託受益証券(評価額)	8,619,311,186
投資証券(評価額)	72,086,485,439
未収入金	18,624,711
未収配当金	314,883,579
(B) 負債	**333,262,325**
未払金	211,605,325
未払解約金	121,657,000
(C) 純資産総額(A－B)	**81,199,094,810**
元本	47,496,039,171
次期繰越損益金	33,703,055,639
(D) 受益権総口数	**47,496,039,171口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**17,096円**

(注1) 期首元本額 33,589,773,063円
追加設定元本額 48,627,104,040円
一部解約元本額 34,720,837,932円

(注2) 期末における元本の内訳

ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	2,361,712,742円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	35,315,437円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（安定型）	3,799,837円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（中立型）	16,993,360円
ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（積極型）	42,801,843円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	53,631,948円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	39,861,110円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	42,915,263円
たわらノーロード 先進国リート	15,013,942,860円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,566,109,485円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	331,123,558円
たわらノーロード バランス（８資産均等型）	3,467,723,278円
たわらノーロード バランス（堅実型）	28,608,263円
たわらノーロード バランス（標準型）	563,881,175円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,170,685,116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）	48,387,380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）	499,698,074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）	506,479,071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）	890,805,367円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	623,293円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	33,617,966円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	6,202,351円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	25,151,182円
Ｏｎｅ ＤＣ先進国リートインデックスファンド	1,662,663,729円
マネックス資産設計ファンド（隔月分配型）	18,491,200円
マネックス資産設計ファンド（育成型）	690,947,972円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	57,534,103円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10）	214,120,117円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20）	312,458,906円
ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30）	567,875,975円
投資のソムリエ	9,045,210,186円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>	720,615,046円
ＤＩＡＭ ８資産バランスファンドＮ<ＤＣ年金>	240,510,446円
投資のソムリエ<ＤＣ年金>リスク抑制型	670,367,293円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,618,196,372円
ワールドアセットバランス（基本コース）	347,351,219円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,009,390,261円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	42,415,971円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	20,915,842円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,844,141円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	100,031,740円
９資産分散投資・スタンダード<ＤＣ年金>	176,001,936円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	50,035,961円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	23,020,391円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	14,147,630円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	3,342,049円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	86,386,655円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	284,697,856円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド<ＤＣ年金>	328,891,728円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12（適格機関投資家限定）	217,802円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06（適格機関投資家限定）	647,540円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09（適格機関投資家限定）	125,270円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03（適格機関投資家限定）	285,547円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ2021-04（適格機関投資家限定）	711,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	506,310円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	244,380,951円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	1,243,561円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	572,716円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	3,700,623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）	54,518,708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）	184,149,001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）	944,444,517円
期末元本合計	47,496,039,171円

■損益の状況

当期　自2022年６月23日　至2023年６月22日

項目	当期
(A) 配当等収益	**3,018,423,361円**
受取配当金	3,005,881,073
受取利息	11,524,314
その他収益金	1,180,907
支払利息	△162,933
(B) 有価証券売買損益	**△1,857,706,305**
売買益	7,975,013,780
売買損	△9,832,720,085
(C) その他費用	**△39,826,167**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**1,120,890,889**
(E) 前期繰越損益金	**22,413,304,632**
(F) 解約差損益金	**△21,875,935,842**
(G) 追加信託差損益金	**32,044,795,960**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**33,703,055,639**
次期繰越損益金(H)	**33,703,055,639**

（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。