

# りそな・リスクコントロールファンド2019-12

## 愛称：みつぼしフライト2019-12

### 償還 運用報告書(全体版)

第3期(償還)(償還日 2022年4月26日)

#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。  
「りそな・リスクコントロールファンド2019-12」は、信託約款の規定に基づき、2022年4月26日に信託期間が終了し、繰上償還いたしました。  
ここに、設定以来の運用状況と償還内容をご報告いたしますとともに、受益者のみなさまのご愛顧に対しまして、重ねてお礼申し上げます。

#### 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信/内外/資産複合	
信託期間	2019年12月17日から2022年4月26日(当初は2020年11月15日)まで	
運用方針	主として以下の各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等への分散投資を行い、安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。	
主 投 資 対 象	りそな・リスクコントロールファンド2019-12	以下の各マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	RM国内債券マザーファンド	・NOMURA-BPI 総合に採用されている国内の債券
	RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)に採用されている先進国の債券
	RM国内株式マザーファンド	・東証株価指数(TOPIX、配当込み)に採用されている株式
	RM先進国株式マザーファンド	・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている先進国株式等(日本の株式を除きます。以下同じ。) ・先進国株式の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)
	RM新興国株式マザーファンド	・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている新興国株式等 ・新興国株式の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)
	RM新興国債券マザーファンド	・JPMオルガンGBI-EMグローバル・ダイバースファイド(円換算ベース)に採用されている新興国の債券 ・新興国債券の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)
	RM国内リートマザーファンド	・東証REIT指数(配当込み)に採用されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。)
	RM先進国リートマザーファンド	・先進国(除く日本)の金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。) ・先進国(除く日本)の金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)
	RMマネーマザーファンド	・国内の公社債
主 投 資 制 限	りそな・リスクコントロールファンド2019-12	株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	RM国内債券マザーファンド	外貨建資産への投資は、行いません。
	RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	RM国内株式マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
	RM先進国株式マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	RM新興国株式マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	RM新興国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	RM国内リートマザーファンド	不動産投資信託証券および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は、行いません。
	RM先進国リートマザーファンド	不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
RMマネーマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。	
分配方針	毎決算時に、元本超過額または経費控除後の配当等収益のうちいずれか多い額を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、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には分配を行わないことがあります。	

<照会先>

りそなアセットマネジメント 株式会社

電話番号：0120-223351

(委託会社の営業日の午前9時~午後5時)

東京都江東区木場1丁目5番65号

ホームページ：<https://www.resona-am.co.jp/>

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			受益者 受戻り	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券組入比率	元残 本率	
	(分配落)	税金 分配	期中 騰落率							
(設定日) 2019年12月17日	円銭 10,000	円 -	円銭 -	% -	% -	% -	% -	% -	% 100.0	
1期(2020年11月16日)	9,641	0	△359	△3.6	△3.9	5.6	1.1	50.1	1.8	82.6
2期(2021年11月15日)	9,869	0	228	2.4	△0.7	16.9	1.5	75.7	4.9	64.7
(償還時) 3期(2022年4月26日)	(償還価額) 9,517.55	-	△351.45	△3.6	△2.0	-	-	-	-	37.2

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。また、株式先物比率には不動産投信指数先物比率を含めて表示しております。

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

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

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券組入比率
	騰落率	騰落率				
(期首) 2021年11月15日	円銭 9,869	% -	% 16.9	% 1.5	% 75.7	% 4.9
11月末	9,824	△0.5	16.0	1.7	75.7	4.7
12月末	9,830	△0.4	15.3	1.5	78.7	4.5
2022年1月末	9,638	△2.3	7.2	0.7	34.6	2.1
2月末	9,577	△3.0	3.2	0.3	53.9	0.9
3月末	9,529	△3.4	0.9	0.1	43.0	0.3
(償還時) 2022年4月26日	(償還価額) 9,517.55	△3.6	-	-	-	-

(注) 騰落率は期首比です。

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。また、株式先物比率には不動産投信指数先物比率を含めて表示しております。

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

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

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○設定以来の運用経過

(2019年12月17日～2022年4月26日)

## 基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。なお、当ファンドは単位型投信であり、実際には分配金は再投資されませんのでご注意ください。

## ○基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて投資を行った結果、当ファンドの基準価額は設定時10,000円から償還時9,517.55円と値下がりしました。設定来では特に先進国株式が基準価額の主な値上がり要因となった一方、先進国債券（為替ヘッジあり）が基準価額の主な値下がり要因となりました。

投資対象とする資産の当期間の値動きは、先進国債券（為替ヘッジあり）、新興国債券、国内債券が下落した一方、そのほかのすべての資産は上昇しました。

## 投資環境

### 国内債券市況

国内の長期金利は、設定時と比較して上昇（債券価格は下落）しました。2020年3月には、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による経済活動の停滞懸念が金融市場の混乱に繋がり、変動率の高い展開となりました。2021年以降は、日銀による大規模な金融緩和策が維持され、国内の長期金利は低位での推移が続きました。2022年以降は、主要国中央銀行の金融政策正常化の前倒し観測の影響から10年国債利回りは日銀の変動許容幅の上限である0.25%近辺まで上昇する展開となりました。

### 先進国債券市況

先進国の長期金利は、設定時と比較して上昇（債券価格は下落）しました。2020年3月には、新型コロナウイルスの感染拡大による経済活動の停滞懸念が強まり、主要国中央銀行は利下げや資産購入策など大規模な金融支援策を展開しました。2021年には、主要国金利は歴史的な低水準で推移する中、ワクチン接種進展等による経済活動の正常化進展を背景に主要国金利は上昇しました。2022年以降は、主要国中央銀行による政策正常化ペースの加速を織りこみ、主要国金利は一段と上昇しました。米国では、FRB（米連邦準備制度理事会）によるインフレ抑制姿勢が強まり、米10年国債利回りは2.9%台まで上昇しました。

### 国内株式市況

国内の株式市場は、設定時と比較して上昇しました。2020年3月には、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う経済活動の停滞懸念等から、一時大幅に下落しました。その後、政策当局による大規模な金融政策や財政政策に対する期待などから反発が進みました。2021年央には、日経平均株価が1990年以来となる3万円を上回る場面が見られました。2022年には、FRBをはじめとする主要国中央銀行の金融政策正常化の加速に伴い、上昇幅を縮小する展開となりました。

### 先進国株式市況

先進国の株式市場は、設定時と比較して上昇しました。2020年3月には、新型コロナウイルスの感染拡大による経済活動の停滞懸念が強まり、一時大幅に下落しました。その後、主要各国による大規模な財政・金融支援策への政策効果期待から上昇に転じました。2021年には、緩和的な金融環境やワクチン接種の本格化による経済活動の正常化期待が支援材料となり、上昇基調を維持しました。2022年は、主要国中央銀行の政策正常化の加速を背景とする急速な金利上昇やウクライナ情勢を巡る不確実性による企業業績の悪化懸念などから上昇幅を縮小しました。

### 新興国株式市況

新興国株式市場は、設定時と比較して上昇しました。2020年3月には、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う経済活動の停滞懸念等から一時大幅に下落しました。その後、大規模な金融政策や財政政策による支援効果期待や米国実質金利（名目金利から予想物価上昇率を差し引いた金利）低下を背景に新興国株式に買いが入る展開となりました。2021年以降は、主要国対比でワクチン接種の進展に遅れが見られたことや、一貫して厳格なゼロコロナ政策が維持される中国の軟調な推移を受け、上昇幅を縮小しました。

## 新興国債券市況

新興国の長期金利は、設定時と比較して上昇（債券価格は下落）しました。2020年3月には、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による経済活動の停滞懸念が金融市場の混乱に繋がり、経済基盤が脆弱な地域の金利上昇が強まりました。その後、主要中央銀行による大規模な金融緩和策が市場参加者の安心感に繋がり、新興国債券の利回りの低下が進みました。2021年以降は、インフレ高進が見られたブラジルなどで利上げがいち早く進み、新興国金利は上昇基調となりました。2022年には、ロシアのウクライナ侵攻を背景に主要国は対ロシア向け経済制裁を強化しました。これを受け、ロシア政府の信用リスク悪化に繋がり、ロシア国債の利回りは大きく上昇しました。

## 国内リート市況

国内のリート市場は、設定時と比較して上昇しました。2020年3月には、新型コロナウイルスの感染拡大により経済活動の停滞懸念が強まり、急速に下落幅を拡大しました。その後、主要各国による大規模な財政・金融支援策への政策効果期待から上昇に転じましたが事業環境の不透明感は払拭されず、買い戻しの動きは限定的となりました。2021年は経済活動の正常化期待から上昇基調が維持されたものの、度重なる感染抑制策導入を受け上値追いの乏しい展開となりました。2022年に入ると、主要中央銀行の政策正常化の加速を背景とする急速な金利上昇や世界的株安の影響を受け、下落しました。

## 先進国リート市況

先進国リート市場は、設定時と比較して上昇しました。2020年3月には、新型コロナウイルスの感染拡大による経済活動の停滞懸念が強まり、一時大幅に下落しました。その後、主要各国による大規模な財政・金融支援策を受けて買い戻されました。2021年には、緩和的な金融環境やワクチン接種の本格化による経済活動の正常化期待が支援材料となり、上昇基調を維持しました。2022年に入ると、主要中央銀行の政策正常化の加速を背景とする急速な金利上昇や世界的株安の影響を受け、上昇幅を縮小しました。

## 為替市況

設定時と比較して、円は米ドル・ユーロの双方に対して円安となりました。

米ドルに対して、2020年3月には、新型コロナウイルス問題に伴う金融市場の混乱により一時変動率の高い展開も見られました。2022年には、日銀に政策正常化の遅れが見られる一方で、FRBによる政策正常化の加速が進み、金利差は拡大しました。これを受け、約20年ぶりに1米ドル=129円台まで米ドル高円安が進行する場面が見られました。

ユーロに対して、2020年央までユーロ安円高が進みましたが、EU首脳会談における欧州復興基金合意による政策効果期待等からユーロ高が進みました。2022年以降は、ECB（欧州中央銀行）による利上げ時期の前倒し観測などから、ユーロ高が進行しました。

新興国通貨は円に対して通貨高となり、米ドルに対して通貨安となりました。2020年3月には、新型コロナウイルスの感染拡大懸念の高まりを受けて金融市場のリスク回避姿勢が強まり、新興国通貨は水準を切り下げました。2021年以降は新興国で利上げが進み、円に対して通貨高が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

当ファンドは、主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券（リート）などへの分散投資を行い、中長期的に信託財産の着実な成長を目指して運用を行いました。

投資環境を定量的に分析し、安定性重視資産（国内債券・先進国債券（為替ヘッジあり））と成長性重視資産（国内株式・先進国株式・新興国株式・新興国債券・国内リート・先進国リート）の配分比率を機動的に変更することで、運用リスクのコントロールを行いました。安定性重視資産と成長性重視資産の配分比率の割合は、70%：30%程度から90%：10%程度の範囲内で変更しました。

2020年2月下旬のコロナショックの際には、リスク性資産における安定性重視資産への配分比率（目標値）を最大である90%まで高めるとともに、キャッシュ等への配分比率を高位とすることで、基準価額の変動を抑制しました。

その後、市場のボラティリティ（価格変動性）の安定度合いに応じ、リスク性資産における成長性重視資産への配分比率を再度引き上げる調整を行いました。また、基準価額の回復に伴い、2021年7月下旬にはキャッシュ等への配分比率を0%まで引き下げました。

しかし、2022年1月以降、米欧の物価指標が上昇し、インフレ懸念の高まりを受けて、金融政策正常化に向けた利上げペースが加速するとの見方から、主要先進国を中心に金利が上昇（債券価格は下落）しました。他方、先進国株式市場においても、これまで上昇を続けていたハイテク株（金利敏感株）を中心に調整が入り、加えてウクライナ情勢が重荷となり、株安・債券安の環境となりました。

こうした中、当ファンドでは1月中旬以降、成長性重視資産の投資比率を引き下げ、安定性重視資産の投資比率を引き上げたほか、キャッシュ等の組入比率を段階的に引き上げました。

しかしながら、当ファンドの基準価額は下落し、基準価額が9,544円となった2022年3月11日以降、基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満（9,550円未満）となったことから、当ファンドは信託約款に基づき繰上償還することとなりました。

### RM国内債券マザーファンド

国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

### RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

日本を除く先進国の債券を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。また、ベンチマークとの連動性を高めるため、投資対象資産の通貨は対円で為替ヘッジ（為替の売り予約）を行いました。

### RM国内株式マザーファンド

国内の株式を主要投資対象とし、東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。

### RM先進国株式マザーファンド

日本を除く先進国の株式を主要投資対象とし、MSCI-KOKUSA I 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

### RM新興国株式マザーファンド

新興国の株式を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

### RM新興国債券マザーファンド

新興国の現地通貨建て債券を実質的な主要投資対象とし、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への運動性を高めるため、ETF（上場投資信託証券）を活用して運用を行いました。ETFへの投資を通じて実質債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

### RM国内リートマザーファンド

国内の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（用途別の比率など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。不動産投資信託証券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。

### RM先進国リートマザーファンド

日本を除く先進国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、用途別の比率など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。不動産投資信託証券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

### RMマネーマザーファンド

国内の公社債を主要投資対象とし、利息等収益の獲得および流動性の確保を目指して残存期間の短い国内の公社債へ投資することによりポートフォリオを構築しました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

## 分配金

第1期および第2期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して、見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行いました。

第3期については償還のため分配は行いませんでした。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年11月16日～2022年4月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 35	% 0.364	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(15)	(0.157)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(19)	(0.192)	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、購入後の 情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 1)	(0.015)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(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
（ 株 式 ）	( 0)	(0.000)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	( 0)	(0.000)	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
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	9	0.093	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 0)	(0.005)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用
（ 保 証 料 ）	( 8)	(0.087)	保証料は、保証契約に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0)	(0.002)	その他は、権利・配当にかかる税金及びその払戻し、ファンドの運営管理にか かる費用等
合 計	44	0.458	
期中の平均基準価額は、9,679円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

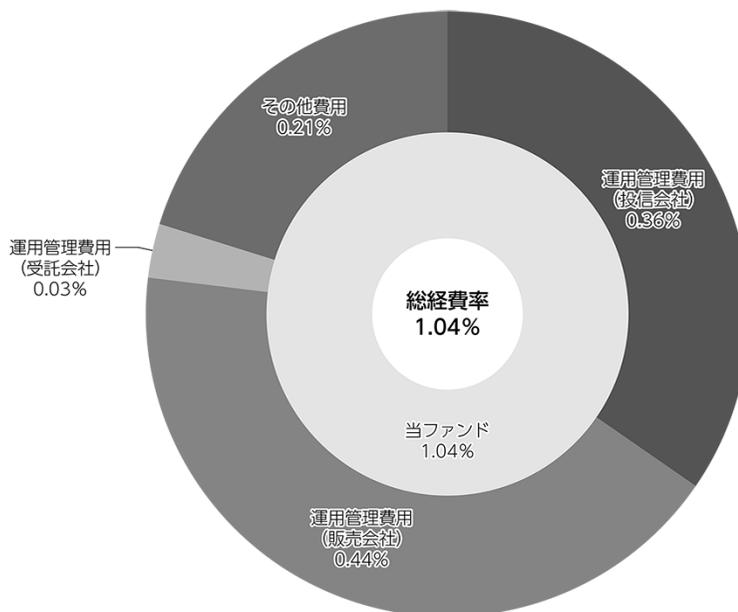
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンド  
に対応するものを含みます。

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

## (参考情報)

## ○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.04%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年11月16日～2022年4月26日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
RM国内株式マザーファンド	33,110	46,150	224,443	317,231
RM国内リートマザーファンド	12,949	18,523	107,399	152,259
RM先進国株式マザーファンド	139,727	274,694	967,760	1,940,844
RM新興国株式マザーファンド	26,402	41,554	196,680	319,822
RM先進国リートマザーファンド	31,139	44,485	228,403	330,441
RM国内債券マザーファンド	523,325	545,438	2,322,312	2,420,763
RM新興国債券マザーファンド	16,210	16,739	146,558	157,799
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	2,092,242	2,126,886	9,315,235	9,410,630
RMマネーマザーファンド	4,515,855	4,500,000	4,515,855	4,499,598

## ○株式売買比率

(2021年11月16日～2022年4月26日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期			
	RM国内株式マザーファンド	RM先進国株式マザーファンド	RM新興国株式マザーファンド	RM先進国リートマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	23,937,517千円	15,833,242千円	3,772,905千円	17,857千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	65,012,304千円	111,810,479千円	15,670,881千円	88,601千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.36	0.14	0.24	0.20

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年11月16日～2022年4月26日)

## 利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;RM国内株式マザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	24	13	155

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、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社りそなホールディングスです。

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2021年11月16日～2022年4月26日）

該当事項はございません。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年11月16日～2022年4月26日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年4月26日現在)

2022年4月26日現在、有価証券等の組入れはございません。

## 親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
RM国内株式マザーファンド			千口 191,332
RM国内リートマザーファンド			94,449
RM先進国株式マザーファンド			828,032
RM新興国株式マザーファンド			170,278
RM先進国リートマザーファンド			197,263
RM国内債券マザーファンド			1,798,987
RM新興国債券マザーファンド			130,347
RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）			7,222,992

## ○投資信託財産の構成

(2022年4月26日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	6,929,449	100.0
投資信託財産総額	6,929,449	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

## ○特定資産の価格等の調査

(2021年11月16日～2022年4月26日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2022年4月26日現在)

項 目	償 還 時	円
(A) 資産	6,929,449,303	
コール・ローン等	6,929,449,303	
(B) 負債	106,134,801	
未払解約金	71,670,540	
未払信託報酬	24,781,691	
未払利息	18,794	
その他未払費用	9,663,776	
(C) 純資産総額(A-B)	6,823,314,502	
元本	7,169,194,515	
償還差損金	△ 345,880,013	
(D) 受益権総口数	7,169,194,515口	
1万口当たり償還価額(C/D)	9,517円55銭	

(注) 当ファンドの設定元本額は19,250,909,180円、期首元本額は12,466,301,121円、期末における元本残存率は37.2%です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は0.951755円です。

(注) 2022年4月26日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は345,880,013円です。

## ○損益の状況

(2021年11月16日～2022年4月26日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	△ 1,102,569	
支払利息	△ 1,102,569	
(B) 有価証券売買損益	△358,408,715	
売買益	217,125,558	
売買損	△575,534,273	
(C) 信託報酬等	△ 50,242,718	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△409,754,002	
(E) 前期繰越損益金	△163,054,766	
(F) 解約差損益金	226,928,755	
償還差損金(D+E+F)	△345,880,013	

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

(注) 損益の状況の中で(F)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。

## ○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2019年12月17日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年4月26日			資産総額	6,929,449,303円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	106,134,801円	
				純資産総額	6,823,314,502円	
受益権口数	19,250,909,180口	7,169,194,515口	△12,081,714,665口	受益権口数	7,169,194,515口	
元本額	19,250,909,180円	7,169,194,515円	△12,081,714,665円	1万円当たり償還金	9,517円55銭	
毎計算期末の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金		
				金額	分配率	
第1期	15,904,875,360円	15,333,779,771円	9,641円	0円	0%	
第2期	12,466,301,121	12,303,246,355	9,869	0	0	
信託期間中1万円当たり総収益金及び年平均収益率				△482円45銭	-%	

## ○償還金のお知らせ

1万円当たり償還金(税込み)	9,517円55銭
----------------	-----------

## ○お知らせ

2022年4月8日付けで当ファンドの基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となったため、約款の規定に基づき2022年4月26日付けで信託終了(繰上償還)いたしました。

# RM国内債券マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日 2022年1月25日）  
（2021年1月26日～2022年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	①主として、NOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、NOMURA-BPI総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②債券の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。
主要投資対象	・ NOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券
主な投資制限	・ 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限りま 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、行いません。

りそなアセットマネジメント 株式会社

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債組入比率	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
2期(2018年1月25日)	10,328	0.3	379.684	0.3	99.3	46,026
3期(2019年1月25日)	10,483	1.5	385.440	1.5	99.7	64,555
4期(2020年1月27日)	10,645	1.5	391.374	1.5	99.3	80,324
5期(2021年1月25日)	10,506	△1.3	386.571	△1.2	99.3	82,199
6期(2022年1月25日)	10,475	△0.3	385.520	△0.3	99.3	123,850

(注) 「NOMURA-BPI総合」は、野村証券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。野村証券株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、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。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債組入比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2021年1月25日	10,506	—	386.571	—	99.3
1月末	10,497	△0.1	386.252	△0.1	99.2
2月末	10,410	△0.9	383.056	△0.9	99.2
3月末	10,482	△0.2	385.724	△0.2	99.3
4月末	10,502	△0.0	386.440	△0.0	99.1
5月末	10,506	0.0	386.621	0.0	99.0
6月末	10,512	0.1	386.903	0.1	98.1
7月末	10,564	0.6	388.809	0.6	98.9
8月末	10,556	0.5	388.461	0.5	98.6
9月末	10,520	0.1	387.116	0.1	98.6
10月末	10,508	0.0	386.721	0.0	99.2
11月末	10,533	0.3	387.655	0.3	99.1
12月末	10,510	0.0	386.841	0.1	99.2
(期末) 2022年1月25日	10,475	△0.3	385.520	△0.3	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

## ○運用経過

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の変動要因

基準価額は前期末10,506円から当期末10,475円となり、31円の値下がりとなりました。

国内債券の市況（NOMURA-BPI総合）の下落により、基準価額は下落しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

## 投資環境

## 国内債券市況

国内の長期金利は、前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。期初は、主要海外金利の上昇や、日銀の長期金利変動許容幅の拡大観測の強まりを背景に、長期金利は一時0.1%台後半まで上昇しました。期央には、度重なる緊急事態宣言の発令・延長による景気回復の後ずれ懸念の高まりから、国内の金利水準は低下しました。期末にかけて、主要国中央銀行の金融政策正常化の前倒し観測の影響を受けて、国内の長期金利は水準を切り上げました。

## 当ファンドのポートフォリオ

国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

### 当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は-0.3%となり、ベンチマークの-0.3%とほぼ同水準となりました。

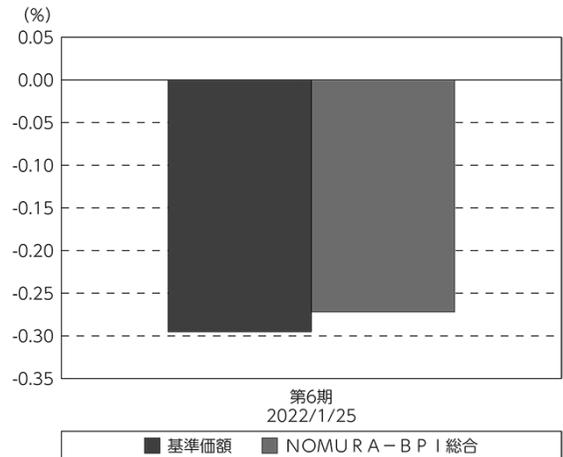
(マイナス要因)

- ・コスト負担(債券等に係る取引費用)が生じたこと

(その他の要因)

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



### ○今後の運用方針

引き続き、主としてNOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,508円です。			

(注) 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・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	58,763,196	23,001,692
	地方債証券	3,085,191	602,947
	特殊債証券	2,532,987	303,645
	社債証券（投資法人債券を含む）	2,820,410	(126,087) 602,221

(注) 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債証券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2021年1月26日～2022年1月25日）

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年1月25日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	97,414,000 ( 900,000)	102,703,182 ( 873,804)	82.9 ( 0.7)	— (—)	53.7 ( 0.7)	19.3 ( —)	9.9 ( —)
地方債証券	6,684,500 ( 6,684,500)	6,899,600 ( 6,899,600)	5.6 ( 5.6)	— (—)	3.8 ( 3.8)	1.4 ( 1.4)	0.3 ( 0.3)
特殊債券 (除く金融債)	7,064,579 ( 7,064,579)	7,278,388 ( 7,278,388)	5.9 ( 5.9)	— (—)	3.8 ( 3.8)	1.7 ( 1.7)	0.3 ( 0.3)
金融債券	400,000 ( 400,000)	399,999 ( 399,999)	0.3 ( 0.3)	— (—)	— ( —)	0.2 ( 0.2)	0.1 ( 0.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	5,700,000 ( 5,700,000)	5,724,692 ( 5,724,692)	4.6 ( 4.6)	— (—)	2.4 ( 2.4)	1.8 ( 1.8)	0.4 ( 0.4)
合 計	117,263,079 ( 20,749,079)	123,005,862 ( 21,176,483)	99.3 (17.1)	— (—)	63.8 (10.8)	24.4 ( 5.1)	11.1 ( 1.2)

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 格付のない債券については、BB格以下組入比率に含まれておりません。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第421回利付国債 (2年)	0.1	400,000	400,772	2023/2/1
第423回利付国債 (2年)	0.005	860,000	860,911	2023/4/1
第424回利付国債 (2年)	0.005	600,000	600,678	2023/5/1
第425回利付国債 (2年)	0.005	350,000	350,423	2023/6/1
第426回利付国債 (2年)	0.005	650,000	650,786	2023/7/1
第427回利付国債 (2年)	0.005	840,000	841,075	2023/8/1
第428回利付国債 (2年)	0.005	420,000	420,567	2023/9/1
第429回利付国債 (2年)	0.005	350,000	350,497	2023/10/1
第430回利付国債 (2年)	0.005	630,000	630,888	2023/11/1
第136回利付国債 (5年)	0.1	1,180,000	1,182,961	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	1,070,000	1,073,177	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	1,490,000	1,494,946	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	1,980,000	1,987,444	2024/3/20
第140回利付国債 (5年)	0.1	1,710,000	1,716,976	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	1,250,000	1,255,637	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	1,220,000	1,226,014	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	1,070,000	1,075,724	2025/3/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	1,360,000	1,367,860	2025/6/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	1,220,000	1,227,356	2025/9/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	1,460,000	1,469,125	2025/12/20
第147回利付国債 (5年)	0.005	980,000	982,440	2026/3/20
第148回利付国債 (5年)	0.005	1,280,000	1,283,097	2026/6/20
第149回利付国債 (5年)	0.005	560,000	561,170	2026/9/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	1,000,000	1,002,120	2023/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	100,000	141,963	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	180,000	247,516	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	110,000	152,194	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	170,000	236,301	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	240,000	322,888	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	240,000	318,528	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	220,000	281,047	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	290,000	346,944	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	480,000	431,980	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	420,000	441,823	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	340,000	346,803	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	360,000	332,402	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	430,000	395,767	2060/3/20
第14回利付国債 (40年)	0.7	330,000	323,535	2061/3/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	411,000	414,226	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	297,000	300,632	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	257,000	260,711	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	90,000	91,002	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	652,000	660,299	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	225,000	228,237	2024/3/20

銘柄		当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
第334回利付国債 (10年)		0.6	261,000	265,196	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)		0.5	345,000	350,216	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)		0.5	210,000	213,475	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)		0.3	170,000	171,825	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)		0.4	631,000	640,345	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)		0.4	385,000	391,160	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)		0.4	934,000	949,878	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)		0.3	440,000	446,274	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)		0.1	380,000	382,443	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)		0.1	780,000	785,155	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)		0.1	960,000	966,259	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)		0.1	1,070,000	1,077,083	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)		0.1	1,310,000	1,319,104	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)		0.1	680,000	684,773	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)		0.1	980,000	987,203	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)		0.1	890,000	896,568	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)		0.1	980,000	987,232	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)		0.1	710,000	715,225	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)		0.1	800,000	805,848	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)		0.1	940,000	946,805	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)		0.1	720,000	725,140	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)		0.1	800,000	805,320	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)		0.1	1,250,000	1,257,637	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)		0.1	1,010,000	1,015,565	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)		0.1	820,000	823,993	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)		0.1	840,000	843,158	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)		0.1	660,000	661,986	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)		0.1	980,000	982,156	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)		0.1	1,050,000	1,050,945	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)		0.1	1,180,000	1,179,445	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)		0.1	950,000	948,185	2031/9/20
第1回利付国債 (30年)		2.8	60,000	72,711	2029/9/20
第7回利付国債 (30年)		2.3	40,000	48,782	2032/5/20
第10回利付国債 (30年)		1.1	30,000	32,997	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)		1.7	80,000	93,528	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	80,000	97,414	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	200,000	241,838	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	60,000	75,606	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	200,000	255,184	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	140,000	179,172	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	160,000	203,492	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	60,000	75,750	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	100,000	126,574	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	100,000	129,612	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	180,000	229,100	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	50,000	65,191	2036/3/20

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額
国債証券		%	千円	千円
第23回利付国債 (30年)		2.5	220,000	287,590
第24回利付国債 (30年)		2.5	170,000	222,793
第25回利付国債 (30年)		2.3	200,000	257,044
第26回利付国債 (30年)		2.4	205,000	266,977
第27回利付国債 (30年)		2.5	295,000	390,547
第28回利付国債 (30年)		2.5	290,000	385,868
第29回利付国債 (30年)		2.4	150,000	198,064
第30回利付国債 (30年)		2.3	190,000	248,719
第31回利付国債 (30年)		2.2	170,000	220,444
第32回利付国債 (30年)		2.3	335,000	441,556
第33回利付国債 (30年)		2.0	290,000	368,288
第34回利付国債 (30年)		2.2	335,000	438,719
第35回利付国債 (30年)		2.0	406,000	518,202
第36回利付国債 (30年)		2.0	375,000	480,142
第37回利付国債 (30年)		1.9	450,000	569,511
第38回利付国債 (30年)		1.8	290,000	362,094
第39回利付国債 (30年)		1.9	300,000	381,183
第40回利付国債 (30年)		1.8	215,000	269,334
第41回利付国債 (30年)		1.7	255,000	314,774
第42回利付国債 (30年)		1.7	190,000	234,754
第43回利付国債 (30年)		1.7	180,000	222,607
第44回利付国債 (30年)		1.7	260,000	321,838
第45回利付国債 (30年)		1.5	290,000	347,086
第46回利付国債 (30年)		1.5	350,000	419,125
第47回利付国債 (30年)		1.6	320,000	390,460
第48回利付国債 (30年)		1.4	353,000	415,357
第49回利付国債 (30年)		1.4	330,000	388,426
第50回利付国債 (30年)		0.8	350,000	365,144
第51回利付国債 (30年)		0.3	350,000	325,230
第52回利付国債 (30年)		0.5	310,000	301,723
第53回利付国債 (30年)		0.6	310,000	308,329
第54回利付国債 (30年)		0.8	360,000	374,500
第55回利付国債 (30年)		0.8	100,000	103,949
第56回利付国債 (30年)		0.8	300,000	311,604
第57回利付国債 (30年)		0.8	330,000	342,490
第58回利付国債 (30年)		0.8	490,000	507,556
第59回利付国債 (30年)		0.7	280,000	282,833
第60回利付国債 (30年)		0.9	280,000	295,562
第61回利付国債 (30年)		0.7	260,000	261,479
第62回利付国債 (30年)		0.5	230,000	219,505
第63回利付国債 (30年)		0.4	300,000	278,349
第64回利付国債 (30年)		0.4	260,000	240,814
第65回利付国債 (30年)		0.4	300,000	277,374
第66回利付国債 (30年)		0.4	340,000	314,537
第67回利付国債 (30年)		0.6	250,000	243,212
第68回利付国債 (30年)		0.6	360,000	350,571

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額
国債証券		%	千円	千円
第69回利付国債 (30年)		0.7	340,000	339,588
第70回利付国債 (30年)		0.7	390,000	388,588
第71回利付国債 (30年)		0.7	360,000	358,686
第72回利付国債 (30年)		0.7	180,000	179,119
第61回利付国債 (20年)		1.0	50,000	50,621
第62回利付国債 (20年)		0.8	80,000	80,978
第63回利付国債 (20年)		1.8	60,000	61,573
第64回利付国債 (20年)		1.9	120,000	123,913
第65回利付国債 (20年)		1.9	380,000	394,231
第67回利付国債 (20年)		1.9	20,000	20,844
第68回利付国債 (20年)		2.2	90,000	94,378
第69回利付国債 (20年)		2.1	60,000	62,790
第70回利付国債 (20年)		2.4	110,000	116,509
第71回利付国債 (20年)		2.2	100,000	105,438
第72回利付国債 (20年)		2.1	210,000	222,064
第73回利付国債 (20年)		2.0	180,000	190,792
第75回利付国債 (20年)		2.1	100,000	106,823
第76回利付国債 (20年)		1.9	100,000	106,192
第77回利付国債 (20年)		2.0	20,000	21,301
第78回利付国債 (20年)		1.9	50,000	53,345
第79回利付国債 (20年)		2.0	20,000	21,406
第80回利付国債 (20年)		2.1	90,000	96,633
第81回利付国債 (20年)		2.0	30,000	32,260
第82回利付国債 (20年)		2.1	170,000	183,428
第83回利付国債 (20年)		2.1	10,000	10,841
第84回利付国債 (20年)		2.0	120,000	129,633
第85回利付国債 (20年)		2.1	150,000	163,395
第86回利付国債 (20年)		2.3	100,000	109,761
第87回利付国債 (20年)		2.2	90,000	98,411
第88回利付国債 (20年)		2.3	185,000	204,114
第89回利付国債 (20年)		2.2	120,000	131,869
第90回利付国債 (20年)		2.2	170,000	187,736
第91回利付国債 (20年)		2.3	80,000	88,719
第92回利付国債 (20年)		2.1	255,000	281,713
第93回利付国債 (20年)		2.0	80,000	88,391
第94回利付国債 (20年)		2.1	140,000	155,405
第95回利付国債 (20年)		2.3	185,000	208,302
第96回利付国債 (20年)		2.1	70,000	78,059
第97回利付国債 (20年)		2.2	130,000	146,404
第98回利付国債 (20年)		2.1	70,000	78,437
第99回利付国債 (20年)		2.1	85,000	95,670
第100回利付国債 (20年)		2.2	151,000	171,625
第101回利付国債 (20年)		2.4	20,000	22,977
第102回利付国債 (20年)		2.4	145,000	167,422
第103回利付国債 (20年)		2.3	100,000	114,823
第104回利付国債 (20年)		2.1	10,000	11,354

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
第105回利付国債	(20年)	2.1	12,000	13,684	2028/9/20
第106回利付国債	(20年)	2.2	40,000	45,881	2028/9/20
第107回利付国債	(20年)	2.1	80,000	91,620	2028/12/20
第108回利付国債	(20年)	1.9	220,000	248,921	2028/12/20
第109回利付国債	(20年)	1.9	80,000	90,860	2029/3/20
第110回利付国債	(20年)	2.1	195,000	224,257	2029/3/20
第111回利付国債	(20年)	2.2	50,000	58,094	2029/6/20
第112回利付国債	(20年)	2.1	205,000	236,668	2029/6/20
第113回利付国債	(20年)	2.1	85,000	98,540	2029/9/20
第114回利付国債	(20年)	2.1	160,000	186,097	2029/12/20
第115回利付国債	(20年)	2.2	100,000	117,099	2029/12/20
第116回利付国債	(20年)	2.2	140,000	164,617	2030/3/20
第117回利付国債	(20年)	2.1	225,000	262,737	2030/3/20
第118回利付国債	(20年)	2.0	131,000	152,360	2030/6/20
第119回利付国債	(20年)	1.8	150,000	171,949	2030/6/20
第120回利付国債	(20年)	1.6	240,000	271,106	2030/6/20
第121回利付国債	(20年)	1.9	205,000	237,455	2030/9/20
第122回利付国債	(20年)	1.8	190,000	218,446	2030/9/20
第123回利付国債	(20年)	2.1	265,000	312,572	2030/12/20
第124回利付国債	(20年)	2.0	200,000	234,136	2030/12/20
第125回利付国債	(20年)	2.2	120,000	143,030	2031/3/20
第126回利付国債	(20年)	2.0	100,000	117,377	2031/3/20
第127回利付国債	(20年)	1.9	130,000	151,411	2031/3/20
第128回利付国債	(20年)	1.9	225,000	262,824	2031/6/20
第129回利付国債	(20年)	1.8	240,000	278,112	2031/6/20
第130回利付国債	(20年)	1.8	220,000	255,499	2031/9/20
第131回利付国債	(20年)	1.7	30,000	34,554	2031/9/20
第132回利付国債	(20年)	1.7	80,000	92,319	2031/12/20
第133回利付国債	(20年)	1.8	355,000	413,138	2031/12/20
第134回利付国債	(20年)	1.8	45,000	52,472	2032/3/20
第135回利付国債	(20年)	1.7	40,000	46,241	2032/3/20
第136回利付国債	(20年)	1.6	50,000	57,302	2032/3/20
第137回利付国債	(20年)	1.7	170,000	196,975	2032/6/20
第138回利付国債	(20年)	1.5	90,000	102,438	2032/6/20
第139回利付国債	(20年)	1.6	370,000	424,922	2032/6/20
第140回利付国債	(20年)	1.7	420,000	487,725	2032/9/20
第141回利付国債	(20年)	1.7	185,000	215,286	2032/12/20
第142回利付国債	(20年)	1.8	390,000	458,019	2032/12/20
第143回利付国債	(20年)	1.6	335,000	386,971	2033/3/20
第144回利付国債	(20年)	1.5	270,000	308,939	2033/3/20
第145回利付国債	(20年)	1.7	545,000	637,159	2033/6/20
第146回利付国債	(20年)	1.7	560,000	655,995	2033/9/20
第147回利付国債	(20年)	1.6	385,000	447,381	2033/12/20
第148回利付国債	(20年)	1.5	545,000	627,889	2034/3/20
第149回利付国債	(20年)	1.5	540,000	623,035	2034/6/20
第150回利付国債	(20年)	1.4	590,000	674,434	2034/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
第151回利付国債 (20年)		1.2	515,000	576,491	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	660,000	739,325	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	440,000	498,916	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	408,000	457,645	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	490,000	536,834	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	630,000	638,114	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	480,000	472,070	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	300,000	307,341	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	370,000	384,185	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	510,000	536,443	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	480,000	497,164	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	290,000	300,086	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	420,000	434,175	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	530,000	539,264	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	430,000	436,948	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	610,000	638,560	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	440,000	445,904	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	530,000	527,456	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)		0.3	410,000	400,397	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)		0.3	540,000	526,321	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)		0.3	400,000	389,092	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)		0.4	360,000	355,784	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)		0.4	510,000	503,099	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)		0.4	570,000	561,233	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)		0.5	490,000	490,421	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)		0.5	530,000	529,533	2041/3/20
第177回利付国債 (20年)		0.4	490,000	479,636	2041/6/20
第178回利付国債 (20年)		0.5	200,000	199,286	2041/9/20
小	計		97,414,000	102,703,182	
<b>地方債証券</b>					
第14回東京都公募公債		2.31	100,000	113,631	2028/3/17
第723回東京都公募公債		0.76	100,000	101,247	2023/9/20
第746回東京都公募公債		0.499	100,000	101,679	2025/6/20
第761回東京都公募公債		0.075	100,000	100,260	2026/9/18
第789回東京都公募公債		0.085	100,000	99,924	2028/12/20
第808回東京都公募公債		0.11	100,000	99,573	2030/9/20
平成28年度第8回北海道公募公債		0.06	100,000	100,180	2026/10/28
第15回神奈川県公募公債 (20年)		1.94	100,000	115,391	2030/11/12
第211回神奈川県公募公債		0.438	100,000	101,256	2024/12/20
第220回神奈川県公募公債		0.08	100,000	100,285	2026/3/19
第164回大阪府公募公債		0.001	100,000	99,977	2024/7/30
第170回大阪府公募公債		0.001	100,000	99,970	2025/4/28
第376回大阪府公募公債		0.82	110,000	111,488	2023/9/27
第444回大阪府公募公債		0.097	100,000	99,796	2029/5/30
第451回大阪府公募公債		0.063	100,000	99,280	2029/12/26
第471回大阪府公募公債		0.083	140,000	138,458	2031/8/29

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
平成27年度第13回京都市公募公債		0.11	100,000	100,409	2026/3/17
平成29年度第4回京都市公募公債		0.19	100,000	100,721	2027/6/21
平成29年度第1回兵庫県公募公債		0.187	100,000	100,694	2027/5/21
令和元年度第2回兵庫県公募公債		0.105	100,000	99,927	2029/5/25
平成25年度第5回静岡県公募公債		0.926	100,000	101,377	2023/7/25
平成26年度第6回静岡県公募公債		0.566	100,000	101,449	2024/8/26
平成30年度第14回静岡県公募公債		0.15	100,000	100,370	2028/12/20
平成22年度第8回愛知県公募公債		1.891	100,000	114,788	2030/9/13
平成28年度第8回愛知県公募公債		0.065	100,000	100,215	2026/8/26
平成29年度第11回愛知県公募公債		0.225	100,000	100,829	2027/10/27
令和3年度第12回愛知県公募公債		0.481	100,000	98,854	2041/11/22
平成29年度第3回広島県公募公債		0.15	100,000	100,390	2027/9/27
平成30年度第1回広島県公募公債		0.2	100,000	100,725	2028/5/25
第8回埼玉県公募公債		2.19	100,000	115,605	2029/9/20
第16回埼玉県公募公債		1.216	100,000	111,419	2035/8/14
平成26年度第6回埼玉県公募公債		0.554	100,000	101,465	2024/9/26
令和3年度第9回埼玉県公募公債		0.344	100,000	99,150	2036/10/31
平成24年度第2回福岡県公募公債		1.635	100,000	114,479	2032/8/16
平成27年度第1回福岡県公募公債		0.578	100,000	101,957	2025/6/26
第11回千葉県公募公債		1.87	100,000	116,239	2031/12/12
第19回千葉県公募公債		1.166	100,000	110,755	2035/10/15
平成29年度第6回千葉県公募公債		0.245	100,000	100,991	2028/1/25
第15回千葉県公募公債		0.235	100,000	99,395	2041/10/15
第123回共同発行市場公募地方債		0.87	100,000	101,216	2023/6/23
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	100,000	101,536	2024/4/25
第156回共同発行市場公募地方債		0.1	100,000	100,370	2026/3/25
第169回共同発行市場公募地方債		0.205	100,000	100,778	2027/4/23
第174回共同発行市場公募地方債		0.145	100,000	100,361	2027/9/24
第181回共同発行市場公募地方債		0.18	100,000	100,594	2028/4/25
第185回共同発行市場公募地方債		0.245	100,000	101,009	2028/8/25
第187回共同発行市場公募地方債		0.269	100,000	101,172	2028/10/25
第191回共同発行市場公募地方債		0.14	100,000	100,243	2029/2/22
第207回共同発行市場公募地方債		0.15	100,000	100,000	2030/6/25
第209回共同発行市場公募地方債		0.125	100,000	99,746	2030/8/23
第216回共同発行市場公募地方債		0.204	100,000	100,263	2031/3/25
第217回共同発行市場公募地方債		0.199	100,000	100,190	2031/4/25
令和3年度第2回堺市公募公債		0.241	100,000	99,359	2041/11/22
平成27年度第1回静岡市公募公債		0.476	100,000	101,804	2025/11/25
第11回大阪市公募公債		2.25	100,000	116,985	2030/3/26
第17回名古屋市公募公債		1.203	100,000	111,152	2035/5/28
令和元年度第4回京都市公募公債		0.141	114,500	114,508	2030/1/28
平成22年度第9回神戸市公募公債		2.09	100,000	117,118	2031/1/24
第26回横浜市公募公債		1.776	100,000	116,411	2033/1/28
第21回横浜市公募公債		1.969	100,000	115,230	2030/7/19
第37回川崎市公募公債		0.224	100,000	99,138	2041/12/20
平成26年度第5回福岡市公募公債		0.539	100,000	101,471	2024/10/28

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
平成27年度第2回広島市公募公債		0.464	100,000	101,796	2025/12/25
平成29年度第3回千葉県公募公債		0.215	120,000	120,961	2027/12/28
平成29年度第5回福井県公募公債		0.19	100,000	100,656	2028/4/27
平成29年度第2回岡山県公募公債		0.235	100,000	100,934	2028/1/31
小	計		6,684,500	6,899,600	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.699	127,000	128,564	2023/10/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	100,000	101,453	2025/11/18
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.13	145,000	145,693	2027/6/14
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.209	213,000	215,061	2028/8/15
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.668	100,000	100,783	2023/3/17
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	114,000	115,804	2024/6/28
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.544	127,000	128,884	2024/9/30
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.466	100,000	101,390	2024/12/27
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.484	100,000	101,675	2025/6/30
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.557	103,000	105,014	2025/7/31
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	133,000	134,678	2026/1/30
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.115	100,000	100,400	2027/1/29
第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.16	100,000	100,673	2027/11/30
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.195	100,000	100,886	2028/2/29
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.12	100,000	100,408	2028/4/28
第375回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.085	100,000	100,104	2029/2/28
第387回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.001	100,000	99,373	2029/7/31
第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		0.668	100,000	100,779	2023/3/15
第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		0.45	100,000	101,423	2025/3/13
第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		0.209	100,000	100,980	2028/9/19
第31回国際協力機構債券		0.53	100,000	101,859	2025/9/19
第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.26	100,000	100,927	2028/1/18
第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.7	100,000	97,360	2050/6/20
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.45	100,000	110,060	2026/3/19
第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.7	100,000	132,102	2036/9/19
第27回道路債券		2.42	100,000	105,153	2024/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.42	150,000	172,020	2028/6/20
第1回地方公共団体金融機構債券		1.864	100,000	124,247	2044/6/28
第13回公営企業債券		2.16	100,000	107,308	2025/6/20
F 82回地方公共団体金融機構債券		1.381	100,000	103,864	2024/11/20
第97回地方公共団体金融機構債券		0.205	200,000	201,446	2027/6/28
F 132回地方公共団体金融機構債券		1.09	100,000	103,789	2025/7/30
F 228回地方公共団体金融機構債券		1.269	100,000	109,751	2031/3/20
F 305回地方公共団体金融機構債券		1.33	100,000	113,258	2040/10/26
F 14回地方公共団体金融機構債券		0.736	100,000	99,022	2051/11/28
F 151回地方公共団体金融機構債券		0.13	100,000	99,126	2031/12/26
第10回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)		2.167	100,000	116,090	2030/3/19
第97回都市再生債券		1.017	100,000	106,558	2029/9/20
第2回一般担保住宅金融公庫債券		2.54	100,000	111,071	2026/6/19
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.06	69,165	68,810	2034/2/10

銘	柄	当期		
		利 率	額 面 金 額	評 価 額
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.14	74,119	73,938
第97回一般担保住宅金融支援機構債券		1.903	100,000	116,325
第117回一般担保住宅金融支援機構債券		1.438	100,000	107,563
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	80,034	80,758
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	80,117	80,623
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	81,750	82,132
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	80,708	81,205
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	84,094	84,449
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	85,302	86,120
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	90,701	89,887
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.3	92,424	92,210
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.35	95,307	95,446
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	97,243	97,723
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	98,250	98,393
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.31	98,640	98,353
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.31	98,821	98,523
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	99,077	98,920
第174回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.38	99,414	99,698
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	99,861	99,964
第223回一般担保住宅金融支援機構債券		0.403	100,000	101,131
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	47,225	47,080
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.18	48,421	48,303
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	51,906	51,822
第334回一般担保住宅金融支援機構債券		0.481	100,000	98,678
第79回東日本高速道路株式会社社債		0.05	100,000	100,043
第87回中日本高速道路株式会社社債		0.06	100,000	100,078
第88回中日本高速道路株式会社社債		0.05	100,000	100,040
第29回西日本高速道路株式会社社債		0.31	100,000	101,089
第52回西日本高速道路株式会社社債		0.03	100,000	99,985
第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.04	100,000	100,048
小 計			7,064,579	7,278,388
<b>金融債券</b>				
第340回信金中金債		0.11	100,000	100,086
第358回信金中金債(5年)		0.01	100,000	99,919
第372回信金中金債		0.06	100,000	100,019
第376回信金中金債		0.05	100,000	99,975
小 計			400,000	399,999
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>				
第543回中部電力株式会社社債		0.12	100,000	99,860
第536回関西電力株式会社社債		0.44	100,000	100,257
第541回関西電力株式会社社債		0.37	100,000	99,768
第413回中国電力株式会社社債		0.4	100,000	100,586
第338回北陸電力株式会社社債		0.3	100,000	99,418
第343回北陸電力株式会社社債		0.29	100,000	99,310
第531回東北電力株式会社社債		0.31	100,000	99,446
第540回東北電力株式会社社債		0.19	100,000	100,050

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
第289回四国電力株式会社社債		0.26	100,000	100,213	2026/11/25
第462回九州電力株式会社社債		0.42	100,000	100,590	2028/5/25
第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債		0.2	100,000	99,125	2029/7/13
第1回ココ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債		0.1	100,000	99,882	2024/9/19
第27回味の素株式会社無担保社債		0.13	100,000	99,439	2028/10/20
第12回日本たばこ産業株式会社社債		0.11	100,000	99,958	2023/9/8
第18回旭化成株式会社無担保社債		0.24	100,000	99,192	2031/12/9
第54回三井化学株式会社無担保社債		0.28	100,000	99,384	2031/12/3
第3回株式会社電通無担保社債		0.424	100,000	100,587	2028/10/25
第20回株式会社オリエントランド無担保社債		0.09	100,000	99,656	2026/9/2
第12回Zホールディングス株式会社無担保社債		0.37	100,000	99,733	2026/7/31
第10回株式会社資生堂無担保社債		0.08	100,000	99,662	2025/2/26
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債		0.375	100,000	100,531	2029/4/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債		0.31	100,000	100,310	2027/5/28
第12回株式会社小松製作所無担保社債		0.11	100,000	99,788	2024/6/6
第18回株式会社日立製作所無担保社債		0.06	100,000	99,926	2023/3/10
第17回J A三井リース株式会社無担保社債		0.19	100,000	99,928	2025/9/4
第5回大日本印刷株式会社無担保社債		0.27	100,000	99,408	2030/3/8
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債		0.535	100,000	100,277	2028/5/31
第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債		0.14	100,000	99,999	2026/4/28
第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債		0.15	100,000	99,999	2026/11/6
第14回N T Tファイナンス株式会社無担保社債		0.001	100,000	99,918	2023/6/20
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債		0.38	100,000	100,760	2030/9/20
第21回N T Tファイナンス株式会社無担保社債		0.1	100,000	99,906	2026/9/18
第71回株式会社ホンダファイナンス無担保社債		0.09	100,000	99,630	2026/9/18
第73回株式会社ホンダファイナンス無担保社債		0.1	100,000	99,635	2026/12/18
第96回トヨタファイナンス株式会社無担保社債		0.06	100,000	99,828	2026/4/15
第81アコム株式会社無担保社債		0.17	100,000	99,521	2026/9/3
第205回オリックス株式会社無担保社債		0.21	100,000	99,405	2028/6/14
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債		0.25	100,000	100,302	2024/9/13
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債		0.22	100,000	100,224	2025/1/23
第5回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債		0.33	100,000	100,000	2029/1/24
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債		0.19	100,000	99,999	2026/11/13
第120回三菱地所株式会社無担保社債		0.24	100,000	100,159	2027/6/18
第134回三菱地所株式会社無担保社債		0.16	100,000	99,558	2028/6/21
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.757	100,000	101,309	2024/1/30
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.41	100,000	101,054	2026/1/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		1.133	100,000	107,274	2047/7/26
第3回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.264	100,000	99,990	2032/1/21
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債		2.262	100,000	116,024	2030/3/12
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債		0.616	100,000	98,799	2041/12/9
第22回K D D I株式会社無担保社債		0.31	100,000	100,381	2028/7/12
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債		0.43	100,000	100,380	2023/7/24
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債		1.01	100,000	103,442	2029/7/10
第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債		0.68	100,000	100,048	2031/8/29
第70回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.09	100,000	99,685	2026/7/13

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債		0.405	100,000	101,002	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債		0.384	100,000	100,102	2024/10/11
第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債		0.32	100,000	100,075	2023/7/6
小	計		5,700,000	5,724,692	
合	計		117,263,079	123,005,862	

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 123,005,862	% 97.2
コール・ローン等、その他	3,553,591	2.8
投資信託財産総額	126,559,453	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

## ○特定資産の価格等の調査

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	126,559,453,870
コール・ローン等	787,812,261
公社債(評価額)	123,005,862,198
未収入金	2,574,734,900
未収利息	181,925,487
前払費用	9,119,024
(B) 負債	2,709,290,134
未払解約金	2,709,288,000
未払利息	2,134
(C) 純資産総額(A-B)	123,850,163,736
元本	118,230,260,033
次期繰越損益金	5,619,903,703
(D) 受益権総口数	118,230,260,033口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,475円

(注) 当ファンドの期首元本額は78,237,839円、期中追加設定元本額は59,135,281,431円、期中一部解約元本額は19,142,299,237円です。

(注) 2022年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな国内債券インデックスファンド	71,437,954,163円
・りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,749,263,845円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	7,499,799,918円
・つみたてバランスファンド	3,810,731,129円
・りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	3,804,685,425円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,602,656,234円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,204,394,830円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,562,608,214円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,950,707,494円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,590,501,113円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,570,801,401円
・Smart-i 国内債券インデックス	1,432,758,696円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	1,080,095,683円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-12	945,152,331円
・りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	889,528,096円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	805,438,240円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	805,079,980円
・DCりそな グローバルバランス	618,510,848円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-06	332,474,172円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	311,267,841円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	275,372,083円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	248,943,469円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	244,955,926円
・FWりそな円建債券アクティブファンド	228,241,199円
・リスクコントロール・オープン	94,120,016円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	80,087,353円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	17,357,885円
・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	15,403,444円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	14,606,006円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	3,937,824円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	2,593,927円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	231,248円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0475円です。

## ○損益の状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	704,185,019
受取利息	705,287,074
支払利息	△ 1,102,055
(B) 有価証券売買損益	△1,144,386,790
売買益	14,178,093
売買損	△1,158,564,883
(C) 保管費用等	△ 5,781
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 440,207,552
(E) 前期繰越損益金	3,962,342,549
(F) 追加信託差損益金	3,042,796,869
(G) 解約差損益金	△ 945,028,163
(H) 計(D+E+F+G)	5,619,903,703
次期繰越損益金(H)	5,619,903,703

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

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

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

## ○お知らせ

---

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

# RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 運用報告書

第5期（決算日 2021年12月10日）  
（2020年12月11日～2021年12月10日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2016年10月6日から無期限です。
運用方針	<p>①主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>②債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p>
主要投資対象	・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"><li>・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限りません。</li><li>・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。</li><li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>

りそなアセットマネジメント 株式会社

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率	純資産総額
	期騰	期落率	期騰	期落率		
(設定日) 2016年10月6日	円 10,000	% —	396.83	% —	% —	百万円 199
1期(2017年12月11日)	9,784	△2.2	387.33	△2.4	100.2	39,151
2期(2018年12月10日)	9,636	△1.5	381.92	△1.4	98.4	58,353
3期(2019年12月10日)	10,237	6.2	406.21	6.4	98.9	151,156
4期(2020年12月10日)	10,723	4.7	429.26	5.7	99.8	204,734
5期(2021年12月10日)	10,478	△2.3	419.63	△2.2	99.2	302,938

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率
	騰落	騰落率	騰落	騰落率	
(期首) 2020年12月10日	円 10,723	% —	429.26	% —	% 99.8
12月末	10,734	0.1	429.65	0.1	99.5
2021年1月末	10,667	△0.5	427.12	△0.5	99.4
2月末	10,353	△3.5	414.29	△3.5	100.7
3月末	10,332	△3.6	413.65	△3.6	100.7
4月末	10,322	△3.7	413.35	△3.7	99.1
5月末	10,340	△3.6	414.03	△3.5	99.7
6月末	10,383	△3.2	415.77	△3.1	98.3
7月末	10,564	△1.5	423.02	△1.5	98.0
8月末	10,567	△1.5	423.13	△1.4	98.6
9月末	10,400	△3.0	416.47	△3.0	99.8
10月末	10,397	△3.0	416.21	△3.0	100.7
11月末	10,460	△2.5	418.85	△2.4	97.3
(期末) 2021年12月10日	10,478	△2.3	419.63	△2.2	99.2

(注) 騰落率は期首比です。

## ○運用経過

(2020年12月11日～2021年12月10日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の変動要因

基準価額は、前期末10,723円から当期末10,478円となり、245円の値下がりとなりました。

先進国債券の市況（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の下落により、基準価額は下落しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

## 投資環境

## 先進国債券市況

先進国の長期金利は、前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。期前半は、新型コロナワクチンの接種進展に伴う景気見通しの改善期待から主要国金利は上昇しました。期後半は、世界的に新型コロナワクチン接種が進む中、感染再拡大に伴う景気下振れ懸念から主要国金利は低下に転じました。その後、経済活動正常化の進展を受けて主要国中央銀行による金融緩和策の調整を模索する動きや高インフレ環境の長期化懸念に伴う市場の早期利上げ観測から主要国金利は上昇する局面もみられましたが、期末にかけて新型コロナ変異株への懸念などから上昇幅を縮小しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

日本を除く先進国の債券を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。また、ベンチマークとの連動性を高めるため、投資対象資産の通貨は対円が為替ヘッジ（為替の売り予約）を行いました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は-2.3%となり、ベンチマークの-2.2%と同等のリターンとなりました。主な差異要因は以下の通りです。

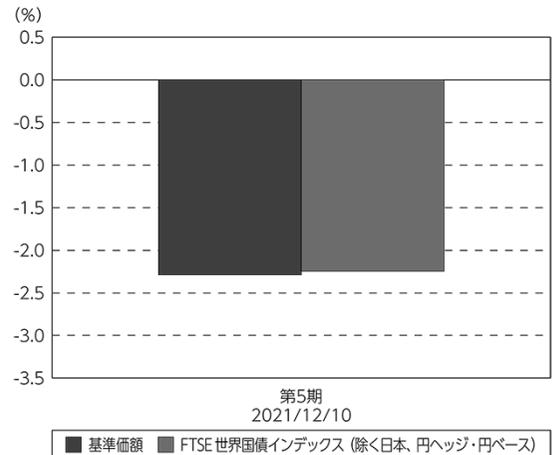
（マイナス要因）

- ・コスト負担（債券等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと

（その他の要因）

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



## ○今後の運用方針

引き続き、主としてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）を行います。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年12月11日～2021年12月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.015	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(2)	(0.015)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	2	0.015	
期中の平均基準価額は、10,459円です。			

(注) 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・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2020年12月11日～2021年12月10日)

## 公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券 千米ドル 734,920	千米ドル 288,546
	カナダ	国債証券 千カナダドル 38,891	千カナダドル 20,961
	メキシコ	国債証券 千メキシコペソ 175,933	千メキシコペソ 85,162
	ユーロ	千ユーロ 89,088	千ユーロ 41,500
	ドイツ	国債証券 107,889	49,253
	イタリア	国債証券 118,522	50,241
	フランス	国債証券 20,952	7,802
	オランダ	国債証券 67,701	26,726
	スペイン	国債証券 22,978	9,366
	ベルギー	国債証券 14,608	5,625
	オーストリア	国債証券 5,293	1,324
	フィンランド	国債証券 7,372	2,312
	アイルランド	国債証券 千英ポンド 56,962	千英ポンド 30,900
	イギリス	国債証券 千スウェーデンクローナ 28,872	千スウェーデンクローナ 11,683
	スウェーデン	国債証券 千ノルウェークローネ 19,831	千ノルウェークローネ 2,063
	ノルウェー	国債証券 千デンマーククローネ 31,607	千デンマーククローネ 13,664
	デンマーク	国債証券 千ポーランドズロチ 20,469	千ポーランドズロチ 8,735
	ポーランド	国債証券 千オーストラリアドル 35,346	千オーストラリアドル 42,610
	オーストラリア	国債証券 千シンガポールドル 6,849	千シンガポールドル 1,925
シンガポール	国債証券 千マレーシアリンギット 22,186	千マレーシアリンギット 5,322	
マレーシア	国債証券 千中国元 72,414	千中国元 -	
中国	国債証券 千イスラエルシェケル 17,539	千イスラエルシェケル 5,070	
イスラエル	国債証券		

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年12月11日～2021年12月10日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2020年12月11日～2021年12月10日）

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

（2021年12月10日現在）

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末								
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
アメリカ	千米ドル 1,230,340	千米ドル 1,259,575	千円 142,924,050	% 47.2	% —	% 21.3	% 17.1	% 8.7	
カナダ	千カナダドル 63,470	千カナダドル 65,353	5,832,137	1.9	—	1.0	0.6	0.4	
メキシコ	千メキシコペソ 374,176	千メキシコペソ 384,407	2,080,413	0.7	—	0.4	0.2	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
ドイツ	147,850	171,838	22,015,889	7.3	—	4.5	1.9	0.9	
イタリア	182,740	206,366	26,439,734	8.7	—	5.3	2.5	0.9	
フランス	200,770	234,537	30,048,883	9.9	—	6.4	2.7	0.8	
オランダ	37,180	44,283	5,673,568	1.9	—	1.3	0.4	0.2	
スペイン	116,940	136,014	17,426,128	5.8	—	3.7	1.6	0.5	
ベルギー	43,960	52,958	6,785,052	2.2	—	1.7	0.4	0.1	
オーストリア	27,740	32,521	4,166,639	1.4	—	0.9	0.3	0.2	
フィンランド	12,800	13,897	1,780,556	0.6	—	0.4	0.2	0.1	
アイルランド	16,420	18,323	2,347,603	0.8	—	0.6	0.2	0.0	
イギリス	千英ポンド 98,420	千英ポンド 122,371	18,350,776	6.1	—	4.7	1.0	0.4	
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 62,910	千スウェーデンクローナ 69,454	870,259	0.3	—	0.1	0.1	0.1	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 52,630	千ノルウェークローネ 53,414	674,086	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーククローネ 63,140	千デンマーククローネ 76,946	1,325,791	0.4	—	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランドズロチ 52,710	千ポーランドズロチ 51,261	1,426,054	0.5	—	0.2	0.2	0.1	
オーストラリア	千オーストラリアドル 57,470	千オーストラリアドル 60,017	4,861,998	1.6	—	1.2	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポールドル 14,710	千シンガポールドル 15,500	1,288,574	0.4	—	0.3	0.1	0.1	
マレーシア	千マレーシアリンギット 51,690	千マレーシアリンギット 53,065	1,427,068	0.5	—	0.3	0.1	0.0	
中国	千中国元 72,010	千中国元 72,540	1,290,626	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
イスラエル	千イスラエルシェケル 35,440	千イスラエルシェケル 39,893	1,460,267	0.5	—	0.2	0.1	0.1	
合 計	—	—	300,496,162	99.2	—	55.1	30.3	13.8	

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 格付のない債券については、BB格以下組入比率に含まれておりません。

## (B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券					
	US TREASURY N/B	2.0	4,180	4,246	481,887	2022/11/30
	US TREASURY N/B	0.125	6,470	6,456	732,609	2022/11/30
	US TREASURY N/B	1.625	3,550	3,596	408,094	2022/12/15
	US TREASURY N/B	2.125	4,440	4,521	513,095	2022/12/31
	US TREASURY N/B	0.125	9,230	9,206	1,044,642	2022/12/31
	US TREASURY N/B	1.5	2,330	2,358	267,622	2023/1/15
	US TREASURY N/B	1.75	2,360	2,396	271,962	2023/1/31
	US TREASURY N/B	2.375	3,830	3,916	444,359	2023/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	4,630	4,717	535,257	2023/2/15
	US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,528	286,960	2023/2/15
	US TREASURY N/B	1.5	2,300	2,330	264,452	2023/2/28
	US TREASURY N/B	2.625	1,500	1,540	174,755	2023/2/28
	US TREASURY N/B	0.125	11,280	11,238	1,275,191	2023/2/28
	US TREASURY N/B	0.5	3,500	3,502	397,416	2023/3/15
	US TREASURY N/B	1.5	2,140	2,169	246,117	2023/3/31
	US TREASURY N/B	2.5	2,350	2,411	273,680	2023/3/31
	US TREASURY N/B	0.125	10,900	10,850	1,231,170	2023/3/31
	US TREASURY N/B	0.25	3,500	3,489	395,927	2023/4/15
	US TREASURY N/B	1.625	1,650	1,675	190,172	2023/4/30
	US TREASURY N/B	2.75	3,740	3,855	437,531	2023/4/30
	US TREASURY N/B	0.125	5,630	5,600	635,517	2023/4/30
	US TREASURY N/B	1.75	4,410	4,488	509,296	2023/5/15
	US TREASURY N/B	0.125	3,900	3,878	440,069	2023/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,060	2,093	237,532	2023/5/31
	US TREASURY N/B	2.75	1,800	1,858	210,915	2023/5/31
	US TREASURY N/B	0.125	10,300	10,237	1,161,618	2023/5/31
	US TREASURY N/B	0.25	7,750	7,716	875,545	2023/6/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,160	3,200	363,201	2023/6/30
	US TREASURY N/B	2.625	2,220	2,291	260,011	2023/6/30
	US TREASURY N/B	0.125	6,090	6,050	686,605	2023/6/30
	US TREASURY N/B	0.125	8,650	8,589	974,633	2023/7/15
	US TREASURY N/B	1.25	2,100	2,123	240,902	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.75	3,890	4,028	457,062	2023/7/31
	US TREASURY N/B	0.125	7,960	7,899	896,411	2023/7/31
	US TREASURY N/B	2.5	3,500	3,610	409,695	2023/8/15
	US TREASURY N/B	0.125	6,000	5,951	675,341	2023/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	2,320	2,350	266,664	2023/8/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,130	2,207	250,490	2023/8/31
	US TREASURY N/B	0.125	6,850	6,791	770,680	2023/8/31
	US TREASURY N/B	0.125	6,940	6,879	780,622	2023/9/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,330	3,374	382,858	2023/9/30
	US TREASURY N/B	0.25	7,130	7,080	803,384	2023/9/30
	US TREASURY N/B	0.125	4,050	4,011	455,128	2023/10/15

銘柄		当期				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券					
	US TREASURY N/B	1.625	3,800	3,869	439,060	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.875	1,800	1,874	212,719	2023/10/31
	US TREASURY N/B	0.375	5,980	5,948	674,945	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	5,480	5,698	646,639	2023/11/15
	US TREASURY N/B	0.25	5,000	4,959	562,718	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,420	2,488	282,331	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.875	3,180	3,316	376,296	2023/11/30
	US TREASURY N/B	0.5	5,000	4,982	565,311	2023/11/30
	US TREASURY N/B	0.125	6,600	6,523	740,213	2023/12/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,920	1,980	224,679	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.625	2,700	2,804	318,252	2023/12/31
	US TREASURY N/B	0.125	5,470	5,399	612,728	2024/1/15
	US TREASURY N/B	2.25	3,410	3,519	399,326	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.5	3,980	4,128	468,440	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	4,880	5,090	577,656	2024/2/15
	US TREASURY N/B	0.125	5,950	5,869	666,047	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	1,800	1,853	210,341	2024/2/29
	US TREASURY N/B	2.375	3,360	3,478	394,707	2024/2/29
	US TREASURY N/B	0.25	9,000	8,891	1,008,863	2024/3/15
	US TREASURY N/B	2.125	5,350	5,511	625,418	2024/3/31
	US TREASURY N/B	0.375	6,080	6,017	682,756	2024/4/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,320	2,384	270,582	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,940	3,038	344,821	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.5	8,040	8,361	948,755	2024/5/15
	US TREASURY N/B	0.25	6,060	5,973	677,850	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	3,140	3,228	366,344	2024/5/31
	US TREASURY N/B	0.25	8,300	8,173	927,416	2024/6/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,380	2,448	277,791	2024/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	6,540	6,685	758,587	2024/6/30
	US TREASURY N/B	0.375	8,890	8,774	995,587	2024/7/15
	US TREASURY N/B	2.125	1,480	1,527	173,373	2024/7/31
	US TREASURY N/B	1.75	4,000	4,090	464,198	2024/7/31
	US TREASURY N/B	2.375	6,110	6,347	720,194	2024/8/15
	US TREASURY N/B	0.375	7,920	7,810	886,290	2024/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	2,640	2,707	307,248	2024/8/31
	US TREASURY N/B	1.25	2,480	2,502	283,944	2024/8/31
	US TREASURY N/B	0.375	7,800	7,684	871,928	2024/9/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,520	2,603	295,416	2024/9/30
	US TREASURY N/B	1.5	3,760	3,818	433,296	2024/9/30
	US TREASURY N/B	0.625	7,000	6,939	787,370	2024/10/15
	US TREASURY N/B	2.25	2,420	2,509	284,776	2024/10/31
	US TREASURY N/B	1.5	8,500	8,631	979,376	2024/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	5,460	5,662	642,537	2024/11/15
	US TREASURY N/B	0.75	6,000	5,963	676,644	2024/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	1,300	1,343	152,477	2024/11/30

銘柄		当期					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		債還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	国債証券						
	US TREASURY N/B	1.5	4,880	4,954	562,190	2024/11/30	
	US TREASURY N/B	2.25	2,400	2,490	282,593	2024/12/31	
	US TREASURY N/B	1.75	3,800	3,886	441,005	2024/12/31	
	US TREASURY N/B	2.5	2,620	2,739	310,878	2025/1/31	
	US TREASURY N/B	1.375	3,290	3,325	377,355	2025/1/31	
	US TREASURY N/B	2.0	10,850	11,173	1,267,843	2025/2/15	
	US TREASURY N/B	2.75	2,300	2,424	275,110	2025/2/28	
	US TREASURY N/B	1.125	4,140	4,150	470,976	2025/2/28	
	US TREASURY N/B	2.625	2,530	2,658	301,657	2025/3/31	
	US TREASURY N/B	0.5	4,340	4,262	483,649	2025/3/31	
	US TREASURY N/B	2.875	2,540	2,691	305,450	2025/4/30	
	US TREASURY N/B	0.375	6,090	5,946	674,782	2025/4/30	
	US TREASURY N/B	2.125	5,950	6,156	698,539	2025/5/15	
	US TREASURY N/B	2.875	2,470	2,619	297,240	2025/5/31	
	US TREASURY N/B	0.25	5,320	5,165	586,116	2025/5/31	
	US TREASURY N/B	2.75	2,120	2,241	254,322	2025/6/30	
	US TREASURY N/B	0.25	4,650	4,511	511,888	2025/6/30	
	US TREASURY N/B	2.875	2,250	2,390	271,244	2025/7/31	
	US TREASURY N/B	0.25	8,720	8,446	958,421	2025/7/31	
	US TREASURY N/B	2.0	6,300	6,496	737,144	2025/8/15	
	US TREASURY N/B	2.75	1,890	2,000	227,015	2025/8/31	
	US TREASURY N/B	0.25	7,000	6,771	768,351	2025/8/31	
	US TREASURY N/B	3.0	2,430	2,598	294,850	2025/9/30	
	US TREASURY N/B	0.25	6,020	5,821	660,515	2025/9/30	
	US TREASURY N/B	3.0	2,200	2,353	267,098	2025/10/31	
	US TREASURY N/B	0.25	7,180	6,930	786,422	2025/10/31	
	US TREASURY N/B	2.25	5,570	5,800	658,173	2025/11/15	
	US TREASURY N/B	2.875	1,720	1,834	208,136	2025/11/30	
	US TREASURY N/B	0.375	5,800	5,618	637,482	2025/11/30	
	US TREASURY N/B	2.625	1,700	1,798	204,050	2025/12/31	
	US TREASURY N/B	0.375	7,500	7,259	823,732	2025/12/31	
	US TREASURY N/B	2.625	2,820	2,983	338,559	2026/1/31	
	US TREASURY N/B	0.375	6,190	5,982	678,866	2026/1/31	
	US TREASURY N/B	1.625	6,860	6,978	791,843	2026/2/15	
	US TREASURY N/B	2.5	1,700	1,790	203,169	2026/2/28	
	US TREASURY N/B	0.5	7,720	7,494	850,427	2026/2/28	
	US TREASURY N/B	2.25	2,670	2,786	316,148	2026/3/31	
	US TREASURY N/B	0.75	7,970	7,813	886,551	2026/3/31	
	US TREASURY N/B	2.375	2,500	2,623	297,736	2026/4/30	
	US TREASURY N/B	0.75	7,700	7,544	856,039	2026/4/30	
	US TREASURY N/B	1.625	5,420	5,512	625,529	2026/5/15	
	US TREASURY N/B	2.125	2,700	2,807	318,516	2026/5/31	
	US TREASURY N/B	0.75	8,400	8,225	933,377	2026/5/31	
	US TREASURY N/B	1.875	2,700	2,777	315,177	2026/6/30	
	US TREASURY N/B	0.875	11,500	11,315	1,283,955	2026/6/30	

銘柄	当	期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ						
国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2,600	2,675	303,607	2026/7/31
	US TREASURY N/B	0.625	6,800	6,610	750,075	2026/7/31
	US TREASURY N/B	1.5	5,830	5,900	669,489	2026/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,280	3,301	374,638	2026/8/31
	US TREASURY N/B	0.75	7,970	7,790	883,972	2026/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,360	2,402	272,611	2026/9/30
	US TREASURY N/B	0.875	3,550	3,487	395,737	2026/9/30
	US TREASURY N/B	1.625	2,520	2,566	291,171	2026/10/31
	US TREASURY N/B	1.125	11,000	10,932	1,240,466	2026/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	5,740	5,946	674,775	2026/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,550	2,596	294,615	2026/11/30
	US TREASURY N/B	1.25	9,000	8,997	1,020,910	2026/11/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,720	2,787	316,330	2026/12/31
	US TREASURY N/B	1.5	2,270	2,298	260,756	2027/1/31
	US TREASURY N/B	2.25	5,530	5,800	658,201	2027/2/15
	US TREASURY N/B	1.125	1,000	992	112,649	2027/2/28
	US TREASURY N/B	0.625	2,800	2,706	307,117	2027/3/31
	US TREASURY N/B	0.5	4,180	4,009	454,961	2027/4/30
	US TREASURY N/B	2.375	4,620	4,882	554,006	2027/5/15
	US TREASURY N/B	0.5	5,600	5,362	608,450	2027/5/31
	US TREASURY N/B	0.5	4,280	4,095	464,660	2027/6/30
	US TREASURY N/B	0.375	5,970	5,669	643,359	2027/7/31
	US TREASURY N/B	2.25	5,550	5,830	661,541	2027/8/15
	US TREASURY N/B	0.5	4,290	4,094	464,614	2027/8/31
	US TREASURY N/B	0.375	6,870	6,502	737,851	2027/9/30
	US TREASURY N/B	0.5	5,010	4,768	541,126	2027/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	5,240	5,511	625,333	2027/11/15
	US TREASURY N/B	0.625	6,100	5,846	663,452	2027/11/30
	US TREASURY N/B	0.625	7,920	7,582	860,418	2027/12/31
	US TREASURY N/B	0.75	16,620	16,012	1,816,919	2028/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	5,850	6,332	718,588	2028/2/15
	US TREASURY N/B	1.125	7,000	6,902	783,244	2028/2/29
	US TREASURY N/B	1.25	9,190	9,115	1,034,316	2028/3/31
	US TREASURY N/B	1.25	7,730	7,665	869,790	2028/4/30
	US TREASURY N/B	2.875	6,090	6,648	754,439	2028/5/15
	US TREASURY N/B	1.25	6,500	6,442	731,072	2028/5/31
	US TREASURY N/B	1.25	7,200	7,131	809,260	2028/6/30
	US TREASURY N/B	1.0	5,800	5,649	641,055	2028/7/31
	US TREASURY N/B	2.875	8,390	9,183	1,042,045	2028/8/15
	US TREASURY N/B	1.125	4,700	4,613	523,465	2028/8/31
	US TREASURY N/B	1.25	8,600	8,507	965,397	2028/9/30
	US TREASURY N/B	1.375	6,080	6,062	687,903	2028/10/31
	US TREASURY N/B	3.125	6,480	7,219	819,154	2028/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	6,610	7,159	812,442	2029/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	6,010	6,416	728,119	2029/5/15

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	6,460	6,563	744,784	2029/8/15
		US TREASURY N/B	1.75	3,990	4,091	464,293	2029/11/15
		US TREASURY N/B	1.5	6,300	6,336	719,021	2030/2/15
		US TREASURY N/B	6.25	780	1,080	122,626	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	10,120	9,467	1,074,258	2030/5/15
		US TREASURY N/B	0.625	13,650	12,743	1,445,950	2030/8/15
		US TREASURY N/B	0.875	13,620	12,976	1,472,414	2030/11/15
		US TREASURY N/B	5.375	3,210	4,309	489,047	2031/2/15
		US TREASURY N/B	1.125	13,740	13,366	1,516,751	2031/2/15
		US TREASURY N/B	1.625	13,850	14,059	1,595,378	2031/5/15
		US TREASURY N/B	1.25	11,510	11,281	1,280,122	2031/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	5,000	4,949	561,632	2031/11/15
		US TREASURY N/B	4.5	540	750	85,129	2036/2/15
		US TREASURY N/B	5.0	130	191	21,682	2037/5/15
		US TREASURY N/B	4.375	690	959	108,926	2038/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	2,620	3,698	419,680	2038/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	960	1,214	137,768	2039/2/15
		US TREASURY N/B	4.25	1,290	1,781	202,159	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	1,340	1,905	216,249	2039/8/15
		US TREASURY N/B	4.375	1,600	2,245	254,782	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	780	1,127	127,968	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	950	1,339	152,005	2040/5/15
		US TREASURY N/B	1.125	4,640	4,083	463,382	2040/5/15
		US TREASURY N/B	3.875	1,410	1,871	212,327	2040/8/15
		US TREASURY N/B	1.125	8,140	7,136	809,777	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	1,220	1,694	192,330	2040/11/15
		US TREASURY N/B	1.375	7,710	7,048	799,773	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	1,800	2,660	301,933	2041/2/15
		US TREASURY N/B	1.875	8,360	8,304	942,309	2041/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	1,130	1,600	181,573	2041/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	9,140	9,635	1,093,346	2041/5/15
		US TREASURY N/B	3.75	1,080	1,417	160,819	2041/8/15
		US TREASURY N/B	1.75	10,560	10,258	1,163,980	2041/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,040	1,256	142,518	2041/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	5,000	5,076	575,993	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,340	1,621	183,992	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	1,070	1,272	144,400	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	1,640	1,877	213,088	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	1,860	2,129	241,690	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	2,240	2,712	307,767	2043/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,710	4,331	491,453	2043/5/15
		US TREASURY N/B	3.625	2,430	3,167	359,421	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.75	2,260	3,003	340,797	2043/11/15
		US TREASURY N/B	3.625	3,140	4,106	465,981	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	2,710	3,427	388,944	2044/5/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	3,930	4,796	544,269	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,800	3,357	380,924	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,380	3,740	424,413	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,500	3,010	341,584	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,590	3,062	347,464	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	1,820	2,200	249,730	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,070	3,414	387,474	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	4,010	4,465	506,648	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	4,250	4,526	513,650	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,220	2,647	300,375	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,940	3,587	407,059	2047/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,190	3,903	442,903	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	3,430	4,025	456,719	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	4,050	4,757	539,849	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	4,650	5,726	649,795	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	4,500	5,673	643,753	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	5,090	6,281	712,793	2048/8/15
		US TREASURY N/B	3.375	5,530	7,298	828,138	2048/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	5,280	6,550	743,261	2049/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	5,190	6,308	715,823	2049/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	5,670	6,126	695,146	2049/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	5,740	6,373	723,166	2049/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	6,190	6,353	720,981	2050/2/15
		US TREASURY N/B	1.25	6,850	5,881	667,419	2050/5/15
		US TREASURY N/B	1.375	8,500	7,528	854,293	2050/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	8,570	8,066	915,269	2050/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	9,100	9,090	1,031,487	2051/2/15
		US TREASURY N/B	2.375	9,440	10,530	1,194,925	2051/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	9,200	9,469	1,074,507	2051/8/15
		US TREASURY N/B	1.875	4,770	4,779	542,351	2051/11/15
小		計				142,924,050	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	GOV OF CANADA	0.25	2,250	2,236	199,564	2023/2/1
		GOV OF CANADA	1.75	2,160	2,184	194,938	2023/3/1
		GOV OF CANADA	0.25	2,100	2,082	185,817	2023/5/1
		GOV OF CANADA	1.5	1,330	1,341	119,758	2023/6/1
		GOV OF CANADA	0.25	1,960	1,938	172,970	2023/8/1
		GOV OF CANADA	2.0	2,580	2,626	234,365	2023/9/1
		GOV OF CANADA	0.5	1,640	1,624	145,011	2023/11/1
		GOV OF CANADA	0.75	1,140	1,132	101,054	2024/2/1
		GOV OF CANADA	2.25	840	861	76,906	2024/3/1
		GOV OF CANADA	0.25	2,310	2,266	202,302	2024/4/1
		GOV OF CANADA	2.5	1,180	1,219	108,863	2024/6/1
		GOV OF CANADA	1.5	1,110	1,121	100,049	2024/9/1
		GOV OF CANADA	0.75	1,110	1,097	97,930	2024/10/1

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
国債証券	GOV OF CANADA		1.25	840	840	75,021	2025/3/1
	GOV OF CANADA		2.25	1,250	1,293	115,433	2025/6/1
	GOV OF CANADA		0.5	3,490	3,392	302,790	2025/9/1
	GOV OF CANADA		0.25	2,260	2,161	192,892	2026/3/1
	GOV OF CANADA		1.5	850	856	76,459	2026/6/1
	GOV OF CANADA		1.0	2,790	2,743	244,869	2026/9/1
	GOV OF CANADA		1.25	910	903	80,647	2027/3/1
	GOV OF CANADA		1.0	920	902	80,570	2027/6/1
	GOV OF CANADA		2.0	1,000	1,039	92,746	2028/6/1
	GOV OF CANADA		5.75	670	876	78,230	2029/6/1
	GOV OF CANADA		2.25	1,340	1,422	126,944	2029/6/1
	GOV OF CANADA		1.25	3,850	3,797	338,862	2030/6/1
	GOV OF CANADA		0.5	3,750	3,446	307,566	2030/12/1
	GOV OF CANADA		1.5	4,140	4,140	369,504	2031/6/1
	GOV OF CANADA		1.5	1,520	1,512	134,990	2031/12/1
	GOV OF CANADA		5.75	1,020	1,457	130,089	2033/6/1
	GOV OF CANADA		5.0	690	995	88,828	2037/6/1
	GOV OF CANADA		4.0	960	1,309	116,856	2041/6/1
	GOV OF CANADA		3.5	1,270	1,688	150,699	2045/12/1
	GOV OF CANADA		2.75	1,210	1,452	129,643	2048/12/1
GOV OF CANADA		2.0	4,740	4,943	441,155	2051/12/1	
GOV OF CANADA		1.75	1,550	1,515	135,261	2053/12/1	
GOV OF CANADA		2.75	740	924	82,537	2064/12/1	
小 計						5,832,137	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	UNITED MEXICAN STATE		6.75	21,430	21,529	116,518	2023/3/9
	UNITED MEXICAN STATE		8.0	29,990	30,608	165,650	2023/12/7
	UNITED MEXICAN STATE		8.0	35,200	36,041	195,055	2024/9/5
	UNITED MEXICAN STATE		10.0	33,220	35,842	193,981	2024/12/5
	UNITED MEXICAN STATE		5.75	45,780	43,523	235,547	2026/3/5
	UNITED MEXICAN STATE		5.5	880	815	4,413	2027/3/4
	UNITED MEXICAN STATE		7.5	42,840	43,416	234,970	2027/6/3
	UNITED MEXICAN STATE		8.5	36,240	38,800	209,989	2029/5/31
	UNITED MEXICAN STATE		7.75	33,576	34,488	186,652	2031/5/29
	UNITED MEXICAN STATE		7.75	9,600	9,851	53,316	2034/11/23
	UNITED MEXICAN STATE		10.0	8,200	10,015	54,204	2036/11/20
	UNITED MEXICAN STATE		8.5	28,000	29,958	162,137	2038/11/18
	UNITED MEXICAN STATE		7.75	22,210	22,076	119,478	2042/11/13
	UNITED MEXICAN STATE		8.0	27,010	27,438	148,497	2047/11/7
	小 計						2,080,413
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	—	2,110	2,125	272,315	2022/12/15
		GOV OF GERMANY	1.5	2,340	2,402	307,814	2023/2/15
		GOV OF GERMANY	—	2,130	2,149	275,385	2023/3/10
		GOV OF GERMANY	—	2,460	2,485	318,380	2023/4/14

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	1.5	2,510	2,591	332,072	2023/5/15
		GOV OF GERMANY	—	1,810	1,829	234,454	2023/6/16
		GOV OF GERMANY	2.0	2,650	2,773	355,390	2023/8/15
		GOV OF GERMANY	—	1,460	1,478	189,483	2023/9/15
		GOV OF GERMANY	—	2,500	2,535	324,851	2023/10/13
		GOV OF GERMANY	—	1,300	1,318	168,946	2023/12/15
		GOV OF GERMANY	1.75	3,730	3,935	504,255	2024/2/15
		GOV OF GERMANY	—	3,130	3,184	408,014	2024/4/5
		GOV OF GERMANY	1.5	2,940	3,101	397,380	2024/5/15
		GOV OF GERMANY	1.0	2,810	2,941	376,906	2024/8/15
		GOV OF GERMANY	—	2,760	2,817	361,027	2024/10/18
		GOV OF GERMANY	0.5	2,940	3,054	391,371	2025/2/15
		GOV OF GERMANY	—	2,450	2,507	321,239	2025/4/11
		GOV OF GERMANY	1.0	4,000	4,250	544,512	2025/8/15
		GOV OF GERMANY	—	3,320	3,406	436,445	2025/10/10
		GOV OF GERMANY	—	350	359	46,101	2025/10/10
		GOV OF GERMANY	0.5	3,660	3,838	491,742	2026/2/15
		GOV OF GERMANY	—	2,980	3,063	392,525	2026/4/10
		GOV OF GERMANY	—	3,670	3,780	484,419	2026/8/15
		GOV OF GERMANY	—	2,590	2,665	341,563	2026/10/9
		GOV OF GERMANY	0.25	3,490	3,644	466,897	2027/2/15
		GOV OF GERMANY	6.5	1,680	2,362	302,745	2027/7/4
		GOV OF GERMANY	0.5	3,790	4,024	515,599	2027/8/15
		GOV OF GERMANY	—	2,810	2,905	372,194	2027/11/15
		GOV OF GERMANY	5.625	1,730	2,401	307,681	2028/1/4
		GOV OF GERMANY	0.5	3,640	3,880	497,216	2028/2/15
		GOV OF GERMANY	4.75	1,630	2,214	283,713	2028/7/4
		GOV OF GERMANY	0.25	3,220	3,391	434,471	2028/8/15
		GOV OF GERMANY	—	2,520	2,609	334,341	2028/11/15
		GOV OF GERMANY	0.25	3,160	3,336	427,445	2029/2/15
		GOV OF GERMANY	—	3,380	3,508	449,451	2029/8/15
		GOV OF GERMANY	6.25	1,150	1,795	230,071	2030/1/4
		GOV OF GERMANY	—	3,040	3,157	404,592	2030/2/15
		GOV OF GERMANY	—	4,220	4,383	561,676	2030/8/15
		GOV OF GERMANY	—	700	731	93,668	2030/8/15
		GOV OF GERMANY	5.5	2,070	3,225	413,245	2031/1/4
		GOV OF GERMANY	—	3,490	3,620	463,882	2031/2/15
		GOV OF GERMANY	—	3,830	3,964	507,927	2031/8/15
		GOV OF GERMANY	—	750	778	99,764	2031/8/15
		GOV OF GERMANY	4.75	2,850	4,735	606,720	2034/7/4
		GOV OF GERMANY	—	3,260	3,357	430,194	2035/5/15
		GOV OF GERMANY	—	2,320	2,383	305,360	2036/5/15
		GOV OF GERMANY	4.0	3,160	5,256	673,420	2037/1/4
		GOV OF GERMANY	4.25	2,360	4,281	548,598	2039/7/4
		GOV OF GERMANY	4.75	2,430	4,752	608,891	2040/7/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	3.25	2,450	4,247	544,188	2042/7/4
		GOV OF GERMANY	2.5	3,460	5,622	720,403	2044/7/4
		GOV OF GERMANY	2.5	3,840	6,418	822,363	2046/8/15
		GOV OF GERMANY	1.25	3,580	4,891	626,748	2048/8/15
		GOV OF GERMANY	—	4,260	4,356	558,212	2050/8/15
		GOV OF GERMANY	—	980	995	127,599	2052/8/15
イタリア	国債証券	GOV OF ITALY	0.05	1,790	1,800	230,706	2023/1/15
		GOV OF ITALY	0.95	1,830	1,861	238,519	2023/3/1
		GOV OF ITALY	0.95	2,290	2,330	298,643	2023/3/15
		GOV OF ITALY	4.5	1,940	2,074	265,830	2023/5/1
		GOV OF ITALY	0.6	2,320	2,358	302,163	2023/6/15
		GOV OF ITALY	4.75	2,510	2,723	348,993	2023/8/1
		GOV OF ITALY	0.3	2,260	2,287	293,066	2023/8/15
		GOV OF ITALY	2.45	2,490	2,616	335,196	2023/10/1
		GOV OF ITALY	0.65	2,210	2,251	288,496	2023/10/15
		GOV OF ITALY	—	4,870	4,897	627,462	2024/1/15
		GOV OF ITALY	—	1,520	1,527	195,666	2024/1/30
		GOV OF ITALY	4.5	1,980	2,189	280,501	2024/3/1
		GOV OF ITALY	—	2,070	2,079	266,441	2024/4/15
		GOV OF ITALY	1.85	1,900	1,995	255,621	2024/5/15
		GOV OF ITALY	1.75	2,020	2,118	271,479	2024/7/1
		GOV OF ITALY	—	1,350	1,354	173,486	2024/8/15
		GOV OF ITALY	3.75	2,190	2,422	310,428	2024/9/1
		GOV OF ITALY	1.45	2,050	2,143	274,632	2024/11/15
		GOV OF ITALY	2.5	2,030	2,186	280,190	2024/12/1
		GOV OF ITALY	0.35	3,110	3,151	403,731	2025/2/1
		GOV OF ITALY	5.0	2,350	2,733	350,186	2025/3/1
		GOV OF ITALY	1.45	2,400	2,520	322,970	2025/5/15
		GOV OF ITALY	1.5	2,260	2,378	304,748	2025/6/1
		GOV OF ITALY	1.85	2,010	2,141	274,323	2025/7/1
		GOV OF ITALY	2.5	2,340	2,564	328,570	2025/11/15
		GOV OF ITALY	2.0	2,310	2,487	318,637	2025/12/1
		GOV OF ITALY	0.5	2,400	2,437	312,310	2026/2/1
		GOV OF ITALY	4.5	2,660	3,152	403,944	2026/3/1
		GOV OF ITALY	—	3,430	3,405	436,317	2026/4/1
		GOV OF ITALY	1.6	2,400	2,552	327,075	2026/6/1
		GOV OF ITALY	2.1	2,170	2,360	302,436	2026/7/15
		GOV OF ITALY	—	1,800	1,780	228,069	2026/8/1
GOV OF ITALY	1.25	3,120	3,276	419,740	2026/12/1		
GOV OF ITALY	0.85	2,280	2,344	300,382	2027/1/15		
GOV OF ITALY	2.2	2,580	2,841	364,056	2027/6/1		
GOV OF ITALY	2.05	2,000	2,186	280,136	2027/8/1		
GOV OF ITALY	0.95	3,910	4,030	516,445	2027/9/15		
GOV OF ITALY	6.5	2,580	3,493	447,566	2027/11/1		
GOV OF ITALY	2.0	3,190	3,490	447,185	2028/2/1		

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	GOV OF ITALY	0.25	2,590	2,550	326,735	2028/3/15
		GOV OF ITALY	0.5	2,210	2,202	282,204	2028/7/15
		GOV OF ITALY	4.75	2,660	3,400	435,641	2028/9/1
		GOV OF ITALY	2.8	2,550	2,941	376,846	2028/12/1
		GOV OF ITALY	0.45	500	493	63,203	2029/2/15
		GOV OF ITALY	3.0	2,640	3,102	397,492	2029/8/1
		GOV OF ITALY	5.25	3,280	4,445	569,528	2029/11/1
		GOV OF ITALY	3.5	3,490	4,266	546,598	2030/3/1
		GOV OF ITALY	1.35	2,770	2,901	371,707	2030/4/1
		GOV OF ITALY	0.95	2,810	2,840	363,919	2030/8/1
		GOV OF ITALY	1.65	2,620	2,798	358,501	2030/12/1
		GOV OF ITALY	0.9	2,810	2,808	359,875	2031/4/1
		GOV OF ITALY	6.0	3,850	5,641	722,809	2031/5/1
		GOV OF ITALY	0.6	2,300	2,227	285,400	2031/8/1
		GOV OF ITALY	0.95	2,180	2,171	278,221	2031/12/1
		GOV OF ITALY	1.65	2,790	2,968	380,376	2032/3/1
		GOV OF ITALY	0.95	1,000	988	126,682	2032/6/1
		GOV OF ITALY	5.75	2,530	3,787	485,280	2033/2/1
		GOV OF ITALY	2.45	2,550	2,920	374,146	2033/9/1
		GOV OF ITALY	5.0	2,740	3,969	508,559	2034/8/1
		GOV OF ITALY	3.35	1,870	2,347	300,711	2035/3/1
		GOV OF ITALY	1.45	1,660	1,698	217,556	2036/3/1
		GOV OF ITALY	2.25	1,810	2,038	261,112	2036/9/1
		GOV OF ITALY	4.0	3,090	4,211	539,613	2037/2/1
		GOV OF ITALY	0.95	1,770	1,673	214,409	2037/3/1
		GOV OF ITALY	2.95	2,110	2,594	332,466	2038/9/1
		GOV OF ITALY	5.0	2,270	3,516	450,537	2039/8/1
		GOV OF ITALY	3.1	1,800	2,255	288,941	2040/3/1
		GOV OF ITALY	5.0	2,430	3,819	489,354	2040/9/1
		GOV OF ITALY	1.8	2,710	2,813	360,418	2041/3/1
		GOV OF ITALY	4.75	1,910	3,036	388,979	2044/9/1
		GOV OF ITALY	1.5	2,040	1,978	253,441	2045/4/30
GOV OF ITALY	3.25	2,030	2,649	339,438	2046/9/1		
GOV OF ITALY	2.7	2,250	2,691	344,777	2047/3/1		
GOV OF ITALY	3.45	2,080	2,820	361,379	2048/3/1		
GOV OF ITALY	3.85	1,590	2,307	295,672	2049/9/1		
GOV OF ITALY	2.45	1,870	2,132	273,180	2050/9/1		
GOV OF ITALY	1.7	1,840	1,794	229,899	2051/9/1		
GOV OF ITALY	2.8	1,260	1,463	187,501	2067/3/1		
GOV OF ITALY	2.15	560	548	70,245	2072/3/1		
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	—	2,120	2,139	274,130	2023/2/25
		GOV OF FRANCE	—	6,190	6,247	800,474	2023/3/25
		GOV OF FRANCE	1.75	6,720	6,961	891,869	2023/5/25
		GOV OF FRANCE	4.25	4,330	4,734	606,559	2023/10/25
		GOV OF FRANCE	—	4,100	4,160	532,990	2024/2/25

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	—	5,420	5,502	705,015	2024/3/25
		GOV OF FRANCE	2.25	4,180	4,480	573,979	2024/5/25
		GOV OF FRANCE	1.75	4,620	4,945	633,611	2024/11/25
		GOV OF FRANCE	—	6,150	6,264	802,665	2025/3/25
		GOV OF FRANCE	0.5	5,250	5,444	697,515	2025/5/25
		GOV OF FRANCE	6.0	3,250	4,091	524,182	2025/10/25
		GOV OF FRANCE	1.0	5,060	5,367	687,642	2025/11/25
		GOV OF FRANCE	—	5,240	5,347	685,148	2026/2/25
		GOV OF FRANCE	3.5	5,800	6,823	874,254	2026/4/25
		GOV OF FRANCE	0.5	5,000	5,219	668,664	2026/5/25
		GOV OF FRANCE	0.25	5,010	5,184	664,253	2026/11/25
		GOV OF FRANCE	—	1,830	1,867	239,326	2027/2/25
		GOV OF FRANCE	1.0	4,950	5,335	683,571	2027/5/25
		GOV OF FRANCE	2.75	6,110	7,257	929,819	2027/10/25
		GOV OF FRANCE	0.75	6,360	6,809	872,409	2028/5/25
		GOV OF FRANCE	0.75	6,480	6,954	891,059	2028/11/25
		GOV OF FRANCE	5.5	4,750	6,801	871,407	2029/4/25
		GOV OF FRANCE	0.5	5,230	5,521	707,414	2029/5/25
		GOV OF FRANCE	—	5,340	5,421	694,664	2029/11/25
		GOV OF FRANCE	2.5	5,930	7,291	934,154	2030/5/25
		GOV OF FRANCE	—	6,430	6,487	831,212	2030/11/25
		GOV OF FRANCE	1.5	7,080	8,136	1,042,433	2031/5/25
		GOV OF FRANCE	—	5,580	5,580	714,935	2031/11/25
		GOV OF FRANCE	5.75	4,140	6,747	864,448	2032/10/25
		GOV OF FRANCE	1.25	4,660	5,288	677,566	2034/5/25
		GOV OF FRANCE	4.75	3,510	5,660	725,198	2035/4/25
		GOV OF FRANCE	1.25	5,210	5,953	762,702	2036/5/25
		GOV OF FRANCE	4.0	3,480	5,629	721,228	2038/10/25
		GOV OF FRANCE	1.75	3,580	4,479	573,873	2039/6/25
		GOV OF FRANCE	0.5	2,920	2,965	379,973	2040/5/25
		GOV OF FRANCE	4.5	4,280	7,583	971,602	2041/4/25
		GOV OF FRANCE	0.5	1,510	1,514	194,056	2044/6/25
GOV OF FRANCE	3.25	3,150	5,078	650,595	2045/5/25		
GOV OF FRANCE	2.0	3,700	5,013	642,348	2048/5/25		
GOV OF FRANCE	1.5	3,950	4,863	623,067	2050/5/25		
GOV OF FRANCE	0.75	3,760	3,848	493,080	2052/5/25		
GOV OF FRANCE	0.75	1,100	1,116	143,079	2053/5/25		
GOV OF FRANCE	4.0	2,370	4,732	606,318	2055/4/25		
GOV OF FRANCE	4.0	2,040	4,290	549,756	2060/4/25		
GOV OF FRANCE	1.75	1,790	2,436	312,124	2066/5/25		
GOV OF FRANCE	0.5	1,110	956	122,496	2072/5/25		
オランダ	国債証券	GOV OF NETHERLANDS	3.75	1,490	1,564	200,479	2023/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	1.75	2,140	2,226	285,321	2023/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	—	1,830	1,857	237,919	2024/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.0	1,970	2,108	270,086	2024/7/15

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	GOV OF NETHERLANDS	0.25	2,360	2,434	311,854	2025/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.5	2,360	2,479	317,700	2026/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	—	1,910	1,960	251,208	2027/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.75	1,950	2,089	267,757	2027/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	5.5	1,490	2,043	261,845	2028/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.75	1,990	2,150	275,569	2028/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	—	840	861	110,418	2029/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.25	1,400	1,466	187,889	2029/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	—	1,610	1,652	211,673	2030/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	—	1,250	1,277	163,624	2031/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.5	2,200	2,862	366,722	2033/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	4.0	1,940	3,153	404,023	2037/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	—	1,220	1,226	157,098	2038/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.5	1,200	1,326	169,907	2040/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	3.75	2,280	4,035	516,987	2042/1/15
GOV OF NETHERLANDS	2.75	2,550	4,330	554,775	2047/1/15		
GOV OF NETHERLANDS	—	1,200	1,176	150,706	2052/1/15		
スペイン	国債証券	GOV OF SPAIN	5.4	2,270	2,426	310,870	2023/1/31
		GOV OF SPAIN	—	2,860	2,883	369,496	2023/4/30
		GOV OF SPAIN	0.35	2,810	2,853	365,587	2023/7/30
		GOV OF SPAIN	4.4	2,590	2,837	363,503	2023/10/31
		GOV OF SPAIN	4.8	1,790	1,997	255,904	2024/1/31
		GOV OF SPAIN	3.8	2,750	3,038	389,242	2024/4/30
		GOV OF SPAIN	—	2,220	2,245	287,646	2024/5/31
		GOV OF SPAIN	0.25	2,420	2,466	315,960	2024/7/30
		GOV OF SPAIN	2.75	3,310	3,624	464,339	2024/10/31
		GOV OF SPAIN	—	2,470	2,503	320,755	2025/1/31
		GOV OF SPAIN	1.6	2,940	3,143	402,746	2025/4/30
		GOV OF SPAIN	4.65	2,610	3,092	396,229	2025/7/30
		GOV OF SPAIN	2.15	2,870	3,153	404,038	2025/10/31
		GOV OF SPAIN	—	2,690	2,722	348,795	2026/1/31
		GOV OF SPAIN	1.95	2,870	3,152	403,954	2026/4/30
		GOV OF SPAIN	5.9	2,490	3,208	411,101	2026/7/30
		GOV OF SPAIN	1.3	3,060	3,295	422,155	2026/10/31
		GOV OF SPAIN	—	1,130	1,138	145,926	2027/1/31
		GOV OF SPAIN	1.5	2,670	2,912	373,211	2027/4/30
		GOV OF SPAIN	0.8	2,490	2,615	335,080	2027/7/30
		GOV OF SPAIN	1.45	2,790	3,042	389,756	2027/10/31
		GOV OF SPAIN	—	1,610	1,611	206,474	2028/1/31
		GOV OF SPAIN	1.4	3,230	3,523	451,425	2028/4/30
		GOV OF SPAIN	1.4	2,990	3,270	418,992	2028/7/30
		GOV OF SPAIN	5.15	2,040	2,763	353,996	2028/10/31
GOV OF SPAIN	6.0	2,640	3,772	483,366	2029/1/31		
GOV OF SPAIN	1.45	2,730	3,007	385,296	2029/4/30		
GOV OF SPAIN	0.6	3,320	3,446	441,540	2029/10/31		

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	GOV OF SPAIN	0.5	2,720	2,793	357,874	2030/4/30
		GOV OF SPAIN	1.95	2,890	3,322	425,686	2030/7/30
		GOV OF SPAIN	1.25	2,870	3,124	400,252	2030/10/31
		GOV OF SPAIN	0.1	2,760	2,708	347,029	2031/4/30
		GOV OF SPAIN	0.5	2,390	2,419	309,956	2031/10/31
		GOV OF SPAIN	5.75	2,650	4,142	530,703	2032/7/30
		GOV OF SPAIN	2.35	2,270	2,746	351,904	2033/7/30
		GOV OF SPAIN	1.85	2,720	3,147	403,220	2035/7/30
		GOV OF SPAIN	4.2	2,610	3,947	505,788	2037/1/31
		GOV OF SPAIN	0.85	1,900	1,915	245,400	2037/7/30
		GOV OF SPAIN	4.9	2,070	3,550	454,833	2040/7/30
		GOV OF SPAIN	1.2	2,340	2,459	315,157	2040/10/31
		GOV OF SPAIN	4.7	2,470	4,199	538,043	2041/7/30
		GOV OF SPAIN	1.0	760	771	98,867	2042/7/30
		GOV OF SPAIN	5.15	1,740	3,255	417,131	2044/10/31
		GOV OF SPAIN	2.9	2,330	3,301	422,986	2046/10/31
GOV OF SPAIN	2.7	1,860	2,569	329,257	2048/10/31		
GOV OF SPAIN	1.0	2,570	2,482	318,035	2050/10/31		
GOV OF SPAIN	3.45	1,770	2,849	365,130	2066/7/30		
GOV OF SPAIN	1.45	590	557	71,476	2071/10/31		
ベルギー	国債証券	GOV OF BELGIUM	2.25	1,540	1,610	206,316	2023/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.2	1,160	1,179	151,170	2023/10/22
		GOV OF BELGIUM	2.6	1,710	1,854	237,572	2024/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.5	1,660	1,717	219,982	2024/10/22
		GOV OF BELGIUM	0.8	2,950	3,097	396,885	2025/6/22
		GOV OF BELGIUM	4.5	1,200	1,466	187,942	2026/3/28
		GOV OF BELGIUM	1.0	2,020	2,160	276,815	2026/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.8	1,980	2,118	271,443	2027/6/22
		GOV OF BELGIUM	—	1,080	1,106	141,788	2027/10/22
		GOV OF BELGIUM	5.5	1,770	2,444	313,189	2028/3/28
		GOV OF BELGIUM	0.8	2,230	2,402	307,783	2028/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.9	2,030	2,210	283,189	2029/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.1	1,510	1,545	198,047	2030/6/22
		GOV OF BELGIUM	1.0	2,100	2,320	297,307	2031/6/22
		GOV OF BELGIUM	—	1,800	1,803	231,065	2031/10/22
		GOV OF BELGIUM	4.0	1,130	1,607	205,937	2032/3/28
		GOV OF BELGIUM	1.25	1,430	1,635	209,546	2033/4/22
		GOV OF BELGIUM	3.0	1,200	1,631	209,016	2034/6/22
		GOV OF BELGIUM	5.0	2,270	3,725	477,329	2035/3/28
		GOV OF BELGIUM	1.45	1,030	1,208	154,822	2037/6/22
GOV OF BELGIUM	1.9	980	1,228	157,431	2038/6/22		
GOV OF BELGIUM	0.4	990	982	125,858	2040/6/22		
GOV OF BELGIUM	4.25	1,970	3,361	430,716	2041/3/28		
GOV OF BELGIUM	3.75	1,260	2,158	276,523	2045/6/22		
GOV OF BELGIUM	1.6	1,270	1,565	200,553	2047/6/22		

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	GOV OF BELGIUM	1.7	1,520	1,929	247,269	2050/6/22
		GOV OF BELGIUM	2.25	700	1,027	131,633	2057/6/22
		GOV OF BELGIUM	2.15	880	1,320	169,209	2066/6/22
		GOV OF BELGIUM	0.65	590	536	68,704	2071/6/22
オーストリア	国債証券	GOV OF AUSTRIA	—	790	797	102,167	2023/4/20
		GOV OF AUSTRIA	—	1,160	1,173	150,328	2023/7/15
		GOV OF AUSTRIA	1.75	1,580	1,653	211,816	2023/10/20
		GOV OF AUSTRIA	—	1,460	1,484	190,225	2024/7/15
		GOV OF AUSTRIA	1.65	1,210	1,291	165,497	2024/10/21
		GOV OF AUSTRIA	—	700	712	91,341	2025/4/20
		GOV OF AUSTRIA	1.2	1,340	1,433	183,603	2025/10/20
		GOV OF AUSTRIA	4.85	1,030	1,271	162,962	2026/3/15
		GOV OF AUSTRIA	0.75	1,840	1,952	250,091	2026/10/20
		GOV OF AUSTRIA	0.5	1,350	1,419	181,850	2027/4/20
		GOV OF AUSTRIA	6.25	1,220	1,687	216,241	2027/7/15
		GOV OF AUSTRIA	0.75	1,360	1,455	186,514	2028/2/20
		GOV OF AUSTRIA	0.5	1,380	1,457	186,779	2029/2/20
		GOV OF AUSTRIA	—	1,330	1,349	172,956	2030/2/20
		GOV OF AUSTRIA	—	1,370	1,382	177,112	2031/2/20
		GOV OF AUSTRIA	2.4	1,030	1,334	171,027	2034/5/23
		GOV OF AUSTRIA	0.25	1,110	1,119	143,460	2036/10/20
		GOV OF AUSTRIA	4.15	1,620	2,620	335,736	2037/3/15
		GOV OF AUSTRIA	—	420	400	51,267	2040/10/20
		GOV OF AUSTRIA	3.15	780	1,284	164,541	2044/6/20
GOV OF AUSTRIA	1.5	980	1,263	161,881	2047/2/20		
GOV OF AUSTRIA	0.75	710	778	99,783	2051/3/20		
GOV OF AUSTRIA	3.8	460	1,011	129,600	2062/1/26		
GOV OF AUSTRIA	1.5	310	439	56,362	2086/11/2		
GOV OF AUSTRIA	2.1	730	1,271	162,945	2117/9/20		
GOV OF AUSTRIA	0.85	470	472	60,543	2120/6/30		
フィンランド	国債証券	GOV OF FINLAND	1.5	660	680	87,173	2023/4/15
		GOV OF FINLAND	—	660	667	85,575	2023/9/15
		GOV OF FINLAND	2.0	610	649	83,220	2024/4/15
		GOV OF FINLAND	—	460	468	60,043	2024/9/15
		GOV OF FINLAND	4.0	520	607	77,801	2025/7/4
		GOV OF FINLAND	0.875	670	707	90,651	2025/9/15
		GOV OF FINLAND	0.5	840	878	112,597	2026/4/15
		GOV OF FINLAND	—	500	511	65,545	2026/9/15
		GOV OF FINLAND	0.5	910	959	122,970	2027/9/15
		GOV OF FINLAND	2.75	470	568	72,866	2028/7/4
		GOV OF FINLAND	0.5	510	539	69,107	2028/9/15
		GOV OF FINLAND	0.5	1,240	1,315	168,574	2029/9/15
		GOV OF FINLAND	—	360	365	46,835	2030/9/15
		GOV OF FINLAND	0.75	490	531	68,148	2031/4/15
GOV OF FINLAND	0.125	870	889	113,963	2031/9/15		

銘柄			当 期 末				
			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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	GOV OF FINLAND	1.125	390	444	56,903	2034/4/15
		GOV OF FINLAND	0.125	580	580	74,371	2036/4/15
		GOV OF FINLAND	0.25	470	476	61,064	2040/9/15
		GOV OF FINLAND	2.625	680	1,023	131,189	2042/7/4
		GOV OF FINLAND	1.375	470	608	77,999	2047/4/15
		GOV OF FINLAND	0.125	440	421	53,950	2052/4/15
アイルランド	国債証券	GOV OF IRELAND	3.9	890	941	120,627	2023/3/20
		GOV OF IRELAND	3.4	920	1,005	128,775	2024/3/18
		GOV OF IRELAND	5.4	1,350	1,613	206,733	2025/3/13
		GOV OF IRELAND	1.0	1,370	1,459	186,952	2026/5/15
		GOV OF IRELAND	0.2	1,050	1,080	138,409	2027/5/15
		GOV OF IRELAND	0.9	890	956	122,604	2028/5/15
		GOV OF IRELAND	1.1	1,260	1,378	176,560	2029/5/15
		GOV OF IRELAND	2.4	1,160	1,408	180,470	2030/5/15
		GOV OF IRELAND	0.2	1,080	1,103	141,333	2030/10/18
		GOV OF IRELAND	1.35	760	859	110,070	2031/3/18
		GOV OF IRELAND	—	1,150	1,143	146,466	2031/10/18
		GOV OF IRELAND	1.3	700	790	101,242	2033/5/15
		GOV OF IRELAND	0.4	590	600	76,917	2035/5/15
		GOV OF IRELAND	1.7	730	878	112,598	2037/5/15
		GOV OF IRELAND	0.55	460	465	59,637	2041/4/22
		GOV OF IRELAND	2.0	1,210	1,608	206,139	2045/2/18
GOV OF IRELAND	1.5	850	1,030	132,063	2050/5/15		
小 計						116,684,055	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY	0.125	3,920	3,915	587,208	2023/1/31	
	UK TREASURY	0.75	2,390	2,408	361,161	2023/7/22	
	UK TREASURY	2.25	1,950	2,015	302,178	2023/9/7	
	UK TREASURY	0.125	3,730	3,706	555,856	2024/1/31	
	UK TREASURY	1.0	1,920	1,949	292,421	2024/4/22	
	UK TREASURY	2.75	1,330	1,415	212,214	2024/9/7	
	UK TREASURY	0.25	1,420	1,409	211,395	2025/1/31	
	UK TREASURY	5.0	1,040	1,192	178,840	2025/3/7	
	UK TREASURY	0.625	2,500	2,521	378,070	2025/6/7	
	UK TREASURY	2.0	1,250	1,322	198,308	2025/9/7	
	UK TREASURY	0.125	2,160	2,131	319,624	2026/1/30	
	UK TREASURY	1.5	1,470	1,539	230,910	2026/7/22	
	UK TREASURY	0.375	2,110	2,092	313,807	2026/10/22	
	UK TREASURY	1.25	1,610	1,676	251,370	2027/7/22	
	UK TREASURY	4.25	1,480	1,802	270,323	2027/12/7	
	UK TREASURY	0.125	1,520	1,482	222,255	2028/1/31	
	UK TREASURY	1.625	1,520	1,630	244,490	2028/10/22	
	UK TREASURY	6.0	1,210	1,660	249,069	2028/12/7	
	UK TREASURY	0.5	830	822	123,314	2029/1/31	
	UK TREASURY	0.875	1,590	1,620	243,040	2029/10/22	

銘	柄	当 期 末				
		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		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	国債証券	UK TREASURY	2,660	2,589	388,302	2030/10/22
		UK TREASURY	1,430	1,938	290,657	2030/12/7
		UK TREASURY	3,150	3,004	450,573	2031/7/31
		UK TREASURY	2,060	2,783	417,455	2032/6/7
		UK TREASURY	1,320	1,331	199,740	2033/7/31
		UK TREASURY	1,350	1,946	291,888	2034/9/7
		UK TREASURY	2,780	2,674	401,017	2035/7/31
		UK TREASURY	1,900	2,758	413,684	2036/3/7
		UK TREASURY	2,310	2,586	387,827	2037/9/7
		UK TREASURY	1,710	2,753	412,949	2038/12/7
		UK TREASURY	850	873	131,009	2039/1/31
		UK TREASURY	1,680	2,601	390,179	2039/9/7
		UK TREASURY	1,520	2,401	360,121	2040/12/7
		UK TREASURY	2,880	3,040	456,027	2041/10/22
		UK TREASURY	2,170	3,659	548,760	2042/12/7
		UK TREASURY	2,560	3,744	561,548	2044/1/22
		UK TREASURY	2,410	3,697	554,422	2045/1/22
		UK TREASURY	1,420	1,400	209,945	2046/1/31
		UK TREASURY	1,860	3,237	485,442	2046/12/7
		UK TREASURY	2,310	2,618	392,715	2047/7/22
		UK TREASURY	1,320	1,593	238,949	2049/1/22
		UK TREASURY	1,500	2,752	412,719	2049/12/7
		UK TREASURY	1,120	1,055	158,282	2050/10/22
		UK TREASURY	980	1,074	161,148	2051/7/31
		UK TREASURY	1,350	2,404	360,652	2052/7/22
		UK TREASURY	700	832	124,854	2053/7/31
		UK TREASURY	1,790	2,201	330,169	2054/10/22
		UK TREASURY	1,890	3,834	574,947	2055/12/7
		UK TREASURY	2,330	3,045	456,707	2057/7/22
		UK TREASURY	1,410	2,956	443,429	2060/1/22
		UK TREASURY	1,720	1,620	242,996	2061/10/22
		UK TREASURY	1,750	2,978	446,616	2065/7/22
		UK TREASURY	1,830	3,935	590,113	2068/7/22
		UK TREASURY	1,450	2,127	319,051	2071/10/22
小	計				18,350,776	
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		
	国債証券	GOV OF SWEDEN	12,400	12,822	160,663	2023/11/13
		GOV OF SWEDEN	9,680	10,576	132,520	2025/5/12
		GOV OF SWEDEN	9,470	9,981	125,063	2026/11/12
		GOV OF SWEDEN	7,110	7,463	93,523	2028/5/12
		GOV OF SWEDEN	8,240	8,726	109,344	2029/11/12
		GOV OF SWEDEN	6,300	6,314	79,114	2031/5/12
		GOV OF SWEDEN	4,350	5,322	66,693	2032/6/1
		GOV OF SWEDEN	5,360	8,247	103,335	2039/3/30
小	計				870,259	

銘柄	当 期 末					
	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		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	GOV OF NORWAY	2.0	9,520	9,651	121,798	2023/5/24
	GOV OF NORWAY	3.0	7,370	7,667	96,761	2024/3/14
	GOV OF NORWAY	1.75	6,490	6,581	83,055	2025/3/13
	GOV OF NORWAY	1.5	3,380	3,398	42,889	2026/2/19
	GOV OF NORWAY	1.75	7,630	7,760	97,938	2027/2/17
	GOV OF NORWAY	2.0	3,330	3,443	43,461	2028/4/26
	GOV OF NORWAY	1.75	5,420	5,534	69,848	2029/9/6
	GOV OF NORWAY	1.375	5,980	5,933	74,885	2030/8/19
	GOV OF NORWAY	1.25	3,510	3,442	43,447	2031/9/17
小 計					674,086	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	GOV OF DENMARK	1.5	6,620	6,893	118,782	2023/11/15
	GOV OF DENMARK	—	4,310	4,379	75,457	2024/11/15
	GOV OF DENMARK	1.75	6,640	7,226	124,511	2025/11/15
	GOV OF DENMARK	0.5	8,370	8,791	151,471	2027/11/15
	GOV OF DENMARK	0.5	11,550	12,224	210,624	2029/11/15
	GOV OF DENMARK	—	5,860	5,916	101,938	2031/11/15
	GOV OF DENMARK	4.5	13,990	25,508	439,504	2039/11/15
	GOV OF DENMARK	0.25	5,800	6,007	103,501	2052/11/15
小 計					1,325,791	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	GOV OF POLAND	2.5	5,650	5,641	156,939	2023/1/25
	GOV OF POLAND	4.0	4,140	4,222	117,474	2023/10/25
	GOV OF POLAND	2.5	3,910	3,866	107,563	2024/4/25
	GOV OF POLAND	2.25	3,560	3,486	96,988	2024/10/25
	GOV OF POLAND	0.75	3,450	3,194	88,867	2025/4/25
	GOV OF POLAND	3.25	4,450	4,465	124,232	2025/7/25
	GOV OF POLAND	2.5	5,820	5,646	157,070	2026/7/25
	GOV OF POLAND	0.25	1,490	1,298	36,128	2026/10/25
	GOV OF POLAND	2.5	5,090	4,902	136,369	2027/7/25
	GOV OF POLAND	2.75	4,420	4,314	120,015	2028/4/25
	GOV OF POLAND	5.75	1,120	1,313	36,536	2029/4/25
	GOV OF POLAND	2.75	5,800	5,634	156,744	2029/10/25
	GOV OF POLAND	1.25	3,810	3,275	91,125	2030/10/25
小 計					1,426,054	
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		
国債証券	GOV OF AUSTRALIA	5.5	2,500	2,673	216,614	2023/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.75	1,610	1,688	136,762	2024/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	0.25	2,990	2,929	237,314	2024/11/21
	GOV OF AUSTRALIA	3.25	2,340	2,503	202,768	2025/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	0.25	2,100	2,018	163,548	2025/11/21
	GOV OF AUSTRALIA	4.25	2,200	2,474	200,459	2026/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	0.5	2,490	2,391	193,754	2026/9/21
	GOV OF AUSTRALIA	4.75	2,280	2,674	216,648	2027/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.75	2,310	2,480	200,935	2027/11/21

銘柄	当 期 末					
	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		
国債証券	GOV OF AUSTRALIA	2.25	1,860	1,944	157,542	2028/5/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.75	1,430	1,544	125,089	2028/11/21
	GOV OF AUSTRALIA	3.25	2,270	2,536	205,498	2029/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.75	2,290	2,486	201,394	2029/11/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.5	3,000	3,207	259,812	2030/5/21
	GOV OF AUSTRALIA	1.0	3,240	3,062	248,112	2030/12/21
	GOV OF AUSTRALIA	1.5	2,860	2,817	228,280	2031/6/21
	GOV OF AUSTRALIA	1.0	3,680	3,452	279,696	2031/11/21
	GOV OF AUSTRALIA	1.25	2,670	2,555	207,041	2032/5/21
	GOV OF AUSTRALIA	1.75	2,440	2,446	198,215	2032/11/21
	GOV OF AUSTRALIA	4.5	1,970	2,535	205,371	2033/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.75	1,000	1,102	89,299	2035/6/21
	GOV OF AUSTRALIA	3.75	1,370	1,678	136,014	2037/4/21
	GOV OF AUSTRALIA	3.25	1,230	1,423	115,289	2039/6/21
	GOV OF AUSTRALIA	2.75	1,690	1,816	147,192	2041/5/21
	GOV OF AUSTRALIA	3.0	1,610	1,800	145,824	2047/3/21
	GOV OF AUSTRALIA	1.75	2,040	1,771	143,514	2051/6/21
小 計					4,861,998	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	GOV OF SINGAPORE	1.75	1,100	1,113	92,586	2023/2/1
	GOV OF SINGAPORE	2.75	910	937	77,972	2023/7/1
	GOV OF SINGAPORE	2.0	710	726	60,403	2024/2/1
	GOV OF SINGAPORE	3.0	1,090	1,148	95,503	2024/9/1
	GOV OF SINGAPORE	2.375	870	906	75,338	2025/6/1
	GOV OF SINGAPORE	0.5	700	680	56,602	2025/11/1
	GOV OF SINGAPORE	2.125	820	848	70,538	2026/6/1
	GOV OF SINGAPORE	3.5	870	958	79,700	2027/3/1
	GOV OF SINGAPORE	2.625	620	660	54,895	2028/5/1
	GOV OF SINGAPORE	2.875	790	857	71,261	2029/7/1
	GOV OF SINGAPORE	2.875	1,200	1,309	108,833	2030/9/1
	GOV OF SINGAPORE	1.625	330	327	27,263	2031/7/1
	GOV OF SINGAPORE	3.375	710	819	68,153	2033/9/1
	GOV OF SINGAPORE	2.25	930	965	80,252	2036/8/1
	GOV OF SINGAPORE	2.375	380	403	33,563	2039/7/1
	GOV OF SINGAPORE	2.75	620	697	57,965	2042/4/1
	GOV OF SINGAPORE	2.75	890	1,007	83,788	2046/3/1
	GOV OF SINGAPORE	1.875	890	857	71,248	2050/3/1
	GOV OF SINGAPORE	1.875	280	273	22,702	2051/10/1
小 計					1,288,574	
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		
国債証券	GOV OF MALAYSIA	3.48	2,600	2,640	71,020	2023/3/15
	GOV OF MALAYSIA	3.757	820	837	22,518	2023/4/20
	GOV OF MALAYSIA	3.8	1,530	1,568	42,189	2023/8/17
	GOV OF MALAYSIA	3.478	1,560	1,590	42,765	2024/6/14
	GOV OF MALAYSIA	4.181	1,470	1,523	40,966	2024/7/15

銘	柄	当 期 末					
		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		
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		
	国債証券	GOV OF MALAYSIA	4.059	1,260	1,305	35,101	2024/9/30
		GOV OF MALAYSIA	3.882	730	754	20,299	2025/3/14
		GOV OF MALAYSIA	3.955	3,030	3,147	84,636	2025/9/15
		GOV OF MALAYSIA	4.392	1,510	1,592	42,838	2026/4/15
		GOV OF MALAYSIA	3.906	1,190	1,231	33,110	2026/7/15
		GOV OF MALAYSIA	3.9	2,960	3,064	82,403	2026/11/30
		GOV OF MALAYSIA	3.892	700	724	19,477	2027/3/15
		GOV OF MALAYSIA	3.502	1,790	1,815	48,836	2027/5/31
		GOV OF MALAYSIA	3.899	1,890	1,956	52,618	2027/11/16
		GOV OF MALAYSIA	3.733	3,130	3,181	85,552	2028/6/15
		GOV OF MALAYSIA	3.885	2,460	2,523	67,854	2029/8/15
		GOV OF MALAYSIA	4.498	1,690	1,803	48,498	2030/4/15
		GOV OF MALAYSIA	2.632	1,850	1,716	46,163	2031/4/15
		GOV OF MALAYSIA	4.232	1,730	1,810	48,690	2031/6/30
		GOV OF MALAYSIA	3.844	1,410	1,422	38,243	2033/4/15
		GOV OF MALAYSIA	4.642	1,100	1,184	31,859	2033/11/7
		GOV OF MALAYSIA	3.828	2,100	2,091	56,239	2034/7/5
		GOV OF MALAYSIA	4.254	2,360	2,455	66,039	2035/5/31
		GOV OF MALAYSIA	4.762	1,610	1,749	47,048	2037/4/7
		GOV OF MALAYSIA	4.893	890	972	26,162	2038/6/8
		GOV OF MALAYSIA	3.757	2,730	2,602	69,995	2040/5/22
		GOV OF MALAYSIA	4.935	860	934	25,121	2043/9/30
		GOV OF MALAYSIA	4.736	1,180	1,242	33,405	2046/3/15
		GOV OF MALAYSIA	4.921	1,280	1,389	37,378	2048/7/6
		GOV OF MALAYSIA	4.065	2,270	2,232	60,032	2050/6/15
小	計					1,427,068	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	GOV OF CHINA	2.57	7,000	7,009	124,710	2023/5/20
		GOV OF CHINA	2.36	3,820	3,812	67,830	2023/7/2
		GOV OF CHINA	2.88	8,600	8,661	154,107	2023/11/5
		GOV OF CHINA	2.47	4,300	4,286	76,256	2024/9/2
		GOV OF CHINA	1.99	7,800	7,628	135,723	2025/4/9
		GOV OF CHINA	2.69	8,300	8,293	147,547	2026/8/12
		GOV OF CHINA	2.85	8,200	8,215	146,170	2027/6/4
		GOV OF CHINA	3.28	5,470	5,612	99,850	2027/12/3
		GOV OF CHINA	2.68	5,200	5,088	90,524	2030/5/21
		GOV OF CHINA	3.27	5,500	5,653	100,587	2030/11/19
		GOV OF CHINA	3.81	4,220	4,491	79,911	2050/9/14
		GOV OF CHINA	3.72	3,600	3,788	67,405	2051/4/12
小	計					1,290,626	
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券	GOV OF ISRAEL	1.25	1,720	1,741	63,736	2022/11/30
		GOV OF ISRAEL	4.25	2,150	2,332	85,383	2023/3/31
		GOV OF ISRAEL	0.15	2,310	2,314	84,732	2023/7/31
		GOV OF ISRAEL	1.5	2,470	2,541	93,038	2023/11/30

銘柄	当 期 末					
	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		
イスラエル	%	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル	千円		
国債証券	GOV OF ISRAEL	3.75	2,370	2,628	96,220	2024/3/31
	GOV OF ISRAEL	0.4	900	905	33,149	2024/10/31
	GOV OF ISRAEL	0.5	3,390	3,425	125,383	2025/4/30
	GOV OF ISRAEL	1.75	1,840	1,946	71,240	2025/8/31
	GOV OF ISRAEL	0.5	860	870	31,866	2026/2/27
	GOV OF ISRAEL	6.25	1,970	2,538	92,924	2026/10/30
	GOV OF ISRAEL	2.0	2,350	2,568	94,023	2027/3/31
	GOV OF ISRAEL	2.25	2,190	2,442	89,421	2028/9/28
	GOV OF ISRAEL	1.0	3,290	3,334	122,058	2030/3/31
	GOV OF ISRAEL	1.5	2,130	2,092	76,590	2037/5/31
	GOV OF ISRAEL	5.5	2,430	4,061	148,653	2042/1/31
	GOV OF ISRAEL	3.75	3,070	4,148	151,845	2047/3/31
小 計					1,460,267	
合 計					300,496,162	

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

## ○投資信託財産の構成

(2021年12月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 300,496,162	% 98.7
コール・ローン等、その他	4,057,411	1.3
投資信託財産総額	304,553,573	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（300,865,234千円）の投資信託財産総額（304,553,573千円）に対する比率は98.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=113.47円、1カナダドル=89.24円、1メキシコペソ=5.412円、1ユーロ=128.12円、1英ポンド=149.96円、1スウェーデンクローナ=12.53円、1ノルウェークローネ=12.62円、1デンマーククローネ=17.23円、1ポーランドズロチ=27.8191円、1オーストラリアドル=81.01円、1シンガポールドル=83.13円、1マレーシアリングギット=26.8926円、1中国元=17.7917円、1イスラエルシェケル=36.6039円。

## ○特定資産の価格等の調査

(2020年12月11日～2021年12月10日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年12月10日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	608,059,078,762	
コール・ローン等	2,042,920,267	
公社債(評価額)	300,496,162,992	
未収入金	304,191,638,699	
未収利息	1,201,706,983	
前払費用	126,649,821	
(B) 負債	305,120,446,714	
未払金	304,883,726,861	
未払解約金	236,715,000	
未払利息	4,853	
(C) 純資産総額(A-B)	302,938,632,048	
元本	289,108,179,101	
次期繰越損益金	13,830,452,947	
(D) 受益権総口数	289,108,179,101口	
1口当たり基準価額(C/D)	10,478円	

(注) 当ファンドの期首元本額は190,933,135,042円、期中追加設定元本額は157,544,516,288円、期中一部解約元本額は59,369,472,229円です。

(注) 2021年12月10日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	166,734,335,327円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	27,616,546,940円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	16,581,799,063円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-09	16,323,465,468円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-10	9,983,710,876円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-06	8,738,377,556円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-03	8,064,048,063円
・りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,674,872,294円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-12	7,059,428,607円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,047,671,110円
・りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	2,611,166,543円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	2,609,454,458円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	2,545,647,285円
・りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	1,817,391,492円
・FWりそな円建債券アクティブファンド	1,446,207,063円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,416,355,826円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	1,044,063,037円
・Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,023,895,027円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	764,989,854円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	755,101,711円
・りそなリスクコントロール・オープン	375,957,117円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	289,914,699円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	240,007,676円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	228,299,944円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	69,866,564円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	15,189,275円
・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	14,870,286円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	13,236,525円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	1,462,902円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	809,455円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	37,058円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0478円です。

## ○損益の状況（2020年12月11日～2021年12月10日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	4,045,125,369	
受取利息	4,047,630,297	
支払利息	△ 2,504,928	
(B) 有価証券売買損益	△ 8,159,782,039	
売買益	26,748,871,837	
売買損	△34,908,653,876	
(C) 保管費用等	△ 36,875,292	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 4,151,531,962	
(E) 前期繰越損益金	13,801,095,368	
(F) 追加信託差損益金	6,925,974,812	
(G) 解約差損益金	△ 2,745,085,271	
(H) 計(D+E+F+G)	13,830,452,947	
次期繰越損益金(H)	13,830,452,947	

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

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

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

## ○お知らせ

---

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。（2021年4月24日）

# RM国内株式マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日 2022年1月25日）  
（2021年1月26日～2022年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	①主として、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている株式に投資し、東証株価指数（TOPIX、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。なお、東証株価指数（TOPIX、配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。 ②株式（指数先物取引、ETF（上場投資信託証券）を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
主要投資対象	・東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている株式
主な投資制限	・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は、行いません。

りそなアセットマネジメント 株式会社

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (TOPIX、配当込み) (ベンチマーク)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	騰落	中率	騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
2期(2018年1月25日)	12,597	26.5	2,743.29	26.5	98.2	2.0	16,168
3期(2019年1月25日)	10,694	△15.1	2,330.25	△15.1	95.9	4.0	25,096
4期(2020年1月27日)	11,913	11.4	2,597.26	11.5	98.3	1.9	41,046
5期(2021年1月25日)	13,338	12.0	2,909.49	12.0	97.0	1.5	40,988
6期(2022年1月25日)	13,876	4.0	3,026.56	4.0	98.9	1.1	65,729

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 「東証株価指数 (TOPIX、配当込み)」は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数 (TOPIX、配当込み) (ベンチマーク)		株組入比率	株先物比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2021年1月25日	円	%		%	%	%
	13,338	—	2,909.49	—	97.0	1.5
1月末	12,958	△2.8	2,826.50	△2.9	98.4	1.7
2月末	13,363	0.2	2,914.58	0.2	99.1	0.8
3月末	14,125	5.9	3,080.87	5.9	98.1	1.6
4月末	13,726	2.9	2,993.46	2.9	98.6	1.5
5月末	13,914	4.3	3,034.76	4.3	98.6	1.3
6月末	14,079	5.6	3,070.81	5.5	99.0	1.4
7月末	13,773	3.3	3,003.91	3.2	98.7	1.2
8月末	14,208	6.5	3,099.08	6.5	99.3	0.8
9月末	14,826	11.2	3,234.08	11.2	99.1	1.3
10月末	14,615	9.6	3,188.28	9.6	98.6	1.5
11月末	14,086	5.6	3,073.26	5.6	99.1	1.5
12月末	14,575	9.3	3,179.28	9.3	99.4	1.1
(期末) 2022年1月25日	円	%		%	%	%
	13,876	4.0	3,026.56	4.0	98.9	1.1

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○運用経過

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末13,338円から当期末13,876円となり、538円の値上がりとなりました。

国内株式の市況（東証株価指数（TOPIX、配当込み）の上昇により、基準価額は上昇しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

## 投資環境

## 国内株式市況

国内の株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期初は、新型コロナワクチンの接種進展や堅調な企業業績が支援材料となり、日経平均株価は約30年ぶりに30,000円台を回復しました。その後、度重なる緊急事態宣言等の発令・延長による景気回復の後ずれ懸念の高まりから、上昇圧力に乏しい展開が続きました。2021年9月には菅首相（当時）の次期自民党総裁選挙への不出馬表明をきっかけに一時騰勢が強まる場面も見られましたが、期末にかけてFRB（米連邦準備制度理事会）をはじめとする主要国中央銀行の金融政策正常化加速に伴い、上昇幅を縮小しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

国内の株式を主要投資対象とし、東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。

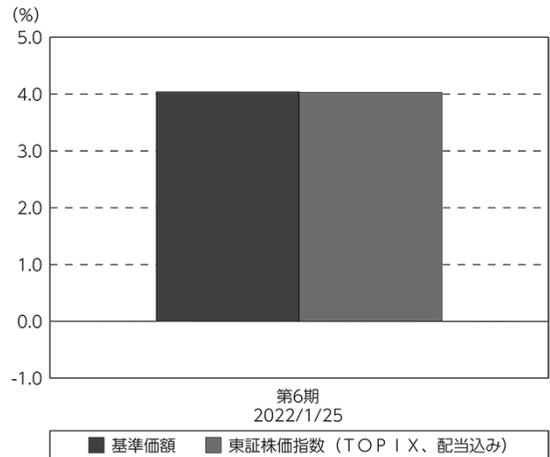
## 当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+4.0%となり、ベンチマークの+4.0%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

(マイナス要因)

- ・コスト負担(株式等に係る取引費用)が生じたこと

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



## ○今後の運用方針

引き続き、主として東証株価指数 (TOPIX、配当込み) に採用されている国内の株式に投資し、東証株価指数 (TOPIX、配当込み) の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 株 式 ) ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	円 0 (0) (0)	% 0.001 (0.000) (0.001)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	0 (0)	0.000 (0.000)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、14,020円です。			

(注) 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・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		21,838 (1,006)	54,264,423 ( )	11,641 ( 1)	30,222,625 ( )

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 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 6,658	百万円 7,604	百万円 -	百万円 -

## ○株式売買比率

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	84,487,048千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	53,230,737千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.58

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 90	百万円 48	百万円 136

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、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社りそなホールディングス、株式会社関西みらいフィナンシャルグループです。

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年1月25日現在)

## 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
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			
極洋	0.7	1.2	3,756
日本水産	20.9	34	18,428
マルハニチロ	3	5.3	12,863
雪国まいたけ	1.3	2.5	2,935
カネコ種苗	0.6	1	1,488
サカタのタネ	2.5	4.1	13,550
ホクト	1.6	2.9	5,614
ホクリヨウ	0.3	0.5	347
<b>鉱業 (0.3%)</b>			
住石ホールディングス	4.3	5.9	796
日鉄鉱業	0.5	0.8	5,000
三井松島ホールディングス	0.8	1.4	2,370
I N P E X	77	136.5	149,740
石油資源開発	2.7	4	10,564
K&Oエナジーグループ	1	1.5	2,245
<b>建設業 (2.3%)</b>			
ヒノキヤグループ	0.5	0.7	1,412
ショーボンドホールディングス	3.3	4.9	24,843
ミライト・ホールディングス	6.2	11	20,493
タマホーム	1.1	2.1	4,983
サンヨーホームズ	0.2	0.4	294
日本アクア	0.8	1.4	891
ファーストコーポレーション	0.6	1	683
ベステラ	0.4	0.7	918
R o b o t H o m e	4	5.6	1,237
キャンディル	0.4	0.6	292
スペースバリューホールディングス	2.6	3.2	3,676
ダイセキ環境ソリューション	0.4	0.7	821
第一カッター興業	0.5	0.8	1,054
安藤・間	12.5	16.9	14,601
東急建設	6.1	10	6,960
コムシスホールディングス	7.4	11	30,096
ビーアールホールディングス	2.3	4.6	1,610

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高松コンストラクショングループ	1.3	2.1	4,137
東建コーポレーション	0.6	1	9,380
ソネック	0.2	0.4	410
ヤマウラ	0.9	1.6	1,542
オリエンタル白石	—	11.4	2,701
大成建設	16.1	22.7	84,784
大林組	48.3	78.6	72,862
清水建設	49	73.6	56,672
飛鳥建設	1.4	2.1	2,184
長谷工コーポレーション	18.7	23.4	33,766
松井建設	1.9	3.1	2,170
銭高組	0.2	0.3	1,228
鹿島建設	37.9	57.6	78,854
不動テトラ	1.3	1.7	2,731
大末建設	0.6	0.8	1,032
鉄建建設	1	1.7	3,085
西松建設	3.7	4.8	18,120
三井住友建設	11.7	17.7	7,557
大豊建設	1.1	1.1	4,092
前田建設工業	12.1	—	—
佐田建設	1	1.7	783
ナカノフドー建設	1.3	1.9	630
奥村組	2.3	4.6	15,019
東鉄工業	2.1	3.7	9,139
イチケン	0.3	0.6	1,101
富士ビー・エス	0.7	1	482
浅沼組	0.5	0.9	4,797
戸田建設	20.1	32.6	24,124
熊谷組	2.2	4	11,592
北野建設	0.3	0.5	1,065
植木組	0.2	0.7	993
矢作建設工業	2.1	3.5	2,632
ビーエス三菱	1.6	2.6	1,554
日本ハウスホールディングス	3.3	5.4	2,316

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大東建託	5.3	8	106,640
新日本建設	2.1	3.3	2,498
N I P P O	4	6	23,970
東亜道路工業	0.3	0.4	1,956
前田道路	4.3	—	—
日本道路	0.5	0.8	6,744
東亜建設工業	1.5	1.9	4,567
日本国土開発	4.7	7.6	4,081
若築建設	0.9	1.3	2,184
東洋建設	5.4	8.8	4,892
五洋建設	19.2	31.2	19,905
世紀東急工業	2.3	3.8	3,059
福田組	0.6	0.8	3,428
住友林業	12.2	20.1	40,823
日本基礎技術	1.6	2.2	1,251
巴コーポレーション	2.1	3.5	1,701
大和ハウス工業	47.8	72.6	245,968
ライト工業	2.8	4.9	9,251
積水ハウス	52.4	85.2	199,794
日特建設	1.3	1.6	1,043
北陸電気工事	0.8	1.6	1,286
ユアテック	2.8	4.5	2,902
日本リーテック	1	1.6	2,259
四電工	0.3	0.9	1,489
中電工	1.9	3.6	7,668
関電工	6.9	12.8	11,148
きんでん	11.5	17.6	29,779
東京エネシス	1.6	2.6	2,425
トーエネック	0.5	0.8	2,528
住友電設	1.4	1.9	3,841
日本電設工業	2.6	4.3	6,376
エクシオグループ	7.3	11.8	28,095
新日本空調	1.3	2.1	4,300
九電工	3.4	6.1	20,435
三機工業	3.4	5.1	7,247
日揮ホールディングス	14.9	24.2	26,620
中外炉工業	0.5	0.8	1,298
ヤマト	1.5	2.3	1,605

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
太平電業	1.2	1.7	4,637
高砂熟学工業	3.7	7.1	13,497
三晃金属工業	0.2	0.3	704
朝日工業社	0.3	0.5	1,457
明星工業	3.1	5.1	3,575
大気社	2.4	3.8	11,141
ダイダマン	1.2	1.7	3,802
日比谷総合設備	1.6	2.5	4,725
フィル・カンパニー	0.3	0.4	378
テスホールディングス	—	1.4	1,843
インフロニア・ホールディングス	—	33.5	35,778
OSJBホールディングス	7.6	—	—
東洋エンジニアリング	2	3.3	2,145
レイズネクスト	2.6	3.8	4,442
<b>食料品 (3.4%)</b>			
ニッポン	4.5	7.4	12,328
日清製粉グループ本社	17.5	28.4	46,263
日東富士製粉	0.1	0.4	1,490
昭和産業	1.4	2.4	6,427
鳥越製粉	1.4	2.2	1,445
中部飼料	1.9	2.8	2,822
フィード・ワン	2.1	3.4	2,390
東洋精糖	0.3	0.4	412
日本甜菜製糖	0.8	1.3	2,207
DM三井製糖ホールディングス	1.4	2.3	4,567
塩水港精糖	1.7	3	636
日新製糖	0.7	1.2	2,077
森永製菓	3.6	5.9	21,741
中村屋	0.4	0.6	2,079
江崎グリコ	4.3	6.9	26,082
名糖産業	0.7	1.1	1,813
井村屋グループ	0.9	1.4	3,138
不二家	1	1.4	3,143
山崎製パン	11.6	18.9	30,693
第一屋製パン	0.3	0.5	270
モロゾフ	0.3	0.4	2,276
亀田製菓	0.9	1.4	5,838
寿スピリッツ	1.5	2.4	11,328

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カルビー	7	11.5	31,188
森永乳業	2.9	4.7	26,461
六甲バター	1	1.8	2,692
ヤクルト本社	10.6	18.6	111,228
明治ホールディングス	10.2	16.6	121,346
雪印メグミルク	3.7	6.1	12,572
ブリマハム	2.4	3.1	7,867
日本ハム	5.9	9.6	43,104
林兼産業	0.5	0.8	401
丸大食品	1.6	2.5	3,930
S Foods	1.2	2.3	7,532
柿安本店	0.5	0.9	2,280
伊藤ハム米久ホールディングス	10	16.2	10,902
サッポロホールディングス	5.3	8.6	19,350
アサヒグループホールディングス	33.8	59.2	285,640
キリンホールディングス	65.6	92.5	173,807
宝ホールディングス	11.5	17.1	19,134
オエノンホールディングス	4.4	7.1	2,364
養命酒製造	0.5	0.8	1,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11.8	17.7	23,877
サントリー食品インターナショナル	10.3	16.8	73,836
ダイドーグループホールディングス	0.8	1.3	6,175
伊藤園	4.7	7.6	48,488
キーコーヒー	1.5	2.5	5,142
ユニカフェ	0.5	0.8	744
ジャパンフーズ	0.2	0.4	481
日清オイリオグループ	2	3.1	9,331
不二製油グループ本社	3.8	5.5	12,991
かどや製油	0.2	0.3	1,200
J-オイルミルズ	0.8	2.3	3,983
キッコーマン	11.1	18.1	152,583
味の素	34.2	55.5	176,490
ブルドックソース	—	1.1	2,157
キューピー	8.6	13.2	31,046
ハウス食品グループ本社	5.8	9.4	28,134
カゴメ	6.3	9.5	29,165
焼津水産化学工業	0.7	1.2	1,095
アリアケジャパン	1.4	2.3	14,260

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ピエトロ	0.2	0.3	537
エバラ食品工業	0.4	0.5	1,403
やまみ	0.1	0.3	486
ニチレイ	7.4	11.5	30,222
東洋水産	8	12.1	57,051
イートアンドホールディングス	0.5	0.9	2,082
大冷	0.2	0.3	572
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.9	1.3	613
日清食品ホールディングス	6.6	9.9	80,487
永谷園ホールディングス	0.8	1.1	2,137
一正蒲鉾	0.6	1	747
フジッコ	1.7	2.3	4,480
ロック・フィールド	1.7	2.7	4,139
日本たばこ産業	82.9	134.9	317,217
ケンコーマヨネーズ	0.9	1.4	1,828
わらべや日洋ホールディングス	1	1.6	3,107
なとり	0.9	1.4	2,812
イフジ産業	0.3	0.4	366
ビックスコーポレーション	0.3	1.2	1,875
ファーマフーズ	—	2.4	3,820
北の達人コーポレーション	5.4	—	—
ユグレナ	6.7	12.8	9,625
紀文食品	—	1.5	1,365
ミヨシ油脂	0.5	1	1,144
理研ビタミン	1.5	2.6	4,420
<b>繊維製品 (0.5%)</b>			
片倉工業	2	2.7	6,093
グンゼ	1.1	1.7	6,749
東洋紡	6	9.7	12,309
ユニチカ	4.4	6.7	2,036
富士紡ホールディングス	0.7	1.1	4,378
倉敷紡績	1.5	2.1	3,945
シキボウ	0.8	1.3	1,194
日本毛織	5	7.4	6,637
ダイトウボウ	2.5	3.9	354
トーア紡コーポレーション	0.6	0.9	364
ダイドーリミテッド	2	3.2	441
帝国繊維	1.7	2.8	5,336

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
帝人	12.3	23.1	33,633
東レ	109.3	177.7	129,863
サカイオーベックス	0.4	—	—
住江織物	0.3	0.5	905
日本フェルト	0.9	1.4	616
イチカワ	0.2	0.3	409
日東製網	0.2	0.3	429
アツギ	1.2	1.9	1,031
ダイニック	0.6	0.9	635
セーレン	3.7	5	11,325
ソトー	0.6	0.9	738
東海染工	0.2	0.3	344
小松マテーレ	2.5	4	4,796
ワコールホールディングス	3.8	6.1	12,919
ホギメディカル	1.7	3.3	10,081
クラウディアホールディングス	0.4	0.6	144
T S I ホールディングス	4.6	8.2	2,648
マツオカコーポレーション	0.4	0.8	941
ワールド	2.1	3.2	3,596
三陽商会	0.8	1.2	1,044
ナイガイ	0.6	0.8	226
オンワードホールディングス	9.1	14.8	4,425
ルックホールディングス	0.5	0.8	973
キムラタン	8.9	12.9	232
ゴールドウイン	2.7	4.4	26,664
デサント	2.9	4.8	18,120
キング	0.7	1.2	630
ヤマトインターナショナル	1.3	2.1	604
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>			
特種東海製紙	0.9	1.5	6,180
王子ホールディングス	63.1	102.6	61,765
日本製紙	6.7	11.8	13,652
三菱製紙	1.7	3.5	1,092
北越コーポレーション	9	16.1	11,736
中越パルプ工業	0.6	0.9	870
巴川製紙所	0.4	0.7	559
大王製紙	7.3	11.8	21,806
阿波製紙	0.4	0.6	197

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レンゴー	14.3	23.2	19,928
トーモク	0.9	1.5	2,601
ザ・バック	1.1	1.9	5,107
<b>化学 (6.7%)</b>			
北の達人コーポレーション	—	8.8	2,112
クラレ	23.8	35.9	36,869
旭化成	100	162.7	183,769
共和レザー	0.8	1.5	963
昭和電工	11.5	21.3	49,373
住友化学	110.9	180.3	103,131
住友精化	0.7	1.1	3,404
日産化学	8.3	13.4	80,936
ラサ工業	0.5	0.9	1,401
クレハ	1.3	1.9	15,485
多木化学	0.6	1	5,670
テイカ	1.1	1.8	2,311
石原産業	2.7	4.1	4,567
片倉コープアグリ	0.4	0.6	679
日本曹達	2.1	3.1	10,075
東ソー	23.3	35.4	62,481
トクヤマ	4.4	7.9	14,559
セントラル硝子	3.1	4	8,404
東亜合成	9.5	14	15,834
大阪ソーダ	1.5	2.3	6,810
関東電化工業	3.6	5.4	5,783
デンカ	5.5	9	35,460
信越化学工業	25.9	42.1	763,483
日本カーバイド工業	0.5	0.9	1,170
堺化学工業	1	1.7	3,576
第一稀元素化学工業	1.6	2.3	2,472
エア・ウォーター	14	23.2	40,228
日本酸素ホールディングス	14.5	23.6	55,389
日本化学工業	0.5	0.8	2,088
東邦アセチレン	0.2	0.4	504
日本パーカライズニング	7.6	12.4	13,193
高压ガス工業	2.4	3.9	2,956
チタン工業	0.2	0.3	497
四国化成工業	2.2	3.2	4,480

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
戸田工業	0.4	0.5	1,620
ステラ ケミファ	0.8	1.2	2,961
保土谷化学工業	0.6	0.8	4,320
日本触媒	2.3	4.1	21,730
大日精化工業	1.3	2	4,458
カネカ	3.9	6.3	23,341
三菱瓦斯化学	14	22.8	48,016
三井化学	14	22.3	70,022
J S R	14.1	22.9	86,676
東京応化工業	2.6	4.2	27,636
大阪有機化学工業	1.4	2.1	6,457
三菱ケミカルホールディングス	100.9	164.1	144,785
KHネオケム	2.5	4	11,744
ダイセル	18.8	35.4	28,532
住友ベークライト	2.4	3.9	21,177
積水化学工業	31.9	51.4	99,099
日本ゼオン	13.6	22.1	28,730
アイカ工業	4.5	6.8	22,236
宇部興産	7.6	11.6	23,780
積水樹脂	2.7	3.7	7,610
タキロンシーアイ	3.3	5.3	2,957
旭有機材	0.9	1.4	2,405
ニチバン	0.8	1.5	2,602
リケンテクノス	3.7	6	2,880
大倉工業	0.7	1.3	2,553
積水化成成品工業	2	3.3	1,560
群栄化学工業	0.3	0.6	2,166
タイガースポリマー	0.8	1.3	568
ミライアル	0.5	0.8	1,221
ダイキアクシス	0.5	1	686
ダイキョーニシカワ	3.2	5.2	3,120
竹本容器	0.5	0.9	672
森六ホールディングス	0.8	1.3	2,496
恵和	—	0.7	3,640
日本化薬	9.3	19.3	21,480
カーリットホールディングス	1.6	2.4	1,596
日本精化	1.2	2	4,318
扶桑化学工業	1.5	2.2	9,603

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トリケミカル研究所	0.3	2.5	7,612
ADEKA	6.9	11.3	27,199
日油	5.7	8.4	44,100
新日本理化	2.5	4	976
ハリマ化成グループ	1.2	1.8	1,454
花王	36.9	55.4	329,907
第一工業製薬	0.6	0.9	2,697
石原ケミカル	0.4	1.2	1,560
日華化学	0.5	0.8	638
ニイタカ	0.3	0.5	1,072
三洋化成工業	0.9	1.5	7,830
有機合成薬品工業	1.2	1.7	453
大日本塗料	1.7	3	2,421
日本ペイントホールディングス	12.5	92.2	83,717
関西ペイント	17	25.5	62,271
神東塗料	1.2	1.9	294
中国塗料	4.3	5.8	5,312
日本特殊塗料	1.1	1.8	1,546
藤倉化成	2	3.1	1,478
太陽ホールディングス	1.1	3.6	11,718
D I C	6.4	10.4	30,617
サカタインクス	3.3	4.9	4,728
東洋インキS Cホールディングス	3.2	5.2	9,911
T & K TOKA	1.2	2	1,582
富士フイルムホールディングス	29.5	44	336,512
資生堂	30.6	46.7	274,362
ライオン	20	30.3	47,116
高砂香料工業	1	1.7	4,702
マンダム	3.5	5.3	7,303
ミルボン	2.1	3.1	17,391
ファンケル	6.2	10.1	29,290
コーセー	2.9	4.7	50,995
コタ	0.9	1.6	2,560
シーボン	0.2	0.3	514
ポーラ・オルビスホールディングス	6.6	10.7	18,971
ノエビアホールディングス	1.3	2.1	10,668
アジュバンホールディングス	0.3	0.6	633
新日本製薬	—	0.7	768

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エステー	1	1.6	2,422
アグロ カネシヨウ	0.6	0.8	938
コニシ	2.5	4.1	6,789
長谷川香料	2.7	4.3	10,410
星光PMC	0.9	1.4	903
小林製薬	4.3	7	61,600
荒川化学工業	1.4	2.1	2,389
メック	1.1	1.9	5,975
日本高純度化学	0.4	0.7	1,785
タカラバイオ	4	6.6	15,120
JCU	1.9	2.8	13,692
新田ゼラチン	1	1.6	1,049
OATアグリオ	0.3	0.5	918
デクセリアルズ	4	6.5	19,760
アース製薬	1.2	2.1	12,285
北興化学工業	1.4	2.3	1,817
大成ラミック	0.5	0.8	2,181
クミアイ化学工業	6.4	9.3	7,291
日本農薬	2.7	4.5	2,290
アキレス	1.1	1.6	1,979
有沢製作所	2.3	3.7	3,740
日東電工	10.6	15.1	133,031
レック	1.6	3.3	2,933
三光合成	1.8	2.6	884
きもと	2.6	3.8	881
藤森工業	1.4	2.2	8,822
前澤化成工業	1	1.6	2,028
未来工業	0.8	0.9	1,378
ウェーブブロックホールディングス	0.5	1	713
JSP	0.9	1.5	2,400
エフビコ	3.2	4.6	16,928
天馬	1	2	5,038
信越ポリマー	2.8	4.5	4,581
東リ	3.9	6.2	1,333
ニフコ	5.7	8.4	31,542
バルカー	1.3	2	4,996
ユニ・チャーム	32.7	48.3	233,578
ショーエイコーポレーション	0.3	0.7	452

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>医薬品 (4.8%)</b>			
協和キリン	15.5	29.4	85,554
武田薬品工業	128.2	197	646,554
アステラス製薬	133.6	217.3	421,453
大日本住友製薬	11.4	15.5	20,909
塩野義製薬	19.4	31.5	213,853
わかもと製薬	1.8	3	885
あすか製薬	1.8	—	—
日本新薬	4	6.6	50,160
ピオフェルミン製薬	0.3	—	—
中外製薬	48.2	78.4	289,923
科研製薬	2.6	3.9	16,477
エーザイ	18.4	30	176,790
ロート製薬	7.9	12.9	41,215
小野薬品工業	35.4	57.6	154,368
久光製薬	4.1	6.6	23,694
持田製薬	2.1	3.2	11,232
参天製薬	28.7	46.7	62,297
扶桑薬品工業	0.5	0.9	1,964
日本ケミファ	0.2	0.3	610
ツムラ	4.8	7.8	25,896
日医工	4.4	7.8	5,756
キッセイ薬品工業	2.7	4.4	10,111
生化学工業	3	4.4	4,131
栄研化学	2.7	4.4	7,783
日水製薬	0.6	0.9	891
鳥居薬品	1	1.3	3,755
JCRファーマ	4.3	7.1	14,540
東和薬品	2	3.6	9,925
富士製薬工業	1	1.5	1,474
沢井製薬	3.2	—	—
ゼリア新薬工業	2.8	4.5	8,712
第一三共	132.3	196.9	513,121
キョーリン製薬ホールディングス	3.4	5	9,190
大幸薬品	1.9	3.8	2,276
ダイト	1	1.6	4,409
大塚ホールディングス	32	52.1	218,976
大正製薬ホールディングス	3.3	6	33,480

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ベプチドリーム	7.8	13.2	27,508
あすか製薬ホールディングス	—	2.9	2,833
サワイグループホールディングス	—	5.5	24,255
<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>			
日本コークス工業	13.1	21.1	2,721
ニチレキ	1.8	3.2	4,096
ユシロ化学工業	0.9	1.3	1,428
ビービー・カストロール	0.5	0.9	1,190
富士石油	4.2	6.7	1,695
MORESCO	0.6	0.8	921
出光興産	17.1	27.8	90,350
ENEOSホールディングス	231.8	377	170,441
コスモエネルギーホールディングス	4.5	7.3	16,804
<b>ゴム製品 (0.7%)</b>			
横浜ゴム	8.9	14.5	24,737
TOYO TIRE	8.1	13.2	21,568
ブリヂストン	41	72.2	365,548
住友ゴム工業	13.8	22.5	26,932
藤倉コンポジット	1.3	2	1,616
オカモト	0.9	1.5	6,097
フコク	0.7	1.1	1,087
ニッタ	1.7	2.6	7,228
住友理工	3	4.9	2,846
三ツ星ベルト	2	3	6,342
バンドー化学	2.7	4	3,516
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>			
日東紡績	2.3	3.7	10,330
AGC	14.1	23	117,530
日本板硝子	7.4	12	6,108
石塚硝子	0.3	0.4	831
日本山村硝子	0.6	1	783
日本電気硝子	5.7	10.1	28,027
オハラ	0.6	1	1,061
住友大阪セメント	2.8	4.6	16,146
太平洋セメント	9.7	14.2	32,631
日本ヒューム	1.5	2.5	1,755
日本コンクリート工業	3.3	4.9	1,376
三谷セキサン	0.7	1.2	7,572

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アジアパイルホールディングス	2.2	3.9	1,727
東海カーボン	15.1	21	25,200
日本カーボン	0.8	1.3	5,193
東洋炭素	0.9	1.6	4,606
ノリタケカンパニーリミテド	0.9	1.4	6,300
TOTO	11	17.9	87,710
日本碍子	18.5	27.1	51,300
日本特殊陶業	11.7	19.1	37,321
ダントーホールディングス	1.1	1.6	353
MARUWA	0.6	0.9	13,320
品川リフラクトリーズ	0.4	0.6	2,253
黒崎播磨	0.3	0.4	1,798
ヨータイ	1.2	1.6	1,992
イソライト工業	0.8	1	1,198
東京窯業	2	3.2	953
ニッカトー	0.7	1.1	743
フジミインコーポレーテッド	1.4	2	13,460
クニミネ工業	0.6	0.8	807
エーアンドエーマテリアル	0.3	0.4	363
ニチアス	4.2	5.8	15,091
ニチハ	2.1	3.5	9,971
<b>鉄鋼 (0.8%)</b>			
日本製鉄	68.2	110.9	203,612
神戸製鋼所	27.9	46.3	25,372
中山製鋼所	2.1	3.9	1,665
合同製鐵	0.8	1.3	1,801
ジェイ エフ イー ホールディングス	41.2	66.9	96,603
東京製鐵	7.4	8.4	9,542
共英製鋼	1.7	2.8	4,211
大和工業	3.2	4.7	16,309
東京鐵鋼	0.6	1.1	1,455
大阪製鐵	0.8	1.3	1,506
淀川製鋼所	2.1	3.3	8,045
丸一鋼管	4.9	8.8	22,536
モリ工業	0.5	0.7	1,793
大同特殊鋼	2.5	4.1	16,912
日本高周波鋼業	0.6	0.9	312
日本冶金工業	1.3	1.8	3,956

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
山陽特殊製鋼	1	2.5	4,870	
愛知製鋼	0.9	1.4	3,536	
日立金属	16.4	26.6	55,594	
日本金属	0.4	0.6	570	
大太平洋金属	1	1.5	3,195	
新日本電工	9.8	16	4,512	
栗本鐵工所	0.8	1.1	1,695	
虹技	0.2	0.3	288	
日本鋳鉄管	0.2	0.3	299	
三菱製鋼	1.1	1.6	1,608	
日亜鋼業	2.2	3.2	892	
日本精線	0.2	0.4	1,832	
エンビプロ・ホールディングス	0.6	1.1	1,624	
シンニッタン	2.4	3	663	
新家工業	0.3	0.6	971	
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	2.5	3.7	5,542	
日本軽金属ホールディングス	3.9	6.3	11,088	
三井金属鉱業	4.1	6.7	21,004	
東邦亜鉛	0.8	1.4	3,221	
三菱マテリアル	10.1	16.4	32,832	
住友金属鉱山	19.5	31.7	161,289	
DOWAホールディングス	3.9	6.8	33,252	
古河機械金属	2.7	4.1	5,194	
エス・サイエンス	6.8	11.3	259	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1.6	2.9	2,328	
東邦チタニウム	2.7	4.4	3,973	
UACJ	2.3	3.8	9,644	
CKサンエツ	0.3	0.5	2,017	
古河電気工業	4.7	7.7	18,056	
住友電気工業	57	92.7	143,082	
フジクラ	18.4	27.6	15,980	
昭和電線ホールディングス	1.8	2.2	3,927	
東京特殊電線	0.2	0.4	1,144	
タツタ電線	3	4.4	2,103	
カナレ電気	0.3	0.4	636	
平河ビューテック	0.8	1.4	1,569	
リョービ	1.9	3	3,318	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アーレスティ	2	2.6	982	
アサヒホールディングス	2.7	9.9	20,473	
<b>金属製品 (0.6%)</b>				
稲葉製作所	0.9	1.4	1,806	
宮地エンジニアリンググループ	0.5	0.8	2,508	
トーカロ	4.2	6.4	8,544	
アルファC o	0.5	1	1,121	
SUMCO	19.5	38.1	83,172	
川田テックノロジーズ	0.3	0.5	1,997	
RS Technologies	0.5	0.8	4,328	
ジエイテックコーポレーション	0.1	0.3	465	
信和	0.9	1.5	1,230	
東洋製罐グループホールディングス	9.7	15.8	21,187	
ホッカンホールディングス	0.8	1.4	1,999	
コロナ	0.8	1.4	1,236	
横河ブリッジホールディングス	2.8	4.3	9,374	
駒井ハルテック	0.3	0.5	1,132	
高田機工	0.1	0.2	574	
三和ホールディングス	14.4	23.4	29,179	
文化シャッター	4.5	7.9	8,405	
三協立山	2	3.2	1,968	
アルインコ	1.1	1.8	1,695	
東洋シャッター	0.4	0.5	275	
LIXIL	22.5	39	100,503	
日本ファイルコン	1.1	1.7	860	
ノーリツ	3.2	4.7	7,900	
長府製作所	1.5	2.5	4,980	
リンナイ	3	4.7	49,303	
ダイニチ工業	0.8	1.2	849	
日東精工	1.9	3.1	1,729	
三洋工業	0.2	0.3	550	
岡部	3.1	5	3,690	
ジーテクト	1.9	3.1	4,299	
東ブレ	2.8	4.6	5,602	
高周波熱練	2.9	4.4	2,618	
東京製綱	1.1	1.5	1,261	
サンコール	1.1	2.1	1,197	
モリテック スチール	1.2	1.9	596	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バイオラックス	2.3	3.6	6,300
エイチワン	1.5	2.4	1,591
日本発條	16.3	22.8	21,067
中央発條	0.2	1.2	921
アドバネクス	0.2	0.3	420
立川ブラインド工業	0.7	1.1	1,157
三益半導体工業	1.2	1.9	4,430
<b>機械 (5.4%)</b>			
日本ドライケミカル	0.4	0.6	1,102
日本製鋼所	4.6	7.5	27,600
三浦工業	6.6	10.7	36,326
タクマ	5.2	8.4	11,936
ツガミ	3.2	5.4	7,619
オークマ	1.8	2.9	14,427
芝浦機械	1.7	2.8	10,136
アマダ	18.9	39.1	43,713
アイダエンジニアリング	4	6.5	6,773
滝澤鉄工所	0.5	0.7	851
F U J I	6.6	11.4	28,545
牧野フライス製作所	1.8	2.7	10,422
オーエスジー	7.5	11.5	22,942
ダイジェット工業	0.2	0.3	296
旭ダイヤモンド工業	4	6.5	3,867
DMG森精機	9.6	14.7	26,180
ソディック	3.3	5.5	4,378
ディスコ	2.1	3.7	115,625
日東工器	0.8	1.4	2,345
日進工具	0.6	1.9	2,661
パンチ工業	1.4	2.1	1,024
富士ダイス	0.7	1.2	741
豊和工業	0.8	1.3	1,007
OKK	0.6	1	1,017
石川製作所	0.4	0.6	877
東洋機械金属	1.1	1.6	804
津田駒工業	0.3	0.5	291
エンシュウ	0.4	0.5	309
島精機製作所	2.4	3.6	6,692
オプトラン	1.9	3.1	7,139

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
NCホールディングス	0.5	0.7	1,089
イワキポンプ	1	1.6	1,596
フリュー	1.5	2.2	2,659
ヤマシンフィルタ	3.4	5	2,090
日阪製作所	1.9	3.1	2,517
やまびこ	3	4.8	5,054
野村マイクロ・サイエンス	—	0.7	2,898
平田機工	0.7	1.2	7,116
ペガサスミシン製造	1.6	2.5	1,185
マルマエ	0.6	1	2,421
タツモ	0.6	1.2	1,568
ナプテスコ	9	14.1	48,292
三井海洋開発	1.6	2.6	2,958
レオン自動機	1.5	2.7	2,875
SMC	4.8	7.3	464,937
ホソカワミクロン	0.5	1.7	5,094
ユニオンツール	0.6	0.9	3,330
オイレス工業	2	3.5	5,631
日精エー・エス・ピー機械	0.4	0.8	2,444
サトーホールディングス	2.2	3.3	6,692
技研製作所	1.3	2.2	8,613
日本エアテック	0.5	1.1	1,164
カワタ	0.4	0.8	820
日精樹脂工業	1.3	1.7	1,742
オカダアイオン	0.5	0.8	1,169
ワイエイシイホールディングス	0.7	1	1,113
小松製作所	69.8	113.6	318,080
住友重機械工業	8.8	14.3	42,399
日立建機	6.2	10	29,540
日工	2.1	3.4	2,094
巴工業	0.6	1	2,133
井関農機	1.5	2.3	3,040
TOWA	1.6	2.1	5,134
丸山製作所	0.3	0.5	764
北川鉄工所	0.7	1.1	1,501
ローツェ	0.7	1.2	12,168
タカキタ	0.5	0.9	547
クボタ	81	122.2	295,479

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
荏原実業	0.4	1.1	2,405
三菱化工機	0.5	0.8	1,703
月島機械	2.8	4.6	4,751
帝国電機製作所	1.3	1.7	2,339
東京機械製作所	0.6	1	845
新東工業	3.7	5.5	3,795
澁谷工業	1.3	2.2	5,579
アイチ コーポレーション	2.7	3.6	2,923
小森コーポレーション	3.9	6.3	4,265
鶴見製作所	1.2	1.9	3,190
住友精密工業	0.2	0.4	760
日本ギア工業	0.6	0.9	234
酒井重工業	0.3	0.4	1,060
荏原製作所	6.4	10.4	58,032
石井鐵工所	0.2	0.4	1,196
西島製作所	1.6	2.3	2,079
北越工業	1.6	2.3	2,178
ダイキン工業	19.6	31.9	775,010
オルガノ	0.6	0.7	5,768
トーヨーカネツ	0.7	0.9	2,229
栗田工業	8.3	13.6	63,036
椿本チエイン	2.2	3.3	10,345
大同工業	0.7	1.1	1,034
木村化工機	1.3	2.1	1,520
アネスト岩田	2.4	3.9	2,905
ダイフク	7.9	13.8	109,572
サムコ	0.4	0.6	1,321
加藤製作所	0.8	1.2	996
油研工業	0.3	0.4	693
タダノ	7.4	13.1	14,672
フジテック	5.6	9.3	24,998
CKD	4.2	7.4	14,933
キトー	1.2	2.1	3,620
平和	4.3	7	13,013
理想科学工業	1.4	2.1	4,368
SANKYO	3.4	5.4	16,054
日本金銭機械	1.7	2.5	1,545
マースグループホールディングス	1	1.6	2,606

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フクシマガリレイ	1	1.7	7,072
オーイズミ	0.6	0.9	347
ダイコク電機	0.7	1.2	1,462
竹内製作所	2.6	3.8	10,708
アマノ	4	6.6	15,556
JUK I	2.1	3.5	2,705
サンデン	2	3.5	661
ジャノメ	1.4	2.1	1,543
マックス	2.4	3.3	5,943
グローリー	4	6.4	13,747
新晃工業	1.4	2.3	4,218
大和冷機工業	2.5	3.6	3,992
セガサミーホールディングス	15.3	24.9	47,310
日本ピストンリング	0.6	0.9	1,178
リケン	0.7	1.1	2,861
T P R	2.1	3.4	4,913
ツバキ・ナカシマ	2.9	5.5	7,546
ホシザキ	4.9	7.3	60,955
大豊工業	1.3	2	1,576
日本精工	29	47.2	36,438
NTN	35.7	53.9	12,289
ジェイテクト	14.8	24	23,160
不二越	1.4	2.1	8,547
日本トムソン	4.6	6.9	4,133
THK	9.6	14.1	39,451
ユースン精機	1.2	1.9	1,341
前澤給装工業	0.6	1.9	1,875
イーグル工業	1.9	3.1	3,379
前澤工業	1	1.5	925
日本ビラー工業	1.6	2.5	7,687
キッツ	5.6	8.4	5,527
マキタ	20.1	30.5	138,195
三井E&Sホールディングス	—	9.1	3,221
日立造船	12.2	21.2	16,175
三菱重工業	25.8	39.4	119,066
I H I	11.1	15.6	34,694
サノヤスホールディングス	—	3.1	390
スター精密	2.4	3.8	5,506

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>電気機器 (18.6%)</b>			
日清紡ホールディングス	9.4	15.3	14,106
イビデン	9.4	13.2	77,088
コニカミノルタ	33.7	54.8	28,057
ブラザー工業	18.8	30.6	67,136
ミネベアミツミ	28.6	43.2	114,739
日立製作所	74.1	120.5	743,605
東芝	—	43.8	204,151
三菱電機	154.1	250.6	365,124
富士電機	9.3	15.1	82,446
東洋電機製造	0.6	1	963
安川電機	16.6	27	130,005
シンフォニアテクノロジー	2	3	3,528
明電舎	2.8	4.3	10,590
オリジン	0.4	0.6	739
山洋電気	0.7	1.1	5,687
デンヨー	1.3	2.1	3,528
PHCホールディングス	—	2.9	4,732
東芝テック	1.9	2.7	11,340
芝浦メカトロニクス	0.3	0.4	3,276
マブチモーター	4.3	5.9	21,181
日本電産	37.1	65	685,425
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.9	1.1	425
トレックス・セミコンダクター	0.9	1.3	3,402
東光高岳	0.9	1.4	1,919
ダブル・スコープ	2.8	7.2	5,947
宮越ホールディングス	0.6	—	—
ダイヘン	1.7	2.7	11,218
ヤーマン	2.5	4.1	3,681
JVCケンウッド	12.6	20.4	3,570
ミマキエンジニアリング	1.4	2.2	1,623
I-PEX	0.7	1.2	2,055
日新電機	3.6	5.9	8,531
大崎電気工業	3.1	4.6	2,120
オムロン	13.8	20.9	192,259
日東工業	2.3	3.3	5,045
I D E C	2.2	3.1	7,337
正興電機製作所	0.4	0.8	792

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
不二電機工業	0.3	0.5	589
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5.1	8.2	19,967
サクサホールディングス	0.4	0.6	773
メルコホールディングス	0.5	0.7	2,649
テクノメディカ	0.3	0.6	967
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	0.3	0.7	700
日本電気	18.7	31.8	156,456
富士通	14.9	22.5	397,237
神電気工業	6.3	10.2	9,067
岩崎通信機	0.7	1	813
電気興業	0.7	1.3	3,044
サンケン電気	1.7	2.3	11,132
ナカヨ	0.3	0.4	470
アイホン	0.9	1.4	3,018
ルネサスエレクトロニクス	66.2	135.9	169,875
セイコーエプソン	19.1	31.1	61,795
ワコム	10.4	19.4	16,179
アルバック	2.8	4.6	27,140
アクセル	0.6	1	1,068
E I Z O	1.2	1.9	7,315
ジャパンディスプレイ	44.9	85.2	3,067
日本信号	3.9	6.4	5,644
京三製作所	3.6	5.4	2,257
能美防災	2	3.3	6,807
ホーチキ	1.1	1.8	2,196
星和電機	0.8	1.1	649
エレコム	1.8	5.7	7,945
パナソニック	176.1	267.3	339,203
シャープ	17.8	28.6	35,635
アンリツ	9.9	16.1	25,341
富士通ゼネラル	4.2	6.8	17,074
ソニーグループ	96.5	157	1,959,360
T D K	7.4	36.3	145,200
帝国通信工業	0.7	1.1	1,449
タムラ製作所	5.1	9.7	6,188
アルプスアルパイン	13.6	22.2	23,865
池上通信機	0.5	0.7	445
日本電波工業	1.4	2.3	2,870

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
鈴木	0.8	1.1	917
メイコー	—	2	7,520
日本トリム	0.2	0.5	1,483
ローランド ディー. ジー.	0.9	1.5	4,140
フォスター電機	1.6	2.5	1,842
SMK	0.4	0.6	1,273
ヨコオ	1	1.9	4,751
ティアック	1.1	4	620
ホシデン	4.2	6	6,660
ヒロセ電機	2.4	3.9	66,729
日本航空電子工業	3.5	5.7	10,619
TOA	1.7	2.7	2,135
マクセル	3.3	5	6,425
古野電気	2	3	3,003
ユニデンホールディングス	0.4	0.5	1,727
スミダコーポレーション	1.3	2.3	2,286
アイコム	0.9	0.9	2,083
リオン	0.6	1	2,054
本多通信工業	1.3	1.9	782
船井電機	1.6	—	—
横河電機	14.1	25.1	48,066
新電元工業	0.5	1	3,285
アズビル	9.7	14.7	65,856
東亜ディーケーケー	0.8	1.2	1,062
日本光電工業	6.4	10.4	31,980
チノー	0.5	0.8	1,283
共和電業	1.6	2.4	900
日本電子材料	0.6	1.3	3,023
堀場製作所	3.1	4.6	27,922
アドバンテスト	11.5	18.6	175,770
小野測器	0.6	1	480
エスベック	1.4	2	4,016
キーエンス	14	22.7	1,334,306
日置電機	0.7	1.2	8,532
シスメックス	11	21.2	225,992
日本マイクロニクス	2.7	4.4	6,683
メガチップス	1.4	2.3	9,924
OBARA GROUP	0.9	1.1	3,586

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
澤藤電機	0.2	0.3	454
原田工業	0.7	1.2	1,140
コーセル	2.1	3.1	2,489
イリソ電子工業	1.3	2.1	9,450
オブテックスグループ	2.5	4.1	6,182
千代田インテグレ	0.6	1.1	1,969
アイ・オー・データ機器	0.5	0.9	656
レーザーテック	6.8	11	286,385
スタンレー電気	10.8	17.5	47,722
岩崎電気	0.6	0.9	2,034
ウシオ電機	8.5	12.8	22,963
岡谷電機産業	1.2	1.8	568
ヘリオス テクノ ホールディング	1.4	2.1	606
エノモト	0.5	0.7	1,179
日本セラミック	1.6	2.3	5,602
遠藤照明	0.8	1.1	1,056
古河電池	1.1	1.8	2,228
双信電機	0.7	1.2	764
山一電機	1.1	1.8	3,580
図研	1	1.6	4,659
日本電子	3	5.2	32,396
カシオ計算機	13.6	18.1	26,371
ファナック	14.5	22	504,240
日本シイエムケイ	3.6	4.9	2,626
エンプラス	0.8	0.6	1,680
大真空	0.6	3.4	4,110
ローム	6.4	11.2	107,520
浜松トニクス	11.1	18	104,940
三井ハイテック	1.7	2.5	20,475
新光電気工業	5.2	7.4	34,595
京セラ	21.7	35.3	243,534
太陽誘電	6.9	12.2	67,466
村田製作所	45.3	73.6	629,500
双葉電子工業	2.4	4.3	2,924
北陸電気工業	0.6	0.9	1,089
ニチコン	5.2	7.9	9,179
日本ケミコン	1.3	2.4	3,852
KOA	2.3	3.8	5,240

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
市光工業	2.3	3	1,521
小糸製作所	9.2	13.8	83,490
ミツバ	2.8	4.6	1,807
SCREENホールディングス	2.7	4.3	48,246
キャノン電子	1.4	2.3	3,581
キャノン	76.6	124.5	355,136
リコー	39.2	69.6	73,080
象印マホービン	4.2	6.8	9,465
MUTOHホールディングス	0.2	0.3	629
東京エレクトロン	9.8	15.9	904,233
<b>輸送用機器 (8.7%)</b>			
トヨタ紡織	4.5	10.2	21,358
芦森工業	0.3	0.5	464
ユニプレス	3	3.7	3,045
豊田自動織機	12.5	20.3	181,685
モリタホールディングス	2.7	4	5,096
三櫻工業	2	3.5	2,884
デンソー	33.9	55.2	479,577
東海理化電機製作所	4.1	6.6	9,807
三井E&Sホールディングス	5.6	—	—
川崎重工業	12	18.3	40,314
名村造船所	5	7.5	1,410
サノヤスホールディングス	1.9	—	—
日本車輛製造	0.6	0.9	1,826
三菱ロジスネクスト	2	3.3	3,316
近畿車輛	0.2	0.4	406
日産自動車	181.8	295.6	178,956
いすゞ自動車	44.7	78.6	108,939
トヨタ自動車	172	1,269.4	2,839,013
日野自動車	19.2	31.3	30,110
三菱自動車工業	57	92.8	28,768
エプテック	1.1	1.7	923
レシップホールディングス	0.6	1	530
GMB	0.3	0.5	402
ファルテック	0.3	0.4	277
武蔵精密工業	3.4	5.6	9,928
日産車体	3	3.7	2,490
新明和工業	4.2	7.1	6,283

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
極東開発工業	2.9	4.7	6,702
トピー工業	1.3	2.1	2,286
ティラド	0.6	0.7	1,857
曙ブレーキ工業	8.5	13.7	2,397
タチエス	2.5	4.4	5,271
NOK	8.3	12.1	14,834
フタバ産業	4.3	6.3	2,646
KYB	1.7	2.6	7,748
大同メタル工業	3	4.8	2,985
プレス工業	7.7	12.4	4,699
ミクニ	2	3.2	1,398
太平洋工業	3.2	5.2	5,756
河西工業	2.1	3.1	914
アイシン	12.7	18.3	78,873
マツダ	45.3	78.7	70,200
今仙電機製作所	1.4	1.6	923
本田技研工業	121.3	197.3	670,622
スズキ	30.5	57.3	264,095
SUBARU	47.8	71.8	148,554
安永	0.7	1.2	1,021
ヤマハ発動機	21.8	32.7	89,467
TBK	1.8	2.7	1,082
エクセディ	2.1	3.8	6,456
豊田合成	5	8.1	19,423
愛三工業	2.4	3.9	2,652
盟和産業	0.2	0.4	404
日本プラスト	1.2	2	1,084
ヨロズ	1.4	2.3	2,286
エフ・シー・シー	2.5	4.1	6,018
シマノ	5.8	10.1	271,084
ティ・エス テック	3.6	10.6	15,338
ジャムコ	0.8	1.5	1,237
<b>精密機器 (2.6%)</b>			
テルモ	43.6	70.9	295,014
クリエートメディック	0.5	0.8	776
日機装	5	7.5	6,300
日本エム・ディ・エム	0.9	1.4	2,177
島津製作所	18.4	32.3	130,976

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
JMS	1.3	2.1	1,268
クボテック	0.4	0.5	137
長野計器	1.1	1.8	2,311
ブイ・テクノロジー	0.7	1.1	3,729
東京計器	1	1.6	1,609
愛知時計電機	0.2	0.4	2,188
インターアクション	0.8	1.3	2,519
オーバル	1.4	2.2	556
東京精密	2.8	4.2	20,202
マニー	6.1	10	16,430
ニコン	23.5	38.3	46,917
トプコン	7.8	11.8	15,882
オリンパス	85.3	131.4	321,010
理研計器	1.4	2	10,740
タムロン	1.2	1.9	4,816
HOYA	30.6	48.9	696,336
シード	0.7	1.2	621
ノーリツ鋼機	1	2.3	4,903
エー・アンド・デイ	1.4	2.3	2,258
朝日インテック	17.5	27.5	55,357
シチズン時計	18	29.4	14,259
リズム	0.5	0.8	986
大研医器	1.1	2	1,038
メニコン	2.2	8.3	22,127
シンシア	0.2	0.3	144
松風	0.7	1	1,808
セイコーホールディングス	2.2	3.5	7,388
ニプロ	10.7	18.7	19,747
<b>その他製品 (2.3%)</b>			
中本ボックス	0.4	0.7	1,202
スノーピーク	0.9	3.3	7,451
パラマウントベッドホールディングス	1.6	4.8	9,268
トランザクション	0.8	1.4	1,477
粧美堂	0.4	0.7	273
ニホンフラッシュ	1.4	2.1	2,144
前田工織	1.7	2.8	9,534
永大産業	2	3.3	996
アートネイチャー	1.6	2.1	1,467

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バンダイナムコホールディングス	15.9	22.5	177,187
アイフィスジャパン	0.4	0.6	395
共立印刷	2.6	4.2	625
SHOE I	1.3	2.4	9,744
フランスベッドホールディングス	2.2	3.2	2,832
パイロットコーポレーション	2.7	4.2	17,178
萩原工業	0.9	1.6	1,908
トッパン・フォームズ	3.3	—	—
フジシールインターナショナル	3.5	6.1	13,298
タカラトミー	6.9	10.5	11,686
広済堂ホールディングス	1.1	1.6	1,190
エステールホールディングス	0.4	0.6	381
タカノ	0.6	0.9	585
プロネクス	1.3	1.9	2,067
ホクシン	1.1	1.8	288
ウッドワン	0.5	0.8	800
大建工業	1	1.5	3,147
凸版印刷	21.8	38.1	82,029
大日本印刷	20.2	29.6	83,916
共同印刷	0.5	0.7	1,908
N I S S H A	3.2	5.1	7,267
光村印刷	0.1	0.2	274
TAKARA & COMPANY	0.7	1.2	2,166
アシックス	13.6	22.2	47,952
ツツミ	0.5	0.6	1,059
ローランド	—	1.7	6,817
小松ウオール工業	0.5	0.8	1,508
ヤマハ	9.2	14.9	76,884
河合楽器製作所	0.5	0.7	2,135
クリナップ	1.4	2.3	1,214
ビジョン	9.9	15.1	36,224
オリバー	0.3	—	—
兼松サステック	0.1	0.2	323
キングジム	1.3	2	1,770
リンテック	3.7	5.4	14,256
イトーキ	3.1	4.6	1,568
任天堂	9.5	14.1	760,695
三菱鉛筆	2.5	4.1	4,846

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タカラスタンダード	3.2	5.2	7,098
コクヨ	7.4	12	19,956
ナカバヤシ	1.5	2.2	1,122
グローブライト	0.7	2.2	6,047
オカムラ	5.4	8.6	10,337
美津濃	1.4	2.5	5,417
<b>電気・ガス業 (1.1%)</b>			
東京電力ホールディングス	123	187.6	57,030
中部電力	47.1	76.7	96,028
関西電力	58.4	95	104,880
中国電力	22.2	39.2	37,200
北陸電力	14.1	22.9	13,579
東北電力	38.5	58.7	48,662
四国電力	13.9	22.6	18,599
九州電力	31.8	51.7	44,927
北海道電力	14.4	21.8	10,987
沖縄電力	3	5.3	7,632
電源開発	12.3	21.4	32,121
エフオン	0.8	1.5	784
イーレックス	2.4	3.7	5,594
レノバ	2.6	4.9	8,388
東京瓦斯	29.6	48	106,752
大阪瓦斯	29.9	45.4	88,530
東邦瓦斯	7.6	11.5	33,982
北海道瓦斯	0.8	1.2	1,790
広島ガス	3.2	4.8	1,732
西部ガスホールディングス	1.7	2.8	6,109
静岡ガス	4.4	6.5	6,402
メタウォーター	1.5	2.6	4,836
<b>陸運業 (3.0%)</b>			
SBSホールディングス	1.1	1.9	6,669
東武鉄道	16.1	24.5	66,101
相鉄ホールディングス	4.9	8	16,992
東急	38.9	63.2	96,000
京浜急行電鉄	19.8	32.2	37,738
小田急電鉄	22.9	37.3	77,546
京王電鉄	8	13	68,510
京成電鉄	10.7	17.4	53,592

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
富士急行	2.1	3	12,330
新京成電鉄	0.4	0.6	1,203
東日本旅客鉄道	27.1	44.1	295,558
西日本旅客鉄道	13.7	30.4	147,409
東海旅客鉄道	12.8	20.8	310,336
西武ホールディングス	20.1	32.7	37,147
鴻池運輸	2.5	4	4,612
西日本鉄道	4.3	6.9	17,836
ハマキョウレックス	1.2	1.8	5,140
サカイ引越センター	0.8	1.2	5,346
近鉄グループホールディングス	14.6	23.7	79,276
阪急阪神ホールディングス	19.5	29.7	99,346
南海電気鉄道	6.9	10.6	23,839
京阪ホールディングス	6.5	10.6	28,174
神戸電鉄	0.3	0.6	1,908
名古屋鉄道	12	19.5	35,860
山陽電気鉄道	1	1.8	3,542
アルプス物流	—	1.7	1,713
日本通運	5.1	—	—
ヤマトホールディングス	24.2	33.3	80,486
山九	4.1	6.2	28,458
丸運	0.9	1.3	313
丸全昭和運輸	1.2	1.9	5,833
センコーグループホールディングス	8	11.9	10,924
トナミホールディングス	0.4	0.6	2,256
ニッコンホールディングス	5.2	8	17,112
日本石油輸送	0.2	0.3	789
福山通運	1.9	3.9	14,196
セイノーホールディングス	10.9	16.2	18,273
エスライン	0.4	0.7	616
神奈川中央交通	0.4	0.6	1,983
日立物流	2.7	4.6	24,242
丸和運輸機関	3.1	5	6,790
C&Fロジホールディングス	1.5	2.4	3,285
九州旅客鉄道	12.8	18.4	43,626
SGホールディングス	30.6	44.8	106,758
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	8.2	55,022

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>海運業 (0.5%)</b>			
日本郵船	12.2	19.8	161,370
商船三井	9.2	13.1	105,324
川崎汽船	4.5	7.3	47,450
NSユニテッド海運	0.8	1.3	3,770
明治海運	1.6	2.8	1,937
飯野海運	6.8	11	5,643
共栄タンカー	0.3	0.4	349
乾汽船	0.8	1.6	3,561
<b>空運業 (0.4%)</b>			
日本航空	32.8	54.4	116,252
ANAホールディングス	36.3	60.3	143,845
バスコ	0.3	0.4	516
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
トランコム	0.4	0.7	5,740
日新	1.3	1.9	3,009
三菱倉庫	4.6	7.5	20,512
三井倉庫ホールディングス	1.7	2.5	5,852
住友倉庫	5.2	8.4	16,766
滋澤倉庫	0.8	1.4	2,962
東陽倉庫	2.6	4	1,256
日本トランスシティ	3.2	5.2	3,338
ケイヒン	0.3	0.4	525
中央倉庫	0.9	1.4	1,370
川西倉庫	0.3	0.4	432
安田倉庫	1.2	1.9	1,831
ファイズホールディングス	0.3	0.5	267
東洋埠頭	0.4	0.7	999
宇徳	1.2	1.6	1,156
上組	8.1	13.1	29,029
サンリツ	0.3	0.7	578
キムラユニティー	0.4	0.6	754
キューソー流通システム	0.4	1.2	1,005
近鉄エクスプレス	3.1	4.5	12,496
東海運	0.8	1.3	393
エーアイティー	1	1.5	2,208
内外トランスライン	0.5	0.9	1,650
日本コンセプト	0.5	0.8	1,053

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>情報・通信業 (7.9%)</b>			
NECネットエスアイ	4.3	8.1	14,053
クロスキャット	0.4	0.6	840
システナ	5.4	35.1	12,249
デジタルアーツ	0.7	1.3	8,658
日鉄ソリューションズ	2.3	3.6	11,970
キューブシステム	0.8	1.2	1,112
WOW WORLD	0.3	0.3	436
コア	0.6	1	1,499
ラクーンホールディングス	0.7	1.7	1,973
ソリトンシステムズ	0.8	1.2	1,543
ソフトクリエイトホールディングス	0.7	1.1	4,004
T I S	15.1	23.5	71,675
J N Sホールディングス	0.6	1.1	444
電算システム	0.6	—	—
グリー	9.3	15.1	12,850
GMOペパボ	—	0.3	657
コーエーテクモホールディングス	3.1	7.8	30,732
三菱総合研究所	0.6	1.1	4,180
ボルテージ	0.4	0.7	235
電算	0.2	0.3	677
AGS	0.9	1.2	1,020
ファインデックス	1.3	2.1	1,896
ブレインパッド	0.4	1.9	2,074
KL a b	2.8	4.5	1,971
ポルトウイン・ビットクルーホールディングス	1.8	3.6	3,258
イーブックイニシアティブジャパン	0.2	—	—
ネクソン	38.2	55.5	113,775
アイスタイル	4.2	7.5	1,500
エムアップホールディングス	0.4	2.8	2,052
エイチーム	1	1.7	1,242
エニグモ	1.4	2.7	1,633
テクノスジャパン	1.2	1.9	906
e n i s h	0.8	1.5	529
コロブラ	5	8.1	5,273
オルトプラス	0.9	1.9	568
ブロードリーフ	7.5	12.2	4,343
クロス・マーケティンググループ	0.7	0.9	713

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
デジタルハーツホールディングス	0.8	1.1	1,840
システム情報	1.1	1.8	1,576
メディアドゥ	0.5	0.9	2,349
じげん	3.7	6.9	1,925
ブイキューブ	0.8	2.5	2,007
エンカレッジ・テクノロジー	0.3	0.5	267
サイバーリンクス	0.5	0.8	681
ディー・エル・イー	1.2	1.6	356
フィックスターズ	1.6	2.6	1,950
CARTA HOLDINGS	0.6	1	1,854
オブティム	0.8	1.7	1,711
セレス	0.5	0.9	1,676
SHIFT	0.7	1.2	22,272
ティーガイア	1.3	2.2	3,665
セック	0.2	0.4	882
日本アジアグループ	1.6	—	—
テクマトリックス	2.1	4.2	7,102
プロシップ	0.4	0.8	1,104
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3.6	6.7	15,979
GMOペイメントゲートウェイ	3.2	4.8	48,528
ザッパラス	0.7	1	491
システムリサーチ	0.4	0.7	1,227
インターネットイニシアティブ	4.5	6.6	25,509
さくらインターネット	1.6	2.6	1,300
ヴィンクス	0.4	0.7	597
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.3	0.5	1,737
SRAホールディングス	0.8	1.2	3,309
システムインテグレータ	0.5	0.8	404
朝日ネット	1.1	2.2	1,304
eBASE	1.8	2.9	1,496
アバント	1.4	2.6	2,574
アドソル日進	0.5	0.9	1,446
ODKソリューションズ	—	0.5	315
フリービット	0.8	1.5	1,318
コムチュア	1.7	2.8	7,730
サイバーコム	0.3	0.4	420
アステリア	0.9	1.8	1,537
アイル	0.8	1.4	1,692

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マークラインズ	0.6	1.2	3,002
メディカル・データ・ビジョン	1.7	3.1	3,273
gumi	1.9	3.4	1,890
ショーケース	0.3	0.5	225
モバイルファクトリー	0.3	0.6	477
テラスカイ	0.5	0.9	1,301
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.6	1.1	1,293
PCIホールディングス	0.6	1.1	1,102
パイブドHD	0.2	0.4	936
アイビーシー	0.2	0.4	254
ネオジャパン	0.3	0.7	764
PR TIMES	0.3	0.5	1,357
ラクス	—	8.5	20,442
ランドコンピュータ	0.2	0.6	492
ダブルスタンダード	0.2	0.7	1,674
オープンドア	0.7	1.5	2,172
マイネット	0.5	0.9	422
アカツキ	0.5	1.1	2,911
ベネフィットジャパン	0.1	0.2	418
Ubicomホールディングス	0.3	0.6	1,254
カナミックネットワーク	1.4	2.6	1,149
ノムラシステムコーポレーション	0.7	1.2	296
チェンジ	2.1	4.5	6,408
シンクロ・フード	0.7	1.2	346
オークネット	0.8	1.3	1,950
キャピタル・アセット・プランニング	—	0.5	352
セグエグループ	0.4	0.6	366
エイトレッド	0.3	0.3	609
AOI TYO Holdings	1.5	—	—
マクロミル	3.1	5	5,355
ビーグリー	0.3	0.6	654
オロ	0.5	0.8	1,888
ユーザローカル	0.2	0.7	1,009
テモナ	0.3	0.5	199
ニーズウェル	0.3	0.6	351
マネーフォワード	—	3.7	17,889
サインポスト	0.3	0.8	688
電算システムホールディングス	—	1	2,624

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソルクシーズ	0.6	2.1	856
フェイス	0.5	0.6	390
プロトコーポレーション	1.4	2.6	3,419
ハイマックス	0.4	0.7	793
野村総合研究所	21.4	47.5	196,887
サイバネットシステム	1.1	1.7	1,094
CEホールディングス	0.8	1.3	601
日本システム技術	0.2	0.5	1,106
インテージホールディングス	1.9	3.1	5,366
東邦システムサイエンス	0.4	0.6	574
ソースネクスト	7.2	10.5	1,659
インフォコム	1.7	2.7	5,016
シンプレクス・ホールディングス	—	2.6	5,977
HEROZ	0.2	0.7	708
ラクスル	1.2	2.7	10,125
I P S	—	0.7	1,243
F I G	1.7	2.7	723
システムサポート	0.3	0.7	680
イーソル	0.8	1.5	787
アルテリア・ネットワークス	1.7	3.1	4,154
E d u L a b	0.1	0.2	144
東海ソフト	0.1	0.4	355
ウイングアーク1 s t	—	1.4	1,827
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	0.3	0.6	1,219
サーバーワークス	—	0.4	940
東名	0.1	0.2	181
ヴィッツ	0.1	0.2	257
トピラシステムズ	0.1	0.5	394
S a n s a n	—	8.7	12,388
L i n k - U	0.1	0.4	286
ギブティ	—	2.2	2,765
ベース	—	0.4	1,580
J M D C	—	2.3	12,512
フォーカスシステムズ	0.9	1.6	1,441
クレスコ	0.9	1.8	3,213
フジ・メディア・ホールディングス	14.6	23.7	27,397
オービック	5.2	7.7	140,140
ジャストシステム	2.5	3.5	16,887

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TDCソフト	1.3	2.1	2,097
Zホールディングス	207.7	357.4	200,572
トレンドマイクロ	8.1	13.1	77,421
IDホールディングス	0.6	1.5	1,264
日本オラクル	3.1	5	43,600
アルファシステムズ	0.5	0.7	2,502
フューチャー	1.8	5.2	7,800
C A C H o l d i n g s	1	1.4	1,867
S B テ ク ノ ロ ジ ー	0.5	1.1	2,519
トーセ	0.4	0.7	492
オービックビジネスコンサルタント	1.5	2.3	9,890
伊藤忠テクノソリューションズ	6.9	11.2	36,400
アイティフォー	1.8	3	2,319
東計電算	0.2	0.3	1,419
エクスネット	0.2	0.4	384
大塚商会	8.2	13.3	62,244
サイボウズ	1.8	3.3	4,656
電通国際情報サービス	1.9	3.6	12,402
A C C E S S	1.4	2.8	1,584
デジタルガレージ	2.7	4.1	17,650
EMシステムズ	2.1	4.1	2,652
ウェザーニューズ	0.5	0.7	5,278
C I J	1	1.6	1,315
ビジネスエンジニアリング	0.2	0.3	1,075
日本エンタープライズ	1.5	2.5	415
WOWOW	0.7	1.2	2,017
スカラ	1	2.2	1,443
インテリジェント ウェイブ	0.9	1.4	716
I M A G I C A G R O U P	1.3	2.1	1,199
ネットワンシステムズ	5.8	9.4	26,536
システムソフト	3.3	5.3	535
アルゴグラフィックス	1.3	1.9	6,327
マーベラス	2.3	3.9	2,831
エイベックス	2.6	4.2	5,376
日本ユニシス	4.7	7.7	23,446
兼松エレクトロニクス	0.8	1.3	4,979
都築電気	0.5	1.3	2,076
T B S ホールディングス	9.2	15	25,455

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本テレビホールディングス	12.6	20.5	24,907
朝日放送グループホールディングス	1.5	2.4	1,677
テレビ朝日ホールディングス	4.2	5.9	8,879
スカパーJ SATホールディングス	9.9	20.8	9,006
テレビ東京ホールディングス	1.2	1.8	3,567
日本BS放送	0.5	0.8	888
ビジョン	1.9	4.2	3,922
スマートバリュー	0.4	0.6	282
USEN-NEXT HOLDINGS	0.6	2.3	5,575
ワイヤレスゲート	0.6	1	299
コネクシオ	0.9	1.7	2,380
日本通信	11.8	20.5	3,362
クロップス	0.3	0.4	361
日本電信電話	202.1	257.3	844,973
KDDI	110.2	179.3	654,982
ソフトバンク	137.4	372.5	540,125
光通信	1.6	2.9	41,383
エムティーアイ	1.5	2.4	1,351
GMOインターネット	5.4	8.7	20,958
ファイバーゲート	0.5	0.8	848
アйдママーケティングコミュニケーション	0.5	0.5	139
KADOKAWA	4.1	13.4	31,717
学研ホールディングス	2	3.5	3,584
ゼンリン	3	4	3,840
昭文社ホールディングス	0.7	1	436
インプレスホールディングス	1.3	2	410
アイネット	0.8	1.3	1,639
松竹	1	1.6	18,896
東宝	8.9	14.5	64,960
東映	0.6	0.8	12,792
エヌ・ティ・ティ・データ	40.3	65.5	142,528
ピー・シー・エー	0.3	1.4	2,123
ビジネスブレイン太田昭和	0.5	0.8	1,356
DTS	3.4	4.7	12,055
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6.4	11.4	63,270
シーイーシー	1.6	2.6	2,779
カブコン	7.1	23.2	60,134
アイ・エス・ピー	0.7	1.1	1,010

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジャステック	1	1.4	1,453
S C S K	3.5	17	33,218
日本システムウエア	0.5	0.9	1,920
アイネス	1.5	2.2	3,344
TKC	1.3	4.2	12,663
富士ソフト	1.6	2.6	12,766
NSD	4.9	7.9	15,444
コナミホールディングス	5.5	8.9	52,599
福井コンピュータホールディングス	0.6	1.1	3,220
J B C Cホールディングス	1	1.7	2,745
ミロク情報サービス	1.3	2.2	2,598
ソフトバンクグループ	120	147.5	747,677
<b>卸売業 (5.5%)</b>			
ハウスイ	0.1	0.2	161
高千穂交易	0.6	0.9	1,335
オルパヘルスケアホールディングス	0.2	0.4	550
伊藤忠食品	0.4	0.6	2,976
エレマテック	1.4	2	2,040
J A L U X	0.4	0.6	1,528
あらた	1.2	2	8,100
トーマンデバイス	0.2	0.4	2,452
東京エレクトロン デバイス	0.5	0.7	3,843
フィールズ	1.2	2.2	1,053
双日	83.8	27.3	48,266
アルフレッサ ホールディングス	16.9	27.4	43,703
横浜冷凍	4	6.9	5,865
神栄	0.2	0.3	258
ラサ商事	0.8	1.3	1,270
アルコニックス	1.6	3.1	3,989
神戸物産	10.5	19.2	69,120
ハイパー	0.2	0.6	289
あい ホールディングス	2.2	3.5	6,160
ディーブイエックス	0.5	0.8	817
ダイワボウホールディングス	1.3	12	19,848
マクニカ・富士エレホールディングス	3.6	5.9	14,142
ラクト・ジャパン	0.7	0.8	1,473
グリムス	0.3	1.1	2,159
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2.9	4.3	3,397

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
八洲電機	1.2	1.8	1,747
メディアスホールディングス	0.9	1.4	1,198
レスターホールディングス	1.6	2.3	4,432
ジュレットクホールディングス	0.3	0.6	696
大光	0.6	0.9	594
OCHIホールディングス	0.4	0.7	934
TOKAIホールディングス	8	12	10,356
黒谷	0.4	0.7	436
Cominix	0.3	0.4	293
三洋貿易	1.5	2.5	2,472
ビューティガレージ	0.2	0.4	1,139
ウイン・パートナーズ	1.1	1.8	1,695
ミタチ産業	0.5	0.7	655
シップヘルスケアホールディングス	2.4	7.9	20,389
明治電機工業	0.5	0.8	998
デリカフーズホールディングス	0.5	1	566
スターティアホールディングス	0.3	0.6	456
コマダホールディングス	3.3	5.4	10,908
ピーバンドットコム	0.2	0.3	185
アセンテック	0.3	0.8	584
富士興産	0.5	0.6	604
協栄産業	0.2	0.2	342
フルサト・マルカホールディングス	—	2.4	5,342
ヤマエグループホールディングス	—	1.7	1,711
小野建	1.4	2.4	3,895
南陽	0.3	0.5	956
佐鳥電機	1	1.5	1,356
エコートレーディング	0.3	0.5	296
伯東	0.9	1.5	3,583
コンドータック	1.2	1.9	1,909
中山福	0.9	1.3	460
ナガイレーベン	2	3.3	7,184
三菱食品	1.7	2.4	6,760
松田産業	1.1	1.8	4,098
第一興商	2.3	4.7	15,392
メディバルホールディングス	16.4	26.6	55,062
SPK	0.7	1	1,300
萩原電気ホールディングス	0.6	0.9	1,768

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アズワン	1	3.5	19,985
スズデン	0.5	0.9	1,591
尾家産業	0.4	0.6	597
シモジマ	0.9	1.5	1,567
ドウシシャ	1.4	2.3	3,456
小津産業	0.3	0.5	969
高速	0.9	1.5	2,260
たけびし	0.5	0.9	1,273
リックス	0.3	0.6	891
丸文	1.3	2.2	1,623
ハビネット	1.3	2.1	3,139
橋本総業ホールディングス	0.3	0.5	993
日本ライフライン	4.5	7.3	7,781
タカショー	1	1.9	1,259
マルカ	0.5	—	—
IDOM	4.1	7.5	5,010
進和	0.9	1.5	3,103
エスケイジャパン	0.3	0.6	253
ダイトロン	0.6	1	1,965
シークス	1.9	3.5	4,441
田中商事	0.5	0.8	504
オーハシテクニカ	0.8	1.3	1,758
白銅	0.5	0.8	2,078
ダイコー通産	0.1	0.3	343
伊藤忠商事	106.2	172.6	634,305
丸紅	158	243.5	275,155
高島	0.2	0.4	932
長瀬産業	8.5	13.6	24,765
蝶理	1	1.4	2,473
豊田通商	16.9	24.8	115,444
三共生興	2.3	3.3	1,871
兼松	5.7	9.2	11,417
ツカモトコーポレーション	0.3	0.4	526
三井物産	131.4	191.7	536,568
日本紙パルプ商事	0.9	1.3	5,161
カメイ	2	2.9	2,943
東都水産	0.2	0.1	396
OUGホールディングス	0.2	0.4	1,075

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スターゼン	0.6	1.8	3,645
山善	5.9	10.4	10,275
椿本興業	0.3	0.5	2,142
住友商事	95.8	155.8	270,001
内田洋行	0.6	1.1	4,966
三菱商事	99.5	185	705,220
第一実業	0.7	1.1	4,774
キヤノンマーケティングジャパン	3.8	6.1	13,871
西華産業	0.9	1.3	1,999
佐藤商事	1.3	2	2,236
菱洋エレクトロ	1.5	1.5	3,487
東京産業	1.4	2.2	1,548
ユアサ商事	1.4	2.3	6,626
神鋼商事	0.4	0.6	1,995
トルク	0.9	1.3	262
阪和興業	2.8	4.9	15,410
正栄食品工業	1	1.6	6,360
カナデン	1.2	2	2,052
菱電商事	1.1	2	3,368
フルサト工業	0.8	—	—
岩谷産業	3.9	5.9	33,335
ナイス	0.6	0.9	1,569
昭光通商	0.5	—	—
ニチモウ	0.2	0.4	1,023
極東貿易	0.4	0.7	1,818
アステナホールディングス	2	3.5	1,319
三愛石油	3.7	6.1	5,746
稲畑産業	3.3	5.4	9,142
G S Iクレオス	0.4	1.2	1,423
明和産業	1.4	2.3	2,467
クワザワホールディングス	0.5	1	592
ヤマエ久野	1.1	—	—
ワキタ	3.2	5.3	5,284
東邦ホールディングス	4.9	7.9	13,556
サンゲツ	4.1	6.5	10,374
ミツウロコグループホールディングス	2.2	3.6	3,852
シナネンホールディングス	0.6	0.9	2,776
伊藤忠エネクス	3.4	5.5	5,555

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サンリオ	4.3	7.6	16,628
サンワテクノス	1.1	1.5	1,929
リョーサン	1.7	2.7	5,864
新光商事	2.3	3.7	3,200
トーホー	0.7	1.1	1,152
三信電気	0.8	1.1	1,628
東陽テクニカ	1.6	2.4	2,520
モスフードサービス	2	3.2	9,664
加賀電子	1.5	2.2	6,360
ソーダニッカ	1.6	2.4	1,968
立花エレテック	1.1	2	3,062
フォーナル	0.7	1.1	927
P A L T A C	2.4	3.5	14,630
三谷産業	2	2.9	890
太平洋興発	0.6	0.9	565
西本Wismettacホールディングス	0.3	0.6	1,740
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.1	0.2	388
コーア商事ホールディングス	0.3	1.8	1,062
国際紙パルプ商事	3.6	5.1	1,535
ヤマタネ	0.8	1.1	1,766
丸紅建材リース	0.1	0.2	351
日鉄物産	1.1	1.8	9,090
泉州電業	0.4	0.7	4,298
トラスコ中山	3.5	5.1	12,892
オートボックスセブン	5.6	8.3	11,487
モリト	1.1	1.8	1,227
加藤産業	2.2	3.6	11,754
北恵	0.4	0.6	499
イノテック	0.8	1.5	2,107
イェローハット	2.9	4.3	6,828
J Kホールディングス	1.4	2	2,140
日伝	1.4	2	4,440
北沢産業	1.1	1.6	368
杉本商事	0.8	1.2	2,613
因幡電機産業	4.3	6.6	17,496
東テク	0.5	0.8	1,954
ミスミグループ本社	19	31	113,925
アルテック	1.1	1.6	403

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タキヒヨー	0.5	0.7	966
蔵王産業	0.3	0.5	891
スズケン	6.4	9.6	32,016
ジェコス	1	1.7	1,368
グローセル	1.5	2.9	1,189
小売業 (4.2%)			
ローソン	3.8	5.5	27,417
サンエー	1.3	1.9	7,790
カワチ薬品	1.2	1.9	4,240
エービーシー・マート	2.4	3.9	21,177
ハードオフコーポレーション	0.6	1.1	803
アスクル	1.6	4	5,496
ゲオホールディングス	2.7	3.3	3,834
アダストリア	2.1	2.7	4,476
ジーフット	0.9	1.5	454
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	0.2	0.4	154
くら寿司	0.9	2.6	8,931
キャンドウ	0.7	1.2	2,516
アイケイ	—	0.7	246
バルグループホールディングス	1.5	2.2	3,502
エディオン	7	11.3	12,068
サーラコーポレーション	3.1	5	3,140
ワッツ	0.7	1.2	825
ハローズ	0.6	1.1	3,033
フジオフードグループ本社	1.3	2.1	2,643
あみやき亭	0.3	0.6	1,723
ひらまつ	2.8	5.2	925
大黒天物産	0.4	0.8	3,632
ハニーズホールディングス	1.3	2	2,022
ファーマライズホールディングス	0.4	0.6	433
アルベン	1.2	1.9	3,714
ハブ	0.4	0.8	440
クオールホールディングス	2.2	3	3,942
ジンスホールディングス	0.8	1.7	11,730
ビックカメラ	9	14.6	14,673
DCMホールディングス	9.3	15.2	16,431
ベッパーフードサービス	1.6	3.4	1,169
Monotaro	10.8	31.2	57,564

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京一番フーズ	0.4	0.6	352
DDホールディングス	0.6	1.3	689
きちりホールディングス	0.4	0.7	246
アークランドサービスホールディングス	1.3	1.8	3,868
J. フロント リテイリング	18.1	29.5	29,765
ドトール・日レスホールディングス	2.2	4.3	6,634
マツキヨココカラ&カンパニー	6.3	15.2	59,128
ブロンコビリー	0.8	1.4	2,987
ZOZO	10.4	17	47,532
トレジャー・ファクトリー	0.4	0.7	562
物語コーポレーション	0.4	1.3	8,021
ココカラファイン	1.6	—	—
三越伊勢丹ホールディングス	26.5	43.2	38,188
H a m e e	0.5	0.6	601
マーケットエンタープライズ	—	0.2	144
ウエルシアホールディングス	9	13	41,470
クリエイトSDホールディングス	2.6	3.6	11,124
丸善CHIホールディングス	1.8	2.9	1,044
ミサワ	0.3	0.5	350
ティーライフ	0.2	0.3	403
エー・ビーホールディングス	0.3	0.5	219
チムニー	0.5	0.8	920
シュッピン	1	2.1	2,339
オイシックス・ラ・大地	1.5	3.5	7,969
ネクステージ	2.6	5	14,395
ジョイフル本田	4.4	7.2	11,044
鳥貴族ホールディングス	0.4	0.9	1,504
ホットランド	1.1	1.8	2,183
すかいらーくホールディングス	17	31.9	47,212
SFPホールディングス	0.9	1.2	1,676
綿半ホールディングス	1.1	1.9	2,409
ヨシックスホールディングス	0.2	0.5	957
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4.4	7.2	7,610
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.8	1.3	1,359
BEENOS	0.7	1.2	2,214
あさひ	1.1	2	2,792
日本調剤	0.9	1.5	1,987
コスモス薬品	1.3	2.5	36,675

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トーエル	0.7	1.2	1,000
オンリー	0.3	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	59.4	96.6	510,337
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8.2	13.1	9,366
ツルハホールディングス	3.3	5.4	51,678
サンマルクホールディングス	1.2	1.9	2,783
フェリシモ	0.3	0.5	591
トリドールホールディングス	3.8	6.1	13,578
TOKYO BASE	1.4	2.3	1,025
ウイルプラスホールディングス	0.2	0.4	400
JMホールディングス	1.1	1.7	2,714
サツドラホールディングス	0.2	1.1	680
アレンザホールディングス	0.8	1.9	2,027
串カツ田中ホールディングス	0.4	0.7	1,425
パロックジャパンリミテッド	1.1	1.7	1,535
クスリのアオキホールディングス	1.4	2.5	17,200
力の源ホールディングス	0.7	1.3	698
FOOD & LIFE COMPANIES	8.3	14.4	48,528
メディカルシステムネットワーク	1.5	2.4	1,221
一家ホールディングス	—	0.5	262
藤久ホールディングス	—	0.6	436
はるやまホールディングス	0.7	1.2	592
ノジマ	2.7	4	9,200
カッパ・クリエイト	2.1	3.5	4,676
ライトオン	1.1	1.8	1,251
ジーンズメイト	0.5	—	—
良品計画	20.2	28.4	44,872
三城ホールディングス	1.6	3	690
アドヴァングループ	2.3	2.5	2,435
アルビス	0.6	0.8	1,738
コナカ	1.8	2.9	991
ハウス オブ ローゼ	0.2	0.3	500
G-7ホールディングス	0.9	2.7	3,801
イオン北海道	2	4.3	4,631
コジマ	2.6	4.2	2,221
ヒマラヤ	0.5	0.9	895
コーナン商事	2.2	3.5	11,847
エコス	0.6	0.9	1,778

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ワタミ	1.8	3	2,637
マルシェ	0.4	0.6	244
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	33.4	49.4	75,927
西松屋チェーン	3.3	5.4	7,597
ゼンショーホールディングス	7.3	12	32,784
幸楽苑ホールディングス	1	1.6	2,107
ハークスレイ	0.3	1	464
サイゼリヤ	2.3	3.7	9,668
VTホールディングス	6.3	9.3	4,175
魚力	0.4	0.7	1,400
ポプラ	0.4	0.6	79
フジ・コーポレーション	0.4	1.3	1,476
ユナイテッドアローズ	1.6	2.6	4,659
ハイデイ日高	2.2	3.6	5,922
YU-WA Creation Holdings	1	1.4	282
コロワイド	5	10.1	16,452
ピーシーデポコーポレーション	2	2.9	838
沓番屋	1.1	1.7	7,871
トップカルチャー	0.6	0.9	250
PLANT	0.4	0.6	406
スギホールディングス	3	4.9	34,104
薬王堂ホールディングス	0.7	1.2	2,760
ヴィア・ホールディングス	1.9	3.1	452
スクロール	2.3	3.8	3,169
ヨンドシーホールディングス	1.5	2.3	4,006
木曾路	2	3.3	7,253
SRSホールディングス	1.8	3.4	2,611
千趣会	2.8	4.5	1,647
タカキュー	1.3	1.8	190
リテールパートナーズ	2	3	3,597
ケーヨー	3.1	4.6	3,919
上新電機	1.8	2.8	5,773
日本瓦斯	2.3	12	17,736
ロイヤルホールディングス	2.6	4.2	7,509
東天紅	0.1	0.2	190
いなげや	1.9	3.1	4,259
島忠	2.9	—	—
チヨダ	1.6	2.4	1,809

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ライフコーポレーション	1.2	2.3	7,026
リンガーハット	1.9	3	6,681
MrMaxHD	2.1	3.1	1,856
テンアライド	1.4	2.4	736
AOKIホールディングス	3	4.8	2,875
オークワ	2.4	3.9	3,537
コメリ	2.3	3.8	9,686
青山商事	3.1	5.1	3,355
しまむら	1.8	2.9	29,986
はせがわ	0.8	1.3	373
高島屋	11.1	18	19,314
松屋	3.1	5	3,505
エイチ・ツー・オー リテイリング	7.2	11.7	9,161
近鉄百貨店	0.6	0.9	2,346
丸井グループ	13.9	19.5	41,515
アクシアル リテイリング	1.3	1.9	6,184
井筒屋	0.9	1.2	450
イオン	58.4	95	241,917
イズミ	3.1	4.5	14,400
平和堂	3.1	4.6	8,809
フジ	1.8	3	5,637
ヤオコー	1.7	2.8	18,452
ゼビオホールディングス	1.8	3.4	3,002
ケーズホールディングス	14.6	22.8	25,285
Olympicグループ	0.8	1.3	891
日産東京販売ホールディングス	2.3	3.6	810
シルバーライフ	0.2	0.5	515
一家ダイニングプロジェクト	0.2	—	—
Genky DrugStores	0.7	1.1	4,554
ナルミヤ・インターナショナル	0.3	0.6	699
ブックオフグループホールディングス	0.9	1.4	1,426
ギフト	0.1	0.4	910
アインホールディングス	1.9	3.6	20,880
元気寿司	0.4	0.7	1,708
ヤマダホールディングス	46.2	90.3	35,307
アークランドサカモト	2.4	3.9	6,013
ニトリホールディングス	6.6	9.8	164,983
グルメ杵屋	1.1	2	1,952

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
愛眼	1.2	1.7	300
ケーユーホールディングス	0.8	1.3	1,275
吉野家ホールディングス	5	8.6	20,691
松屋フーズホールディングス	0.7	1.2	4,272
サガミホールディングス	2	3.8	3,978
関西スーパーマーケット	1.3	1.9	1,936
王将フードサービス	1.1	1.6	9,376
プレナス	1.7	2.8	5,516
ミニストップ	1.1	1.8	2,640
アークス	3.1	4.7	10,025
パローホールディングス	3.4	5.5	12,023
藤久	0.3	—	—
ベルク	0.7	1.1	5,962
大庄	0.8	1.3	1,294
ファーストリテイリング	2	3.3	224,400
サンドラッグ	5.7	9.3	27,183
サックスパー ホールディングス	1.3	2.3	1,184
ヤマザワ	0.4	0.6	950
やまや	0.3	0.5	1,212
ペルーナ	3.3	5.3	3,789
<b>銀行業 (5.3%)</b>			
島根銀行	0.4	0.8	439
じもとホールディングス	1	1.8	1,173
めぶきフィナンシャルグループ	79	128.4	32,742
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2.1	3.1	4,876
九州フィナンシャルグループ	33.3	50.5	22,321
ゆうちょ銀行	43.1	58.3	64,713
富山第一銀行	3.6	5.9	1,781
コンコルディア・フィナンシャルグループ	86.8	141.2	66,222
西日本フィナンシャルホールディングス	10.1	16.1	12,815
関西みらいフィナンシャルグループ	10.1	—	—
三十三フィナンシャルグループ	1.4	2.3	3,498
第四北越フィナンシャルグループ	2.6	4	10,440
ひろぎんホールディングス	22.4	36.5	25,623
おきなわフィナンシャルグループ	—	2.2	4,936
十六フィナンシャルグループ	—	3.3	7,477
北國フィナンシャルホールディングス	—	2.3	6,557
新生銀行	11.2	16.1	33,697

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
あおぞら銀行	9.1	13.8	35,314
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,039.8	1,550.2	1,044,214
りそなホールディングス	166.7	281.5	136,077
三井住友トラスト・ホールディングス	28.7	46.7	187,360
三井住友フィナンシャルグループ	105.1	171.1	701,338
千葉銀行	50.7	82.5	60,060
群馬銀行	29.2	47.5	17,765
武蔵野銀行	2.3	3.7	6,759
千葉興業銀行	4.2	5.8	1,583
筑波銀行	6.4	9.6	1,776
七十七銀行	5.1	7.8	10,787
青森銀行	1.2	1.9	3,583
秋田銀行	1	1.6	2,728
山形銀行	1.7	2.8	2,592
岩手銀行	1	1.6	3,081
東邦銀行	13.6	20.7	4,409
東北銀行	0.7	1.2	1,212
みちのく銀行	1	1.6	1,377
ふくおかフィナンシャルグループ	12.8	20.8	45,864
静岡銀行	37	60.2	54,842
十六銀行	1.9	—	—
スルガ銀行	15.6	21.7	11,001
八十二銀行	36.7	55.7	22,725
山梨中央銀行	1.8	2.7	2,492
大垣共立銀行	3	4.9	9,858
福井銀行	1.3	2.1	2,912
北國銀行	1.5	—	—
清水銀行	0.6	1	1,585
富山銀行	0.3	0.4	770
滋賀銀行	3	4.6	10,000
南都銀行	2.5	3.9	7,488
百五銀行	13.7	23.7	8,366
京都銀行	5.4	8.9	46,903
紀陽銀行	5.4	8.4	12,054
ほくほくフィナンシャルグループ	10.1	15.4	13,783
山陰合同銀行	9	14.7	9,452
中国銀行	13.1	19.8	18,513
鳥取銀行	0.5	0.8	935

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
伊予銀行	21.7	32.8	19,286
百十四銀行	1.6	2.6	4,123
四国銀行	2.3	3.8	2,986
阿波銀行	2.5	3.8	8,424
大分銀行	0.9	1.4	2,695
宮崎銀行	1	1.5	3,124
佐賀銀行	0.9	1.4	2,083
神縄銀行	1.4	—	—
琉球銀行	3.5	5.4	4,266
セブン銀行	50.8	73.4	17,909
みずほフィナンシャルグループ	206.5	316.1	488,532
高知銀行	0.6	0.9	689
山口フィナンシャルグループ	19	28.8	20,246
長野銀行	0.5	0.8	972
名古屋銀行	1.1	1.8	5,160
北洋銀行	22.9	37.3	9,474
愛知銀行	0.5	0.9	4,230
中京銀行	0.6	0.9	1,561
大光銀行	0.5	0.8	1,080
愛媛銀行	2.1	3.5	3,164
トマト銀行	0.6	0.9	953
京葉銀行	6.5	10.5	4,935
栃木銀行	7.4	11.9	2,594
北日本銀行	0.5	0.8	1,266
東和銀行	2.7	4.3	2,274
福島銀行	1.4	2.8	697
大東銀行	0.8	1.2	886
トモニホールディングス	11.8	19.1	6,169
フィデアホールディングス	14.9	2.3	3,171
池田泉州ホールディングス	17.5	28.5	5,130
<b>証券、商品先物取引業 (0.8%)</b>			
F P G	4.7	8.3	5,419
ジャパンインベストメントアドバイザー	0.8	1.9	1,985
マーキュリアインベストメント	0.6	—	—
マーキュリアホールディングス	—	1	510
S B Iホールディングス	17.5	30.5	88,877
日本アジア投資	1.3	1.9	343
ジャフコ グループ	2.3	3.1	17,980

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大和証券グループ本社	122	185.1	127,607
野村ホールディングス	267.5	377.4	190,511
岡三証券グループ	13	19.4	7,372
丸三証券	4.5	7.3	3,869
東洋証券	5.5	8.1	1,198
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17.5	28.4	11,360
光世証券	0.4	0.5	242
水戸証券	4.4	6.6	1,808
いちよし証券	2.8	4.6	3,100
松井証券	8.7	12.1	9,595
マネックスグループ	11.2	20.2	11,716
極東証券	2	3.3	2,455
岩井コスモホールディングス	1.4	2.3	3,141
アイザワ証券グループ	2.7	4.1	3,710
マネーパートナーズグループ	1.6	2.6	556
スパークス・グループ	7	11.4	2,998
小林洋行	0.5	0.7	150
<b>保険業 (2.2%)</b>			
かんぽ生命保険	5.4	24.9	49,999
SOMPOホールディングス	28.6	40.6	212,500
アニコム ホールディングス	5.1	7.6	5,175
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	39.7	55.4	217,223
第一生命ホールディングス	86	121.7	305,162
東京海上ホールディングス	53.7	81.4	544,403
T&Dホールディングス	45.4	64.2	105,223
アドバンスクリエイト	0.3	1.2	1,233
<b>その他金融業 (1.2%)</b>			
全国保証	4.3	5.9	30,621
あんしん保証	—	0.7	200
ジェイリース	0.4	0.8	1,392
イントラスト	0.5	1	700
日本モーゲージサービス	0.6	1.4	1,489
C a s a	0.5	0.9	786
アルヒ	2.4	3.6	4,071
プレミアグループ	0.8	1.2	4,026
クレディセゾン	10.6	15.9	20,240
芙蓉総合リース	1.6	2.6	19,760
みずほリース	2.3	3.8	12,103

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京センチュリー	3.1	4.8	26,832
日本証券金融	6.7	9.7	8,836
アイフル	23.2	41.5	13,861
リコーリース	1.2	2.2	8,261
イオンフィナンシャルサービス	9.3	13.4	16,214
アコム	30.6	48.8	15,713
ジャックス	1.7	2.7	8,316
オリエントコーポレーション	41.1	67	8,442
日立キャピタル	3.6	—	—
オリックス	94.3	150.1	355,737
三菱HCキャピタル	38.6	91.3	54,232
九州リースサービス	0.7	1.2	699
日本取引所グループ	43.6	62.6	142,696
イー・ギャランティ	1.7	3.6	6,573
アサックス	0.8	1.3	898
NECキャピタルソリューション	0.6	1	2,025
<b>不動産業 (1.9%)</b>			
いちご	19.3	27.5	8,085
日本駐車場開発	15.1	27.1	3,550
スター・マイカ・ホールディングス	0.8	1.3	1,751
SREホールディングス	—	0.6	2,784
ADワークスグループ	2.9	5	675
ヒューリック	32.2	59	61,537
三栄建築設計	0.6	1	1,544
野村不動産ホールディングス	9.2	12.8	33,497
三重交通グループホールディングス	3.1	5	2,290
サムティ	2.2	4	8,360
ディア・ライフ	2.1	3.2	1,657
コーセーアールイー	0.4	0.7	500
地主	1	1.6	2,716
プレサンスコーポレーション	2.5	3.2	6,716
THEグローバル社	0.7	1.5	258
ハウスコム	0.3	0.4	490
日本管理センター	0.8	1.2	1,147
サンセイランディック	0.4	0.7	562
エストラスト	0.2	0.3	176
フージャースホールディングス	3	3.2	2,166
オープンハウスグループ	4.8	7.9	45,662

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東急不動産ホールディングス	41.3	72.8	47,465
飯田グループホールディングス	12.7	20.6	48,698
イーランド	0.2	0.4	547
ムゲンエステート	0.9	1.5	721
ビーロット	0.7	1.7	807
ファーストブラザーズ	0.3	0.6	444
And Doホールディングス	0.7	1.2	984
シーアールイー	0.4	0.7	1,141
プロパティエージェント	0.2	0.3	456
ケイアイスター不動産	0.5	1.1	7,656
アグレ都市デザイン	0.2	0.4	529
グッドコムアセット	0.7	1.1	1,144
ジェイ・エス・ピー	0.3	0.5	1,430
テンポイノベーション	0.3	0.7	564
グローバル・リンク・マネジメント	0.3	0.4	326
フェイスネットワーク	—	0.2	254
パーク24	8.2	13.3	22,570
バラカ	0.4	0.6	936
宮越ホールディングス	—	0.9	799
三井不動産	73.9	112.7	264,957
三菱地所	106.5	162.4	267,472
平和不動産	2.8	4.2	16,422
東京建物	15	24.4	41,040
ダイビル	3.9	5.8	12,742
京阪神ビルディング	2.4	3.8	5,403
住友不動産	34.2	51.9	179,729
テーオーシー	3	4.4	3,080
東京楽天地	0.2	0.4	1,556
レオパレス21	19.9	25.7	4,420
スターツコーポレーション	2.1	3.4	8,432
フジ住宅	1.8	2.9	1,914
空港施設	1.5	2.5	1,405
明和地所	0.8	1.2	722
ゴールドクレスト	1.2	1.9	3,070
エスリード	0.6	1	1,706
日神グループホールディングス	2.2	4	1,988
日本エスコン	2.8	4.6	3,500
タカラレーベン	7	10.4	3,109

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
AVANTIA	0.9	1.3	1,080
イオンモール	7.6	12.4	20,286
毎日コムネット	0.4	0.8	556
ファースト住建	0.6	0.9	1,054
ランド	83.5	133.9	1,339
カチタス	3.8	6.1	21,472
トーセイ	2.1	3.4	3,597
穴吹興産	0.3	0.5	953
サンフロンティア不動産	2.1	3.4	3,502
FJネクストホールディングス	1.3	2.4	2,361
インテリックス	0.4	0.6	372
ランドビジネス	0.5	1	254
サンネクスタグループ	0.5	0.8	825
グランディハウス	1.2	1.7	827
日本空港ビルデング	4.9	9.4	45,637
<b>サービス業 (5.8%)</b>			
明豊ファシリティワークス	0.7	1.1	845
日本工営	1	1.4	4,249
LIFULL	5.1	7.3	1,576
ミクシィ	2.8	5.5	11,418
ジェイエイシーリクルートメント	1	1.9	3,691
日本M&Aセンターホールディングス	11.3	39.3	72,705
メンバーズ	0.4	0.7	1,468
中広	0.2	0.4	152
UTグループ	2.3	3.5	11,112
アイティメディア	0.6	1.1	1,623
タケエイ	1.6	—	—
E・Jホールディングス	0.6	1.3	1,466
夢真ビーネックスグループ	1.8	6.4	9,984
コシダカホールディングス	3.5	6.4	3,737
アルトナー	0.4	0.6	537
パソナグループ	1.6	2.6	6,676
CDS	0.4	0.6	969
リンクアンドモチベーション	2.7	5.3	2,395
GCA	1.9	—	—
エス・エム・エス	4.6	8.1	25,798
サニーサイドアップグループ	0.5	0.8	560
パーソルホールディングス	14.7	23.9	68,521

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リニカル	0.7	1.3	828
クックパッド	4.6	7.5	1,867
エスクリ	0.5	1.1	360
アイ・ケイ・ケイホールディングス	0.7	1.2	703
学情	0.5	1	981
スタジオアリス	0.7	1.1	2,349
シミックホールディングス	0.7	1.3	1,891
エプロ	0.4	0.5	361
N J S	0.4	0.5	987
総合警備保障	5.9	9.5	41,230
カカココム	10.9	17.6	42,715
アイロムグループ	0.5	0.9	1,361
セントケア・ホールディング	1	1.6	1,187
サイネックス	0.2	0.4	234
ルネサンス	0.8	1.7	1,722
ディップ	2	4.2	14,574
デジタルホールディングス	1	1.7	2,170
新日本科学	1.6	2.9	3,430
ツクイホールディングス	3.5	—	—
キャリアデザインセンター	0.3	0.6	556
ベネフィット・ワン	5.4	8.7	31,581
エムスリー	32.5	42.3	185,993
ツカダ・グローバルホールディング	1.2	1.5	396
プラス	0.2	0.3	184
アウトソーシング	8.4	13.7	18,248
ウェルネット	1.5	2.4	1,010
ワールドホールディングス	0.5	1	2,319
ディー・エヌ・エー	6.2	9.1	16,434
博報堂D Yホールディングス	20.5	33.3	60,073
ぐるなび	2.6	3.9	1,474
タカミヤ	1.6	2.9	1,122
ジャパンベストレスキューシステム	1.2	1.6	1,384
ファンココミュニケーションズ	4	6	2,274
ライク	0.5	0.6	1,102
ビジネス・ブレークスルー	0.6	0.9	365
エスポール	3.8	6.8	7,493
WDBホールディングス	0.7	1.1	2,982
手間いらず	0.1	0.3	1,338

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ティア	0.9	1.4	610
CDG	0.2	0.3	405
アドウェイズ	—	3.6	2,610
パリュエコマース	1	1.9	6,659
インフォマート	14.9	26.2	19,178
J Pホールディングス	4.6	6.1	1,366
エコナックホールディングス	2.7	4.3	374
E P Sホールディングス	2	—	—
C Lホールディングス	0.4	0.5	594
プレステージ・インターナショナル	5.5	9	6,273
アミューズ	0.8	1.3	2,644
ドリームインキュベータ	0.4	0.6	1,068
クイック	0.9	1.6	1,979
T A C	0.9	1.3	271
ケネディクス	12.7	—	—
電通グループ	16.6	24.7	97,812
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.6	1.1	1,045
びあ	0.4	0.8	2,480
イオンファンタジー	0.6	0.9	1,657
シーティーエス	1.7	2.7	2,043
ネクシィーズグループ	0.4	0.8	544
H. U. グループホールディングス	4.1	6.3	17,847
アルプス技研	1.3	2.1	3,786
サニックス	2.6	4.2	932
ダイオーズ	0.3	0.5	496
日本空調サービス	1.5	2.5	1,950
オリエンタルランド	15.7	28.3	522,276
ダスキン	3.7	5.6	15,192
明光ネットワークジャパン	1.9	2.8	1,565
ファルコホールディングス	0.8	1.1	2,196
秀英予備校	0.3	0.5	207
田谷	0.3	0.4	219
ラウンドワン	4.1	6.7	8,803
リゾートトラスト	6.8	11	20,328
ピー・エム・エル	1.9	3.1	11,082
ワタベウエディング	0.2	—	—
りらいあコミュニケーションズ	2.6	3.5	3,412
リソー教育	6.7	10.9	4,305

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
早稲田アカデミー	0.6	1.3	1,332
ユー・エス・エス	16.5	26.8	50,089
東京個別指導学院	0.5	2.1	1,213
サイバーエージェント	9.1	59	99,297
楽天グループ	68.6	123	121,770
クリーク・アンド・リバー社	0.8	1.3	2,319
モーニングスター	1.6	4.2	2,490
テー・オー・ダブリュー	2.4	4.2	1,234
山田コンサルティンググループ	1	1.2	1,234
セントラルスポーツ	0.5	0.9	2,143
フルキャストホールディングス	1.3	2	4,100
エン・ジャパン	2.6	3.9	10,869
リゾルホールディングス	0.2	0.3	1,297
テクノプロ・ホールディングス	2.9	14.3	42,556
アトラグループ	0.3	0.5	129
インターワークス	0.3	0.7	269
アイ・アールジャパンホールディングス	0.6	1.1	5,632
KeepPer 技研	1.1	1.5	2,599
ファーストロジック	0.3	0.5	390
三機サービス	0.3	0.5	488
Gunosy	0.9	1.5	1,069
デザインワン・ジャパン	0.5	0.5	91
イー・ガーディアン	0.6	1	2,731
リブセンス	0.8	1.3	224
ジャパンマテリアル	4.5	7.4	12,017
ベクトル	1.8	3.4	3,342
ウチヤマホールディングス	0.7	1.2	362
チャーム・ケア・コーポレーション	1.3	1.8	2,205
キャリアリンク	0.5	0.9	1,495
IBJ	1.2	2	1,494
アサンテ	0.6	1.1	1,810
N・フィールド	1	—	—
バリュースHR	0.6	1	2,356
M&Aキャピタルパートナーズ	1.2	2	9,280
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.6	0.9	1,343
ERIホールディングス	0.4	0.7	781
アビスト	0.2	0.4	1,158
シグマクシス・ホールディングス	1	1.4	2,958

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ウィルグループ	1	1.8	2,214
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.2	3.2	547
メドピア	0.7	1.8	5,130
レアジョブ	0.1	0.5	388
リクルートホールディングス	105.5	184.7	1,016,958
エラン	2	3.3	3,234
土木管理総合試験所	0.7	1.1	349
ネットマーケティング	0.6	1.2	486
日本郵政	120.7	312.7	301,943
ベルシステム24ホールディングス	2.5	3.4	4,804
鎌倉新書	1.1	2.7	1,355
SMN	0.3	0.5	312
一蔵	0.2	0.3	117
LITALICO	0.5	—	—
グローバルキッズCOMPANY	0.3	0.4	316
エアトリ	0.8	1.5	3,879
アトラエ	0.4	1.7	2,975
ストライク	0.6	0.9	3,825
ソラスト	4.1	5.9	6,088
セラク	0.5	0.8	901
インソース	1.2	2.3	4,271
ペイカレント・コンサルティング	0.9	1.7	68,255
Orchestra Holdings	0.3	0.5	1,307
アイモバイル	0.5	0.7	780
キャリアインデックス	0.6	0.8	582
MS-Japan	0.5	1	819
船場	0.3	0.5	367
グレイステクノロジー	0.7	3.1	195
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	3.4	7.6	12,046
フルテック	0.2	0.3	408
グリーンズ	0.4	0.9	408
ツナググループ・ホールディングス	0.3	0.5	123
GameWith	0.4	0.7	296
ソウルドアウト	0.4	0.6	612
MS&Consulting	0.3	0.3	195
ウェルビー	—	1.6	1,822
エル・ティー・エス	0.1	0.3	710
ミダックホールディングス	0.2	1	2,661

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日総工産	1	1.9	1,497
キュービーネットホールディングス	0.6	1.1	1,829
RPAホールディングス	1.1	3.4	1,115
スプリックス	0.4	0.7	1,022
マネジメントソリューションズ	0.7	1.2	3,696
プロレド・パートナーズ	0.2	0.5	407
and factory	0.1	0.5	172
テノ.ホールディングス	0.1	0.3	175
フロンティア・マネジメント	0.2	0.6	375
ピアラ	0.1	0.4	226
コプロ・ホールディングス	0.1	0.5	545
ギークス	0.2	0.4	557
カーブスホールディングス	4	6.6	4,501
フォーラムエンジニアリング	0.8	1.7	1,400
ダイレクトマーケティングミックス	0.6	2.8	3,749
ポピンズホールディングス	—	0.6	1,480
LITALICO	—	1.9	5,652
アドバンテッジリスクマネジメント	0.7	1.2	806
リログループ	8.1	13.1	26,750
東祥	0.9	1.8	2,561
TREホールディングス	—	3.3	4,636
人・夢・技術グループ	—	1	1,808
エイチ・アイ・エス	2.1	5.3	9,752
ラックランド	0.4	0.7	1,953
共立メンテナンス	2.4	4.3	17,114
イチネンホールディングス	1.6	2.5	3,160
建設技術研究所	0.9	1.4	3,364
スペース	1	1.7	1,497
長大	0.6	—	—
樫ホールディングス	0.6	1	1,509
スバル興業	0.1	0.1	840
東京テアトル	0.6	0.9	1,093
タナベ経営	0.3	0.9	576
ナガワ	0.5	0.8	7,776

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
よみうりランド	0.3	—	—	
東京都競馬	1	1.8	7,290	
常磐興産	0.6	1	1,370	
カナモト	2.6	4.2	9,462	
東京ドーム	6	—	—	
西尾レントオール	1.4	2.2	6,102	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	8.2	13.1	275	
トランス・コスモス	1.4	3	8,922	
乃村工藝社	6.3	10.3	9,609	
藤田観光	0.6	1	2,234	
KNT-CTホールディングス	0.9	1.5	1,953	
日本管財	1.6	2.6	7,238	
トーカイ	1.4	2.1	3,973	
白洋舎	0.2	0.3	339	
セコム	15.6	23.6	190,853	
セントラル警備保障	0.7	1.2	2,755	
丹青社	2.8	4.9	3,626	
メイテック	1.8	2.9	18,531	
応用地質	1.7	2.7	5,586	
船井総研ホールディングス	3	4.9	11,990	
進学会ホールディングス	0.6	0.8	243	
オオバ	1	1.7	1,280	
いであ	0.4	0.6	1,028	
学究社	0.4	0.8	1,228	
ベネッセホールディングス	4.9	8	17,976	
イオンディライト	1.8	3	9,375	
ナック	0.8	1.1	1,048	
ダイセキ	2.5	4.4	20,064	
ステップ	0.5	0.9	1,683	
合 計	株 数 ・ 金 額	16,340	27,541	64,994,960
	銘柄数<比率>	2,171	2,179	<98.9%>

(注) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。  
(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 700	百万円 -

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月25日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	千円 64,994,960	% 98.2
コール・ローン等、その他	1,164,999	1.8
投資信託財産総額	66,159,959	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

## ○特定資産の価格等の調査

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	66,159,959,748	
コール・ローン等	1,024,779,977	
株式(評価額)	64,994,960,610	
未収入金	3,387,000	
未収配当金	88,292,161	
差入委託証拠金	48,540,000	
(B) 負債	430,567,129	
未払金	31,355,350	
未払解約金	399,209,000	
未払利息	2,779	
(C) 純資産総額(A-B)	65,729,392,619	
元本	47,369,957,599	
次期繰越損益金	18,359,435,020	
(D) 受益権総口数	47,369,957,599口	
1口当たり基準価額(C/D)	13,876円	

(注) ファンドの期首元本額は30,730,895,014円、期中追加設定元本額は48,206,865,463円、期中一部解約元本額は31,567,802,878円です。

(注) 2022年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・ F Wリそな国内株式インデックスファンド	25,041,286,185円
・ リそなラップ型ファンド(安定型)	4,201,640,516円
・ つみたてバランスファンド	4,127,985,345円
・ リそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,842,266,743円
・ リそなラップ型ファンド(成長型)	2,475,233,060円
・ S m a r t i T O P I Xインデックス	1,809,725,695円
・ リそなFT T O P I Xインデックス(適格機関投資家専用)	891,112,849円
・ リそなFT R Cバランスファンド(適格機関投資家専用)	875,630,730円
・ リそなD A Aファンド(適格機関投資家専用)	676,460,355円
・ T O P I Xインデックスファンド(適格機関投資家専用)	523,744,186円
・ リそなターゲット・イヤー・ファンド2030	401,144,554円
・ F Wリそな国内株式アクティブファンド	309,678,711円
・ リそな・リスクコントロールファンド2019-09	271,319,248円
・ S m a r t i 8資産バランス 成長型	243,741,990円
・ リそなターゲット・イヤー・ファンド2040	235,030,002円
・ S m a r t i 8資産バランス 安定成長型	212,377,461円
・ リそな・リスクコントロールファンド2020-03	205,373,037円
・ リそな・リスクコントロールファンド2019-06	168,393,273円
・ リそな・リスクコントロールファンド2019-10	166,309,254円
・ リそなターゲット・イヤー・ファンド2050	157,401,716円
・ リそな・リスクコントロールファンド2019-12	100,070,061円
・ リそなD A Aマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	79,202,813円
・ S m a r t i 8資産バランス 安定型	74,574,942円
・ D Cリそな グローバルバランス	74,010,658円
・ リそなターゲット・イヤー・ファンド2035	54,800,498円
・ リそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,961,681円
・ リそなターゲット・イヤー・ファンド2045	34,179,896円
・ リそなターゲット・イヤー・ファンド2060	31,795,735円
・ リそなターゲット・イヤー・ファンド2055	18,236,850円
・ リスクコントロール・オープン	9,800,999円
・ リそなV Iグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	9,712,863円
・ リそなV Iグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	5,761,120円
・ グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	5,358,996円
・ リそなV Iグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	1,635,577円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.3876円です。

## ○損益の状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	1,118,895,992	
受取配当金	1,119,417,461	
その他収益金	361,857	
支払利息	△ 883,326	
(B) 有価証券売買損益	1,195,480,299	
売買益	6,546,045,332	
売買損	△ 5,350,565,033	
(C) 先物取引等取引損益	54,232,000	
取引益	128,205,050	
取引損	△ 73,973,050	
(D) 保管費用等	△ 4,584	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	2,368,603,707	
(F) 前期繰越損益金	10,257,863,598	
(G) 追加信託差損益金	19,675,652,837	
(H) 解約差損益金	△ 13,942,685,122	
(I) 計(E+F+G+H)	18,359,435,020	
次期繰越損益金(I)	18,359,435,020	

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

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

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

## ○お知らせ

---

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

# RM先進国株式マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日 2022年1月25日）  
（2021年1月26日～2022年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	<p>①主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>②株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p>
主要投資対象	<ul style="list-style-type: none"><li>金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式<sup>(*)</sup>（日本の株式を除きます。以下同じ。）</li><li><sup>(*)</sup> 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。</li><li>先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</li></ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"><li>株式への投資割合には、制限を設けません。</li><li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>

りそなアセットマネジメント 株式会社

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCI-KOKUSAI指数 (配当込み、円換算ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資 産額
	期 騰 落	中 率	(ベンチマーク) 期 騰 落	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
2期(2018年1月25日)	12,539	21.7	1,158,586.43	22.5	93.8	4.2	2.2	11,661
3期(2019年1月25日)	11,465	△ 8.6	1,066,031.25	△ 8.0	93.9	3.5	2.5	18,347
4期(2020年1月27日)	14,161	23.5	1,320,229.10	23.8	74.0	24.0	2.1	57,303
5期(2021年1月25日)	15,775	11.4	1,476,411.66	11.8	79.0	18.5	1.7	85,135
6期(2022年1月25日)	19,448	23.3	1,819,378.42	23.2	88.6	9.3	2.1	119,710

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注) 「MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI-KOKUSAI指数 (配当込み、円換算ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率
	騰 落	率	(ベンチマーク) 騰 落	率			
(期首) 2021年1月25日	円	%		%	%	%	%
	15,775	-	1,476,411.66	-	79.0	18.5	1.7
1月末	15,612	△ 1.0	1,461,430.72	△ 1.0	78.9	19.6	1.8
2月末	16,140	2.3	1,513,956.25	2.5	79.2	18.2	1.8
3月末	17,236	9.3	1,611,609.90	9.2	82.8	15.7	1.9
4月末	18,044	14.4	1,687,947.69	14.3	83.5	14.6	1.9
5月末	18,312	16.1	1,713,776.18	16.1	84.0	14.3	1.9
6月末	18,763	18.9	1,757,211.30	19.0	79.3	19.0	1.8
7月末	19,039	20.7	1,782,621.69	20.7	90.2	7.8	2.1
8月末	19,516	23.7	1,826,694.06	23.7	87.6	10.4	2.1
9月末	19,060	20.8	1,784,539.78	20.9	88.5	9.7	2.1
10月末	20,457	29.7	1,915,338.36	29.7	90.2	7.7	2.1
11月末	20,390	29.3	1,907,177.71	29.2	88.3	9.9	2.1
12月末	21,227	34.6	1,986,097.50	34.5	87.5	9.8	2.1
(期末) 2022年1月25日	円	%		%	%	%	%
	19,448	23.3	1,819,378.42	23.2	88.6	9.3	2.1

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ○運用経過

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末15,775円から当期末19,448円となり、3,673円の値上がりとなりました。

先進国株式の市況（MSCI-KOKUSA I 指数（配当込み、円換算ベース））の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも先進国の株価が上昇したことが寄与しました。

基準価額等の推移

(2021年1月26日～2022年1月25日)



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

## 投資環境

## 先進国株式市況

先進国の株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期前半は大規模な財政・金融支援策継続や新型コロナワクチンの接種進展が支援材料となり、先進国株式は上昇基調となりました。期後半には、新型コロナウイルス変異株の感染拡大による景気回復の後ずれ懸念から変動率が一時高まりましたが、堅調な企業業績を背景に上昇基調を維持しました。期末にかけて、世界的に経済活動の正常化が進む中で米国を中心に高インフレ環境の長期化懸念等に伴う早期利上げ観測を受け、金利動向に敏感な大型成長株を中心に売り圧力が強まり、上昇幅を縮小しました。

## 為替市況

前期末と比較して、円は米ドル・ユーロの双方に対して円安となりました。

米ドルに対して、期前半は、米長期金利上昇が主導する形で期初時点の1米ドル=104円台から110円台近辺まで円安が進みました。期後半は、世界的な株式市場の不安定化に対して円が選好される場面も見られましたが、米国における高インフレ環境の長期化懸念からFRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ前倒し観測が強まり、一時は2017年1月以来となる1米ドル=116円台まで米ドル高円安が進行しました。

ユーロに対して、期前半は、ユーロ圏地域のワクチン接種加速や欧州復興基金の運用開始に伴う景気回復期待からユーロ高円安が進みました。期後半には、ECB（欧州中央銀行）が利上げに慎重な姿勢を維持したことなどを受けて、ユーロ高円安の動きは一巡しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

日本を除く先進国の株式を主要投資対象とし、MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っていません。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+23.3%となり、ベンチマークの+23.2%を0.1%上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

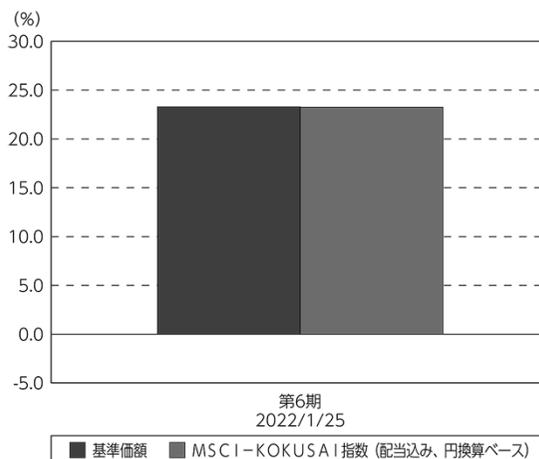
### （マイナス要因）

- ・コスト負担（株式等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
- ・配当金の課税負担が生じたこと

### （その他の要因）

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



## ○今後の運用方針

引き続き、主としてMSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている日本を除く先進国の株式に投資し、MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	( 1 )	(0.005)	
(投資信託証券)	( 0 )	(0.000)	
(先物・オプション)	( 2 )	(0.011)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.011	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	( 2 )	(0.010)	
(投資信託証券)	( 0 )	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	5	0.025	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
(保 管 費 用)	( 4 )	(0.020)	
(そ の 他)	( 1 )	(0.006)	
合 計	10	0.053	
期中の平均基準価額は、18,649円です。			

(注) 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・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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



		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ニュージーランド	百株 272	千ニュージーランドドル 312	百株 99	千ニュージーランドドル 114
	香港	4,223 ( 78)	千香港ドル 19,009 (△ 15)	636	千香港ドル 4,507
	シンガポール	1,418 ( 1,047)	千シンガポールドル 986 ( 110)	787 ( 498)	千シンガポールドル 221 ( 169)
	イスラエル	371	千イスラエルシェケル 954	—	千イスラエルシェケル —

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。



銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	2,207 ( - )	51 (△ 3)	-	-
	GECINA SA	504	66	-	-
	小計	2,711 ( - )	118 (△ 3)	-	-
	ユーロ計	2,711 ( - )	118 (△ 3)	-	-
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	SEGRO PLC	8,059	106	4,074	48
	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,984	56	-	-
	小計	16,043	163	4,074	48
	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
	STOCKLAND	24,241	112	-	-
	DEXUS/AU	9,607 (△13,745)	98 (△ 126)	-	-
	GOODMAN GROUP	6,325	134	-	-
	SCENTRE GROUP	43,055	121	39,403	117
	DEXUS/AU	-	-	-	-
	小計	83,228 ( 13,745)	466 ( 126)	39,403	117
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	7,400	549	-	-
	小計	7,400	549	-	-
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	-	-	-	-
		( 7,703)	( 11)		
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	32,400	97	-	-
		( - )	(△ 1)		
	SUNTEC REIT	-	-	8,500	12
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	52,300	108	41,300	82	
	( - )	(△0.792)	( - )	( 0)	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	-	-	-	-	
	( - )	(△0.131)			
小計	84,700 ( 7,703)	205 ( 9)	49,800 ( - )	95 ( 0)	

(注) 金額は受け渡し代金。

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

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 107,989	百万円 115,420	百万円 —	百万円 —

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

## ○株式売買比率

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	38,238,144千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	90,520,910千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.42

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年1月25日現在)

## 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AES CORP	98	133	300	34,269	公益事業
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	94	156	17,867	メディア・娯楽
AT&T INC	982	1,257	3,312	377,612	電気通信サービス
ABBVIE INC	242	311	4,120	469,806	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADVANCE AUTO PARTS INC	9	9	218	24,870	小売
AGILENT TECHNOLOGIES INC	41	52	728	83,112	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	56	64	298	34,076	各種金融
ALTICE USA INC- A	44	—	—	—	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	258	321	1,604	182,905	食品・飲料・タバコ
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7	14	188	21,546	保険
AMERISOURCEBERGEN CORP	22	25	340	38,844	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16	20	624	71,232	各種金融
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15	—	—	—	各種金融
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	52	342	39,070	各種金融
ARAMARK	22	46	158	18,101	消費者サービス
ARISTA NETWORKS INC	7	40	496	56,581	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASANA INC - CL A	—	12	67	7,688	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	8	8	134	15,282	保険
AVALARA INC	10	15	161	18,442	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	62	87	321	36,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAKER HUGHES COMPANY	71	151	410	46,843	エネルギー
BATH & BODY WORKS INC	—	47	264	30,103	小売
BILL.COM HOLDINGS INC	—	13	230	26,270	ソフトウェア・サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	2	3	218	24,966	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	22	33	250	28,587	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	21	26	2,118	241,486	各種金融
BLACKSTONE INC	89	121	1,330	151,728	各種金融
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15	24	211	24,115	商業・専門サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	187	250	1,066	121,645	ヘルスケア機器・サービス
AFLAC INC	91	112	689	78,553	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	310	386	2,418	275,704	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	16	21	336	38,367	ソフトウェア・サービス
BROWN & BROWN INC	26	40	263	30,098	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	41	52	349	39,847	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	8	11	254	28,977	小売
CBRE GROUP INC - A	47	57	576	65,679	不動産
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	29	39	271	31,003	素材
CIGNA CORP	51	58	1,389	158,437	ヘルスケア機器・サービス
CMS ENERGY CORP	38	51	325	37,062	公益事業
CSX CORP	107	390	1,342	153,028	運輸
ALBEMARLE CORP	15	21	445	50,762	素材
CVS HEALTH CORP	181	233	2,417	275,651	ヘルスケア機器・サービス
CABLE ONE INC	0.68	1	169	19,329	メディア・娯楽
COTERRA ENERGY INC	54	140	275	31,384	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	19	39	180	20,543	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	61	79	1,178	134,331	各種金融

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CARDINAL HEALTH INC	43	43	218	24,955	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	23	28	322	36,812	小売
CARNIVAL CORP	66	142	282	32,151	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	110	142	677	77,262	資本財
CARVANA CO	9	13	217	24,843	小売
CATALENT INC	21	28	297	33,885	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	75	97	2,080	237,173	資本財
CELANESE CORP	17	17	282	32,247	素材
CENTENE CORP	76	99	768	87,578	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	68	99	269	30,695	公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	19	24	193	22,096	ソフトウェア・サービス
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	9	323	36,918	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEVRON CORP	264	341	4,339	494,718	エネルギー
CHEWY INC - CLASS A	10	10	47	5,377	小売
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3	4	685	78,167	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	32	41	428	48,879	家庭用品・パーソナル用品
ALLEGHANY CORP	1	1	129	14,756	保険
CITIGROUP INC	286	357	2,238	255,256	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	56	75	383	43,700	銀行
ALLIANT ENERGY CORP	37	46	270	30,884	公益事業
CLOROX COMPANY	16	20	364	41,578	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	22	41	389	44,368	ソフトウェア・サービス
COCA-COLA CO/THE	560	724	4,342	495,038	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	112	139	1,166	133,043	家庭用品・パーソナル用品
ALLSTATE CORP	42	51	633	72,183	保険
CONAGRA BRANDS INC	65	87	307	35,043	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	180	233	1,941	221,322	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	44	64	529	60,376	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	22	29	713	81,341	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	7	9	358	40,895	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	102	148	522	59,618	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	102	123	569	64,941	素材
CROWN HOLDINGS INC	15	20	224	25,631	素材
CUMMINS INC	19	25	563	64,254	資本財
DR HORTON INC	46	59	545	62,207	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	25	33	386	44,094	公益事業
DANAHER CORP	88	113	3,139	357,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMEREN CORPORATION	33	43	374	42,652	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	17	23	325	37,109	消費者サービス
DAVITA INC	11	11	130	14,833	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	41	51	1,870	213,201	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	32	51	285	32,577	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	13	29	111	12,655	運輸
DEVON ENERGY CORP	84	114	553	63,085	エネルギー
WALT DISNEY CO/THE	248	319	4,394	501,059	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	42	52	607	69,247	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	65	86	770	87,817	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5	7	208	23,775	保険
DOLLAR GENERAL CORP	33	40	880	100,374	小売
DOMINION ENERGY INC	117	142	1,120	127,779	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	5	6	302	34,486	消費者サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DOORDASH INC - A	—	19	228	26,049	小売
AMERICAN EXPRESS CO	95	117	1,874	213,684	各種金融
DOVER CORP	21	26	452	51,605	資本財
DOW INC	99	128	727	82,937	素材
DUKE ENERGY CORP	102	132	1,363	155,486	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	97	91	705	80,447	素材
DYNATRACE INC	24	36	183	20,914	ソフトウェア・サービス
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	116	148	854	97,439	保険
EOG RESOURCES INC	77	101	1,037	118,323	エネルギー
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	5	—	—	—	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	24	39	308	35,132	消費者サービス
EASTMAN CHEMICAL CO	18	26	320	36,596	素材
ECOLAB INC	36	45	877	100,003	素材
BUNGE LTD	14	21	200	22,912	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL	50	64	403	46,011	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	81	110	1,226	139,877	ヘルスケア機器・サービス
ABBOTT LABORATORIES	243	312	3,872	441,472	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	54	75	205	23,444	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	78	105	986	112,418	資本財
ENTERGY CORP	27	34	370	42,209	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	7	9	456	52,068	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	16	20	489	55,776	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	55	55	184	21,016	各種金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	24	39	190	21,714	公益事業
EVERGY INC	25	35	225	25,660	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	44	63	543	61,917	公益事業
EXELON CORP	128	168	947	108,078	公益事業
EXXON MOBIL CORP	582	746	5,433	619,421	エネルギー
FMC CORP	19	22	241	27,587	素材
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5	7	315	35,948	各種金融
FAIR ISAAC CORP	3	5	250	28,608	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24	31	501	57,203	公益事業
AMETEK INC	30	39	541	61,736	資本財
FEDEX CORP	34	44	1,089	124,188	運輸
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	85	107	1,197	136,551	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	31	47	239	27,268	保険
AMPHENOL CORP-CL A	39	103	797	90,964	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST REPUBLIC BANK/CA	22	30	531	60,644	銀行
FIRSTENERGY CORP	80	102	423	48,232	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	11	14	317	36,242	ソフトウェア・サービス
FORD MOTOR CO	521	701	1,431	163,172	自動車・自動車部品
FORTIVE CORP	40	59	431	49,183	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	18	25	249	28,430	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	27	45	144	16,486	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	198	260	1,039	118,492	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	25	35	559	63,808	保険
GARTNER INC	11	14	428	48,890	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	34	42	1,888	215,341	ヘルスケア機器・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	9	11	321	36,674	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	32	41	856	97,694	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,216	—	—	—	資本財

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
GENERAL ELECTRIC CO	—	194	1,886	215,041	資本財
GENERAL MILLS INC	79	105	722	82,342	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	170	231	1,219	139,006	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	19	25	346	39,457	小売
GLOBAL PAYMENTS INC	41	51	718	81,906	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	15	15	155	17,698	保険
GODADDY INC - CLASS A	22	33	244	27,837	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	45	58	2,015	229,731	各種金融
WW GRAINGER INC	6	8	401	45,793	資本財
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	73	97	669	76,377	食品・飲料・タバコ
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9	15	157	17,931	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	35	47	1,153	131,532	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	191	227	811	92,526	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	119	159	454	51,865	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	53	65	461	52,658	保険
HEICO CORP	6	6	93	10,705	資本財
HEICO CORP-CLASS A	8	13	162	18,505	資本財
ARROW ELECTRONICS INC	9	13	168	19,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HERSHEY CO/THE	19	24	496	56,571	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	40	51	459	52,437	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	192	245	395	45,046	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	37	47	671	76,573	消費者サービス
HOME DEPOT INC	147	185	6,755	770,246	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	96	119	2,450	279,385	資本財
HORMEL FOODS CORP	43	43	213	24,334	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	58	58	192	21,904	資本財
HUBSPOT INC	6	7	359	41,039	ソフトウェア・サービス
HUMANA INC	17	22	866	98,760	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6	6	118	13,472	資本財
IDEX CORP	11	13	307	35,110	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	44	55	1,322	150,728	資本財
INGERSOLL-RAND INC	52	68	393	44,861	資本財
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	72	99	1,247	142,277	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	122	159	2,052	233,974	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11	43	588	67,148	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	55	69	335	38,193	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	58	58	209	23,847	メディア・娯楽
IQVIA HOLDINGS INC	25	33	809	92,243	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	417	525	7,624	869,221	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17	24	327	37,389	商業・専門サービス
JOHNSON & JOHNSON	360	463	7,552	861,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	45	45	146	16,687	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KKR & CO INC	69	90	591	67,444	各種金融
KANSAS CITY SOUTHERN	13	—	—	—	運輸
KELLOGG CO	34	45	304	34,688	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	82	131	501	57,221	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	129	170	427	48,705	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	25	30	541	61,697	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	44	58	833	95,043	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	271	355	615	70,139	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	13	20	204	23,331	公益事業

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	24	140	16,031	運輸
KROGER CO	105	131	629	71,717	食品・生活必需品小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28	35	794	90,598	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	13	16	439	50,109	ヘルスケア機器・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	51	51	230	26,229	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	31	40	1,215	138,557	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	7	10	189	21,661	自動車・自動車部品
LEIDOS HOLDINGS INC	19	25	235	26,868	商業・専門サービス
LENNAR CORP-A	37	48	483	55,072	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	4	7	210	23,953	資本財
AUTOLIV INC	7	—	—	—	自動車・自動車部品
ELI LILLY & CO	118	143	3,448	393,200	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOZONE INC	3	3	735	83,866	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	20	33	222	25,353	保険
AVERY DENNISON CORP	9	15	305	34,814	素材
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	24	29	320	36,500	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORP	34	43	1,610	183,618	資本財
LOEWS CORP	29	39	235	26,881	保険
LOWE'S COS INC	104	121	2,833	323,021	小売
LUMEN TECHNOLOGIES INC	129	167	205	23,382	電気通信サービス
M & T BANK CORP	18	24	413	47,170	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	70	70	294	33,560	消費者サービス
MSCI INC	11	14	722	82,322	各種金融
MARATHON PETROLEUM CORP	87	113	799	91,141	エネルギー
MARKEL CORP	2	2	308	35,181	保険
MARSH & MCLENNAN COS	67	88	1,390	158,515	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	9	11	444	50,658	素材
MASCO CORP	30	43	280	31,976	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	122	155	5,429	619,032	ソフトウェア・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	32	42	401	45,768	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	102	131	3,344	381,318	消費者サービス
MCKESSON CORP	21	26	651	74,240	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	44	56	491	56,040	素材
MERCK & CO. INC.	347	446	3,520	401,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	103	128	843	96,185	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	3	4	590	67,369	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK OF AMERICA CORP	1,069	1,332	5,934	676,608	銀行
MOHAWK INDUSTRIES INC	5	9	145	16,587	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	8	11	318	36,266	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	27	27	139	15,888	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	22	29	1,027	117,136	各種金融
MORGAN STANLEY	187	241	2,363	269,499	各種金融
MOSAIC CO/THE	32	55	217	24,755	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22	29	701	79,953	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	33	53	211	24,088	公益事業
NVR INC	0.54	0.54	285	32,550	耐久消費財・アパレル
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	107	143	847	96,631	各種金融
NEWELL RUBBERMAID INC	55	55	129	14,770	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	106	137	869	99,095	素材
NEXTERA ENERGY INC	270	346	2,841	323,975	公益事業

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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
NIKE INC -CL B	172	225	3,296	375,821	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	42	70	190	21,712	公益事業
NORFOLK SOUTHERN CORP	33	43	1,188	135,459	運輸
NORTHROP GRUMMAN CORP	20	26	1,062	121,085	資本財
NUCOR CORP	44	53	505	57,678	素材
OGE ENERGY CORP	29	—	—	—	公益事業
OAK STREET HEALTH INC	—	14	26	3,026	ヘルスケア機器・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	137	165	562	64,079	エネルギー
OMNICOM GROUP	32	32	244	27,903	メディア・娯楽
ONEOK INC	65	79	464	52,947	エネルギー
ORACLE CORP	275	296	2,444	278,696	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	55	70	583	66,575	資本財
OWENS CORNING	16	16	148	16,947	資本財
P G & E CORP	215	274	333	38,064	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	55	73	1,498	170,806	銀行
PPG INDUSTRIES INC	31	40	631	71,990	素材
PPL CORP	103	131	388	44,293	公益事業
PACKAGING CORP OF AMERICA	13	18	255	29,116	素材
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	273	366	41,745	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	12	16	848	96,747	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	17	22	705	80,484	資本財
PAYCOM SOFTWARE INC	7	9	296	33,852	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	190	243	4,227	481,939	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	16	20	358	40,832	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	762	988	5,092	580,597	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAXTER INTERNATIONAL INC	67	85	736	83,919	ヘルスケア機器・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	215	275	2,773	316,240	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	58	76	632	72,119	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	15	—	—	—	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	66	95	296	33,748	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	24	41	864	98,524	エネルギー
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	37	49	360	41,085	保険
PROCTER & GAMBLE CO/THE	340	428	6,909	787,727	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	82	103	1,141	130,109	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	53	68	747	85,257	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	67	87	562	64,121	公益事業
PULTEGROUP INC	36	48	260	29,754	耐久消費財・アパレル
QUEST DIAGNOSTICS INC	19	21	303	34,641	ヘルスケア機器・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	14	23	209	23,853	素材
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17	33	331	37,770	各種金融
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	211	261	2,303	262,657	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	40	51	1,326	151,183	ヘルスケア機器・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	127	169	389	44,391	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	10	—	—	—	保険
REPUBLIC SERVICES INC	30	38	488	55,717	商業・専門サービス
RESMED INC	19	24	590	67,331	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9	12	220	25,127	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	15	23	254	29,013	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	15	19	622	71,020	資本財
ROLLINS INC	30	30	96	10,987	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	13	18	814	92,871	資本財

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
S&P GLOBAL INC	33	42	1,785	203,515	各種金融
SALESFORCE.COM INC	124	172	3,852	439,186	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	185	243	890	101,515	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	214	256	2,273	259,166	各種金融
SEA LTD-ADR	—	24	369	42,117	メディア・娯楽
SEALED AIR CORP	13	26	174	19,864	素材
SEMPRA ENERGY	38	54	721	82,236	公益事業
SERVICENOW INC	26	35	1,847	210,607	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11	43	1,307	149,070	素材
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	51	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SMITH (A.O.) CORP	15	27	214	24,412	資本財
JM SMUCKER CO/THE	12	18	266	30,408	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	7	11	244	27,827	資本財
SNAP INC - A	125	187	597	68,130	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3	37	1,043	118,989	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN CO/THE	147	183	1,232	140,559	公益事業
WR BERKLEY CORP	21	21	178	20,338	保険
SOUTHWEST AIRLINES CO	22	22	96	11,028	運輸
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	192	233	7,089	808,258	各種金融
BLOCK INC	51	88	1,042	118,809	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	20	28	507	57,817	資本財
STATE STREET CORP	47	65	618	70,570	各種金融
STRYKER CORP	46	60	1,518	173,075	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	31	38	391	44,672	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	79	97	438	49,985	各種金融
SYSCO CORP	64	88	680	77,582	食品・生活必需品小売り
TJX COMPANIES INC	165	207	1,435	163,635	小売
TARGET CORP	69	85	1,881	214,540	小売
TELADOC HEALTH INC	14	27	203	23,196	ヘルスケア機器・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5	8	334	38,177	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	6	8	269	30,711	ヘルスケア機器・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	128	209	177	20,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	31	42	303	34,645	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	54	69	3,994	455,392	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	79	100	1,728	197,009	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	6	8	557	63,606	資本財
TRANSUNION	25	33	346	39,486	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	33	43	736	83,980	保険
TRUIST FINANCIAL CORP	186	232	1,447	165,041	銀行
TWILIO INC - A	18	28	563	64,240	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	106	138	485	55,313	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	5	7	349	39,810	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	39	50	457	52,181	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	30	30	137	15,650	公益事業
US BANCORP	188	244	1,389	158,366	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	127	216	784	89,438	運輸
UNION PACIFIC CORP	93	114	2,805	319,845	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	97	128	2,628	299,638	運輸
UNITED RENTALS INC	9	12	377	43,067	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	130	166	7,673	874,876	ヘルスケア機器・サービス
UNITY SOFTWARE INC	—	8	93	10,609	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	10	15	204	23,282	ヘルスケア機器・サービス
ATR PRODUCTS & CHEMICALS INC	30	39	1,106	126,167	素材
VF CORP	44	55	380	43,391	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	5	8	229	26,203	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	54	67	534	60,901	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	13	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17	24	558	63,714	ヘルスケア機器・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	569	728	3,859	440,035	電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	230	297	6,005	684,680	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	48	94	206	23,546	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	11	38	483	55,136	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	17	—	—	—	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	18	22	423	48,235	素材
WEC ENERGY GROUP INC	41	54	519	59,207	公益事業
WABTEC CORP	26	32	298	34,042	資本財
WALMART INC	194	272	3,819	435,473	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	35	44	553	63,160	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	55	75	1,123	128,081	商業・専門サービス
WATERS CORP	8	10	337	38,431	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	8	14	219	25,065	小売
WELLS FARGO & CO	539	724	3,864	440,637	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	9	12	479	54,700	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN UNION CO	55	55	98	11,225	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO	38	53	241	27,498	素材
WHIRLPOOL CORP	7	9	200	22,819	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	162	219	620	70,755	エネルギー
BOEING CO/THE	74	98	2,015	229,781	資本財
WORKDAY INC-CLASS A	22	33	825	94,154	ソフトウェア・サービス
XPO LOGISTICS INC	9	—	—	—	運輸
XCEL ENERGY INC	69	93	627	71,510	公益事業
XYLEM INC	26	32	353	40,356	資本財
YUM! BRANDS INC	40	51	645	73,633	消費者サービス
ZENDESK INC	16	22	213	24,392	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	27	35	437	49,834	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	65	82	1,642	187,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BORGWARNER INC	35	35	156	17,867	自動車・自動車部品
INVESCO LTD	59	59	127	14,575	各種金融
CHUBB LTD	63	77	1,524	173,829	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	36	44	418	47,710	素材
ACCENTURE PLC-CL A	87	111	3,796	432,834	ソフトウェア・サービス
TE CONNECTIVITY LTD	43	57	869	99,109	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APTIV PLC	36	48	684	78,053	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	52	70	1,129	128,742	資本財
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16	31	188	21,480	資本財
ALLEGION PLC	10	15	188	21,452	資本財
STERIS PLC	11	16	373	42,601	ヘルスケア機器・サービス
PERRIGO CO PLC	18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC	233	304	362	41,319	素材
CLARIVATE PLC	—	50	83	9,544	商業・専門サービス
TRANE TECHNOLOGIES PLC	31	41	725	82,768	資本財
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	5	41	4,705	小売

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AON PLC	30	39	1,091	124,420	保険
PENTAIR PLC	24	29	190	21,676	資本財
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16	—	—	—	素材
MEDTRONIC PLC	185	237	2,477	282,505	ヘルスケア機器・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	99	123	911	103,889	資本財
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	27	42	241	27,479	食品・飲料・タバコ
LINDE PLC	72	89	2,837	323,471	素材
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	12	—	—	—	保険
CHENIERE ENERGY INC	25	42	443	50,520	エネルギー
ABIOMED INC	4	7	235	26,886	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	108	137	1,098	125,218	メディア・娯楽
ADOBE INC	65	84	4,365	497,729	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	161	214	2,493	284,311	半導体・半導体製造装置
AFFIRM HOLDINGS INC	—	16	94	10,725	ソフトウェア・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	—	42	626	71,461	消費者サービス
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	21	29	331	37,754	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	10	13	631	71,993	ヘルスケア機器・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	16	21	293	33,435	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	41	50	13,204	1,505,396	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	41	52	13,841	1,578,089	メディア・娯楽
ANSYS INC	11	15	504	57,517	ソフトウェア・サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	25	103	11,756	ソフトウェア・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26	33	288	32,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	21	26	586	66,834	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	—	7	289	33,046	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOOKING HOLDINGS INC	5	7	1,712	195,284	消費者サービス
BROADCOM INC	55	72	3,917	446,605	半導体・半導体製造装置
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12	19	231	26,336	各種金融
CDW CORP/DE	21	25	480	54,798	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14	23	247	28,259	運輸
CME GROUP INC	50	63	1,421	162,067	各種金融
CADENCE DESIGN SYS INC	36	48	729	83,151	ソフトウェア・サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	35	271	30,916	消費者サービス
CARLYLE GROUP INC/THE	12	27	129	14,788	各種金融
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	29	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CERNER CORP	40	50	467	53,251	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	19	22	1,318	150,349	メディア・娯楽
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17	28	328	37,403	保険
CISCO SYSTEMS INC	582	744	4,234	482,742	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	11	16	626	71,483	商業・専門サービス
CITRIX SYSTEMS INC	17	21	232	26,563	ソフトウェア・サービス
COGNEX CORP	19	29	200	22,842	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	71	91	775	88,436	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	—	6	132	15,084	各種金融
COMCAST CORP-CLASS A	627	806	4,036	460,154	メディア・娯楽
COPART INC	28	36	472	53,915	商業・専門サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	16	16	206	23,569	ソフトウェア・サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	60	78	3,818	435,381	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	5	67	472	53,862	商業・専門サービス
COUPA SOFTWARE INC	8	12	161	18,378	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	19	33	557	63,561	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMAZON.COM INC	58	80	23,155	2,640,009	小売
AMERCO	1	1	111	12,714	運輸
DATADOG INC - CLASS A	17	34	474	54,141	ソフトウェア・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	32	37	201	23,023	ヘルスケア機器・サービス
DEXCOM INC	12	16	705	80,391	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	31	376	42,901	エネルギー
DISCOVERY INC - A	17	17	46	5,277	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	33	56	147	16,810	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-A	36	36	113	12,913	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	22	34	416	47,489	ソフトウェア・サービス
DOLLAR TREE INC	31	39	517	59,000	小売
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	87	—	—	—	半導体・半導体製造装置
DRAFTKINGS INC - CL A	25	59	119	13,658	消費者サービス
DROPBOX INC-CLASS A	26	53	127	14,589	ソフトウェア・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	61	61	278	31,787	保険
EBAY INC	98	117	699	79,731	小売
ELECTRONIC ARTS INC	38	49	674	76,932	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	17	21	278	31,706	半導体・半導体製造装置
ENTEGRIS INC	—	24	303	34,567	半導体・半導体製造装置
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3	3	68	7,811	保険
ETSY INC	17	22	349	39,836	小売
EXACT SCIENCES CORP	23	30	225	25,714	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXPEDIA GROUP INC	19	25	432	49,268	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	25	30	363	41,476	運輸
META PLATFORMS INC	329	418	12,934	1,474,607	メディア・娯楽
AMGEN INC	80	99	2,246	256,078	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FASTENAL CO	76	98	567	64,735	資本財
F5 INC	9	9	207	23,671	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIFTH THIRD BANCORP	102	124	565	64,477	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	2	173	19,770	銀行
ANALOG DEVICES INC	48	92	1,500	171,081	半導体・半導体製造装置
FISERV INC	79	103	1,065	121,456	ソフトウェア・サービス
FORTINET INC	16	23	696	79,419	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	38	61	242	27,604	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	18	18	65	7,506	メディア・娯楽
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	8	34	3,944	各種金融
GILEAD SCIENCES INC	173	216	1,487	169,619	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APPLE INC	2,336	2,904	46,950	5,352,783	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	126	158	2,208	251,784	半導体・半導体製造装置
HASBRO INC	17	26	259	29,585	耐久消費財・アパレル
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8	12	209	23,893	ソフトウェア・サービス
HOLOGIC INC	38	43	305	34,826	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	11	16	341	38,934	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	146	260	407	46,421	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	11	—	—	—	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	—	11	144	16,498	メディア・娯楽
IPG PHOTONICS CORP	5	5	85	9,783	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEXX LABORATORIES INC	11	15	770	87,849	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	19	25	932	106,352	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	25	34	258	29,462	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSULET CORP	9	12	274	31,246	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
INTEL CORP	583	715	3,716	423,761	半導体・半導体製造装置
INTUIT INC	36	48	2,583	294,553	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	16	63	1,718	195,942	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA CORP	20	26	1,036	118,161	半導体・半導体製造装置
KRAFT HEINZ CO/THE	89	113	413	47,176	食品・飲料・タバコ
LKQ CORP	28	43	242	27,698	小売
LAM RESEARCH CORP	20	24	1,532	174,752	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	30	38	932	106,350	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	59	73	1,604	182,929	ソフトウェア・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	2	2	31	3,590	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	21	26	383	43,692	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	9	9	43	4,937	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17	30	139	15,861	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	21	39	228	26,037	メディア・娯楽
LUCID GROUP INC	—	73	278	31,715	自動車・自動車部品
LULULEMON ATHLETICA INC	16	21	692	78,982	耐久消費財・アパレル
LYFT INC-A	—	40	148	16,945	運輸
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5	6	253	28,855	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	37	47	740	84,411	消費者サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	143	1,035	118,032	半導体・半導体製造装置
MASIMO CORP	7	10	227	25,915	ヘルスケア機器・サービス
MATCH GROUP INC	33	44	522	59,566	メディア・娯楽
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	37	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	36	36	39	4,527	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	5	7	793	90,476	小売
MICROSOFT CORP	982	1,254	37,184	4,239,456	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	32	94	707	80,711	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	153	193	1,607	183,269	半導体・半導体製造装置
MODERNA INC	36	59	928	105,845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	198	243	1,648	187,957	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	6	9	373	42,561	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6	7	315	36,025	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	52	68	600	68,462	食品・飲料・タバコ
NASDAQ INC	17	21	382	43,624	各種金融
NETAPP INC	24	38	332	37,878	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	60	77	3,014	343,710	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9	18	142	16,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	58	58	128	14,700	メディア・娯楽
NORDSON CORP	7	9	225	25,706	資本財
NORTHERN TRUST CORP	29	37	432	49,280	各種金融
NORTONLIFELOCK INC	62	87	229	26,177	ソフトウェア・サービス
NOVAVAX INC	—	10	85	9,794	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	—	55	304	34,707	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	84	439	10,274	1,171,349	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9	12	789	89,990	小売
OKTA INC	15	21	402	45,901	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12	18	556	63,493	運輸
ON SEMICONDUCTOR CORP	54	77	427	48,701	半導体・半導体製造装置
PPD INC	17	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PTC INC	16	16	188	21,492	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PACCAR INC	46	59	544	62,040	資本財
PAYCHEX INC	42	56	673	76,754	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	153	197	3,198	364,677	ソフトウェア・サービス
PELTON INTERACTIVE INC-A	26	44	133	15,184	耐久消費財・アパレル
PLUG POWER INC	—	84	174	19,901	資本財
POOL CORP	5	7	373	42,637	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	30	39	624	71,166	各種金融
QORVO INC	16	20	280	31,936	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	154	198	3,383	385,777	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	14	18	1,137	129,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	—	31	200	22,897	自動車・自動車部品
ROBINHOOD MARKETS INC - A	—	33	43	4,967	各種金融
ROKU INC	14	20	326	37,199	メディア・娯楽
ROSS STORES INC	47	61	602	68,676	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	17	17	101	11,574	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	30	41	325	37,119	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6	10	601	68,561	銀行
SAREPTA THERAPEUTICS INC	8	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENRY SCHEIN INC	21	21	156	17,833	ヘルスケア機器・サービス
SEAGEN INC	16	23	306	34,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	—	11	349	39,866	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	103	103	62	7,164	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	21	27	388	44,327	半導体・半導体製造装置
SOFI TECHNOLOGIES INC	—	94	125	14,344	各種金融
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	7	9	215	24,515	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	20	27	330	37,654	ソフトウェア・サービス
STARBUCKS CORP	162	208	2,047	233,406	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	23	35	195	22,257	素材
SUNRUN INC	15	28	78	8,909	資本財
SYNOPSYS INC	19	26	812	92,665	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	78	108	1,151	131,331	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	16	21	352	40,141	メディア・娯楽
10X GENOMICS INC-CLASS A	8	13	123	14,105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TERADYNE INC	23	29	435	49,622	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	102	147	13,759	1,568,703	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS INC	125	162	2,905	331,278	半導体・半導体製造装置
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5	74	487	55,526	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	16	21	460	52,490	小売
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	7	15	137	15,625	各種金融
TRIMBLE INC	34	44	323	36,891	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ULTA BEAUTY INC	7	9	346	39,515	小売
UPSTART HOLDINGS INC	—	3	32	3,708	各種金融
VERISIGN INC	13	17	376	42,910	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	20	26	521	59,476	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	36	44	1,030	117,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOMCBS INC - CLASS B	80	105	343	39,125	メディア・娯楽
VIATRIS INC	177	220	317	36,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	99	126	663	75,597	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	41	51	293	33,446	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WYNN RESORTS LTD	10	14	126	14,405	消費者サービス
XILINX INC	31	42	788	89,908	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	7	9	458	52,237	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZILLOW GROUP INC - A	9	9	47	5,387	不動産	
ZILLOW GROUP INC - C	19	26	143	16,367	不動産	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	—	40	199	22,711	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	9	13	330	37,681	ソフトウェア・サービス	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	23	36	561	64,066	ソフトウェア・サービス	
GARMIN LTD	19	26	321	36,652	耐久消費財・アパレル	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7	7	102	11,647	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NXP SEMICONDUCTORS NV	36	47	967	110,342	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY	31	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	13	13	34	3,942	電気通信サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	35	62	165	18,923	電気通信サービス	
IHS MARKIT LTD	50	68	806	91,916	商業・専門サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	17	21	498	56,794	保険	
WIX.COM LTD	7	9	129	14,721	ソフトウェア・サービス	
INMODE LTD	—	9	43	4,958	ヘルスケア機器・サービス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	37	368	41,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	16	62	246	28,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	32	37	322	36,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	7	7	111	12,763	ソフトウェア・サービス	
KORNIT DIGITAL LTD	—	8	87	10,018	資本財	
NOVOCURE LTD	12	16	115	13,180	ヘルスケア機器・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	201	201	110	12,580	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	28	41	243	27,719	資本財	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	23	—	—	—	資本財	
小計	株数	金額	42,475	55,438	678,923	77,404,118
	銘柄数	<比率>	592	606	—	<64.7%>
(カナダ)			千カナダドル			
AIR CANADA	8	8	18	1,651	運輸	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	89	140	245	22,134	公益事業	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—	142	708	63,931	食品・生活必需品小売り	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	117	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
BCE INC	24	12	81	7,379	電気通信サービス	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	26	33	2,989	資本財	
BAUSCH HEALTH COS INC	32	61	190	17,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACKBERRY LTD	14	73	76	6,867	ソフトウェア・サービス	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	179	251	1,701	153,487	各種金融	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	20	20	85	7,717	公益事業	
B2GOLD CORP	101	—	—	—	素材	
CAE INC	31	59	184	16,674	資本財	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	16	31	201	18,159	素材	
CGI INC	34	37	400	36,118	ソフトウェア・サービス	
CI FINANCIAL CORP	7	—	—	—	各種金融	
CAMECO CORP	24	80	203	18,320	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	59	77	1,220	110,140	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	99	121	1,873	169,017	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	162	205	1,278	115,400	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	18	161	1,501	135,442	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	9	9	165	14,898	小売	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	9	9	35	3,183	公益事業	
CANOPY GROWTH CORP	36	36	34	3,086	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
CENOVUS ENERGY INC	103	220	388	35,017	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2	3	709	64,028	ソフトウェア・サービス
ALTAGAS LTD	29	72	184	16,671	公益事業
DOLLARAMA INC	34	52	326	29,495	小売
EMERA INC	41	45	268	24,218	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	26	26	97	8,837	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	285	350	1,782	160,851	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	4	274	24,726	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	92	102	329	29,721	素材
FIRSTSERVICE CORP	6	6	133	12,004	不動産
FORTIS INC	64	82	483	43,585	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	26	32	532	48,010	素材
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	31	31	128	11,614	商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	18	37	186	16,840	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFE CO INC	43	43	165	14,913	保険
HYDRO ONE LTD	49	49	160	14,437	公益事業
IGM FINANCIAL INC	0.81	16	73	6,594	各種金融
IA FINANCIAL CORP INC	12	27	214	19,333	保険
IMPERIAL OIL LTD	28	47	239	21,618	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	20	30	506	45,740	保険
INTER PIPELINE LTD	34	—	—	—	エネルギー
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	103	116	10,543	素材
ATCO LTD -CLASS I	8	—	—	—	公益事業
KEYERA CORP	22	56	156	14,101	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	190	190	134	12,179	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	31	50	254	22,924	素材
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	15	60	5,497	ソフトウェア・サービス
LOBLAW COMPANIES LTD	21	32	302	27,301	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	73	169	177	15,994	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	42	54	536	48,375	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	265	335	839	75,774	保険
METRO INC	41	43	277	25,046	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	46	56	549	49,542	銀行
BANK OF MONTREAL	85	111	1,584	142,948	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	160	209	1,859	167,825	銀行
NORTHLAND POWER INC	32	32	117	10,560	公益事業
NUTRIEN LTD	17	96	845	76,306	素材
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	—	8	62	5,598	ソフトウェア・サービス
BARRICK GOLD CORP	238	298	729	65,808	素材
ONEX CORPORATION	9	9	81	7,376	各種金融
OPEN TEXT CORP	42	42	253	22,863	ソフトウェア・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	20	53	155	14,060	素材
PARKLAND CORP	17	17	59	5,355	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	86	102	395	35,676	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	83	108	436	39,414	保険
QUEBECOR INC -CL B	12	45	133	12,027	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERN	41	52	373	33,665	消費者サービス
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	18	18	141	12,736	商業・専門サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	51	61	373	33,694	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	197	252	3,615	326,184	銀行
SSR MINING INC	28	—	—	—	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
SAPUTO INC	36	36	100	9,082	食品・飲料・タバコ	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	57	87	329	29,726	メディア・娯楽	
SHOPIFY INC - CLASS A	15	20	2,380	214,791	ソフトウェア・サービス	
AGNICO EAGLE MINES LTD	34	47	300	27,143	素材	
SUN LIFE FINANCIAL INC	80	99	696	62,863	保険	
SUNCOR ENERGY INC	209	256	850	76,733	エネルギー	
TFI INTERNATIONAL INC	—	16	198	17,881	運輸	
TMX GROUP LTD	5	14	182	16,463	各種金融	
TC ENERGY CORP	125	173	1,081	97,622	エネルギー	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	74	82	332	29,991	素材	
TELUS CORP	40	82	240	21,699	電気通信サービス	
THOMSON REUTERS CORP	27	29	395	35,640	商業・専門サービス	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	14	14	151	13,676	資本財	
TORONTO-DOMINION BANK	250	322	3,201	288,889	銀行	
TOURMALINE OIL CORP	—	60	261	23,586	エネルギー	
WSP GLOBAL INC	13	19	317	28,607	資本財	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	16	186	16,834	素材	
WESTON (GEORGE) LTD	8	15	209	18,911	食品・生活必需品小売り	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	62	78	400	36,168	素材	
YAMANA GOLD INC	92	—	—	—	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,152	6,951	43,863	3,957,797	
	銘柄 数 < 比 率 >	86	87	—	< 3.3% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG	27	33	794	102,572	耐久消費財・アパレル	
FRESENIUS SE & CO KGAA	57	71	253	32,657	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7	7	25	3,335	電気通信サービス	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	10	—	—	—	素材	
HANNOVER RUECK SE	7	11	185	23,937	保険	
GEA GROUP AG	16	34	143	18,529	資本財	
CONTINENTAL AG	16	20	181	23,377	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	132	178	900	116,183	運輸	
MERCK KGAA	17	21	417	53,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE AG	87	110	390	50,380	公益事業	
SAP SE	144	185	2,172	280,369	ソフトウェア・サービス	
E.ON SE	304	384	457	59,102	公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	15	15	113	14,605	家庭用品・パーソナル用品	
PUMA SE	15	20	185	23,988	耐久消費財・アパレル	
BAYER AG-REG	129	170	860	110,995	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	23	32	244	31,573	家庭用品・パーソナル用品	
BASF SE	129	165	1,073	138,584	素材	
BEIERSDORF AG	11	17	153	19,803	家庭用品・パーソナル用品	
HOCHTIEF AG	0.17	—	—	—	資本財	
HEIDELBERGCEMENT AG	21	21	129	16,768	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	29	38	219	28,287	ヘルスケア機器・サービス	
ALLIANZ SE-REG	58	73	1,592	205,573	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14	109	72	9,371	運輸	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	18	24	636	82,178	保険	
VOLKSWAGEN AG	4	4	113	14,596	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG-PREF	25	32	591	76,371	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	113	149	1,026	132,501	自動車・自動車部品	
NEMETSCHKE SE	5	13	100	12,912	ソフトウェア・サービス	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SIEMENS AG-REG	106	136	1,896	244,818	資本財	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	274	352	386	49,936	各種金融	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	45	58	538	69,521	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6	6	46	5,951	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	473	577	920	118,851	電気通信サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	5	5	220	28,506	ヘルスケア機器・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	182	225	777	100,286	半導体・半導体製造装置	
RATIONAL AG	0.8	0.8	59	7,646	資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2	6	84	10,858	ヘルスケア機器・サービス	
BECHTLE AG	4	12	63	8,187	ソフトウェア・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	25	32	526	67,943	各種金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	17	23	195	25,190	自動車・自動車部品	
LANXESS AG	7	19	99	12,832	素材	
MTU AERO ENGINES AG	8	9	174	22,577	資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE	49	—	—	—	不動産	
SYMRISE AG	18	23	258	33,385	素材	
BRENTAG SE	24	24	181	23,414	資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	17	39	112	14,496	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	126	126	32	4,137	電気通信サービス	
COMMERZBANK AG	138	138	99	12,813	銀行	
LEG IMMOBILIEN SE	10	15	171	22,104	不動産	
KION GROUP AG	7	13	112	14,500	資本財	
VONOVIA SE	70	129	611	78,967	不動産	
KNORR-BREMSE AG	11	11	99	12,887	資本財	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	34	46	270	34,934	ヘルスケア機器・サービス	
TEAMVIEWER AG	22	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS ENERGY AG	50	77	140	18,112	資本財	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	—	10	40	5,228	素材	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	74	237	30,589	資本財	
ZALANDO SE	21	37	246	31,795	小売	
SCOUT24 SE	16	16	88	11,418	メディア・娯楽	
COVESTRO AG	25	33	175	22,609	素材	
HELLOFRESH SE	22	30	163	21,115	食品・生活必需品小売り	
UNIPER SE	28	15	61	7,925	公益事業	
DELIVERY HERO SE	19	29	204	26,420	小売	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,320 61	4,310 59	22,333 —	2,882,403 <2.4%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	160	204	363	46,907	保険	
INTESA SANPAOLO	2,230	2,819	695	89,763	銀行	
MEDIOBANCA SPA	68	106	104	13,434	銀行	
ENEL SPA	1,138	1,461	973	125,679	公益事業	
ENI SPA	355	429	544	70,261	エネルギー	
SNAM SPA	325	325	161	20,795	公益事業	
TELECOM ITALIA SPA	720	2,428	99	12,816	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	714	—	—	—	電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	80	80	131	16,916	運輸	
TERNA SPA	163	255	174	22,530	公益事業	
RECORDATI SPA	8	19	99	12,838	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPLIFON SPA	20	20	76	9,895	ヘルスケア機器・サービス	
PRYSMIAN SPA	28	45	135	17,502	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DIASORIN SPA	2	6	84	10,934	ヘルスケア機器・サービス
MONCLER SPA	24	33	183	23,685	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA	70	70	91	11,837	ソフトウェア・サービス
FINECOBANK SPA	70	110	164	21,175	銀行
UNICREDIT SPA	295	358	460	59,421	銀行
POSTE ITALIANE SPA	53	111	123	15,879	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	24	24	22	2,906	電気通信サービス
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	6,556	8,912	4,689	605,184	
	銘柄 数 < 比 率 >	20	19	—	<0.5%>
(ユーロ…フランス)					
BOUYGUES SA	34	34	108	14,021	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	85	113	347	44,863	公益事業
L'OREAL	34	44	1,643	212,103	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	38	49	3,257	420,433	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA	0.11	—	—	—	資本財
THALES SA	17	17	142	18,350	資本財
CAPGEMINI SA	22	27	526	68,002	ソフトウェア・サービス
PUBLICIS GROUPE	36	36	206	26,597	メディア・娯楽
FAURECIA	8	23	90	11,688	自動車・自動車部品
BOLLORE	32	148	68	8,873	メディア・娯楽
MICHELIN (CGDE)	23	30	437	56,423	自動車・自動車部品
PERNOD RICARD SA	28	36	703	90,741	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	30	30	100	12,950	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	2	2	50	6,538	食品・飲料・タバコ
SEB SA	1	6	77	9,950	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	73	96	1,447	186,836	資本財
VIVENDI	118	141	158	20,399	メディア・娯楽
ORANGE	281	345	345	44,588	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	4	5	719	92,881	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	18	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KERING	10	13	868	112,137	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	10	34	74	9,556	保険
CARREFOUR SA	70	109	190	24,645	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	15	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SANOFI	156	202	1,791	231,218	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA	23	23	71	9,273	消費者サービス
SOCIETE GENERALE SA	120	146	455	58,813	銀行
TELEPERFORMANCE	8	10	351	45,352	商業・専門サービス
EURAZEO	4	4	28	3,703	各種金融
SODEXO	10	15	126	16,263	消費者サービス
AXA SA	261	334	895	115,601	保険
ESSILORLUXOTTICA	38	51	854	110,345	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA	165	219	282	36,517	銀行
BNP PARIBAS	149	197	1,184	152,857	銀行
ORPEA	5	10	75	9,772	ヘルスケア機器・サービス
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	72	86	503	64,944	資本財
WENDEL	2	2	27	3,587	各種金融
ILIAD SA	0.98	—	—	—	電気通信サービス
SAFRAN SA	43	58	610	78,843	資本財
ENGIE	251	313	412	53,268	公益事業
ALSTOM	39	58	178	23,091	資本財

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
EDF	104	104	84	10,935	公益事業	
IPSEN	1	1	13	1,703	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARKEMA	8	10	132	17,094	素材	
LEGRAND SA	37	45	408	52,748	資本財	
EIFFAGE	13	15	136	17,651	資本財	
TOTALENERGIES SE	350	446	2,137	275,913	エネルギー	
ADP	3	3	37	4,901	運輸	
NATIXIS	31	—	—	—	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT	10	23	118	15,283	メディア・娯楽	
SCOR SE	15	—	—	—	保険	
VINCI SA	73	94	903	116,623	資本財	
DANONE	82	113	636	82,205	食品・飲料・タバコ	
AIR LIQUIDE SA	66	84	1,279	165,107	素材	
BUREAU VERITAS SA	45	45	112	14,531	商業・専門サービス	
GETLINK	46	92	128	16,598	運輸	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	57	—	—	—	公益事業	
EDENRED	37	42	161	20,884	ソフトウェア・サービス	
VALEO SA	36	36	89	11,516	自動車・自動車部品	
BIOMERIEUX	4	8	82	10,688	ヘルスケア機器・サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8	23	83	10,798	消費者サービス	
DASSAULT SYSTEMES SE	—	116	495	64,009	ソフトウェア・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	—	1	11	1,419	資本財	
WORLDLINE SA	30	40	170	21,974	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4	4	163	21,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	6	6	41	5,359	各種金融	
小計	株数・金額	3,431	4,445	26,848	3,465,125	
	銘柄数<比率>	64	59	—	<2.9%>	
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE	78	105	1,135	146,540	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	—	8	269	34,759	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	18	18	106	13,749	商業・専門サービス	
WOLTERS KLUWER	36	49	430	55,518	商業・専門サービス	
VOPAK	7	—	—	—	エネルギー	
AEGON NV	165	350	169	21,813	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	589	589	165	21,331	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	87	124	483	62,371	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	120	152	428	55,264	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	34	44	434	56,049	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	18	18	145	18,744	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	23	29	495	63,986	素材	
ASML HOLDING NV	58	72	4,230	546,016	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	146	177	504	65,053	食品・生活必需品小売り	
FERRARI NV	17	22	435	56,255	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	162	193	253	32,760	資本財	
AKZO NOBEL	26	32	290	37,458	素材	
PROSUS NV	68	165	1,200	154,953	小売	
JDE PEET'S BV	11	11	30	3,873	食品・飲料・タバコ	
STELLANTIS NV	154	—	—	—	自動車・自動車部品	
STELLANTIS NV	164	353	593	76,597	自動車・自動車部品	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	90	90	100	12,953	食品・飲料・タバコ	
EURONEXT NV	—	17	143	18,523	各種金融	

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		
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
IMCD NV	—	10	160	20,765	資本財	
NN GROUP NV	40	40	194	25,104	保険	
ARGENX SE	6	9	209	27,100	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	141	296	38,260	メディア・娯楽	
JUST EAT TAKEAWAY	19	35	150	19,413	小売	
ABN AMRO BANK NV-CVA	38	79	109	14,196	銀行	
EXOR NV	13	22	159	20,591	各種金融	
ALTICE EUROPE NV	73	—	—	—	電気通信サービス	
QIAGEN N.V.	26	42	182	23,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADYEN NV	2	3	589	76,022	ソフトウェア・サービス	
ING GROEP NV-CVA	513	695	866	111,814	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,816	3,708	14,964	1,931,355	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	31	—	< 1.6% >	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA	48	48	93	12,047	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	910	1,142	620	80,093	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	46	46	131	16,946	公益事業	
REPSOL SA	217	249	260	33,614	エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	2,405	3,028	891	115,037	銀行	
TELEFONICA SA	690	916	368	47,585	電気通信サービス	
ENAGAS SA	26	65	127	16,493	公益事業	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A.	22	41	68	8,833	資本財	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	28	42	94	12,234	資本財	
FERROVIAL SA	70	70	173	22,368	資本財	
CAIXABANK S.A	525	787	211	27,315	銀行	
IBERDROLA SA	837	1,017	1,014	130,893	公益事業	
EDP RENOVAVEIS SA	—	45	83	10,792	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA	61	76	457	59,025	ソフトウェア・サービス	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	49	86	153	19,823	公益事業	
(Right)ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	28	—	—	—	資本財	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	147	185	504	65,121	小売	
AENA SME SA	10	14	213	27,599	運輸	
CELLNEX TELECOM SA	44	88	362	46,732	電気通信サービス	
GRIFOLS SA	33	33	51	6,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,205	7,986	5,882	759,160	
	銘柄 数 < 比 率 >	19	19	—	< 0.6% >	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV	35	45	340	43,916	銀行	
SOFINA	1	1	57	7,475	各種金融	
SOLVAY SA	9	14	157	20,283	素材	
UCB SA	20	22	191	24,687	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	2	2	10	1,326	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	19	19	183	23,686	各種金融	
PROXIMUS	9	9	16	2,072	電気通信サービス	
GALAPAGOS NV	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ELIA GROUP SA/NV	3	3	38	4,991	公益事業	
AGEAS	27	32	133	17,231	保険	
UMICORE	23	38	126	16,342	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	101	141	799	103,132	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	260	331	2,054	265,146	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	11	—	< 0.2% >	

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…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
OMV AG	14	25	132	17,161	エネルギー	
VERBUND AG	7	10	94	12,232	公益事業	
VOESTALPINE AG	24	24	72	9,389	素材	
ERSTE GROUP BANK AG	39	59	240	31,063	銀行	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	12	24	56	7,286	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	98	144	597	77,133	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
TENARIS SA	50	50	49	6,435	エネルギー	
SES	22	—	—	—	メディア・娯楽	
AROUNDTOWN SA	104	209	112	14,511	不動産	
INPOST SA	—	31	20	2,679	運輸	
EUROFINS SCIENTIFIC	15	21	189	24,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	113	123	333	43,004	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	306	437	705	91,030	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(ユーロ…フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS	44	44	117	15,130	食品・生活必需品小売り	
WARTSILA OYJ ABP	27	81	95	12,315	資本財	
UPM-KYMMENE OYJ	80	99	337	43,493	素材	
STORA ENSO OYJ-R SHS	87	116	188	24,340	素材	
SAMPO OYJ-A SHS	64	84	346	44,765	保険	
FORTUM OYJ	63	76	179	23,147	公益事業	
ELISA OYJ	21	25	133	17,167	電気通信サービス	
NOKIA OYJ	760	927	444	57,389	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NESTE OYJ	57	70	277	35,766	エネルギー	
KONE OYJ-B	45	56	315	40,668	資本財	
ORION OYJ-CLASS B	7	26	92	11,882	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,261	1,609	2,526	326,067	
	銘柄 数 < 比 率 >	11	11	—	< 0.3% >	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC	103	136	588	75,948	素材	
KINGSPAN GROUP PLC	20	29	235	30,437	資本財	
KERRY GROUP PLC-A	20	27	300	38,763	食品・飲料・タバコ	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39	39	179	23,117	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	23	27	350	45,192	消費者サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	207	260	1,653	213,458	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.2% >	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	371	495	219	28,316	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	74	74	68	8,859	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	52	52	108	13,998	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	497	621	396	51,173	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.0% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	24,962	32,769	82,653	10,667,239	
	銘柄 数 < 比 率 >	235	227	—	< 8.9% >	
(イギリス)			千英ポンド			
ANTOFAGASTA PLC	43	74	100	15,489	素材	
ASHTED GROUP PLC	62	76	377	57,989	資本財	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	121	204	125	19,347	耐久消費財・アパレル	
AVIVA PLC	607	746	316	48,628	保険	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
DIAGEO PLC	325	414	1,520	233,695	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	11	27	91	14,029	各種金融
DCC PLC	14	14	85	13,187	資本財
BAE SYSTEMS PLC	439	550	329	50,610	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	320	376	1,198	184,187	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	44	67	163	25,172	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	397	494	241	37,097	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	142	163	283	43,532	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	2,817	3,624	1,783	274,141	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	835	1,042	293	45,093	保険
WM MORRISON SUPERMARKETS	230	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49	49	98	15,186	食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC	73	137	82	12,679	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	51	51	124	19,079	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	348	449	553	85,143	保険
RIO TINTO PLC	157	200	1,057	162,494	素材
ST JAMES'S PLACE PLC	77	114	172	26,559	各種金融
SSE PLC	143	182	279	43,018	公益事業
BP PLC	2,840	3,490	1,271	195,361	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,437	12,137	598	91,918	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	433	775	113	17,516	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	1,323	—	—	—	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	121	168	204	31,390	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	696	893	1,442	221,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASTRAZENECA PLC	181	273	2,277	350,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	1,296	1,617	300	46,254	電気通信サービス
BARCLAYS PLC	2,315	2,906	553	85,040	銀行
INTERTEK GROUP PLC	18	25	135	20,896	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	58	71	134	20,714	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	18	25	183	28,149	小売
KINGFISHER PLC	298	464	146	22,593	小売
SAINSBURY (J) PLC	278	278	79	12,153	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	27	27	85	13,184	保険
BERKELEY GROUP HOLDINGS	14	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	574	707	1,235	189,930	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	521	639	1,116	171,667	エネルギー
BUNZL PLC	47	70	191	29,399	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	208	295	154	23,693	商業・専門サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13	38	75	11,612	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	42	56	412	63,422	各種金融
UNILEVER PLC	362	452	1,783	274,146	家庭用品・パーソナル用品
EXPERIAN PLC	121	168	497	76,419	商業・専門サービス
MONDI PLC	56	78	139	21,366	素材
SEVERN TRENT PLC	27	52	152	23,439	公益事業
WHITBREAD PLC	29	29	85	13,208	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	30	55	72	11,149	各種金融
SMITHS GROUP PLC	38	69	106	16,294	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	166	220	710	109,197	素材
3I GROUP PLC	140	189	246	37,818	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	99	123	790	121,553	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	257	343	766	117,749	商業・専門サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
FRESNILLO PLC	28	—	—	—	素材	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	78	131	139	21,377	公益事業	
OCADO GROUP PLC	63	92	125	19,276	食品・生活必需品小売り	
GLENCORE PLC	1,381	1,703	661	101,625	素材	
ENTAIN PLC	69	106	165	25,406	消費者サービス	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,072	1,644	185	28,570	資本財	
EVRAZ PLC	30	30	15	2,344	素材	
NMC HEALTH PLC	4	4	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
NATWEST GROUP PLC	731	1,064	244	37,603	銀行	
SAGE GROUP PLC/THE	151	185	142	21,908	ソフトウェア・サービス	
WPP PLC	195	195	223	34,413	メディア・娯楽	
COCA-COLA HBC AG-DI	18	38	95	14,611	食品・飲料・タバコ	
AVEVA GROUP PLC	7	20	57	8,830	ソフトウェア・サービス	
COMPASS GROUP PLC	243	301	488	75,051	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC	467	652	704	108,223	公益事業	
ABRDN PLC	329	329	75	11,603	各種金融	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	87	87	57	8,876	保険	
BHP GROUP PLC	281	370	865	133,044	素材	
VODAFONE GROUP PLC	3,601	4,983	612	94,100	電気通信サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	25	31	145	22,354	消費者サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	21	26	202	31,176	素材	
FERGUSON PLC	30	37	428	65,883	資本財	
M&G PLC	419	419	86	13,320	各種金融	
RSA INSURANCE GROUP LTD	164	—	—	—	保険	
TESCO PLC	—	1,314	378	58,246	食品・生活必需品小売り	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	—	13	56	8,693	耐久消費財・アパレル	
JD SPORTS FASHION PLC	—	248	45	6,971	小売	
INFORMA PLC	176	300	158	24,333	メディア・娯楽	
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	689	102	15,822	資本財	
AUTO TRADER GROUP PLC	113	203	134	20,646	メディア・娯楽	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8	12	152	23,483	資本財	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	195	—	—	—	保険	
JD SPORTS FASHION PLC	49	—	—	—	小売	
MELROSE INDUSTRIES PLC	766	—	—	—	資本財	
JOHNSON MATTHEY PLC	18	31	58	9,029	素材	
小計	株数・金額	40,248	51,081	32,154	4,942,163	
	銘柄数<比率>	86	82	—	<4.1%>	
(スイス)			千スイスフラン			
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.42	0.76	164	20,543	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.15	0.24	238	29,788	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	101	12,642	食品・飲料・タバコ	
ROCHE HOLDING AG-BR	—	6	223	27,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HOLCIM LTD	—	90	438	54,689	素材	
CLARIANT AG-REG	28	28	54	6,757	素材	
TEMENOS GROUP AG-REG	7	11	121	15,158	ソフトウェア・サービス	
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	1	59	7,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1	1	257	32,114	ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	2	2	13	1,714	耐久消費財・アパレル	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.78	0.78	70	8,791	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	11	11	97	12,123	不動産	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2	4	498	62,120	各種金融	

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株		千スイスフラン	千円	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2	2		46	5,747	資本財
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	23	29		195	24,406	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIKA AG-REG	19	24		757	94,481	素材
ALCON INC	66	85		580	72,372	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2	—		—	—	銀行
VAT GROUP AG	—	5		179	22,326	資本財
VIFOR PHARMA AG	6	6		103	12,850	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG	0.9	1		311	38,832	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	4	4		213	26,613	電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	1	1		642	80,094	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	21	26		1,133	141,375	保険
NOVARTIS AG-REG	305	384		2,949	367,791	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD-REG	243	294		941	117,367	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	96	123		4,270	532,392	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO SA-REG	23	23		106	13,313	商業・専門サービス
HOLCIM LTD	71	—		—	—	素材
NESTLE SA-REG	395	498		5,883	733,493	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG - REG	6	6		101	12,634	保険
SONOVA HOLDING AG-REG	8	10		313	39,104	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	329	445		368	45,950	各種金融
SWATCH GROUP AG/THE-BR	4	4		118	14,809	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	9	13		807	100,634	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3	5		319	39,828	保険
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4	7		153	19,110	資本財
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8	9		233	29,163	運輸
GEBERIT AG-REG	5	6		397	49,608	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	35	35		210	26,227	各種金融
SWISS RE AG	40	51		494	61,714	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	69	93		1,198	149,392	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG-REG	487	656		1,094	136,502	各種金融
小計	株数・金額	2,351	3,016	26,467	3,299,941	
	銘柄数<比率>	39	41	—	<2.8%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	9	9		418	5,151	各種金融
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	238	313		3,649	44,890	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	133	179		3,194	39,288	銀行
SWEDISH MATCH AB	19	—		—	—	食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS	38	38		422	5,195	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	62	—		—	—	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	95	130		2,193	26,982	小売
ERICSSON LM-B SHS	394	503		5,050	62,118	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB	311	492		1,744	21,453	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	49	76		1,720	21,167	資本財
LUNDIN ENERGY AB	10	32		1,132	13,932	エネルギー
ALFA LAVAL AB	45	64		1,991	24,497	資本財
GETINGE AB-B SHS	—	45		1,455	17,897	ヘルスケア機器・サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	15	15		894	10,997	不動産
ICA GRUPPEN AB	14	—		—	—	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	28	80		988	12,153	資本財
ELECTROLUX AB-SER B	36	—		—	—	耐久消費財・アパレル
SBF AB-B SHARES	45	72		1,476	18,159	資本財

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円		
VOLVO AB-A SHS	—	32	686	8,445	資本財	
VOLVO AB-B SHS	203	251	5,197	63,923	資本財	
SANDVIK AB	156	193	4,568	56,188	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	17	20	578	7,118	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	23	23	646	7,956	各種金融	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	94	106	1,619	19,925	素材	
HEXAGON AB-B SHS	39	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELE2 AB-B SHS	74	74	965	11,880	電気通信サービス	
SAGAX AB-B	—	32	830	10,213	不動産	
ATLAS COPCO AB-A SHS	91	123	6,724	82,706	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	55	68	3,234	39,778	資本財	
EPIROC AB-A	95	—	—	—	資本財	
EPIROC AB-B	46	—	—	—	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	82	120	3,230	39,736	家庭用品・パーソナル用品	
EQT AB	23	51	1,834	22,566	各種金融	
BOLIDEN AB	40	—	—	—	素材	
EVOLUTION AB	18	30	3,423	42,110	消費者サービス	
SINCH AB	—	72	632	7,783	ソフトウェア・サービス	
LIFCO AB-B SHS	—	45	931	11,463	資本財	
EPIROC AB-A	—	112	2,345	28,853	資本財	
EPIROC AB-B	—	46	812	9,989	資本財	
EMBRACER GROUP AB	—	83	704	8,662	メディア・娯楽	
INVESTOR AB-A SHS	—	97	1,987	24,442	各種金融	
INVESTOR AB-B SHS	—	314	6,109	75,147	各種金融	
BOLIDEN AB	—	40	1,502	18,485	素材	
KINNEVIK AB - B	38	—	—	—	各種金融	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	269	2,310	28,420	資本財	
KINNEVIK AB - B	—	38	1,017	12,514	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	—	339	4,034	49,625	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SWEDISH MATCH AB	—	263	1,887	23,218	食品・飲料・タバコ	
ELECTROLUX AB-B	—	36	698	8,588	耐久消費財・アパレル	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	230	286	2,837	34,903	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	138	172	4,248	52,258	資本財	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	48	—	—	—	資本財	
NORDEA BANK ABP	437	559	5,789	71,213	銀行	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14	14	408	5,022	資本財	
小計	株数	金額	3,520	5,977	98,132	1,207,028
銘柄数 < 比率 >	38	44	—	—	—	< 1.0% >
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	131	—	—	—	銀行	
TELENOR ASA	92	138	1,950	24,754	電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA-CL A	11	11	307	3,902	メディア・娯楽	
EQUINOR ASA	141	179	4,443	56,385	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	27	27	1,217	15,446	素材	
MOWI ASA	56	87	1,762	22,366	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA	202	210	1,438	18,256	素材	
AKER BP ASA	—	24	704	8,939	エネルギー	
ORKLA ASA	111	111	946	12,007	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	26	26	572	7,265	保険	
ADEVINTA ASA	39	39	360	4,573	メディア・娯楽	
DNB BANK ASA	—	151	3,071	38,978	銀行	

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
					外貨建金額	邦貨換算金額
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円		
SCHIBSTED ASA-B SHS	5	22	544	6,907	メディア・娯楽	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	847	1,032	17,319	219,782	
(デンマーク)	11	12	—	<0.2%>		
CARLSBERG AS-B	16	20	2,205	38,223	食品・飲料・タバコ	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	0.99	0.99	2,178	37,744	運輸	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.39	0.67	1,372	23,779	運輸	
GN STORE NORD A/S	18	18	696	12,066	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	98	131	1,632	28,285	銀行	
GENMAB A/S	9	11	2,414	41,838	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	1	1	313	5,439	資本財	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	27	—	—	—	資本財	
H LUNDBECK A/S	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DSV A/S	28	34	4,397	76,207	運輸	
PANDORA A/S	16	18	1,307	22,657	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	12	20	1,077	18,667	素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	33	33	1,526	26,462	素材	
COLOPLAST-B	16	22	2,108	36,548	ヘルスケア機器・サービス	
AMBU A/S-B	15	15	198	3,437	ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	238	298	18,151	314,572	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	174	3,034	52,594	資本財	
TRYG A/S	6	46	738	12,799	保険	
ORSTED A/S	26	32	2,319	40,197	公益事業	
DEMANT A/S	5	19	542	9,405	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	574	901	46,216	800,928	
(オーストラリア)	19	18	—	<0.7%>		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	27	27	174	14,258	ヘルスケア機器・サービス	
AUST AND NZ BANKING GROUP	376	488	1,357	110,863	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	476	630	1,312	107,143	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	234	292	600	48,993	素材	
TELSTRA CORP LTD	723	723	293	23,928	電気通信サービス	
COCA-COLA AMATIL LTD	51	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
ASX LTD	32	33	283	23,118	各種金融	
BHP GROUP LTD	412	525	2,395	195,585	素材	
COMPUTERSHARE LTD	56	121	239	19,514	ソフトウェア・サービス	
CSL LTD	63	84	2,210	180,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REA GROUP LTD	5	5	85	6,942	メディア・娯楽	
TRANSURBAN GROUP	375	556	714	58,369	運輸	
COCHLEAR LTD	10	10	204	16,712	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LTD	264	264	147	12,074	公益事業	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	245	314	3,063	250,112	銀行	
RIO TINTO LTD	50	63	683	55,842	素材	
APA GROUP	138	246	236	19,298	公益事業	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	91	111	457	37,371	消費者サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	352	437	191	15,631	保険	
ORICA LTD	62	62	88	7,215	素材	
LENLEASE GROUP	82	175	181	14,858	不動産	
BLUESCOPE STEEL LTD	62	105	195	15,977	素材	
SUNCORP GROUP LTD	192	276	311	25,396	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	461	567	1,597	130,455	銀行	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
NEWCREST MINING LTD	113	150	379	30,976	素材	
OIL SEARCH LTD	328	—	—	—	エネルギー	
AMP LTD	366	—	—	—	各種金融	
QANTAS AIRWAYS LTD	87	87	41	3,423	運輸	
QBE INSURANCE GROUP LTD	242	260	301	24,600	保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73	148	143	11,721	素材	
REECE LTD	—	51	111	9,128	資本財	
SANTOS LTD	265	471	332	27,173	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	72	72	283	23,114	ヘルスケア機器・サービス	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3	39	109	8,908	エネルギー	
TABCORP HOLDINGS LTD	212	379	191	15,628	消費者サービス	
WESFARMERS LTD	151	193	1,026	83,801	小売	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	136	186	469	38,322	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	169	214	749	61,222	食品・生活必需品小売り	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15	15	29	2,430	各種金融	
SEEK LTD	33	67	198	16,214	メディア・娯楽	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	10	107	8,738	消費者サービス	
BRAMBLES LTD	174	277	278	22,707	商業・専門サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	45	62	1,192	97,399	各種金融	
CROWN RESORTS LTD	7	7	9	764	消費者サービス	
EVOLUTION MINING LTD	161	466	187	15,312	素材	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	66	74	363	29,712	素材	
TREASURY WINE ESTATES LTD	70	166	183	14,961	食品・飲料・タバコ	
SYDNEY AIRPORT	225	225	194	15,894	運輸	
AURIZON HOLDINGS LTD	230	230	82	6,733	運輸	
XERO LTD	18	26	302	24,707	ソフトウェア・サービス	
IDP EDUCATION LTD	—	40	122	10,000	消費者サービス	
AFTERPAY LTD	29	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
AMPOL LTD	30	30	89	7,328	エネルギー	
TPG TELECOM LTD	2	—	—	—	電気通信サービス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	169	107	8,793	食品・生活必需品小売り	
AUSNET SERVICES	14	374	93	7,617	公益事業	
MEDIBANK PRIVATE LTD	336	637	205	16,758	保険	
AGL ENERGY LTD	75	—	—	—	公益事業	
SOUTH32 LTD	748	810	319	26,083	素材	
CIMIC GROUP LTD	6	—	—	—	資本財	
COLES GROUP LTD	186	241	394	32,213	食品・生活必需品小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	16	16	82	6,718	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額	9,568	12,332	25,710	2,099,232	
	銘柄数<比率>	58	55	—	<1.8%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD	55	55	59	4,540	ヘルスケア機器・サービス	
A2 MILK CO LTD	78	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	66	113	343	26,237	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	229	433	192	14,670	電気通信サービス	
MERCURY NZ LTD	72	72	41	3,188	公益事業	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	222	222	160	12,253	運輸	
MERIDIAN ENERGY LTD	229	229	104	7,940	公益事業	
小計	株数・金額	953	1,125	901	68,830	
	銘柄数<比率>	7	6	—	<0.1%>	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	16	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	270	270	448	6,569	不動産	
BANK OF EAST ASIA	36	—	—	—	銀行	
CLP HOLDINGS LTD	240	275	2,156	31,563	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR MTR CORP	172	207	9,799	143,462	各種金融	
HANG SENG BANK LTD	195	320	1,364	19,980	運輸	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	119	119	1,858	27,212	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	139	299	1,048	15,350	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	180	230	1,116	16,347	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	1,568	2,087	2,542	37,217	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	320	410	1,883	27,581	消費者サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	440	690	2,070	30,304	銀行	
PCCW LTD	40	—	—	—	電気通信サービス	
SINO LAND CO	180	580	578	8,465	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	197	247	2,397	35,094	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	42	42	194	2,846	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	215	250	3,325	48,678	資本財	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	300	300	651	9,530	資本財	
SJM HOLDINGS LTD	20	—	—	—	消費者サービス	
WYNN MACAU LTD	52	—	—	—	消費者サービス	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	338	469	6,878	小売	
AIA GROUP LTD	1,682	2,138	18,825	275,599	保険	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	330	1,010	1,068	15,644	電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	310	502	1,076	15,764	消費者サービス	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	310	922	13,501	運輸	
SWIRE PROPERTIES LTD	50	50	102	1,500	不動産	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	230	320	1,224	17,919	不動産	
ESR CAYMAN LTD	292	292	776	11,371	不動産	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	310	310	241	3,535	公益事業	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	220	220	475	6,956	食品・飲料・タバコ	
WH GROUP LTD	1,520	1,520	794	11,638	食品・飲料・タバコ	
NEW WORLD DEVELOPMENT	260	260	838	12,275	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	390	485	2,737	40,081	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	44	44	217	3,185	公益事業	
CK ASSET HOLDINGS LTD	400	320	1,718	25,157	不動産	
小計	株数・金額	10,779	14,445	62,924	921,215	
	銘柄数<比率>	33	30		<0.8%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECH ENGINEERING	120	367	136	11,585	資本財	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	245	311	1,109	94,111	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	30	30	21	1,812	不動産	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	115	144	136	11,621	各種金融	
CAPITALAND LTD	498	—	—	—	不動産	
SINGAPORE AIRLINES LTD	263	263	133	11,315	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	166	203	609	51,696	銀行	
UOL GROUP LTD	21	21	15	1,295	不動産	
VENTURE CORP LTD	41	41	74	6,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	—	1,690	420	35,709	電気通信サービス	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,231	—	—	—	電気通信サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	458	567	697	59,182	銀行	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	252	419	178	15,182	食品・飲料・タバコ	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
KEPPEL CORP LTD	190	256	138	11,731	資本財	
GENTING SINGAPORE LTD	808	808	61	5,211	消費者サービス	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	—	498	181	15,382	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,438	5,618	3,914	332,156	
	銘柄 数 < 比 率 >	14	14	—	<0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
BANK HAPOALIM BM	182	182	587	21,171	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	179	299	969	34,957	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	198	7,160	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	75	236	482	17,414	銀行	
ICL GROUP LTD	41	129	390	14,087	素材	
NICE SYSTEMS LTD	9	11	895	32,282	ソフトウェア・サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	14	14	167	6,047	銀行	
AZRIELI GROUP	2	2	68	2,481	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	507	879	3,760	135,602	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	146,380	191,571	—	106,056,038	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,226	1,230	—	<88.6%>	

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

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

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
AGNC INVESTMENT CORP	8,437	8,437	124	14,168	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,752	2,660	519	59,215	0.0	
AMERICAN TOWER CORP	6,152	8,088	2,009	229,052	0.2	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	25,521	193	22,084	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,949	2,369	569	64,926	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	2,200	2,764	317	36,248	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	1,697	268	30,567	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	6,024	7,724	1,418	161,689	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,602	4,809	740	84,384	0.1	
DUKE REALTY CORP	5,513	6,340	361	41,222	0.0	
EQUINIX INC	1,170	1,607	1,174	133,900	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,445	3,451	263	30,051	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	5,175	6,281	554	63,259	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	970	1,187	395	45,051	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,920	2,391	466	53,156	0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,606	9,835	342	39,088	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	10,493	178	20,337	0.0	
INVITATION HOMES INC	7,683	9,853	410	46,832	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	4,068	5,780	256	29,238	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	8,954	205	23,469	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,702	2,088	423	48,277	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	—	—	—	—	
PROLOGIS INC	10,311	13,145	2,015	229,759	0.2	
PUBLIC STORAGE	2,131	2,693	948	108,114	0.1	
REALTY INCOME CORP	4,769	9,338	638	72,831	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	1,514	2,658	188	21,482	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,510	1,865	608	69,431	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	4,258	5,918	864	98,575	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	1,389	2,159	403	45,975	0.0	
UDR INC	3,355	5,162	290	33,068	0.0	
VENTAS INC	5,547	6,823	352	40,232	0.0	
VEREIT INC	2,220	—	—	—	—	
VICI PROPERTIES INC	7,940	10,702	294	33,553	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	1,259	2,829	117	13,359	0.0	
WP CAREY INC	2,436	3,546	269	30,680	0.0	
WELLTOWER INC	5,753	7,706	662	75,573	0.1	
WEYERHAEUSER CO	10,330	12,823	498	56,796	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	169,000	219,696	19,346	2,205,659	
	銘柄 数 < 比 率 >	37	35	—	< 1.8% >	
(カナダ)				千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		950	950	51	4,623	0.0

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)			千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	1,530	33	2,998	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	2,480	84	7,622	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ		
KLEPIERRE	1,289	3,496	80	10,381	0.0
GECINA SA	569	1,073	124	16,098	0.0
COVIVIO	522	522	38	4,943	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	2,281	140	18,131	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	4,661	383	49,555	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	—	<0.0%>	
(イギリス)			千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC	13,842	13,842	73	11,246	0.0
SEGRO PLC	18,596	22,581	289	44,442	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	14,632	113	17,415	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	39,086	475	73,104	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP	63,099	63,099	174	14,219	0.0
GPT GROUP	32,860	32,860	170	13,924	0.0
STOCKLAND	29,890	54,131	219	17,900	0.0
DEXUS/AU	13,745	23,352	251	20,535	0.0
GOODMAN GROUP	23,275	29,600	693	56,626	0.0
SCENTRE GROUP	83,252	86,904	258	21,074	0.0
VICINITY CENTRES	42,168	42,168	70	5,749	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	288,289	1,837	150,030	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	31,300	38,700	2,660	38,951	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	31,300	2,660	38,951	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	74,160	81,863	164	13,963	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	41,300	73,700	210	17,886	0.0
SUNTEC REIT	8,500	—	—	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	49,500	87	7,393	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	23,000	42	3,591	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	185,460	504	42,834	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	4	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	720,276	—	2,567,757	
	銘 柄 数 < 比 率 >	59	56	<2.1%>	

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引		百万円	百万円
		SP500MIN2203	8,911	—
		STX E6002203	2,170	—

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

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月25日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	106,056,038	86.7
投資証券	2,567,757	2.1
コール・ローン等、その他	13,735,696	11.2
投資信託財産総額	122,359,491	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産 (120,003,971千円) の投資信託財産総額 (122,359,491千円) に対する比率は98.1%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=114.01円、1カナダドル=90.23円、1ユーロ=129.06円、1英ポンド=153.70円、1スイスフラン=124.68円、1スウェーデンクローナ=12.30円、1ノルウェークローネ=12.69円、1デンマーククローネ=17.33円、1オーストラリアドル=81.65円、1ニュージーランドドル=76.35円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=84.86円、1イスラエルシケル=36.0642円。

## ○特定資産の価格等の調査

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月25日現在)

項目	当期末	円
(A) 資産	122,654,872,388	
コール・ローン等	9,841,894,972	
株式(評価額)	106,056,038,603	
投資証券(評価額)	2,567,757,104	
未収入金	330,565,059	
未収配当金	74,311,465	
差入委託証拠金	3,784,305,185	
(B) 負債	2,944,222,047	
未払金	901,749,698	
未払解約金	2,042,467,700	
未払利息	4,649	
(C) 純資産総額(A-B)	119,710,650,341	
元本	61,552,790,809	
次期繰越損益金	58,157,859,532	
(D) 受益権総口数	61,552,790,809口	
1口当たり基準価額(C/D)	19,448円	

(注) 当ファンドの期首元本額は53,970,185,829円、期中追加設定元本額は48,821,289,734円、期中一部解約元本額は41,238,684,754円です。

(注) 2022年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・FWりそな先進国株式インデックスファンド 25,563,971,116円
- ・Smart-i 先進国株式インデックス 7,976,337,970円
- ・りそなラップ型ファンド(成長型) 6,531,079,425円
- ・りそなラップ型ファンド(安定成長型) 5,874,167,715円
- ・つみたてバランスファンド 1,931,173,374円
- ・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030 1,694,219,863円
- ・りそなラップ型ファンド(安定型) 1,408,045,794円
- ・りそな・リスクコントロールファンド2019-09 1,151,890,996円
- ・Smart-i 8資産バランス 成長型 1,027,920,801円
- ・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040 1,014,136,654円
- ・Smart-i 8資産バランス 安定成長型 895,934,023円
- ・りそな・リスクコントロールファンド2020-03 867,587,314円
- ・りそな・リスクコントロールファンド2019-06 715,096,249円
- ・りそな・リスクコントロールファンド2019-10 706,125,610円
- ・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050 663,149,133円
- ・りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用) 646,476,859円
- ・りそなDAAファンド(適格機関投資家専用) 479,735,460円
- ・りそな・リスクコントロールファンド2019-12 424,764,261円
- ・りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用) 374,721,602円
- ・Smart-i 8資産バランス 安定型 321,308,310円
- ・りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用) 296,492,103円
- ・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035 231,181,789円
- ・りそな・リスクコントロールファンド2020-06 147,693,697円
- ・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045 145,581,389円
- ・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060 135,998,064円
- ・FWりそな先進国株式アクティブファンド 110,262,602円
- ・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055 76,904,511円
- ・リスクコントロール・オープン 44,315,848円
- ・FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド 38,771,695円
- ・DCりそな グローバルバランス 23,898,163円
- ・りそなV1グローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用) 17,570,797円
- ・りそなV1グローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用) 10,158,552円
- ・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定) 5,178,678円
- ・りそなV1グローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用) 940,392円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.9448円です。

## ○損益の状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

項目	当期	円
(A) 配当等収益	1,452,030,830	
受取配当金	1,462,725,523	
その他収益金	208,621	
支払利息	△ 10,903,314	
(B) 有価証券売買損益	15,573,849,950	
売買益	20,397,541,553	
売買損	△ 4,823,691,603	
(C) 先物取引等取引損益	1,691,334,992	
取引益	2,749,690,024	
取引損	△ 1,058,355,032	
(D) 保管費用等	△ 26,614,447	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	18,690,601,325	
(F) 前期繰越損益金	31,165,302,487	
(G) 追加信託差損益金	40,964,980,266	
(H) 解約差損益金	△32,663,024,546	
(I) 計(E+F+G+H)	58,157,859,532	
次期繰越損益金(I)	58,157,859,532	

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

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

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

## ○お知らせ

---

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

# RM新興国株式マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日 2022年1月25日）  
（2021年1月26日～2022年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	<p>①主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>②株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p>
主要投資対象	<ul style="list-style-type: none"><li>金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式<sup>(*)</sup></li><li>(*) 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。</li><li>新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</li></ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"><li>株式への投資割合には、制限を設けません。</li><li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>

りそなアセットマネジメント 株式会社

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCIエマージング・マーケット指数 (配当込み、円換算ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	騰落	中率	(ベンチマーク) 騰落	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
2期(2018年1月25日)	15,125	35.1	300,137.86	36.8	93.0	6.6	0.4	3,145
3期(2019年1月25日)	12,478	△17.5	250,692.51	△16.5	93.2	6.3	0.4	5,315
4期(2020年1月27日)	13,853	11.0	281,695.65	12.4	71.2	29.0	0.2	10,642
5期(2021年1月25日)	16,589	19.8	341,866.31	21.4	83.0	16.8	0.1	13,856
6期(2022年1月25日)	16,253	△2.0	337,577.45	△1.3	91.0	8.8	0.1	18,736

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 「MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCIエマージング・マーケット指数 (配当込み、円換算ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率
	騰落	騰落率	(ベンチマーク) 騰落	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2021年1月25日	16,589	—	341,866.31	—	83.0	16.8	0.1
1月末	16,223	△2.2	333,543.10	△2.4	82.4	17.6	0.1
2月末	16,778	1.1	348,027.61	1.8	86.0	14.2	0.1
3月末	16,789	1.2	346,561.38	1.4	83.5	16.8	0.1
4月末	17,133	3.3	353,071.00	3.3	80.3	19.6	0.1
5月末	17,225	3.8	355,462.48	4.0	83.7	16.0	0.1
6月末	17,632	6.3	363,603.63	6.4	78.7	21.2	0.1
7月末	16,454	△0.8	340,066.30	△0.5	84.8	15.6	0.1
8月末	16,416	△1.0	339,465.27	△0.7	80.6	19.3	0.1
9月末	16,289	△1.8	337,651.11	△1.2	86.8	13.3	0.1
10月末	16,921	2.0	349,962.19	2.4	88.6	11.2	0.1
11月末	16,183	△2.4	334,849.23	△2.1	84.5	15.8	0.1
12月末	16,364	△1.4	339,256.09	△0.8	87.0	10.9	0.1
(期末)							
2022年1月25日	16,253	△2.0	337,577.45	△1.3	91.0	8.8	0.1

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○運用経過

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の主な変動要因

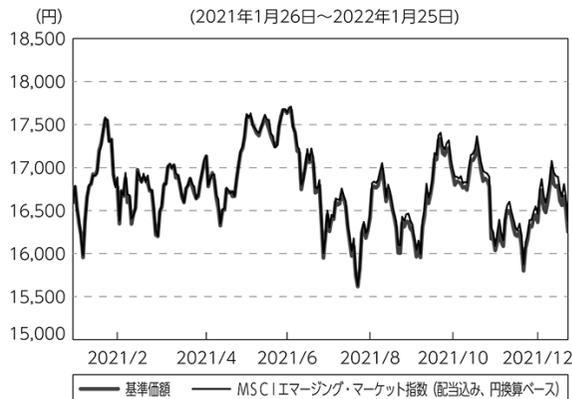
基準価額は前期末16,589円から当期末16,253円となり、336円の値下がりとなりました。

新興国株式の市況（MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース））の下落により、基準価額は下落しました。

主に、為替の影響がプラスに寄与した一方、新興国の株価が下落したことがマイナスに影響しました。

基準価額等の推移

(2021年1月26日～2022年1月25日)



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

## 投資環境

## 新興国株式市況

新興国株式市場は、前期末と比較して下落しました。新型コロナワクチンの普及見通しに不透明感が残る中、金融政策支援の縮小などから下落しました。地域別では、指数構成比率の高い中国では経済減速が続く中、大手不動産会社の債務不安問題や金融市場への規制強化懸念の強まりから株式市場は変動率の高い展開となりました。台湾では、主要国の金利上昇圧力が逆風となる中、世界的な半導体需要の強さを支援材料に上昇しました。

## 為替市況

前期末と比較して、円は米ドル・ユーロの双方に対して円安となりました。

米ドルに対して、期前半は、米長期金利上昇が主導する形で期初時点の1米ドル=104円台から110円台近辺まで円安が進みました。期後半は、世界的な株式市場の不安定化に対して円が選好される場面も見られましたが、米国における高インフレ環境の長期化懸念からFRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ前倒し観測が強まり、一時は2017年1月以来となる1米ドル=116円台まで米ドル高円安が進行しました。

ユーロに対して、期前半は、ユーロ圏地域のワクチン接種加速や欧州復興基金の運用開始に伴う景気回復期待からユーロ高円安が進みました。期後半には、ECB（欧州中央銀行）が利上げに慎重な姿勢を維持したことなどをを受けて、ユーロ高円安の動きは一巡しました。

新興国通貨は円に対しては通貨高となり、米ドルに対しては通貨安となりました。地域別では、中国は過去最大規模の貿易収支黒字が元高圧力の要因となる中、対米ドル、対円ともに元高が進みました。トルコは2022年以來の高インフレ環境にも関わらず、2021年9月以降、利下げを余儀なくされたことが嫌気され、対米ドルでは12月に過去最安値を更新しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

新興国の株式を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っていません。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は-2.0%となり、ベンチマークの-1.3%を0.8%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

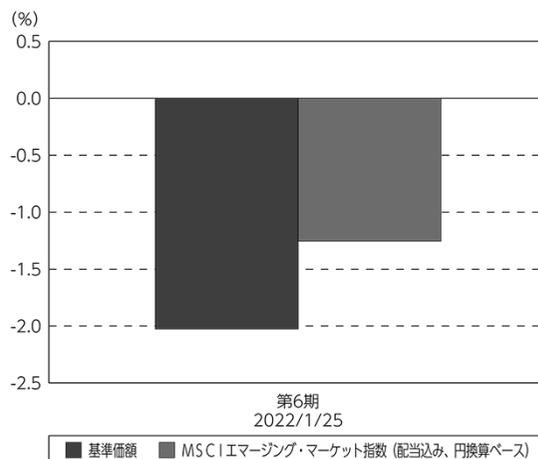
（マイナス要因）

- ・コスト負担（株式等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
- ・配当金の課税負担が生じたこと

（その他の要因）

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



## ○今後の運用方針

引き続き、主としてMSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている新興国の株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要	
	金 額	比 率		
(a) 売 買 委 託 手 数 料	10	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 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料	
(株 式)	(7)	(0.041)		
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)		
(投資信託証券)	(0)	(0.000)		
(先物・オプション)	(3)	(0.017)		
(b) 有 価 証 券 取 引 税	4	0.025	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金	
(株 式)	(4)	(0.025)		
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)		
(投資信託証券)	(0)	(0.000)		
(c) そ の 他 費 用	28	0.165	(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)	(26)	(0.154)		保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	(2)	(0.011)		その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	42	0.247		
期中の平均基準価額は、16,700円です。				

(注) 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・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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



		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	インドネシア	百株 21,651 ( 12,076)	千インドネシアルピア 10,016,899 ( 896,212)	百株 1,815 (2,212)	千インドネシアルピア 225,005 (143,979)
	韓国	1,103 ( 100)	千韓国ウォン 8,753,992 ( 38,861)	95 ( 1)	千韓国ウォン 367,828 ( 38,861)
	台湾	20,654 ( 491)	千新台幣ドル 221,910 (△ 474)	1,461 ( -)	千新台幣ドル 7,079 ( 0)
	中国オフショア	13,127 ( 285)	千オフショア人民元 24,373 ( -)	1,462	千オフショア人民元 2,112
	インド	6,787 ( 157)	千インドルピー 500,097 ( 501)	481 ( -)	千インドルピー 18,366 ( 501)
	クウェート	991 ( 126)	千クウェートディナール 82 ( -)	197	千クウェートディナール 4
	サウジアラビア	1,249 (△ 35)	千サウジアラビリアル 6,120 ( -)	4	千サウジアラビリアル 33
	カタール	1,657	千カタールリアル 1,278	-	千カタールリアル -
	南アフリカ	2,344 ( 10)	千南アフリカランド 27,820 ( 139)	156 ( -)	千南アフリカランド 9,797 ( 139)
	アラブ首長国連邦	2,605	千アラブディルハム 3,147	306	千アラブディルハム 60

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

### 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 - (40,120)	千タイバーツ - (31)	証券 40,120	千タイバーツ 33

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )内は権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

## 投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	メキシコ		千メキシコペソ		千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	13,100 ( - )	299 (△ 14)	- (-)	- ( 0)
	小計	13,100 ( - )	299 (△ 14)	- (-)	- ( 0)
	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	14,667	227	-	-
	小計	14,667	227	-	-

(注) 金額は受け渡し代金。

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

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 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 19,772	百万円 20,404	百万円 -	百万円 -

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

## ○株式売買比率

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	7,017,950千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,496,957千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.51

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

**○利害関係人との取引状況等**

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

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

**○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)**

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年1月25日現在)

## 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	248	—	—	—	小売
AUTOHOME INC-ADR	8	14	46	5,348	メディア・娯楽
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	31	48	40	4,646	素材
CREDICORP LTD	8	12	178	20,325	銀行
DIDI GLOBAL INC	—	47	22	2,550	運輸
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	—	10	38	4,433	半導体・半導体製造装置
GAOTU TECHEDU INC	10	—	—	—	消費者サービス
HUYA INC-ADR	9	—	—	—	メディア・娯楽
KE HOLDINGS INC	12	71	149	17,069	不動産
LUFAX HOLDING LTD	21	—	—	—	各種金融
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	70	83	59	6,738	電気通信サービス
NIO INC - ADR	169	262	652	74,424	自動車・自動車部品
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	20	293	43	4,979	消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	5	7	23	2,702	各種金融
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	—	124	43	4,946	食品・飲料・タバコ
SOUTHERN COPPER CORP	10	15	97	11,099	素材
TAL EDUCATION GROUP- ADR	51	84	26	3,072	消費者サービス
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	8	—	—	—	電気通信サービス
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	46	120	74	8,485	メディア・娯楽
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	61	82	72	8,286	小売
XPENG INC - ADR	22	75	300	34,290	自動車・自動車部品
YPF S. A. -SPONSORED ADR	19	—	—	—	エネルギー
YUM CHINA HOLDINGS INC	53	81	374	42,683	消費者サービス
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	56	84	242	27,629	運輸
GLOBANT SA	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AGORA INC-ADR	—	8	8	1,012	ソフトウェア・サービス
BAIDU INC - SPON ADR	36	53	798	90,981	メディア・娯楽
BAOZUN INC-SPN ADR	9	—	—	—	小売
BEIGENE LTD-ADR	6	9	227	25,903	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	15	30	107	12,264	メディア・娯楽
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	—	15	7	800	ソフトウェア・サービス
DADA NEXUS LTD-ADR	—	10	10	1,247	小売
SINA CORP	6	—	—	—	メディア・娯楽
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	16	—	—	—	メディア・娯楽
51JOB INC-ADR	3	5	24	2,849	商業・専門サービス
GDS HOLDINGS LTD - ADR	12	16	66	7,625	ソフトウェア・サービス
HELLO GROUP INC -SPN ADR	—	26	23	2,701	メディア・娯楽
HUAZHU GROUP LTD-ADR	22	35	136	15,606	消費者サービス
HUTCHMED CHINA-ADR	9	16	46	5,282	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
I-MAB-SPONSORED ADR	—	7	21	2,507	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQIYI INC-ADR	37	45	19	2,180	メディア・娯楽
JOYY INC	7	11	53	6,128	メディア・娯楽
JD.COM INC-ADR	114	—	—	—	小売
KANZHUN LTD	—	12	36	4,109	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	9	9	9	1,119	ソフトウェア・サービス	
LI AUTO INC - ADR	—	106	291	33,241	自動車・自動車部品	
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	—	10	38	4,356	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOMO INC-SPON ADR	19	—	—	—	メディア・娯楽	
NETEASE INC-ADR	55	—	—	—	メディア・娯楽	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	—	9	15	1,777	小売	
PINDUODUO INC-ADR	50	84	512	58,462	小売	
360 DIGITECH INC	—	18	36	4,137	各種金融	
TRIP.COM GROUP LTD	64	99	255	29,159	消費者サービス	
VNET GROUP INC	—	14	11	1,335	ソフトウェア・サービス	
WEIBO CORP-SPON ADR	6	11	38	4,382	メディア・娯楽	
ZAI LAB LTD-ADR	9	15	78	8,947	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
YANDEX NV-A	40	59	250	28,607	メディア・娯楽	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	100	100	9	1,069	不動産	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	—	73	35	4,040	ソフトウェア・サービス	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	189	334	109	12,452	銀行	
GAZPROM PAO -SPON ADR	799	1,144	840	95,840	エネルギー	
VTB BANK JSC -GDR-REG S	221	328	32	3,702	銀行	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	86	122	327	37,379	素材	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	52	66	79	9,039	食品・生活必需品小売り	
VK CO LTD	16	22	15	1,811	メディア・娯楽	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	12	17	333	38,037	エネルギー	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	18	27	68	7,827	素材	
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	167	218	145	16,618	エネルギー	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	55	80	624	71,170	エネルギー	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	23	23	43	4,921	素材	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	8	12	95	10,925	素材	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	351	518	604	68,943	銀行	
SEVERSTAL - GDR REG S	32	38	68	7,767	素材	
SURGUTNEFTGAS-SP ADR	147	137	57	6,612	エネルギー	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	—	21	125	14,273	銀行	
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	33	46	157	17,989	エネルギー	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	18	22	47	5,384	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数	金 額	3,829	5,621	9,439	1,076,247
	銘柄 数 < 比 率 >		61	64	—	< 5.7% >
(メキシコ)			千メキシコペソ			
ALFA S. A. B. -A	346	566	820	4,541	資本財	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	261	383	6,348	35,131	食品・飲料・タバコ	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	339	443	1,752	9,699	メディア・娯楽	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	204	267	1,679	9,291	食品・飲料・タバコ	
GRUMA S. A. B. -B	28	41	1,029	5,696	食品・飲料・タバコ	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	27	44	655	3,625	運輸	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	74	74	435	2,408	資本財	
CEMEX SAB-CPO	1,896	3,003	3,570	19,757	素材	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	348	503	6,541	36,196	銀行	
INDUSTRIAS PENOLLES SAB DE CV	18	26	601	3,328	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	165	330	987	5,461	家庭用品・パーソナル用品	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	30	38	1,529	8,461	運輸	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	422	607	5,270	29,164	素材	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコペソ	千円	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	4,520	6,633	13,232	73,222	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	308	458	1,207	6,680	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	48	77	941	5,207	食品・飲料・タバコ
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	51	75	2,017	11,161	運輸
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	22	65	417	2,308	メディア・娯楽
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	62	—	—	—	公益事業
TELESITES SAB DE CV	197	197	426	2,361	電気通信サービス
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	142	198	960	5,317	素材
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	77	95	1,031	5,708	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	702	1,025	7,237	40,048	食品・生活必需品小売り
BECLÉ SAB DE CV	53	114	562	3,109	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	10,342	15,263	59,256	327,890
	銘柄 数 < 比 率 >	24	23	—	< 1.7% >
(ブラジル)			千ブラジルリアル		
BRF SA	59	126	295	6,135	食品・飲料・タバコ
VALE SA	488	789	6,617	137,357	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11	—	—	—	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	34	48	157	3,278	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	49	70	233	4,839	公益事業
BANCO DO BRASIL S.A.	107	158	495	10,281	銀行
ITAUSA SA	594	893	848	17,619	銀行
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	112	—	—	—	小売
GERDAU SA-PREF	152	214	594	12,348	素材
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	17	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	495	716	2,480	51,494	エネルギー
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	96	—	—	—	小売
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	632	916	2,926	60,745	エネルギー
CCR SA	134	234	281	5,842	運輸
WEG SA	115	324	968	20,107	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF	588	931	1,984	41,194	銀行
BANCO BRADESCO S.A.	181	268	473	9,818	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99	124	321	6,676	素材
BRADESPAR SA -PREF	33	—	—	—	素材
SUZANO SA	102	145	844	17,530	素材
CPFL ENERGIA SA	23	—	—	—	公益事業
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	642	931	2,166	44,966	銀行
BRASKEM SA-PREF A	—	41	204	4,250	素材
ALPARGATAS SA - PREF	27	27	77	1,611	耐久消費財・アパレル
LOCALIZA RENT A CAR	80	115	617	12,809	運輸
LOJAS RENNER S.A.	98	178	461	9,572	小売
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	104	141	189	3,939	エネルギー
COSAN SA	20	193	417	8,672	エネルギー
TOTVS SA	72	92	237	4,936	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	119	186	404	8,400	公益事業
B2W CIA DIGITAL	28	—	—	—	小売
JBS SA	136	169	607	12,599	食品・飲料・タバコ
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	141	217	278	5,785	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50	66	233	4,856	公益事業
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	22	—	—	—	不動産

銘柄	期首(前期末)		当期		業 種 等		
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円			
SUL AMERICA SA - UNITS	43	—	—	—	保険		
HYPERA SA	40	64	185	3,860	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
MAGAZINE LUIZA SA	390	615	392	8,156	小売		
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	44	81	252	5,242	銀行		
ENERGISA SA-UNITS	20	42	172	3,581	公益事業		
TELEFONICA BRASIL S. A.	56	97	466	9,680	電気通信サービス		
RAIA DROGASIL SA	140	202	424	8,804	食品・生活必需品小売り		
VIA VAREJO SA	159	—	—	—	小売		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	98	137	286	5,951	保険		
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	22	47	187	3,887	公益事業		
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	60	106	699	14,520	ヘルスケア機器・サービス		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	172	227	257	5,342	ヘルスケア機器・サービス		
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	30	80	119	2,482	食品・生活必需品小売り		
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	278	1,183	1,544	32,068	各種金融		
AMBEV SA	631	911	1,339	27,795	食品・飲料・タバコ		
KLABIN SA - UNIT	102	136	330	6,859	素材		
NATURA & CO HOLDING SA	120	186	430	8,941	家庭用品・パーソナル用品		
BANCO INTER SA-UNITS	—	61	143	2,969	銀行		
VIA S/A	—	211	89	1,848	小売		
TIM SA	90	171	219	4,550	電気通信サービス		
AMERICANAS SA	—	120	411	8,535	小売		
REDE D'OR SAO LUIZ SA	—	72	292	6,068	ヘルスケア機器・サービス		
VIBRA ENERGIA SA	—	217	456	9,467	小売		
RUMO SA	171	244	405	8,422	運輸		
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	34	209	450	9,348	各種金融		
小 計	株 数 銘柄 数 < 比 率 >	金 額	8,363	13,734	34,980	726,057	<3.9%>
(チリ)			千チリペソ				
BANCO SANTANDER CHILE	9,617	12,033	47,762	6,742	銀行		
BANCO DE CREDITO E INVERSION	5	9	28,739	4,057	銀行		
BANCO DE CHILE	6,016	9,660	74,872	10,569	銀行		
EMPRESAS CMPC SA	148	230	34,037	4,804	素材		
EMPRESAS COPEC SA	56	73	50,905	7,186	エネルギー		
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	17	32	21,776	3,074	食品・飲料・タバコ		
ENEL AMERICAS SA	4,436	3,835	36,447	5,145	公益事業		
COLBUN SA	839	—	—	—	公益事業		
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	28	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	15	25	105,158	14,845	素材		
FALABELLA SA	109	142	38,608	5,450	小売		
CENCOSUD SA	188	259	37,012	5,225	食品・生活必需品小売り		
CENCOSUD SHOPPING SA	52	—	—	—	不動産		
ENEL CHILE SA	3,691	3,691	12,249	1,729	公益事業		
小 計	株 数 銘柄 数 < 比 率 >	金 額	25,223	29,996	487,569	68,829	<0.4%>
(コロンビア)			千コロンビアペソ				
INTERCONEXION ELECTRICA SA	66	81	198,149	5,683	公益事業		
ECOPETROL SA	710	893	252,248	7,235	エネルギー		
BANCOLOMBIA SA	25	46	185,480	5,320	銀行		
BANCOLOMBIA SA-PREF	59	96	334,061	9,581	銀行		

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
(コロンビア) GRUPO DE INV SURAMERICANA	百株 25	百株 21	千コロンビアペソ 58,587	千円 1,680	各種金融	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	887 5	1,139 5	1,028,526 —	29,501 <0.2%>	
(ユーロ…ギリシャ) HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA OPAP SA JUMBO SA PUBLIC POWER CORP EUROBANK ERGASIAS SERVICES A ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	32 21 15 — — —	43 34 22 35 510 465	千ユーロ 72 43 30 30 49 56	9,392 5,602 3,907 3,971 6,371 7,336	電気通信サービス 消費者サービス 小売 公益事業 銀行 銀行	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	69 3	1,112 6	283 —	36,582 <0.2%>	
(イギリス) POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	30	72	千英ポンド 81	12,553	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	30 1	72 1	81 —	12,553 <0.1%>	
(トルコ) AKBANK T. A. S. ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK FORD OTOMOTIV SANAYI AS KOC HOLDING AS TURK SISE VE CAM FABRIKALARI TURK HAVA YOLLARI AO TURKCELL ILETISIM HIZMET AS TURKIYE GARANTI BANKASI TURKIYE IS BANKASI-C TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE YAPI VE KREDI BANKASI HACI OMER SABANCI HOLDING BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	430 79 227 5 86 170 55 190 317 250 17 296 120 59	620 152 280 10 142 298 — 190 448 250 25 — — 82	千トルコリラ 470 319 756 261 425 389 — 337 524 197 418 — — 554	3,981 2,700 6,399 2,210 3,604 3,297 — 2,854 4,433 1,667 3,542 — — 4,688	銀行 資本財 素材 自動車・自動車部品 資本財 資本財 運輸 電気通信サービス 銀行 銀行 エネルギー 銀行 各種金融 食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,306 14	2,504 11	4,654 —	39,380 <0.2%>	
(チェコ) KOMERCNI BANKA AS CEZ AS MONETA MONEY BANK AS	7 21 70	15 29 70	千チェココルナ 1,448 2,356 645	7,610 12,387 3,393	銀行 公益事業 銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	99 3	115 3	4,450 —	23,392 <0.1%>	
(ハンガリー) OTP BANK PLC RICHTER GEDEON NYRT MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	28 20 54	44 24 73	千ハンガリーフォリント 75,535 20,596 19,152	26,984 7,357 6,842	銀行 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	102 3	141 3	115,284 —	41,184 <0.2%>	
(ポーランド) MBANK SA KGHM POLSKA MIEDZ SA BANK PEKAO SA	— 18 26	2 27 33	千ポーランドズロチ 123 376 432	3,485 10,631 12,222	銀行 素材 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	46	116	95	2,690	電気通信サービス	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	40	56	408	11,561	エネルギー	
LPP SA	0.19	0.22	348	9,850	耐久消費財・アパレル	
SANTANDER BANK POLSKA SA	5	6	232	6,567	銀行	
CD PROJEKT SA	8	14	254	7,205	メディア・娯楽	
PKO BANK POLSKI SA	112	161	729	20,630	銀行	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	190	334	177	5,011	エネルギー	
CYFROWY POLSAT SA	31	48	155	4,399	メディア・娯楽	
PGE SA	99	179	136	3,852	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	78	119	409	11,576	保険	
DINO POLSKA SA	7	9	319	9,043	食品・生活必需品小売り	
ALLEGRO. EU SA	31	72	267	7,554	小売	
小 計	株 数 ・ 金 額	696	1,184	4,467	126,283	
	銘柄 数 < 比 率 >	14	15	—	<0.7%>	
(ロシア)			千ロシアルーブル			
INTER RAO UES PJSC	—	7,250	2,722	3,920	公益事業	
SURGUTNEFTGAS-PREFERENCE	—	1,316	4,783	6,887	エネルギー	
ALROSA PJSC	—	462	4,589	6,608	素材	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	—	318	4,499	6,479	各種金融	
UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL	—	550	3,832	5,519	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	—	9,896	20,427	29,415	
	銘柄 数 < 比 率 >	—	5	—	<0.2%>	
(香港)			千香港ドル			
JIANGXI COPPER CO LTD-H	150	240	326	4,778	素材	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	200	200	169	2,477	運輸	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	260	260	134	1,967	運輸	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	175	240	1,022	14,967	素材	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	60	85	239	3,509	公益事業	
HUANENG POWER INTL INC-H	520	740	317	4,647	公益事業	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	140	260	489	7,171	エネルギー	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	120	—	—	—	不動産	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	90	130	518	7,593	家庭用品・パーソナル用品	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	340	340	248	3,633	自動車・自動車部品	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1,240	1,680	1,602	23,463	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	535	760	1,782	26,091	不動産	
CHINA RESOURCES LAND LTD	440	620	2,383	34,900	不動産	
CITIC LTD	770	1,140	1,008	14,770	資本財	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	200	300	155	2,279	運輸	
LENOVO GROUP LTD	920	1,400	1,173	17,175	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PETROCHINA CO LTD-H	2,680	4,100	1,607	23,529	エネルギー	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	244	328	383	5,608	保険	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,300	4,700	1,941	28,417	エネルギー	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	130	200	291	4,269	ソフトウェア・サービス	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	340	510	1,188	17,396	ソフトウェア・サービス	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	109	154	2,005	29,354	公益事業	
KUNLUN ENERGY CO LTD	520	760	570	8,355	公益事業	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	180	320	211	3,096	運輸	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,040	—	—	—	不動産	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	180	300	449	6,579	運輸	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	660	660	295	4,319	素材
WHARF HOLDINGS LTD	200	260	682	9,991	不動産
CHINA EVERBRIGHT LTD	140	—	—	—	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	362	606	853	12,491	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	95	130	519	7,603	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	800	1,140	2,138	31,309	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	520	—	—	—	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	120	180	725	10,619	公益事業
BYD CO LTD-H	85	150	3,783	55,383	自動車・自動車部品
CHINA OILFIELD SERVICES-H	280	400	300	4,392	エネルギー
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	410	750	438	6,412	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	220	220	119	1,742	素材
CHINA YOUZAN LTD	2,040	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	860	1,360	979	14,335	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	440	440	208	3,053	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	260	360	743	10,883	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	430	605	1,409	20,637	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,000	1,440	2,021	29,598	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	740	1,120	1,200	17,577	素材
MMG LTD	—	680	195	2,857	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	320	488	477	6,987	ヘルスケア機器・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	260	360	538	7,884	資本財
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	260	380	617	9,045	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	60	100	738	10,804	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD	380	560	585	8,575	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	240	600	305	4,471	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	200	280	1,695	24,820	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	180	320	219	3,209	運輸
CNOOC LTD	2,390	—	—	—	エネルギー
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	—	190	92	1,351	素材
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,422	2,022	1,199	17,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	370	620	2,982	43,659	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	785	1,220	7,984	116,898	保険
LI NING CO LTD	285	435	3,456	50,596	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	580	760	231	3,382	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	1,390	2,750	187	2,737	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	590	990	425	6,232	公益事業
AIR CHINA LTD-H	300	300	182	2,665	運輸
ZTE CORP-H	88	154	345	5,061	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	430	660	1,395	20,435	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	390	662	926	13,568	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,110	1,610	843	12,350	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	300	400	378	5,545	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	12,730	18,480	10,977	160,705	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	113	160	2,502	36,635	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	320	440	313	4,586	自動車・自動車部品
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	180	180	81	1,191	不動産
MINTH GROUP LTD	100	140	508	7,440	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	200	330	273	4,000	素材

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	480	760	808	11,838	素材
BANK OF CHINA LTD-H	10,590	15,300	4,635	67,869	銀行
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	160	200	123	1,806	不動産
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	150	150	196	2,881	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	264	-	-	-	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	525	750	5,081	74,389	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	8,100	10,860	5,125	75,043	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	130	-	-	-	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	165	165	231	3,381	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	280	580	229	3,362	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	-	450	220	3,234	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	80	100	214	3,132	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	67	103	417	6,107	資本財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,060	1,480	987	14,452	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	480	660	277	4,058	素材
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,150	1,670	627	9,192	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	140	215	107	1,573	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	97	138	2,875	42,103	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	150	208	2,523	36,937	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	40	60	119	1,755	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL LTD	345	485	427	6,255	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	740	1,260	365	5,349	不動産
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	540	540	223	3,272	耐久消費財・アパレル
KINGSOFT CORP LTD	100	178	663	9,720	メディア・娯楽
SINOTRUK HONG KONG LTD	80	115	144	2,121	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	440	650	312	4,567	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	150	210	159	2,336	食品・飲料・タバコ
DONGYUE GROUP	-	280	272	3,984	素材
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	90	135	338	4,960	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	720	930	735	10,769	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	378	514	1,272	18,624	保険
CRRC CORP LTD - H	-	810	289	4,245	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	315	315	98	1,448	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO-H	176	264	492	7,204	ヘルスケア機器・サービス
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	-	380	198	2,909	エネルギー
CHINA RESOURCES CEMENT	360	500	340	4,984	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	400	560	454	6,648	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	260	445	403	5,908	素材
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	-	250	111	1,636	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	180	-	-	-	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	490	660	1,059	15,517	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	113	164	261	3,827	ヘルスケア機器・サービス
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	360	570	613	8,979	不動産
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	196	196	107	1,581	資本財
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	-	190	157	2,308	資本財
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	250	360	1,639	24,006	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	107	173	403	5,913	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	751	1,106	359	5,262	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	370	-	-	-	不動産

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	128	128	170	2,496	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	470	470	142	2,084	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,840	5,070	1,505	22,044	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	80	110	685	10,032	小売
FAR EAST HORIZON LTD	290	290	194	2,844	各種金融
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	110	120	321	4,699	ヘルスケア機器・サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285	435	920	13,469	各種金融
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	160	280	390	5,714	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	436	536	387	5,673	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	95	140	365	5,349	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,260	1,630	407	5,965	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	60	100	346	5,065	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	420	700	385	5,636	不動産
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	560	560	262	3,836	各種金融
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	—	480	419	6,141	ソフトウェア・サービス
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	130	240	367	5,375	資本財
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	200	320	274	4,019	不動産
CHINA EVERGRANDE GROUP	240	—	—	—	不動産
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,250	1,480	948	13,888	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	60	90	315	4,624	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP	180	220	666	9,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	25	—	—	—	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	190	350	1,694	24,800	不動産
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	120	—	—	—	不動産
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	72	97	266	3,905	ヘルスケア機器・サービス
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	110	130	145	2,123	消費者サービス
HEBEI CONSTRUCTION GROUP C-H	80	—	—	—	資本財
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95	95	133	1,955	素材
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	40	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
A-LIVING SMART CITY SERVICES	72	90	142	2,084	不動産
CHINA TOWER CORP LTD-H	6,140	8,340	792	11,599	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	1,880	2,754	5,012	73,379	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTec CO LTD-H	36	68	857	12,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIMOB INC	—	380	267	3,922	ソフトウェア・サービス
MEITUAN	475	786	18,298	267,883	小売
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	144	208	335	4,908	消費者サービス
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	100	210	408	5,976	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	520	960	1,200	17,568	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	135	235	971	14,226	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1,050	2,020	290	4,258	各種金融
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	80	100	364	5,336	小売
LOGAN GROUP CO LTD	190	230	156	2,296	不動産
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	210	325	1,233	18,056	資本財
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	12	—	—	—	不動産
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	200	295	248	3,636	ヘルスケア機器・サービス
CHINA AOYUAN GROUP LTD	140	—	—	—	不動産
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	60	—	—	—	消費者サービス
CANSINO BIOLOGICS INC-H	6	16	233	3,424	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	140	240	186	2,726	小売

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	155	195	165	2,420	運輸
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	160	240	430	6,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA FEIHE LTD	160	640	752	11,018	食品・飲料・タバコ
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	—	2,915	34,722	508,336	小売
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	21	26	301	4,411	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JD.COM INC - CL A	—	387	11,194	163,893	小売
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	70	350	1,286	18,830	食品・飲料・タバコ
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	405	695	6,091	89,182	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	—	35	106	1,557	ヘルスケア機器・サービス
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	—	170	294	4,305	消費者サービス
KUAI SHOU TECHNOLOGY	—	86	733	10,733	メディア・娯楽
HAIER SMART HOME CO LTD-H	288	438	1,414	20,711	耐久消費財・アパレル
AKESO INC	—	50	129	1,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	—	220	197	2,892	不動産
NETEASE INC	—	388	5,827	85,318	メディア・娯楽
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	—	120	214	3,141	ソフトウェア・サービス
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	—	440	99	1,455	小売
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	—	100	65	955	不動産
NONGFU SPRING CO LTD-H	—	348	1,632	23,894	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	756	1,106	51,937	760,368	メディア・娯楽
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	395	690	153	2,242	銀行
CHINA YOUZAN LTD	—	2,200	73	1,078	ソフトウェア・サービス
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	30	65	455	6,675	小売
SEAZEN GROUP LIMITED	240	360	219	3,220	不動産
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	—	64	248	3,644	ヘルスケア機器・サービス
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	—	117	202	2,963	不動産
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	—	108	466	6,822	不動産
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	19	19	180	2,642	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA VANKE CO LTD-H	221	321	685	10,033	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	175	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUEXIU PROPERTY CO LTD	—	308	242	3,548	不動産
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	—	180	270	3,958	不動産
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,400	2,000	174	2,547	メディア・娯楽
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	50	100	404	5,914	半導体・半導体製造装置
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	540	740	506	7,421	ヘルスケア機器・サービス
CGN POWER CO LTD-H	1,100	2,020	454	6,653	公益事業
GF SECURITIES CO LTD-H	156	216	309	4,528	各種金融
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	76	116	524	7,684	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	174	258	360	5,272	各種金融
3SBIO INC	130	205	131	1,920	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	110	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	1,030	—	—	—	各種金融
CHINA LITERATURE LTD	42	78	408	5,977	メディア・娯楽
SSY GROUP LTD	100	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	—	70	246	3,607	半導体・半導体製造装置
DALI FOODS GROUP CO LTD	305	305	145	2,134	食品・飲料・タバコ
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	120	240	53	780	消費者サービス
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	150	300	272	3,983	不動産
BOC AVIATION LTD	35	35	231	3,381	資本財

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	52	109	312	4,571	保険	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	160	200	242	3,548	自動車・自動車部品	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	176	272	597	8,740	各種金融	
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	—	46	575	8,424	素材	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	11	22	251	3,676	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額	114,126	163,991	283,720	4,153,667	
	銘柄数<比率>	197	205	—	<22.2%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット			
AMMB HOLDINGS BHD	234	366	123	3,367	銀行	
GENTING PLANTATIONS BHD	30	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	802	1,279	671	18,278	銀行	
DIGI.COM BHD	397	529	208	5,673	電気通信サービス	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	129	227	129	3,534	運輸	
RHB BANK BHD	181	398	222	6,056	銀行	
HAP SENG CONSOLIDATED	76	123	93	2,538	資本財	
GAMUDA BHD	210	—	—	—	資本財	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	18	53	97	2,666	銀行	
HONG LEONG BANK BERHAD	72	123	235	6,415	銀行	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	64	83	178	4,857	食品・飲料・タバコ	
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	21	21	52	1,429	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BHD	537	917	756	20,594	銀行	
MISC BHD	176	268	187	5,106	運輸	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	10	13	172	4,706	食品・飲料・タバコ	
PPB GROUP BERHAD	82	111	184	5,024	食品・飲料・タバコ	
PETRONAS DAGANGAN BHD	29	59	112	3,070	エネルギー	
PETRONAS GAS BHD	104	140	237	6,471	公益事業	
TELEKOM MALAYSIA BHD	184	184	94	2,579	電気通信サービス	
TENAGA NASIONAL BHD	294	421	383	10,440	公益事業	
QL RESOURCES BHD	171	171	85	2,329	食品・飲料・タバコ	
DIALOG GROUP BHD	500	698	180	4,902	エネルギー	
PUBLIC BANK BERHAD	391	2,833	1,187	32,313	銀行	
TOP GLOVE CORP BHD	665	1,166	242	6,602	ヘルスケア機器・サービス	
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	166	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SUPERMAX CORP BHD	192	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
GENTING BHD	329	413	185	5,047	消費者サービス	
GENTING MALAYSIA BHD	326	557	154	4,215	消費者サービス	
IOI CORP BHD	325	496	194	5,306	食品・飲料・タバコ	
SIME DARBY BERHAD	331	587	127	3,467	資本財	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	237	335	185	5,043	ヘルスケア機器・サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	304	478	180	4,905	電気通信サービス	
MAXIS BHD	302	457	197	5,386	電気通信サービス	
INARI AMERTRON BHD	—	651	214	5,830	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	307	444	395	10,757	素材	
IHH HEALTHCARE BHD	318	318	205	5,600	ヘルスケア機器・サービス	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	68	196	77	2,112	運輸	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	167	652	397	10,826	素材	
SIME DARBY PLANTATION BHD	304	304	121	3,310	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額	9,053	16,071	8,477	230,770	
	銘柄数<比率>	38	35	—	<1.2%>	

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 千タイバツ	邦貨換算金額 千円
(タイ)	百株	百株		
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	78	—	—	銀行
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	165	165	507	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK - NVDR	250	762	1,043	銀行
RATCH GROUP PCL-NVDR	112	112	498	公益事業
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	99	154	1,894	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	851	2,608	1,246	電気通信サービス
KASIKORN BANK PCL-NVDR	213	—	—	銀行
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	40	40	680	公益事業
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	286	212	1,632	電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	567	735	1,911	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	166	234	5,218	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	881	1,112	1,556	小売
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	51	62	2,300	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PTT PCL-NVDR	1,544	1,944	7,484	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	486	486	981	食品・飲料・タバコ
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	82	147	874	各種金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	964	1,562	1,429	不動産
SIAM CEMENT PCL-NVDR	108	152	5,745	素材
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	593	842	5,220	運輸
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	294	385	2,040	不動産
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,326	1,760	3,836	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	60	99	1,351	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	486	593	1,808	消費者サービス
THAI OIL PCL-NVDR	132	240	1,242	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	794	1,161	6,849	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	1,055	1,574	1,440	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200	275	3,410	エネルギー
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	97	—	—	電気通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	165	363	1,715	素材
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	328	421	2,410	素材
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	179	280	2,751	公益事業
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	895	1,549	1,254	運輸
B GRIMM POWER PCL-NVDR	95	95	349	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	322	541	2,718	公益事業
OSOTSPA PCL-NVDR	65	195	638	食品・飲料・タバコ
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	183	373	742	各種金融
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	622	1,906	892	消費者サービス
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	206	332	1,113	小売
SCG PACKAGING PCL-NVDR	—	278	1,716	素材
SRI SAWAD CORP PCL-NVDR	90	162	1,020	各種金融
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	134	134	385	ヘルスケア機器・サービス
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	—	545	1,376	小売
CARABAO GROUP PCL-NVDR	—	49	531	食品・飲料・タバコ
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	76	163	920	各種金融
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	73	133	1,087	公益事業
小 計	株 数	金 額	83,827	289,205
	銘柄 数 < 比 率 >		—	< 1.5% >
(フィリピン)			千フィリピンペソ	
AYALA LAND INC	1,054	1,522	5,342	11,871
				不動産

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		
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	233	424	2,696	5,991	資本財	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	264	346	3,246	7,213	銀行	
GLOBE TELECOM INC	4	4	1,467	3,259	電気通信サービス	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	117	216	4,341	9,647	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	401	514	3,143	6,985	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORP	69	69	1,591	3,536	消費者サービス	
METROPOLITAN BANK & TRUST	276	368	2,098	4,662	銀行	
MEGAWORLD CORP	980	—	—	—	不動産	
SM PRIME HOLDINGS INC	1,288	2,027	6,972	15,495	不動産	
UNIVERSAL ROBINA CORP	132	174	2,226	4,948	食品・飲料・タバコ	
SM INVESTMENTS CORP	31	48	4,626	10,281	資本財	
AYALA CORPORATION	37	47	4,094	9,098	資本財	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	1,450	2,830	1,086	2,414	各種金融	
ABOITIZ POWER CORP	160	—	—	—	公益事業	
MANILA ELECTRIC COMPANY	31	46	1,464	3,254	公益事業	
BDO UNIBANK INC	281	354	4,511	10,024	銀行	
PUREGOLD PRICE CLUB INC	95	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	15	15	869	1,932	資本財	
PLDT INC	9	15	2,890	6,423	電気通信サービス	
AC ENERGY CORP	—	1,546	1,482	3,294	公益事業	
MONDE NISSIN CORP	—	902	1,500	3,335	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,933	11,473	55,653	123,673	
	銘柄 数 < 比 率 >	20	19	—	< 0.7% >	
(インドネシア)			千インドネシアルピア			
ANEKA TAMBANG TBK	—	1,756	331,006	2,648	素材	
BARITO PACIFIC TBK PT	3,775	5,596	478,458	3,827	素材	
UNITED TRACTORS TBK PT	221	338	790,920	6,327	エネルギー	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	482	812	519,680	4,157	食品・飲料・タバコ	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,083	1,390	906,975	7,255	食品・飲料・タバコ	
GUDANG GARAM TBK PT	66	66	209,550	1,676	食品・飲料・タバコ	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	232	232	258,100	2,064	素材	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	269	539	415,030	3,320	素材	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,308	3,643	2,650,282	21,202	銀行	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,007	1,407	574,056	4,592	家庭用品・パーソナル用品	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	7,402	13,208	5,441,881	43,535	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	1,315	—	—	—	公益事業	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,055	1,365	969,150	7,753	銀行	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	322	553	385,717	3,085	素材	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,322	10,703	8,348,340	66,786	銀行	
ADARO ENERGY TBK PT	1,509	3,236	734,572	5,876	エネルギー	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	327	470	404,200	3,233	食品・飲料・タバコ	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	—	1,409	419,882	3,359	電気通信サービス	
KALBE FARMA TBK PT	2,265	3,465	589,050	4,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACE HARDWARE INDONESIA	500	—	—	—	小売	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,508	3,997	2,208,342	17,666	自動車・自動車部品	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	3,473	3,473	371,611	2,972	電気通信サービス	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	6,650	9,647	4,148,210	33,185	電気通信サービス	

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
(インドネシア)	百株	百株	千円			
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,605	2,091	817,581	6,540	素材	
小計	39,696	69,396	31,972,594	255,780		
(韓国)	銘柄数<比率>	22	22	—	<1.4%>	
SKC CO LTD	—	4	59,949	5,719	千韓国ウォン	素材
CHEIL WORLDWIDE INC	10	10	22,785	2,173		メディア・娯楽
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	4	6	59,902	5,714		自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3	5	120,513	11,496		保険
DB INSURANCE CO LTD	7	9	57,757	5,510		保険
COWAY CO LTD	5	10	73,777	7,038		耐久消費財・アパレル
KT&G CORP	15	23	186,360	17,778		食品・飲料・タバコ
S-1 CORPORATION	2	2	16,165	1,542		商業・専門サービス
KOREA GAS CORPORATION	5	—	—	—		公益事業
CJ CORP	1	1	15,054	1,436		資本財
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	5	—	—	—		資本財
SK TELECOM	5	4	26,798	2,556		電気通信サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	43	56	47,824	4,562		各種金融
NCSOFT CORP	2	3	185,409	17,688		メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	23	46	61,677	5,883		電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	28	63	115,128	10,983		資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1	1	170,544	16,269		家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	6	8	596,519	56,907		素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	0.88	1	42,427	4,047		素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	0.31	0.31	17,360	1,656		家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	55	84	325,591	31,061		銀行
HMM CO LTD	—	49	117,096	11,170		運輸
S-OIL CORP	4	8	75,891	7,240		エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORP	14	23	83,364	7,952		素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	23	60	39,459	3,764		各種金融
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	8	12	50,407	4,808		各種金融
LOTTE CHEMICAL CORP	2	3	66,240	6,319		素材
HOTEL SHILLA CO LTD	4	6	44,247	4,221		小売
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	5	7	61,546	5,871		資本財
HYUNDAI MOBIS CO LTD	8	12	303,150	28,920		自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	72	104	1,249,262	119,179		半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	8	14	61,624	5,878		資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	3	3	32,256	3,077		自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	19	26	528,945	50,461		自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	12	16	66,096	6,305		素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	25	44	45,886	4,377		銀行
KIA CORP	35	51	403,374	38,481		自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	1	1	83,424	7,958		素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	34	47	99,225	9,466		公益事業
HANWHA CORPORATION	8	—	—	—		資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	9	31	85,703	8,176		運輸
CJ LOGISTICS	1	1	16,335	1,558		運輸
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2	3	47,892	4,568		素材
DOUZONE BIZON CO LTD	1	3	20,848	1,988		ソフトウェア・サービス
LG ELECTRONICS INC	13	20	275,906	26,321		耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
LOTTE CORP	2	—	—	—	資本財
LG CORP	12	15	121,181	11,560	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	15	29	34,234	3,265	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	8	12	50,160	4,785	資本財
NAVER CORP	16	23	781,501	74,555	メディア・娯楽
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	5	8	67,386	6,428	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.13	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AMOREPACIFIC GROUP	4	4	17,631	1,682	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	13	18	46,693	4,454	消費者サービス
POSCO	9	14	393,358	37,526	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	24	29	67,214	6,412	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	7	10	723,602	69,031	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	7	10	199,290	19,012	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GREEN CROSS CORP	—	0.9	16,335	1,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	627	916	6,886,594	656,981	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	69	121	65,256	6,225	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	108	158	1,079,947	103,026	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE INC	1	—	—	—	小売
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	4	6	16,495	1,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUHAN CORP	5	10	64,487	6,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	23	35	40,013	3,817	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	9	—	—	—	保険
GS HOLDINGS	4	8	32,775	3,126	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	33	43	93,289	8,899	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANA FINANCIAL GROUP	40	58	257,939	24,607	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2	3	64,039	6,109	運輸
LOTTE SHOPPING CO	0.8	2	18,093	1,726	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	9	12	79,367	7,571	保険
AMOREPACIFIC CORP	4	6	94,399	9,005	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	5	—	—	—	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	7	9	244,282	23,304	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	0.88	1	58,720	5,601	食品・飲料・タバコ
PAN OCEAN CO LTD	32	53	27,422	2,616	運輸
LG INNOTEK CO LTD	1	2	104,400	9,959	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK	4	8	187,731	17,909	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	52	76	448,114	42,750	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10	14	50,019	4,771	資本財
ILJIN MATERIALS CO LTD	—	4	46,640	4,449	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANMI PHARM CO LTD	0.87	1	35,072	3,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FILA HOLDINGS CORP	6	—	—	—	耐久消費財・アパレル
E-MART INC	2	3	50,303	4,798	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO., LTD.	1	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	9	13	50,356	4,804	自動車・自動車部品
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	1	8	39,511	3,769	資本財
BGF RETAIL CO LTD/NEW	0.57	1	21,114	2,014	食品・生活必需品小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2	4	42,024	4,009	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1	2	36,688	3,500	素材
NETMARBLE CORPORATION	2	3	46,452	4,431	メディア・娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	74	101	147,189	14,041	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		
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円		
SD BIOSENSOR INC	—	6	38,488	3,671	ヘルスケア機器・サービス	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2	5	43,959	4,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KRAFTON INC	—	4	120,800	11,524	メディア・娯楽	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	—	3	53,067	5,062	素材	
SK SQUARE CO LTD	—	3	18,233	1,739	半導体・半導体製造装置	
SK BIOSCIENCE CO LTD	—	4	74,226	7,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HYBE CO LTD	—	2	80,884	7,716	メディア・娯楽	
KAKAObANK CORP	—	18	75,600	7,212	銀行	
(Right)DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRU	—	7	2,133	203	資本財	
F&F CO LTD / NEW	—	0.65	54,535	5,202	耐久消費財・アパレル	
SAMSUNG SDS CO LTD	4	6	97,050	9,258	ソフトウェア・サービス	
SAMSUNG C&T CORP	10	16	179,470	17,121	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2	3	266,819	25,454	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DOOSAN BOBCAT INC	5	8	34,039	3,247	資本財	
KAKAO CORP	7	60	545,310	52,022	メディア・娯楽	
CJ ENM CO LTD	1	1	25,447	2,427	小売	
KMW CO LTD	3	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2	5	71,424	6,813	素材	
HLB INC	5	16	54,249	5,175	耐久消費財・アパレル	
L&F CO LTD	—	4	82,530	7,873	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CELLTRION INC	12	19	323,010	30,815	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CELLTRION PHARM INC	2	3	30,476	2,907	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEEGENE INC	2	7	46,095	4,397	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ECOPRO BM CO LTD	—	2	82,882	7,907	資本財	
KAKAO GAMES CORP	—	6	41,820	3,989	メディア・娯楽	
ALTEOGEN INC	2	5	28,016	2,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PEARL ABYSS CORP	0.7	5	62,685	5,980	メディア・娯楽	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8	17	121,676	11,607	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数	金 額	1,915	3,023	21,661,981	2,066,552
	銘柄 数 < 比 率 >		106	111	—	< 11.0% >
(台湾)			千新台湾ドル			
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70	100	2,660	10,946	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ACER INC	380	560	1,649	6,787	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	90	140	5,103	21,000	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	60	90	4,815	19,815	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	310	410	1,830	7,533	素材	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	50	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN BUSINESS BANK	796	—	—	—	銀行	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	120	180	2,475	10,185	半導体・半導体製造装置	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100	140	2,191	9,016	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	170	230	4,761	19,593	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	50	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QUANTA COMPUTER INC	370	530	4,982	20,502	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	66	—	—	—	不動産	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	90	130	2,047	8,426	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	716	723	1,283	5,283	銀行	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	220	300	1,053	4,333	自動車・自動車部品	
CHINA STEEL CORP	1,500	2,280	7,626	31,386	素材	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	278	—	—	—	保険	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千新台幣ドル	千円	
ADVANTECH CO LTD	52	72	2,832	11,654	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	460	780	1,985	8,169	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	260	380	10,336	42,536	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	170	250	1,815	7,469	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	510	740	8,658	35,631	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	1,220	1,630	3,308	13,617	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	210	300	3,015	12,407	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP LTD	315	495	5,698	23,450	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	390	550	1,584	6,518	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	60	80	1,805	7,431	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	20	40	2,395	9,860	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS CORP	70	110	5,395	22,204	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	520	740	7,807	32,128	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	450	650	5,135	21,132	素材
GIANT MANUFACTURING	40	60	1,902	7,827	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	200	290	31,610	130,087	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	840	1,455	11,130	45,807	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO	1,074	1,599	3,495	14,386	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	40	60	3,690	15,185	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	240	300	1,947	8,012	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,259	1,889	4,760	19,592	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	990	1,520	9,773	40,222	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,760	2,820	5,202	21,412	保険
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,409	2,319	6,690	27,533	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,658	2,398	24,699	101,647	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,490	2,100	7,749	31,890	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	13	19	3,942	16,224	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,187	2,027	4,054	16,684	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,548	2,158	2,395	9,859	保険
INVENTEC CORP	280	520	1,323	5,446	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	270	390	2,492	10,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,449	1,819	3,012	12,395	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,380	3,570	9,817	40,402	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,306	2,002	5,036	20,727	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	100	—	—	—	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	700	1,000	8,700	35,803	素材
WISTRON CORP	299	529	1,665	6,853	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	340	450	1,460	6,009	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	650	950	6,469	26,624	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	80	120	3,210	13,210	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	150	190	1,862	7,662	エネルギー
PHISON ELECTRONICS CORP	10	—	—	—	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	94	230	1,485	6,114	不動産
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	140	180	1,107	4,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD FOODS CORP	31	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	170	260	1,768	7,276	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	614	1,014	4,784	19,690	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,240	4,732	308,999	1,271,656	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,460	2,270	14,210	58,480	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(台湾)	百株	百株	千新台幣ドル	千円		
WAN HAI LINES LTD	—	110	1,683	6,926	運輸	
WINBOND ELECTRONICS CORP	420	610	1,799	7,405	半導体・半導体製造装置	
YAGEO CORPORATION	51	81	3,795	15,620	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YANG MING MARINE TRANSPORT	—	340	3,396	13,978	運輸	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	220	380	1,081	4,449	運輸	
INNOLUX CORP	900	1,880	3,233	13,307	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WPG HOLDINGS LTD	179	329	1,793	7,379	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	—	40	1,984	8,164	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	31	52	1,406	5,789	資本財	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	—	10	1,700	6,996	半導体・半導体製造装置	
PEGATRON CORP	260	370	2,619	10,780	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	20	26	2,472	10,175	資本財	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	40	70	2,404	9,895	半導体・半導体製造装置	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	159	249	6,199	25,511	各種金融	
ONENESS BIOTECH CO LTD	30	40	948	3,901	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	—	14	2,723	11,206	半導体・半導体製造装置	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	5	5	802	3,302	半導体・半導体製造装置	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	60	130	1,253	5,157	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,183	1,843	4,857	19,992	銀行	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	490	670	3,192	13,138	銀行	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	—	10	1,400	5,761	資本財	
WIWYNN CORP	10	15	1,530	6,296	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	410	630	6,394	26,315	半導体・半導体製造装置	
SILERGY CORP	10	15	5,609	23,085	半導体・半導体製造装置	
MOMO.COM INC	—	10	1,290	5,308	小売	
GLOBALWAFERS CO LTD	30	40	3,124	12,856	半導体・半導体製造装置	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	20	30	1,173	4,827	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数	42,196	61,881	674,564	2,776,103	
	銘柄 数 < 比 率 >	87	86	—	<14.8% >	
(中国オフショア)			千オフショア人民元			
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	88	136	98	1,769	銀行	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	40	122	147	2,647	ソフトウェア・サービス	
PICC HOLDING CO-A	35	35	16	294	保険	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	—	6	80	1,447	耐久消費財・アパレル	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	25	50	139	2,511	各種金融	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	11	—	—	—	資本財	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	3	7	105	1,904	素材	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	6	8	31	569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TIBET SUMMIT RESOURCES CO-A	—	15	47	852	素材	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	36	57	136	2,449	素材	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	4	4	42	773	食品・飲料・タバコ	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	13	13	16	304	各種金融	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	6	7	29	535	食品・生活必需品小売り	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	3	3	17	307	食品・飲料・タバコ	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1	5	76	1,371	耐久消費財・アパレル	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2	11	124	2,245	素材	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	25	25	35	635	食品・飲料・タバコ	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	15	15	15	277	各種金融	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	—	7	78	1,416	素材	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千円	千円	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	15	15	21	389	銀行
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	—	17	29	528	素材
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2	7	58	1,057	ヘルスケア機器・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD-A	16	16	15	275	各種金融
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	38	71	81	1,469	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOTRANS LIMITED-A	20	20	8	155	運輸
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	5	7	117	2,116	半導体・半導体製造装置
WUXI APTEC CO LTD-A	14	31	350	6,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	—	11	56	1,016	半導体・半導体製造装置
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	—	85	33	604	銀行
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	7	12	142	2,571	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	—	61	99	1,798	素材
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	—	2	32	589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRO-A	—	2	72	1,314	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING UNITED INFORMATION-A	—	4	47	853	資本財
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	—	10	77	1,401	素材
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	—	9	114	2,054	半導体・半導体製造装置
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	—	7	54	978	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	—	110	54	976	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	—	8	73	1,317	資本財
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	—	7	48	871	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	7	7	27	494	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	7	9	30	547	資本財
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	14	16	25	454	不動産
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	8	11	317	5,724	半導体・半導体製造装置
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	—	5	67	1,221	資本財
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	—	5	57	1,040	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	—	40	95	1,717	資本財
BANK OF CHANGSHA CO LTD-A	—	75	60	1,095	銀行
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	43	43	16	298	各種金融
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	—	169	59	1,068	銀行
PROYA COSMETICS CO LTD-A	1	1	17	317	家庭用品・パーソナル用品
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	104	569	282	5,092	運輸
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	—	3	101	1,836	半導体・半導体製造装置
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	—	390	223	4,024	銀行
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	—	30	37	679	各種金融
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	—	8	62	1,122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	22	22	32	583	各種金融
CANSINO BIOLOGICS INC-A	—	2	53	954	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	—	13	59	1,075	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	—	20	53	972	資本財
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	6	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	—	105	96	1,731	各種金融
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	—	7	168	3,028	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	4	4	58	1,061	食品・飲料・タバコ
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-A	—	12	56	1,016	各種金融
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	—	10	143	2,592	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	—	6	163	2,938	ソフトウェア・サービス
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	—	36	95	1,714	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	—	2	177	3,191	耐久消費財・アパレル
SHANGHAI MEDICILON INC-A	—	2	78	1,419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTEL INTELLIGENT TECHNOLO-A	—	10	68	1,224	自動車・自動車部品
PETROCHINA CO LTD-A	217	217	115	2,071	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-A	362	774	363	6,550	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	503	709	211	3,817	銀行
BANK OF CHINA LTD-A	163	336	104	1,887	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	118	325	139	2,504	エネルギー
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	25	25	72	1,314	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	55	89	214	3,865	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK-A	173	246	1,275	22,969	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	89	124	658	11,863	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	180	245	540	9,732	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	194	366	318	5,727	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	298	298	118	2,125	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	69	115	224	4,045	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	10	15	2,925	52,678	食品・飲料・タバコ
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	272	375	179	3,227	銀行
CITIC SECURITIES CO-A	86	111	285	5,137	各種金融
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	44	67	186	3,360	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	10	89	51	926	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	174	284	648	11,685	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	111	—	—	—	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	349	563	191	3,457	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	298	568	307	5,533	資本財
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	253	—	—	—	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	89	89	108	1,952	各種金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	44	123	70	1,269	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	42	85	334	6,030	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	187	187	85	1,535	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	—	465	184	3,324	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	189	306	231	4,165	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	28	39	163	2,943	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	67	114	195	3,512	各種金融
HUANENG POWER INTL INC-A	8	113	96	1,731	公益事業
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	—	33	142	2,570	自動車・自動車部品
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	83	128	204	3,685	不動産
CRRC CORP LTD-A	—	357	216	3,902	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	41	80	347	6,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5	35	143	2,589	素材
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	55	116	212	3,828	各種金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	214	214	138	2,489	資本財
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	19	19	75	1,354	保険
HAIER SMART HOME CO LTD-A	57	87	256	4,613	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	62	116	263	4,752	資本財
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	—	310	88	1,585	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30	92	55	1,007	銀行
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	12	19	90	1,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	11	11	6	124	エネルギー

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
GEMDALE CORP-A	33	33	43	789	不動産
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	44	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	23	38	355	6,393	素材
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	8	104	46	833	資本財
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	14	—	—	—	不動産
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	3	—	—	—	メディア・娯楽
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	1	—	—	—	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	177	265	272	4,910	素材
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	72	72	56	1,008	各種金融
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	66	66	67	1,217	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	35	76	291	5,245	資本財
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	5	5	2	41	エネルギー
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	17	23	476	8,585	小売
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	179	443	111	2,002	素材
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1	9	85	1,545	食品・飲料・タバコ
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	9	9	3	63	各種金融
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	21	127	72	1,303	素材
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	13	13	18	339	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIR CHINA LTD-A	8	64	62	1,116	運輸
TBEA CO LTD-A	4	55	108	1,945	資本財
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	5	97	106	1,910	資本財
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	18	218	87	1,582	資本財
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	40	230	206	3,711	資本財
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	—	44	96	1,739	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	10	10	942	運輸	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	2	14	43	781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGXI COPPER CO LTD-A	3	20	43	782	素材
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	38	38	19	346	各種金融
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	14	30	86	1,561	自動車・自動車部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	43	43	46	830	各種金融
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	4	32	41	744	素材
SICHUAN CHUANOU ENERGY CO-A	7	52	60	1,081	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2	20	39	709	ヘルスケア機器・サービス
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	2	—	—	—	メディア・娯楽
AECC AVIATION POWER CO-A	14	25	125	2,257	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	89	89	89	1,602	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	2	2	2	50	ヘルスケア機器・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	99	128	213	3,851	運輸
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	68	172	97	1,753	素材
ZHONGJIN GOLD CORP-A	4	—	—	—	素材
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	6	6	2	43	素材
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	67	67	60	1,094	各種金融
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	15	34	68	1,228	素材
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	6	6	25	450	家庭用品・パーソナル用品
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20	20	97	1,747	資本財
BBMG CORPORATION-A	9	9	2	46	素材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	31	31	12	227	食品・生活必需品小売り
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	9	9	24	450	エネルギー
YUTONG BUS CO LTD-A	2	—	—	—	資本財

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
(中国オフショア)					
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	7	—	—	—	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	13	108	60	1,085	運輸
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	2	—	—	—	小売
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	6	44	82	1,484	資本財
HUADIAN POWER INTL CORP-A	13	13	5	107	公益事業
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	12	—	—	—	不動産
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	3	63	85	1,544	エネルギー
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	5	—	—	—	資本財
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	6	23	144	2,606	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	23	49	192	3,462	ソフトウェア・サービス
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO	—	184	57	1,027	資本財
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	12	12	25	455	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	91	91	65	1,171	運輸
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	56	56	19	347	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	19	19	93	1,677	自動車・自動車部品
XIAMEN C & D INC-A	3	3	2	52	資本財
YOUNGOR GROUP CO-A	31	31	21	382	不動産
AVICOPTER PLC-A	5	5	28	515	資本財
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	32	—	—	—	各種金融
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	3	97	80	1,442	各種金融
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	14	14	30	546	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	—	130	60	1,097	不動産
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	35	35	17	315	素材
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	4	4	4	74	資本財
ZHANGZHOU PIENITZEHUANG PHA-A	6	8	300	5,419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	14	—	—	—	素材
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	8	15	417	7,520	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	11	11	19	353	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	20	—	—	—	エネルギー
KINGFA SCI. & TECH CO LTD-A	32	32	38	701	素材
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	50	50	48	874	小売
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	23	—	—	—	資本財
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	9	9	13	237	不動産
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZHEJIANG JUHUA CO-A	23	23	26	478	素材
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	4	4	11	208	ヘルスケア機器・サービス
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	100	100	46	830	素材
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	10	10	30	546	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	22	—	—	—	公益事業
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	26	26	37	681	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	—	34	17	312	エネルギー
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	3	3	10	183	食品・飲料・タバコ
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	14	—	—	—	資本財
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	—	90	100	1,810	資本財
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	12	12	26	473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	8	—	—	—	運輸
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	16	16	19	352	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	10	46	99	1,787	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	33	63	257	4,633	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	4	19	118	2,139	ソフトウェア・サービス
JCET GROUP CO LTD-A	—	19	53	959	半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	20	20	104	1,889	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	4	4	54	989	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	6	6	35	634	消費者サービス
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	11	11	22	403	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	14	18	56	1,014	素材
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	—	4	78	1,417	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA JUSHI CO LTD -A	29	33	55	1,003	素材
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	—	142	51	928	素材
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	60	60	33	596	小売
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	10	20	164	2,967	資本財
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	—	40	72	1,296	資本財
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2	37	53	970	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAILUN GROUP CO LTD-A	—	31	36	663	自動車・自動車部品
TONGKUN GROUP CO LTD-A	15	15	33	599	素材
WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	15	—	—	—	半導体・半導体製造装置
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	3	3	37	668	素材
ANGEL YEAST CO LTD-A	7	7	39	716	食品・飲料・タバコ
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	—	19	61	1,108	素材
LUENMEI QUANTUM CO LTD-A	24	—	—	—	公益事業
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	26	62	477	8,600	半導体・半導体製造装置
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2	2	36	650	自動車・自動車部品
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	7	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	25	95	126	2,276	エネルギー
CHENGTON MINING GROUP CO -A	—	44	46	831	素材
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	23	41	432	7,795	食品・飲料・タバコ
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	10	10	53	960	食品・飲料・タバコ
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12	12	24	436	自動車・自動車部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	3	3	20	367	資本財
DONGXING SECURITIES CO LT-A	2	62	69	1,247	各種金融
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	8	21	124	2,242	自動車・自動車部品
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	69	114	209	3,771	各種金融
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	43	264	199	3,584	公益事業
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	5	5	35	634	食品・飲料・タバコ
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	—	13	93	1,678	食品・飲料・タバコ
SKSHU PAINT CO LTD-A	4	5	65	1,176	素材
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	4	—	—	—	各種金融
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	32	149	101	1,832	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	58	58	84	1,521	銀行
CHINA FILM CO LTD-A	2	—	—	—	メディア・娯楽
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1	13	42	765	自動車・自動車部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	1	6	31	572	ヘルスケア機器・サービス
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	2	2	5	105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	40	40	63	1,138	運輸
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2	2	23	417	半導体・半導体製造装置
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	8	8	61	1,109	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千円	千円	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	28	28	30	552	各種金融
SDIC CAPITAL CO LTD-A	36	54	43	775	各種金融
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	1	3	48	873	ヘルスケア機器・サービス
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	—	19	33	609	公益事業
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	10	12	147	2,664	半導体・半導体製造装置
TOLY BREAD CO LTD-A	5	7	19	347	食品・飲料・タバコ
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	4	5	29	533	食品・生活必需品小売り
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	1	1	37	675	メディア・娯楽
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	4	4	31	566	資本財
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	—	18	58	1,050	商業・専門サービス
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	2	2	12	231	食品・生活必需品小売り
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	52	52	69	1,250	各種金融
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	24	24	36	662	素材
CECEP WIND POWER CORP-A	—	79	42	763	公益事業
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1	—	—	—	運輸
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	32	32	46	835	各種金融
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	8	8	44	807	商業・専門サービス
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	12	149	67	1,210	不動産
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	8	24	85	1,533	不動産
EVE ENERGY CO LTD-A	15	26	261	4,717	資本財
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	—	15	71	1,287	資本財
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	—	19	29	524	素材
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	16	17	31	564	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	—	8	28	519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	—	9	107	1,930	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	6	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DO-FLUORIDE NEW MATERIALS -A	—	15	62	1,130	素材
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	24	32	27	499	各種金融
BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A	8	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	6	6	19	358	食品・飲料・タバコ
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	19	19	23	415	半導体・半導体製造装置
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	11	11	148	2,671	素材
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	—	31	37	679	素材
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	5	5	18	332	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	—	41	43	788	素材
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	—	22	42	762	資本財
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18	18	44	806	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	25	25	28	519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	22	22	25	466	素材
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	9	9	20	371	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	3	3	35	630	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	—	15	55	995	素材
JOYOUNG CO LTD -A	6	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	13	13	50	911	資本財
HUAGONG TECH CO LTD-A	10	10	25	459	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	4	4	16	289	ソフトウェア・サービス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	4	4	68	1,233	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	29	29	66	1,202	資本財
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	10	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
SHENZHEN AIRPORT CO-A	19	—	—	—	運輸
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	—	24	52	946	資本財
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	13	31	121	2,184	メディア・娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	10	10	14	260	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	7	7	17	311	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YINTAI GOLD CO LTD-A	23	23	21	384	素材
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	6	—	—	—	保険
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	11	—	—	—	素材
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	4	—	—	—	耐久消費財・アパレル
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	18	—	—	—	素材
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	—	53	32	592	資本財
SHENZHEN MTC CO LTD -A	—	45	20	376	耐久消費財・アパレル
GEM CO LTD-A	35	35	32	591	素材
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	3	3	44	809	ソフトウェア・サービス
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	6	15	78	1,420	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	30	139	110	1,994	メディア・娯楽
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	—	11	29	528	耐久消費財・アパレル
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	15	15	197	3,553	資本財
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	13	19	43	790	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	22	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1	10	36	665	耐久消費財・アパレル
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	31	—	—	—	不動産
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	17	21	69	1,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUNNAN TIN CO LTD-A	—	35	79	1,427	素材
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	10	14	31	563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEO GROUP CO LTD-A	41	—	—	—	メディア・娯楽
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	9	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9	9	20	364	食品・飲料・タバコ
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	6	6	20	369	資本財
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	14	14	47	857	資本財
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	7	7	10	192	ソフトウェア・サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	7	7	11	200	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	13	26	190	3,423	食品・飲料・タバコ
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	10	30	130	2,353	資本財
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	30	30	37	676	資本財
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	5	5	15	281	ヘルスケア機器・サービス
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	1	—	—	—	自動車・自動車部品
VENUSTECH GROUP INC-A	4	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	29	65	350	6,315	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	13	20	211	3,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLODON CO LTD-A	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	11	11	21	389	食品・飲料・タバコ
WESTONE INFORMATION INDUST-A	—	13	59	1,069	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	5	85	79	1,429	エネルギー
CHINA BAOAN GROUP-A	—	45	64	1,162	資本財
ADDSINO CO LTD -A	17	17	26	481	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	26	26	38	689	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	24	—	—	—	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	3	24	30	548	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	13	13	10	189	素材
YANGO GROUP CO LTD-A	34	—	—	—	不動産
NAVINFO CO LTD-A	9	9	14	269	耐久消費財・アパレル
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BY-HEALTH CO LTD-A	13	13	33	607	家庭用品・パーソナル用品
DAAN GENE CO LTD-A	6	9	18	328	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	7	7	3	66	不動産
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	10	10	14	262	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2	2	3	68	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	7	17	47	854	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	34	100	190	3,425	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1	1	3	66	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	5	8	180	3,258	半導体・半導体製造装置
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	6	6	21	394	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	10	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	22	22	28	517	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFILM GROUP CO LTD-A	4	4	3	61	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	48	48	35	633	素材
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	—	32	31	565	自動車・自動車部品
ATER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	35	55	191	3,453	ヘルスケア機器・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	7	18	70	1,266	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	—	9	46	837	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1	1	2	45	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	7	37	88	1,587	ヘルスケア機器・サービス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	11	77	45	819	資本財
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	6	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1	1	3	70	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	3	3	2	52	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	4	4	2	52	耐久消費財・アパレル
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2	17	64	1,166	ヘルスケア機器・サービス
YANTAI JEREH OILFIELD-A	9	9	39	705	エネルギー
TONGLING NONFERROUS METALS-A	15	235	86	1,548	素材
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	4	—	—	—	不動産
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	9	39	107	1,942	メディア・娯楽
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	10	10	24	438	資本財
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	10	18	419	7,549	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	18	27	179	3,228	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	5	5	4	84	食品・飲料・タバコ
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	30	30	26	473	各種金融
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	23	43	179	3,230	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	10	10	16	305	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	1	1	4	82	ソフトウェア・サービス
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	25	25	10	182	各種金融
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	6	6	2	50	不動産
KUNLUN TECH CO LTD-A	8	8	16	305	メディア・娯楽
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	9	—	—	—	ソフトウェア・サービス
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	19	—	—	—	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5	5	64	1,167	各種金融

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	6	6	4	80	公益事業
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	13	13	14	254	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	55	86	425	7,662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	4	—	—	—	資本財
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	4	4	2	43	各種金融
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	121	226	185	3,341	メディア・娯楽
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26	76	122	2,213	食品・飲料・タバコ
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	51	—	—	—	不動産
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	24	24	48	868	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	4	4	3	59	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	10	25	120	2,171	ソフトウェア・サービス
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	13	—	—	—	資本財
HESTEEL CO LTD-A	15	15	3	66	素材
GOERTEK INC -A	20	33	165	2,981	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	5	5	3	68	各種金融
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	26	26	18	324	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	50	79	313	5,652	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	46	46	86	1,557	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	62	141	84	1,523	耐久消費財・アパレル
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	12	—	—	—	各種金融
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	68	68	49	898	各種金融
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	11	83	66	1,204	消費者サービス
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43	60	81	1,467	自動車・自動車部品
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	5	5	3	70	各種金融
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	24	24	75	1,360	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	11	19	181	3,270	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A	25	—	—	—	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	84	126	410	7,396	各種金融
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	14	19	317	5,722	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	32	47	1,010	18,202	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	29	29	20	364	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNING.COM CO LTD-A	33	91	36	662	小売
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	343	505	250	4,519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	36	80	111	2,009	不動産
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	46	46	52	951	各種金融
PING AN BANK CO LTD-A	131	230	395	7,123	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	56	96	186	3,353	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	152	272	136	2,449	各種金融
CHINA VANKE CO LTD -A	89	128	277	5,001	不動産
ZTE CORP-A	27	38	121	2,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	64	64	47	857	資本財
WEICHAI POWER CO LTD-A	59	59	96	1,734	資本財
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5	5	18	328	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-A	59	59	131	2,363	各種金融
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	4	34	50	909	資本財
BYD CO LTD -A	16	21	527	9,507	自動車・自動車部品
YOUNGY CO LTD-A	—	4	40	734	資本財
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	—	65	64	1,163	公益事業
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	25	69	45	812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	7	11	120	2,164	素材
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	11	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6	6	59	1,065	素材
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	7	—	—	—	不動産
LB GROUP CO LTD-A	17	17	44	796	素材
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	—	32	59	1,067	素材
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	11	—	—	—	メディア・娯楽
STO EXPRESS CO LTD-A	34	—	—	—	運輸
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	—	19	47	854	素材
CNNC HUA YUAN TITANIUM -A	—	33	37	682	素材
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	22	22	66	1,188	素材
CHACHA FOOD CO LTD-A	4	4	23	418	食品・飲料・タバコ
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	—	28	49	893	資本財
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	9	9	27	490	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	13	13	31	565	資本財
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	2	5	150	2,701	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGBO TECH -A	20	20	18	333	食品・飲料・タバコ
INNER MONGOLIA YUAN XING-A	—	59	54	981	素材
ZIBO QIXIANG TENGDA CHEMIC-A	—	45	44	801	素材
EAST GROUP CO LTD-A	30	—	—	—	資本財
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	8	8	14	261	半導体・半導体製造装置
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	—	46	46	844	素材
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	35	35	19	358	素材
PERFECT WORLD CO LTD-A	13	13	19	355	メディア・娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3	6	129	2,337	食品・飲料・タバコ
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	23	23	21	392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	19	19	19	359	素材
ZHEJIANG JINGSHENG MECHAN-A	9	9	55	995	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	3	3	16	299	耐久消費財・アパレル
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	10	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NINESTAR CORP-A	1	18	93	1,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNDA HOLDING CO LTD-A	11	48	99	1,795	運輸
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	43	43	14	261	半導体・半導体製造装置
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	2	2	2	39	メディア・娯楽
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	4	6	47	855	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	3	3	21	380	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	2	2	68	1,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	—	4	73	1,319	食品・飲料・タバコ
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	4	4	3	63	ヘルスケア機器・サービス
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	9	9	15	277	資本財
S F HOLDING CO LTD-A	35	56	365	6,588	運輸
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	4	4	68	1,239	資本財
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	5	5	3	61	各種金融
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	—	7	59	1,078	素材
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	—	4	45	826	半導体・半導体製造装置
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	8	—	—	—	素材
MIANYANG FULIN PRECISION C-A	—	11	28	518	自動車・自動車部品
XIAMEN INTRETECH INC-A	3	5	16	289	耐久消費財・アパレル
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	37	37	52	937	素材

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	—	14	66	1,204	素材
CHONGQING FULING ZHACAI-A	7	7	23	417	食品・飲料・タバコ
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	—	16	73	1,331	素材
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	—	4	63	1,141	自動車・自動車部品
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	3	9	74	1,337	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	6	12	320	5,775	素材
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	5	5	37	680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	5	5	19	350	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO	—	24	52	945	素材
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	—	5	36	651	素材
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	—	20	63	1,140	素材
C&S PAPER CO LTD-A	10	10	15	283	家庭用品・パーソナル用品
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	2	2	32	581	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	—	5	74	1,335	自動車・自動車部品
ZHEJIANG WOLVO BIO-PHARMAC-A	4	4	20	361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	3	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	3	11	59	1,067	ヘルスケア機器・サービス
BGI GENOMICS CO LTD-A	3	3	26	476	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	4	4	28	508	素材
PHARMABLOCK SCIENCES NANJI-A	—	4	42	762	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A	—	7	57	1,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MINMETALS RARE EARTH-A	—	19	62	1,121	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6	6	50	918	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7	15	506	9,115	ヘルスケア機器・サービス
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	10	—	—	—	消費者サービス
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	5	—	—	—	素材
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	3	3	2	52	各種金融
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	1	4	70	1,267	ソフトウェア・サービス
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	—	12	42	772	素材
OVCTEK CHINA INC-A	3	9	39	713	ヘルスケア機器・サービス
SG MICRO CORP-A	1	4	130	2,356	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	19	28	1,626	29,294	資本財
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	2	3	99	1,790	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	8	8	23	420	ソフトウェア・サービス
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	—	53	20	376	銀行
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	—	7	91	1,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	72	72	27	503	素材
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	—	23	88	1,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	30	30	37	680	各種金融
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	—	3	26	481	半導体・半導体製造装置
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	—	1	85	1,535	資本財
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	—	75	65	1,177	素材
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	—	8	56	1,011	耐久消費財・アパレル
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	—	4	99	1,786	資本財
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	—	22	134	2,418	食品・飲料・タバコ
ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	—	5	26	485	素材
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	3	4	26	473	ヘルスケア機器・サービス
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	—	7	83	1,498	素材
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	12	22	210	3,789	半導体・半導体製造装置

銘柄	株数	当期			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(中国オフショア)	百株	百株	千円	千円		
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	—	10	43	776	ヘルスケア機器・サービス	
LUOYANG XINGQIANGLIAN SLEWI-A	—	5	74	1,339	資本財	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPE-A	—	3	141	2,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,193	25,144	49,360	888,882	
(インド)			千インドルピー			
RELIANCE INDUSTRIES LTD	375	548	130,344	200,730	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	85	161	6,022	9,275	エネルギー	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	107	169	14,500	22,331	自動車・自動車部品	
SHREE CEMENT LTD	1	1	4,791	7,378	素材	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	81	130	3,954	6,089	エネルギー	
TATA STEEL LTD	92	140	15,390	23,702	素材	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	81	110	7,669	11,811	食品・飲料・タバコ	
NESTLE INDIA LTD	4	6	11,661	17,958	食品・飲料・タバコ	
GAIL INDIA LTD	244	298	4,200	6,468	公益事業	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	73	107	19,636	30,240	銀行	
VEDANTA LTD	199	207	6,485	9,987	素材	
TITAN CO LTD	47	68	16,501	25,412	耐久消費財・アパレル	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	264	492	8,163	12,571	エネルギー	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	16	23	3,361	5,176	家庭用品・パーソナル用品	
LUPIN LTD	23	44	4,076	6,277	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MPHASIS LTD	—	17	5,075	7,816	ソフトウェア・サービス	
ACC LTD	11	14	3,183	4,903	素材	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	224	329	83,788	129,033	銀行	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	93	—	—	—	メディア・娯楽	
INFOSYS LTD	449	654	113,711	175,116	ソフトウェア・サービス	
WIPRO LTD	142	265	15,192	23,396	ソフトウェア・サービス	
MRF LTD	0.27	0.38	2,700	4,159	自動車・自動車部品	
INDIAN OIL CORP LTD	244	352	4,245	6,538	エネルギー	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	108	160	36,565	56,310	家庭用品・パーソナル用品	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13	18	8,465	13,036	ヘルスケア機器・サービス	
HCL TECHNOLOGIES LTD	144	209	23,571	36,299	ソフトウェア・サービス	
DABUR INDIA LTD	71	127	6,989	10,763	家庭用品・パーソナル用品	
HERO MOTOCORP LTD	16	22	6,105	9,401	自動車・自動車部品	
SRF LTD	—	29	7,066	10,882	素材	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	12	16	3,794	5,844	自動車・自動車部品	
DR. REDDY'S LABORATORIES	14	21	9,400	14,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IPCA LABORATORIES LTD	10	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BHARTI AIRTEL LTD	153	476	32,906	50,676	電気通信サービス	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	108	163	13,085	20,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DIVI'S LABORATORIES LTD	18	25	10,502	16,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	18	26	21,241	32,712	自動車・自動車部品	
AUROBINDO PHARMA LTD	37	62	3,789	5,836	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOCON LTD	59	83	3,102	4,777	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	128	236	4,991	7,686	自動車・自動車部品	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	27	38	4,442	6,842	各種金融	
PETRONET LNG LTD	78	129	2,715	4,182	エネルギー	
CIPLA LTD	62	90	8,044	12,389	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LARSEN & TOUBRO LTD	94	132	25,245	38,878	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
ULTRATECH CEMENT LTD	14	19	14,040	21,621	素材
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	123	177	67,077	103,298	ソフトウェア・サービス
ADANI ENTERPRISES LTD	—	53	9,201	14,170	資本財
NTPC LTD	636	947	12,563	19,348	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11	20	4,886	7,525	各種金融
AMBUJA CEMENTS LTD	77	137	4,860	7,484	素材
BHARAT FORGE LTD	30	45	3,286	5,060	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	215	305	14,608	22,497	素材
ITC LTD	395	546	11,566	17,811	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	21	27	7,245	11,157	素材
UPL LTD	53	91	6,993	10,770	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	4	8	2,718	4,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIEMENS LTD	7	13	3,007	4,630	資本財
INFO EDGE INDIA LTD	9	14	6,442	9,921	メディア・娯楽
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	53	64	5,529	8,515	家庭用品・パーソナル用品
MINDTREE LTD	—	11	4,464	6,875	ソフトウェア・サービス
MARICO LTD	70	97	4,613	7,104	家庭用品・パーソナル用品
PAGE INDUSTRIES LTD	0.54	1	4,550	7,007	耐久消費財・アパレル
DLF LTD	92	117	4,360	6,714	不動産
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	291	613	13,132	20,224	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON REC LTD	66	95	6,685	10,295	運輸
BAJAJ FINSERV LTD	140	—	—	—	各種金融
BAJAJ AUTO LTD	5	7	11,670	17,972	各種金融
BAJAJ AUTO LTD	8	14	4,738	7,297	自動車・自動車部品
JUBILANT FOODWORKS LTD	11	14	5,243	8,075	消費者サービス
MUTHOOT FINANCE LTD	18	23	3,418	5,264	各種金融
COAL INDIA LTD	161	259	4,061	6,254	エネルギー
TATA MOTORS LTD	229	323	15,461	23,810	自動車・自動車部品
TATA POWER CO LTD	—	285	6,549	10,086	公益事業
INDUS TOWERS LTD	24	135	3,365	5,183	電気通信サービス
PI INDUSTRIES LTD	11	15	3,922	6,040	素材
ASIAN PAINTS LTD	51	74	23,398	36,033	素材
BAJAJ FINANCE LTD	36	52	36,329	55,947	各種金融
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	7	10	6,148	9,468	ソフトウェア・サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	56	76	14,024	21,597	公益事業
INDRAPRASTHA GAS LTD	47	63	2,498	3,848	公益事業
TRENT LTD	25	32	3,667	5,648	小売
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	87	169	10,609	16,338	保険
BHARAT ELECTRONICS LTD	—	229	4,531	6,978	資本財
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7	10	2,464	3,795	各種金融
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	41	52	3,273	5,041	運輸
BANDHAN BANK LTD	98	124	3,838	5,910	銀行
ADANI TOTAL GAS LTD	—	50	8,994	13,852	公益事業
GODREJ PROPERTIES LTD	—	24	3,974	6,120	不動産
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	14	22	7,840	12,074	食品・飲料・タバコ
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	—	82	5,275	8,124	各種金融
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	—	43	3,544	5,459	各種金融
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	—	44	3,580	5,514	商業・専門サービス
YES BANK LTD	1,414	2,141	2,880	4,435	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		
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円		
ZOMATO LTD	—	276	2,527	3,891	小売	
EICHER MOTORS LTD	18	25	6,712	10,337	自動車・自動車部品	
AXIS BANK LTD	299	437	30,812	47,451	銀行	
HAVELLS INDIA LTD	27	45	5,325	8,200	資本財	
STATE BANK OF INDIA	222	329	16,258	25,037	銀行	
ICICI BANK LTD	673	985	78,721	121,231	銀行	
BERGER PAINTS INDIA LTD	26	40	2,908	4,478	素材	
TECH MAHINDRA LTD	84	121	18,428	28,380	ソフトウェア・サービス	
ADANI TRANSMISSION LTD	—	50	10,281	15,833	公益事業	
GRASIM INDUSTRIES LTD	32	48	8,270	12,737	素材	
AVENUE SUPERMARTS LTD	20	32	12,957	19,954	食品・生活必需品小売り	
UNITED SPIRITS LTD	30	59	5,115	7,878	食品・飲料・タバコ	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	25	41	5,574	8,584	保険	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	37	60	3,425	5,275	保険	
INTERGLOBE AVIATION LTD	12	19	3,840	5,915	運輸	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	49	87	10,732	16,527	保険	
JSW STEEL LTD	93	164	10,213	15,728	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	10,375	16,839	1,365,936	2,103,541	
	銘柄 数 < 比 率 >	96	106	—	< 11.2% >	
(クウェート)			千クウェートディナール			
KUWAIT FINANCE HOUSE	552	889	80	30,335	銀行	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	283	430	25	9,733	電気通信サービス	
GULF BANK	197	—	—	—	銀行	
NATIONAL BANK OF KUWAIT	853	1,309	136	51,461	銀行	
AGILITY	170	231	22	8,673	運輸	
MABANEE CO KPSC	73	115	9	3,564	不動産	
BOUBYAN BANK K. S. C	137	211	17	6,585	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,268	3,188	292	110,353	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	6	—	< 0.6% >	
(サウジアラビア)			千サウジアラビアリアル			
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	36	45	309	9,426	素材	
JARIR MARKETING CO	6	10	219	6,685	小売	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6	12	99	3,018	保険	
ETIHAD ETISALAT CO	55	70	225	6,871	電気通信サービス	
SAUDI BRITISH BANK	89	162	665	20,247	銀行	
AL RAJHI BANK	164	236	3,487	106,167	銀行	
ARAB NATIONAL BANK	87	111	301	9,182	銀行	
BANK ALBILAD	53	67	369	11,259	銀行	
BANK AL-JAZIRA	53	78	171	5,217	銀行	
BANQUE SAUDI FRANSI	75	108	537	16,354	銀行	
RIYAD BANK	166	265	874	26,634	銀行	
SAMBA FINANCIAL GROUP	136	—	—	—	銀行	
SAUDI TELECOM CO	81	116	1,384	42,158	電気通信サービス	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	25	42	768	23,399	素材	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	120	174	2,177	66,283	素材	
SAUDI CEMENT	12	12	70	2,144	素材	
SAUDI ELECTRICITY CO	123	155	401	12,219	公益事業	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	29	43	144	4,385	素材	
SAVOLA	33	45	154	4,696	食品・飲料・タバコ	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等		
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(サウジアラビア)	百株	百株	千円	千円			
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	37	67	149	4,557	素材		
ALMARAI CO	31	42	204	6,234	食品・飲料・タバコ		
EMAAR ECONOMIC CITY	42	82	103	3,161	不動産		
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	35	66	293	8,938	素材		
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11	18	135	4,112	素材		
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	81	138	249	7,586	素材		
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	39	128	129	3,954	不動産		
RABIGH REFINING AND PETROCHE	16	39	93	2,857	エネルギー		
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	52	90	112	3,434	電気通信サービス		
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	8	11	157	4,799	保険		
ALINMA BANK	123	180	497	15,143	銀行		
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	4	9	105	3,216	食品・生活必需品小売り		
SAUDI ARABIAN MINING CO	54	84	766	23,320	素材		
NATIONAL PETROCHEMICAL CO	—	20	85	2,587	素材		
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	—	9	184	5,610	ヘルスケア機器・サービス		
SAUDI AIRLINES CATERING CO	4	—	—	—	消費者サービス		
SAUDI ARABIAN OIL CO	296	428	1,556	47,365	エネルギー		
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	7	7	131	3,990	ヘルスケア機器・サービス		
THE SAUDI NATIONAL BANK	199	424	3,038	92,491	銀行		
小 計	株 数	金 額	2,404	3,614	20,358	619,716	
	銘柄 数 < 比 率 >		36	36	—	< 3.3% >	
(カタール)					千カタールリアル		
QATAR NATIONAL BANK	601	875	1,908	59,585	銀行		
COMMERCIAL BANK PQSC	217	414	296	9,254	銀行		
OOREDOO QPSC	124	124	89	2,800	電気通信サービス		
QATAR FUEL QSC	64	98	187	5,861	エネルギー		
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	80	80	141	4,421	公益事業		
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	93	150	152	4,771	銀行		
INDUSTRIES QATAR	239	275	459	14,344	資本財		
QATAR ISLAMIC BANK	159	215	413	12,907	銀行		
QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	370	487	175	5,489	エネルギー		
MASRAF AL RAYAN	449	904	460	14,378	銀行		
BARWA REAL ESTATE CO	247	406	139	4,359	不動産		
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	486	758	184	5,752	素材		
小 計	株 数	金 額	3,133	4,790	4,610	143,927	
	銘柄 数 < 比 率 >		12	12	—	< 0.8% >	
(南アフリカ)					千南アフリカランド		
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	16	22	520	3,897	素材		
BIDVEST GROUP LTD	41	52	983	7,370	資本財		
CLICKS GROUP LTD	34	50	1,575	11,802	食品・生活必需品小売り		
DISCOVERY LTD	55	82	1,194	8,943	保険		
GOLD FIELDS LTD	119	175	2,889	21,644	素材		
REMGRO LTD	70	100	1,274	9,544	各種金融		
NORTHAM PLATINUM LTD	49	—	—	—	素材		
HARMONY GOLD MINING CO LTD	68	107	658	4,930	素材		
EXXARO RESOURCES LTD	28	42	720	5,396	エネルギー		
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9	15	3,103	23,243	銀行		
MTN GROUP LTD	207	328	5,208	39,012	電気通信サービス		
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	56	82	2,494	18,682	素材		

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカランド	千円		
FIRSTSTRAND LTD	647	976	6,025	45,129	各種金融	
NASPERS LTD-N SHS	57	41	10,510	78,724	小売	
NEDBANK GROUP LTD	52	86	1,536	11,509	銀行	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6	9	1,705	12,774	素材	
SASOL LTD	70	109	3,219	24,115	素材	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	65	94	1,926	14,426	食品・生活必需品小売り	
STANDARD BANK GROUP LTD	173	250	3,531	26,450	銀行	
SPAR GROUP LIMITED/THE	25	36	637	4,774	食品・生活必需品小売り	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	129	189	955	7,158	小売	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	51	72	1,480	11,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TIGER BRANDS LTD	20	32	590	4,419	食品・飲料・タバコ	
SANLAM LTD	219	375	2,242	16,794	保険	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	108	158	3,431	25,700	素材	
KUMBA IRON ORE LTD	7	10	531	3,978	素材	
VODACOM GROUP LTD	79	111	1,521	11,395	電気通信サービス	
NEPI ROCKCASTLE PLC	59	79	818	6,133	不動産	
OLD MUTUAL LTD	591	909	1,205	9,028	保険	
REINET INVESTMENTS SCA	22	27	796	5,963	各種金融	
ABSA GROUP LTD	98	133	2,107	15,785	銀行	
PEPKOR HOLDINGS LTD	—	240	548	4,111	小売	
MULTICHOICE GROUP LTD	61	72	847	6,348	メディア・娯楽	
SIBANYE STILLWATER LTD	279	544	2,938	22,009	素材	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	—	72	1,425	10,677	素材	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	100	150	671	5,032	保険	
MR PRICE GROUP LTD	28	46	965	7,228	小売	
BID CORP LTD	43	61	1,972	14,773	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,757	5,955	74,766	560,003	
	銘柄 数 < 比 率 >	36	37	—	< 3.0% >	
(アラブ首長国連邦)			千アラブディルハム			
DUBAI ISLAMIC BANK	204	548	300	9,307	銀行	
EMAAR PROPERTIES PJSC	491	746	348	10,785	不動産	
EMIRATES NBD PJSC	349	493	653	20,261	銀行	
EMAAR MALLS PJSC	306	—	—	—	不動産	
ABU DHABI ISLAMIC BANK	203	270	185	5,733	銀行	
EMIRATES TELECOM GROUP CO	212	672	2,157	66,871	電気通信サービス	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	337	507	445	13,808	銀行	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	373	843	1,726	53,510	銀行	
ALDAR PROPERTIES PJSC	510	720	298	9,243	不動産	
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	—	484	200	6,214	小売	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,988	5,288	6,316	195,735	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	< 1.0% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	319,407	496,376	—	17,055,235	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,352	1,413	—	< 91.0% >	

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

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

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

銘柄	口数	期首(前期末)	当 期 末			
			口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)	口	口	千メキシコペソ	千円	%	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	45,800	58,900	1,282	7,098	0.0	
小 計	口数・金額	45,800	58,900	1,282	7,098	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
(南アフリカ)	口	口	千南アフリカランド			
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	48,594	63,261	882	6,609	0.0	
小 計	口数・金額	48,594	63,261	882	6,609	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
合 計	口数・金額	94,394	122,161	—	13,708	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 株式先物取引 MSCIEMG 2203	百万円 1,643	百万円 —

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

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	17,055,235	89.0
投資証券	13,708	0.1
コール・ローン等、その他	2,094,191	10.9
投資信託財産総額	19,163,134	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産 (18,823,722千円) の投資信託財産総額 (19,163,134千円) に対する比率は98.2%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=114.01円、1メキシコペソ=5.5334円、1ブラジルリアル=20.7561円、1チリペソ=0.141169円、1コロンビアペソ=0.028683円、1ユーロ=129.06円、1英ポンド=153.70円、1トルコリラ=8.4609円、1チェココルナ=5.256円、1ハンガリーフォリント=0.357246円、1ポーランドズロチ=28.2676円、1ロシアルーブル=1.44円、1香港ドル=14.64円、1マレーシアリングギット=27.2221円、1タイバーツ=3.45円、1フィリピンペソ=2.2222円、1インドネシアルピア=0.008円、1韓国ウォン=0.0954円、1新台幣ドル=4.1154円、1オフショア人民元=18.0078円、1インドルピー=1.54円、1クウェートディナール=377.77円、1サウジアラビアリアル=30.44円、1カタールリアル=31.22円、1南アフリカランド=7.49円、1アラブディルハム=30.99円。

## ○特定資産の価格等の調査

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	19,275,006,163
コール・ローン等	1,169,330,083
株式(評価額)	17,055,235,912
投資証券(評価額)	13,708,334
未収入金	114,050,636
未収配当金	6,549,055
差入委託証拠金	916,132,143
(B) 負債	538,164,935
未払金	161,141,853
未払解約金	377,022,300
未払利息	782
(C) 純資産総額(A-B)	18,736,841,228
元本	11,528,471,845
次期繰越損益金	7,208,369,383
(D) 受益権総口数	11,528,471,845口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,253円

(注) 当ファンドの期首元本額は8,352,954,743円、期中追加設定元本額は7,839,919,236円、期中一部解約元本額は4,664,402,134円です。

(注) 2022年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな新興国株式インデックスファンド	3,035,128,480円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	1,709,449,490円
・Smart-i 新興国株式インデックス	1,620,564,443円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,417,476,834円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	683,516,472円
・つみたてバランスファンド	593,645,552円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	347,894,198円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-09	229,337,035円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	213,712,400円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	202,445,076円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	184,634,141円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-03	175,263,556円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	163,668,010円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-06	142,358,621円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-10	140,582,085円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	136,416,875円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-12	84,577,362円
・九州SDGs・グローバルバランス	78,571,550円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	67,146,891円
・りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	66,981,924円
・FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	57,475,396円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	46,692,180円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-06	29,936,724円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	29,427,003円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	27,002,502円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	15,700,411円
・DCりそな グローバルバランス	11,705,697円
・リスクコントロール・オープン	8,378,010円
・りそなV1グローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	4,381,678円
・りそなV1グローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	2,756,548円
・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,410,023円
・りそなV1グローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	234,678円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.6253円です。

## ○損益の状況 (2021年1月26日~2022年1月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	297,277,271
受取配当金	296,499,212
受取利息	895,455
その他収益金	2,824
支払利息	△ 120,220
(B) 有価証券売買損益	△ 450,157,430
売買益	2,407,034,576
売買損	△2,857,192,006
(C) 先物取引等取引損益	△ 279,094,957
取引益	191,584,913
取引損	△ 470,679,870
(D) 保管費用等	△ 26,562,055
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 458,537,171
(F) 前期繰越損益金	5,503,463,356
(G) 追加信託差損益金	5,244,621,664
(H) 解約差損益金	△3,081,178,466
(I) 計(E+F+G+H)	7,208,369,383
次期繰越損益金(I)	7,208,369,383

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

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

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

## ○お知らせ

---

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

# RM新興国債券マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日 2022年1月25日）  
（2021年1月26日～2022年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	<p>①主として、JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>②債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。</p> <p>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p>
主要投資対象	<ul style="list-style-type: none"><li>JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券</li><li>新興国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</li></ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"><li>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、</li><li>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。</li><li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>

りそなアセットマネジメント 株式会社

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース) (ベンチマーク)		投資信託 組入比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円
2期(2018年1月25日)	11,848	12.1	33,711.33	13.6	99.9	1,678
3期(2019年1月25日)	10,717	△ 9.5	31,263.48	△ 7.3	99.9	2,398
4期(2020年1月27日)	11,280	5.3	34,193.00	9.4	98.4	6,100
5期(2021年1月25日)	10,776	△ 4.5	33,073.13	△ 3.3	98.2	5,087
6期(2022年1月25日)	10,768	△ 0.1	33,489.38	1.3	98.0	7,099

(注) 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー(J.P.Morgan Securities LLC)が算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数であり、指数に関する著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース) (ベンチマーク)		投資信託 組入比率
	騰落	率	騰落	率	
(期首) 2021年1月25日	円	%		%	%
	10,776	—	33,073.13	—	98.2
1月末	10,821	0.4	33,168.88	0.3	98.3
2月末	10,805	0.3	33,279.87	0.6	99.5
3月末	10,746	△0.3	33,051.70	△0.1	99.8
4月末	10,961	1.7	33,694.42	1.9	99.6
5月末	11,228	4.2	34,537.40	4.4	99.3
6月末	11,218	4.1	34,491.41	4.3	99.7
7月末	11,062	2.7	34,039.21	2.9	98.0
8月末	11,036	2.4	34,154.94	3.3	99.8
9月末	10,917	1.3	33,770.38	2.1	99.6
10月末	10,974	1.8	34,001.56	2.8	99.7
11月末	10,539	△2.2	32,777.10	△0.9	99.7
12月末	10,852	0.7	33,749.85	2.0	99.6
(期末) 2022年1月25日	円	%		%	%
	10,768	△0.1	33,489.38	1.3	98.0

(注) 騰落率は期首比です。

## ○運用経過

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末10,776円から当期末10,768円となり、8円の値下がりとなりました。

新興国債券の市況（JPMorganGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））は新興国の債券価格が下落したことがマイナスに影響した一方、為替の影響がプラスに寄与し上昇しました。ファンドの諸費用等の影響により基準価額は下落しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

## 投資環境

## 新興国債券市況

新興国の長期金利は、前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。新型コロナワクチンの普及見通しに不透明感が残る中、期後半には、資源価格上昇や通貨安進展などによるインフレ高進を受けて、金融政策の引き締めが進みました。地域別では、南アフリカでは財務状況の改善を受けて債券価格見通しが改善する中、期末にかけて政策金利の引き上げが進み、長期金利は上昇しました。ブラジルではインフレ高進を受けて期を通じて中央銀行は利上げを進め、金利は上昇基調となりました。

## 為替市況

前期末と比較して、円は米ドル・ユーロの双方に対して円安となりました。

米ドルに対して、前半は、米長期金利上昇が主導する形で期初時点の1米ドル＝104円台から110円台近辺まで円安が進みました。後半は、世界的な株式市場の不安定化に対して円が選好される場面も見られましたが、米国における高インフレ環境の長期化懸念からFRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ前倒し観測が強まり、一時は2017年1月以来となる1米ドル＝116円台まで米ドル高円安が進行しました。

ユーロに対して、前半は、ユーロ圏地域のワクチン接種加速や欧州復興基金の運用開始に伴う景気回復期待からユーロ高円安が進みました。後半には、ECB（欧州中央銀行）が利上げに慎重な姿勢を維持したことなどを受けて、ユーロ高円安の動きは一巡しました。

新興国通貨は円に対しては通貨高となり、米ドルに対しては通貨安となりました。地域別では、中国は過去最大規模の貿易収支黒字が元高圧力の要因となる中、対米ドル、対円ともに元高が進みました。トルコは2022年以降の高インフレ環境にも関わらず、2021年9月以降、利下げを余儀なくされたことが嫌気され、対米ドル

では12月に過去最安値を更新しました。

### 当ファンドのポートフォリオ

新興国の現地通貨建て債券を実質的な主要投資対象とし、JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、ETF（上場投資信託証券）を活用して運用を行いました。ETFへの投資を通じて実質債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

### 当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は-0.1%となり、ベンチマークの+1.3%を1.3%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

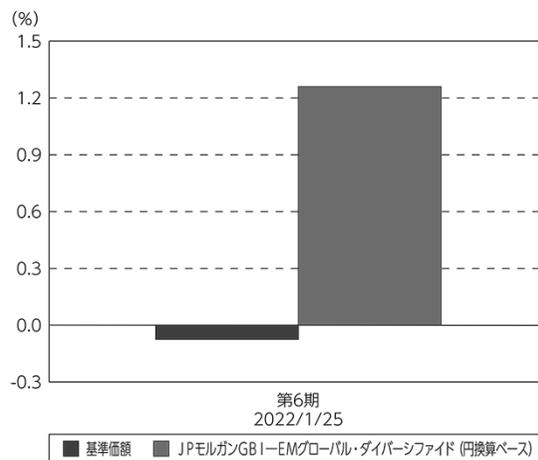
（マイナス要因）

- ・コスト負担（ETF等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
- ・配当金の課税負担が生じたこと

（その他の要因）

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと
- ・ベンチマークとファンドで保有するETFの値動きで乖離が生じたこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



### ○今後の運用方針

引き続き、主としてJPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、JPモルガンGBI—EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）との連動性を高めるため、新興国債券の指数を対象指数としたETFを活用しながら運用を行う方針です。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 投 資 信 託 証 券 )	円 4 (4)	% 0.037 (0.037)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 ( 投 資 信 託 証 券 )	0 (0)	0.000 (0.000)	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	1 (1) (0)	0.013 (0.012) (0.000)	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	5	0.050	
期中の平均基準価額は、10,929円です。			

(注) 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・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	口	千米ドル	口	千米ドル
アメリカ				
VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	382,810	11,825	195,950	5,937
ISHARES JPM EM LCL GOV BND	407,010	22,230	132,450	7,213
小 計	789,820	34,055	328,400	13,151

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年1月25日現在)

## 外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
VANECK J.P. MORGAN EM LOCAL	441,672	628,532	18,007	2,053,028	28.9	
ISHARES JPM EM LCL GOV BND	577,887	852,447	42,997	4,902,136	69.0	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,019,559	1,480,979	61,004	6,955,165	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 98.0% >	

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 6,955,165	% 95.4
コール・ローン等、その他	335,982	4.6
投資信託財産総額	7,291,147	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産 (7,128,338千円) の投資信託財産総額 (7,291,147千円) に対する比率は97.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=114.01円。

## ○特定資産の価格等の調査

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,330,640,253
コール・ローン等	169,631,116
投資信託受益証券(評価額)	6,955,165,055
未収入金	78,673,917
未収配当金	127,170,165
(B) 負債	231,144,859
未払金	39,549,618
未払解約金	191,594,800
未払利息	441
(C) 純資産総額(A-B)	7,099,495,394
元本	6,592,999,606
次期繰越損益金	506,495,788
(D) 受益権総口数	6,592,999,606口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,768円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,721,029,528円、期中追加設定元本額は4,277,823,000円、期中一部解約元本額は2,405,852,922円です。

(注) 2022年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,402,579,045円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	1,031,087,564円
・つみたてバランスファンド	905,452,459円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	849,687,493円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	490,687,519円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	264,874,796円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-09	176,622,147円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	161,437,792円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	155,756,116円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	140,586,512円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-03	134,295,881円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	126,198,464円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-06	109,612,098円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-10	108,263,372円
・FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	107,213,700円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	104,355,527円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-12	65,149,128円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	49,580,458円
・九州SDGs・グローバルバランス	46,988,611円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	35,748,145円
・りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	23,256,681円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-06	22,874,534円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	22,584,587円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	20,558,154円
・DCりそな グローバルバランス	18,103,139円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	12,064,422円
・リスクコントロール・オープン	3,233,077円
・りそなV1グローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	1,923,562円
・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,081,653円
・りそなV1グローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	776,339円
・りそなV1グローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	366,631円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0768円です。

## ○損益の状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	313,307,602
受取配当金	313,349,867
受取利息	790
支払利息	△ 43,055
(B) 有価証券売買損益	△356,003,325
売買益	556,762,595
売買損	△912,765,920
(C) 保管費用等	△ 768,326
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 43,464,049
(E) 前期繰越損益金	366,528,215
(F) 追加信託差損益金	391,186,400
(G) 解約差損益金	△207,754,778
(H) 計(D+E+F+G)	506,495,788
次期繰越損益金(H)	506,495,788

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

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

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

## ○お知らせ

---

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

# RM国内リートマザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日 2022年1月25日）  
（2021年1月26日～2022年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	①主として、東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、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。なお、東証REIT指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証REIT指数（配当込み）を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。 ②不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
主要投資対象	・東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）
主な投資制限	・不動産投資信託証券および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は、行いません。

りそなアセットマネジメント 株式会社

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証REIT指数 (配当込み) (ベンチマーク)		不動産投信 先物比率	投資信託 証券組入比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
2期(2018年1月25日)	11,040	△0.6	3,378.86	△0.4	3.4	96.8	14,593
3期(2019年1月25日)	11,929	8.1	3,654.11	8.1	4.4	95.6	12,367
4期(2020年1月27日)	14,787	24.0	4,533.90	24.1	2.1	97.8	24,559
5期(2021年1月25日)	12,646	△14.5	3,887.39	△14.3	2.3	95.2	24,302
6期(2022年1月25日)	13,731	8.6	4,220.06	8.6	1.0	99.0	28,802

(注) 不動産投信指数先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託(REIT)全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証REIT指数 (配当込み) (ベンチマーク)		不動産投信 先物比率	投資信託 証券組入比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2021年1月25日	円	%		%	%	%
	12,646	—	3,887.39	—	2.3	95.2
1月末	13,025	3.0	4,004.00	3.0	2.6	97.4
2月末	13,695	8.3	4,207.24	8.2	2.7	97.0
3月末	14,314	13.2	4,399.26	13.2	2.7	97.3
4月末	14,704	16.3	4,518.99	16.2	2.2	97.9
5月末	14,808	17.1	4,551.00	17.1	2.5	97.7
6月末	15,397	21.8	4,732.24	21.7	1.5	98.5
7月末	15,511	22.7	4,767.40	22.6	1.2	98.7
8月末	15,471	22.3	4,755.00	22.3	1.4	98.5
9月末	14,985	18.5	4,605.71	18.5	1.4	98.9
10月末	15,163	19.9	4,660.54	19.9	1.6	98.3
11月末	14,544	15.0	4,470.13	15.0	1.5	98.6
12月末	15,046	19.0	4,624.94	19.0	1.3	98.9
(期末) 2022年1月25日	13,731	8.6	4,220.06	8.6	1.0	99.0

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 不動産投信指数先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○運用経過

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の変動要因

基準価額は前期末12,646円から当期末13,731円となり、1,085円の値上がりとなりました。

国内リートの市況(東証REIT指数(配当込み))の上昇により、基準価額は上昇しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

## 投資環境

## 国内リート市況

国内のリート市場は、前期末と比較して上昇しました。期前半は、新型コロナワクチンの接種進展や主要国の大規模な財政・金融支援策継続が支援材料となり上昇しました。期後半は、経済活動の正常化が進む一方、主要国の金利上昇が嫌気され、徐々に水準を切り下げました。期末にかけて、主要国における金融政策正常化の前倒し観測から東証リート指数は上昇幅を縮小しました。用途別指数では、期末にかけて新型コロナウイルス変異株の感染拡大を受け、オフィス指数の下落が目立ちました。

## 当ファンドのポートフォリオ

国内の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値(用途別の比率など)をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。不動産投資信託証券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。

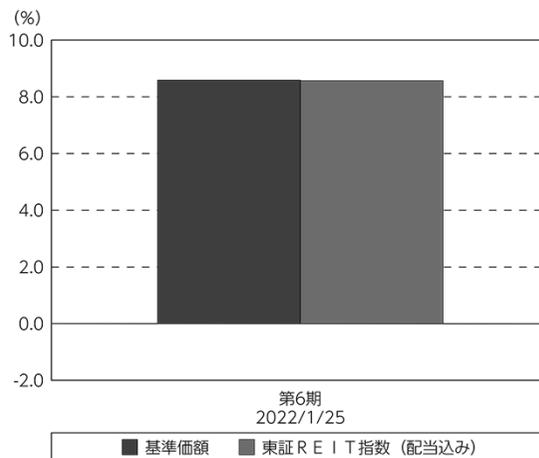
## 当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+8.6%となり、ベンチマークの+8.6%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

(マイナス要因)

- ・コスト負担（リート等に係る売買費用）が生じたこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



## ○今後の運用方針

引き続き、主として東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 投 資 信 託 証 券 ) ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	円 0 (0) (0)	% 0.001 (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、14,721円です。			

(注) 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・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	口	千円	口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	470	65,121	309	40,990
サンケイリアルエステート投資法人	754	93,091	472	55,903
S O S i L A 物流リート投資法人	1,210	193,441	564	85,689
東海道リート投資法人	256	28,764	46	4,962
日本アコモデーションファンド投資法人	725	457,543	604	377,030
MCUBS M i d C i t y 投資法人	554 (△ 3,090)	58,774 (△ 297,818)	401	41,812
森ヒルズリート投資法人	2,481	380,706	2,073	313,508
産業ファンド投資法人	2,987	592,818	2,484	487,924
アドバンス・レジデンス投資法人	2,140	748,471	1,676	575,400
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,498	317,582	1,189	249,619
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,162	537,215	902	416,373
GLP 投資法人	6,950	1,265,855	5,561	1,007,296
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	982	325,304	793	260,665
日本プロロジスリート投資法人	3,478	1,227,872	2,619	930,190
星野リゾート・リート投資法人	363	233,548	268	170,850
One リート投資法人	386	117,524	284	85,113
イオンリート投資法人	2,648	402,949	1,854	276,551
ヒューリックリート投資法人	2,089	367,626	1,461	252,150
日本リート投資法人	675	282,816	608	255,866
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	10,036	193,936	25,456	543,710
積水ハウス・リート投資法人	6,492	570,899	5,221	455,690
トーセイ・リート投資法人	459	60,956	417	55,125
ケネディクス商業リート投資法人	883	246,461	670	184,128
ヘルスケア&メディカル投資法人	449	64,880	376	53,509
サムティ・レジデンシャル投資法人	513	61,867	353	41,161
野村不動産マスターファンド投資法人	6,827	1,147,154	5,713	952,130
いちごホテルリート投資法人	363	31,126	328	28,211
ラサールロジポート投資法人	2,699	479,051	2,014	354,708
スターアジア不動産投資法人	2,347	134,811	1,977	111,142
マリモ地方創生リート投資法人	262	33,745	166	21,084
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	800	452,462	618	346,730
大江戸温泉リート投資法人	338	26,487	282	22,181
投資法人みらい	2,642	132,190	1,909	94,074
森トラスト・ホテルリート投資法人	509	67,359	385	50,885
三菱地所物流リート投資法人	587	265,348	429	194,685
CRE ロジスティクスファンド投資法人	886	167,809	591	109,144
ザイマックス・リート投資法人	316	36,299	286	32,408
タカラレーベン不動産投資法人	933	108,017	572	63,522

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	819	121,328	680	99,526
	日本ビルファンド投資法人	2,472	1,673,072	1,973	1,337,815
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,113	1,396,853	1,768	1,164,955
	日本都市ファンド投資法人	9,162	1,076,333	7,657	884,633
	オリックス不動産投資法人	( 7,834)	( 297,818)		
	日本プライムリアルティ投資法人	4,206	806,484	3,519	668,797
	N T T都市開発リート投資法人	1,481	600,194	1,100	444,947
	東急リアル・エステート投資法人	2,077	316,830	1,614	243,651
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,415	264,397	1,184	217,846
	ユニテッド・アーバン投資法人	1,467	176,220	1,228	146,828
	森トラスト総合リート投資法人	4,819	725,732	3,773	562,971
	インヴィンシブル投資法人	1,508	226,253	1,261	188,460
	フロンティア不動産投資法人	9,424	388,164	7,380	302,066
	平和不動産リート投資法人	750	363,245	585	278,760
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,407	220,222	1,102	170,132
	福岡リート投資法人	1,381	446,027	1,156	367,792
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,092	188,775	914	156,267
	いちごオフィスリート投資法人	652	487,329	545	405,572
	大和証券オフィス投資法人	1,743	158,705	1,485	134,559
	阪急阪神リート投資法人	447	330,711	378	279,571
	スターツプロシード投資法人	957	147,198	801	122,190
	大和ハウスリート投資法人	327	75,006	274	62,148
	大和ハウスリート投資法人	3,249	1,017,869	2,553	781,862
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,690	417,054	6,014	375,264
	大和証券リビング投資法人	2,778	308,890	2,203	241,208
	ジャパンエクセレント投資法人	1,960	280,808	1,640	231,266
合 計	134,545	24,191,609	124,718	19,471,234	
	( 4,744)	( -)			

(注) 金額は受け渡し代金。

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

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	不動産投信指数先物取引	百万円 3,024	百万円 10,550	百万円 -	百万円 -

**○利害関係人との取引状況等**

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

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

**○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)**

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年1月25日現在)

## 国内投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	392	553		74,212	0.3
サンケイリアルエステート投資法人	587	869		97,067	0.3
S O S i L A 物流リート投資法人	631	1,277		196,785	0.7
東海道リート投資法人	—	210		21,924	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人	827	948		565,956	2.0
MCUBS M i d C i t y 投資法人	2,937	—		—	—
森ヒルズリート投資法人	2,819	3,227		449,843	1.6
産業ファンド投資法人	3,393	3,896		739,850	2.6
アドバンス・レジデンス投資法人	2,280	2,744		932,960	3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,566	1,875		371,250	1.3
アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,203	1,463		543,504	1.9
GLP投資法人	7,500	8,889		1,646,242	5.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,047	1,236		377,598	1.3
日本プロロジスリート投資法人	3,632	4,491		1,585,323	5.5
星野リゾート・リート投資法人	365	460		282,900	1.0
On e リート投資法人	374	476		136,992	0.5
イオンリート投資法人	2,434	3,228		458,376	1.6
ヒューリックリート投資法人	1,932	2,560		415,232	1.4
日本リート投資法人	780	847		318,048	1.1
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	15,420	—		—	—
積水ハウス・リート投資法人	7,060	8,331		635,655	2.2
トーセイ・リート投資法人	531	573		71,854	0.2
ケネディクス商業リート投資法人	883	1,096		277,288	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人	512	585		76,752	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	462	622		73,831	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人	7,762	8,876		1,315,423	4.6
いちごホテルリート投資法人	420	455		33,670	0.1
ラサールロジポート投資法人	2,675	3,360		595,056	2.1
スターアジア不動産投資法人	2,466	2,836		170,443	0.6
マリモ地方創生リート投資法人	225	321		39,258	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	838	1,020		582,420	2.0
大江戸温泉リート投資法人	387	443		26,137	0.1
投資法人みらい	2,592	3,325		155,111	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人	520	644		71,677	0.2
三菱地所物流リート投資法人	540	698		313,053	1.1
CREロジスティクスファンド投資法人	768	1,063		207,710	0.7
ザイマックス・リート投資法人	368	398		45,212	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	721	1,082		123,131	0.4
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	931	1,070		169,381	0.6
日本ビルファンド投資法人	2,701	3,200		2,057,600	7.1
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,400	2,745		1,674,450	5.8
日本都市ファンド投資法人	4,509	13,848		1,256,013	4.4

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
オリックス不動産投資法人	4,782		5,469	869,024	3.0
日本プライムリアルティ投資法人	1,494		1,875	672,187	2.3
NTT都市開発リート投資法人	2,168		2,631	381,231	1.3
東急リアル・エステート投資法人	1,609		1,840	333,408	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人	1,667		1,906	205,276	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	5,133		6,179	800,798	2.8
森トラス総合リート投資法人	1,715		1,962	261,927	0.9
インヴィンシブル投資法人	10,036		12,080	420,384	1.5
フロンティア不動産投資法人	797		962	444,444	1.5
平和不動産リート投資法人	1,473		1,778	243,052	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,568		1,793	556,726	1.9
福岡リート投資法人	1,241		1,419	219,519	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	742		849	555,246	1.9
いちごオフィスリート投資法人	1,991		2,249	176,771	0.6
大和証券オフィス投資法人	511		580	389,760	1.4
阪急阪神リート投資法人	1,084		1,240	177,940	0.6
スターツプロシード投資法人	374		427	88,260	0.3
大和ハウスリート投資法人	3,425		4,121	1,359,930	4.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,732		8,408	457,395	1.6
大和証券リビング投資法人	3,134		3,709	395,379	1.4
ジャパンエクセレント投資法人	2,227		2,547	316,337	1.1
合 計	口 数 ・ 金 額	145,293	159,864	28,510,196	
	銘 柄 数 < 比 率 >	62	61	< 99.0% >	

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	278	—
東証REIT指数		

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	28,510,196	98.2
コール・ローン等、その他	510,947	1.8
投資信託財産総額	29,021,143	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

## ○特定資産の価格等の調査

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	29,021,143,556
コール・ローン等	315,505,313
投資証券(評価額)	28,510,196,850
未収入金	9,270,000
未収配当金	150,995,493
差入委託証拠金	35,175,900
(B) 負債	218,320,645
未払金	20,366,790
未払解約金	197,953,000
未払利息	855
(C) 純資産総額(A-B)	28,802,822,911
元本	20,977,046,765
次期繰越損益金	7,825,776,146
(D) 受益権総口数	20,977,046,765口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,731円

(注) 当ファンドの期首元本額は19,216,952,787円、期中追加設定元本額は17,962,516,760円、期中一部解約元本額は16,202,422,782円です。

(注) 2022年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな国内リートインデックスオープン	5,137,575,103円
・FWりそな国内リートインデックスファンド	4,316,001,294円
・J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,753,904,238円
・Smart-i Jリートインデックス	2,491,845,960円
・つみたてバランスファンド	1,436,467,161円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	941,888,323円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	918,821,717円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	799,576,998円
・りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	631,952,851円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	201,177,657円
・J-REITインデックス202102(適格機関投資家専用)	144,744,799円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-09	139,720,663円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	122,510,763円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	118,220,631円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-03	107,582,370円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	106,680,327円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	90,293,569円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-06	86,703,629円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-10	85,641,683円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	79,208,937円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-12	51,539,989円
・九州SDGs・グローバルバランス	42,092,792円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	36,853,920円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	27,242,204円
・DCりそな グローバルバランス	19,129,517円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-06	18,488,113円
・りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	18,387,836円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	17,311,312円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	16,247,660円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	9,161,534円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	2,927,185円
・リスクコントロール・オープン	2,485,168円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	1,952,086円
・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,705,652円
・りそな国内リートインデックス(ラップ専用)	667,246円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	335,878円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.3731円です。

## ○損益の状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,018,306,588
受取配当金	1,009,423,218
その他収益金	9,412,178
支払利息	△ 528,808
(B) 有価証券売買損益	652,044,264
売買益	1,884,901,485
売買損	△1,232,857,221
(C) 先物取引等取引損益	90,612,660
取引益	142,641,090
取引損	△ 52,028,430
(D) 保管費用等	△ 1,577
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,760,961,935
(F) 前期繰越損益金	5,085,114,589
(G) 追加信託差損益金	7,992,571,440
(H) 解約差損益金	△7,012,871,818
(I) 計(E+F+G+H)	7,825,776,146
次期繰越損益金(I)	7,825,776,146

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

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

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

## ○お知らせ

---

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

# R M先進国リートマザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日 2022年1月25日）  
（2021年1月26日～2022年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	<p>①主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、S&amp;P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、S&amp;P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>②不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p>
主要投資対象	<ul style="list-style-type: none"><li>先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）</li><li>先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式</li><li>先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</li></ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"><li>不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。</li><li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>

りそなアセットマネジメント 株式会社

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース)		株組入比率	投資信託 証券組入比率	純資産額
	期騰落	中率	(ベンチマーク)	期騰落中率			
	円	%		%	%	%	百万円
2期(2018年1月25日)	10,205	1.4	118,414.40	2.4	—	99.7	7,034
3期(2019年1月25日)	10,313	1.1	121,176.83	2.3	—	99.8	11,593
4期(2020年1月27日)	12,154	17.9	144,187.15	19.0	—	99.7	24,980
5期(2021年1月25日)	10,369	△14.7	124,243.52	△13.8	0.1	97.4	22,787
6期(2022年1月25日)	14,180	36.8	170,942.03	37.6	0.3	99.2	27,261

(注) 「S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS & Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数であり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はS & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに帰属します。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース)		株組入比率	投資信託 証券組入比率
	騰落	率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2021年1月25日	円	%		%	%	%
	10,369	—	124,243.52	—	0.1	97.4
1月末	10,463	0.9	125,429.28	1.0	0.1	99.1
2月末	11,012	6.2	132,416.19	6.6	0.1	99.0
3月末	11,825	14.0	141,812.87	14.1	0.1	99.2
4月末	12,368	19.3	148,529.32	19.5	0.1	99.4
5月末	12,645	22.0	151,940.77	22.3	0.1	99.1
6月末	13,031	25.7	156,754.89	26.2	0.3	99.1
7月末	13,360	28.8	160,838.62	29.5	0.3	98.8
8月末	13,638	31.5	164,195.00	32.2	0.4	98.9
9月末	13,322	28.5	160,446.27	29.1	0.4	99.2
10月末	14,476	39.6	174,462.99	40.4	0.4	99.2
11月末	14,410	39.0	173,578.89	39.7	0.3	99.0
12月末	15,355	48.1	185,199.45	49.1	0.3	98.6
(期末) 2022年1月25日	円	%		%	%	%
	14,180	36.8	170,942.03	37.6	0.3	99.2

(注) 騰落率は期首比です。

## ○運用経過

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末10,369円から当期末14,180円となり、3,811円の値上がりとなりました。

先進国リートの市況（S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース））の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも先進国のリート価格が上昇したことが寄与しました。

基準価額等の推移

(2021年1月26日～2022年1月25日)



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

## 投資環境

## 先進国リート市況

先進国のリート市場は、前期末と比較して上昇しました。期前半は、大規模な財政・金融支援策継続や新型コロナウイルスの接種進展が支援材料となり上昇しました。セクター別では、感染抑制に伴う行動制限緩和期待からホテル・娯楽・リゾートセクターの上昇が目立ちました。その後も、経済活動の正常化進展を支援材料に上昇基調を維持しました。期末にかけて、米国を中心とする主要国中央銀行の金融政策正常化観測の強まりを受けた主要国金利上昇が嫌気され、期末にかけて上昇幅を縮小する展開となりました。

## 為替市況

前期末と比較して、円は米ドル・ユーロの双方に対して円安となりました。

米ドルに対して、期前半は、米長期金利上昇が主導する形で期初時点の1米ドル=104円台から110円台近辺まで円安が進みました。期後半は、世界的な株式市場の不安定化に対して円が選好される場面も見られましたが、米国における高インフレ環境の長期化懸念からFRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ前倒し観測が強まり、一時は2017年1月以来となる1米ドル=116円台まで米ドル高円安が進行しました。

ユーロに対して、期前半は、ユーロ圏地域のワクチン接種加速や欧州復興基金の運用開始に伴う景気回復期待からユーロ高円安が進みました。期後半には、ECB（欧州中央銀行）が利上げに慎重な姿勢を維持したことなどをを受けて、ユーロ高円安の動きは一巡しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

日本を除く先進国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、用途別の比率など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。不動産投資信託証券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+36.8%となり、ベンチマークの+37.6%を0.8%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

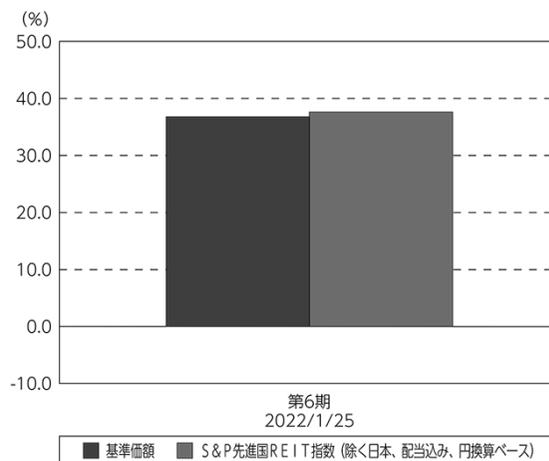
### （マイナス要因）

- ・コスト負担（リート等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
- ・配当金の課税負担が生じたこと

### （その他の要因）

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



## ○今後の運用方針

引き続き、主としてS & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券および不動産関連株式に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	5 (0) (5)	% (0.000) (0.039)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	4 (0) (4)	0.029 (0.000) (0.029)	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	8 (8) (△0)	0.059 (0.062) (△0.003)	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、権利・配当にかかる税金及びその払戻し、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	17	0.127	
期中の平均基準価額は、12,992円です。			

(注) 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・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年1月26日～2022年1月25日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 270	千米ドル 635	百株 26	千米ドル 67
	オーストラリア	567	千オーストラリアドル 176	417	千オーストラリアドル 125

(注) 金額は受け渡し代金。

## 投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	ACADIA REALTY TRUST	4,101	86	5,567	112
	AGREE REALTY CORP	7,106	483	6,618	447
	ALEXANDER & BALDWIN INC	2,475	50	3,859	73
	ALEXANDER'S INC	30	8	86	24
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,938	2,921	15,468	2,739
	ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,626	30	—	—
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	3,080	113	3,681	126
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	12,747	591	14,861	665
	AMERICAN FINANCE TRUST INC	4,976	43	4,871	48
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	28,550	1,049	30,820	1,079
	AMERICOLD REALTY TRUST	32,358	1,177	26,455	964
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	7,730	55	9,415	62
	APARTMENT INCOME REIT CO	15,863	733	17,166	774
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	21,683	319	25,529	380
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	4,913	66	6,070	79
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,318	60	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,319	2,907	16,786	3,315
	BRT APARTMENTS CORP	791	15	—	—
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	516	13	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	14,869	1,587	17,221	1,840
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,084	41	—	—
	BRANDYWINE REALTY TRUST	15,049	199	17,996	242
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	29,687	632	34,442	727
	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	4,819	89	11,303	206
	CAMDEN PROPERTY TRUST	10,392	1,337	11,341	1,359
	CARETRUST REIT INC	8,605	200	10,340	241
	CEDAR REALTY TRUST INC	1,951	45	—	—
	CENTERSPACE	453	42	484	33
	CHATHAM LODGING TRUST	2,656	33	4,050	53
	CITY OFFICE REIT INC	1,800	28	3,950	51
	COLONY CAPITAL INC	20,225	122	30,358	195
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	7,785	139	27,515	482	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	848	40	1,186	55	
CORESITE REALTY CORP	3,473	459	10,676	1,622	
COREPOINT LODGING INC	2,187	33	3,072	34	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	9,705	265	12,013	327	
COUSINS PROPERTIES INC	17,827	646	20,250	738	
CTO REALTY GROWTH INC	—	—	—	—	
	(△ 900)	(△ 40)	—	—	
CTO REALTY GROWTH INC	—	—	—	—	
	( 900)	( 40)	—	—	
CUBESMART	20,107	883	20,214	832	

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	CYRUSONE INC	12,628	958	13,691	982
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	21,045	206	23,989	243
	DIGITAL REALTY TRUST INC	28,724	4,278	33,158	4,813
	DIGITALBRIDGE GROUP INC	28,903	214	24,235	173
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	9,539	33	15,911	67
	DOUGLAS EMMETT INC	19,929	635	21,038	687
	DUKE REALTY CORP	37,772	1,779	42,831	1,913
	EPR PROPERTIES	6,701	313	8,082	387
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	5,980	129	6,633	138
	EASTGROUP PROPERTIES INC	3,472	564	3,963	608
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	10,791	122	12,821	146
	EQUINIX INC	8,967	6,702	10,412	7,460
	EQUITY COMMONWEALTH	10,717	295	13,335	371
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,309	1,246	20,008	1,380
	EQUITY RESIDENTIAL	34,810	2,636	41,096	3,075
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	7,520	202	6,912	180
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,556	1,930	7,704	2,232
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,170	2,144	15,710	2,284
	FARMLAND PARTNERS INC	1,032	11	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	649	86	117	14
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,185	661	7,674	833
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	11,172	559	13,143	632
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	4,237	121	5,023	141
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,235	7	3,315	18
	GEO GROUP INC/THE	8,512	66	10,913	82
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	24,311	1,092	26,424	1,173
	GETTY REALTY CORP	920	31	1,329	38
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,691	39	2,111	44
	GLADSTONE LAND CORP	3,174	67	1,067	19
	GLOBAL NET LEASE INC	8,783	152	8,783	155
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,208	49	1,574	21
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	13,174	405	14,344	441
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	22,172	651	25,442	726
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	56,604	1,880	65,720	2,153
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,520	66	3,735	48
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	8,832	380	10,988	479
	HOST HOTELS & RESORTS INC	76,991	1,269	87,621	1,476
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	14,529	381	17,770	483
	INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	6,069	109	6,692	114
	INDUS REALTY TRUST INC	935	66	—	—
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2,214	55	3,461	83
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,254	456	2,400	468	
INVITATION HOMES INC	62,968	2,259	67,192	2,282	
IRON MOUNTAIN INC	30,275	1,210	35,006	1,373	

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
JBG SMITH PROPERTIES	11,344	348	12,914	408
KILROY REALTY CORP	11,509	756	13,278	893
KIMCO REALTY CORP	54,929 ( 24,844)	1,120 ( 394)	59,044	1,182
KITE REALTY GROUP TRUST	5,352 ( 18,911)	112 ( 305)	5,688	114
LTC PROPERTIES INC	663	28	1,556	67
LXP INDUSTRIAL TRUST	25,605	309	30,618	357
LIFE STORAGE INC	7,590 ( 4,099)	794 ( -)	7,456	710
MACERICH CO/THE	24,101	410	10,566	164
VERIS RESIDENTIAL INC	2,815	49	5,257	86
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	59,930	1,287	65,302	1,398
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,879	1,962	13,745	2,168
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	2,860	54	4,862	88
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,101	268	4,734	326
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15,337	680	17,947	797
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,202	425	6,599	309
NETSTREIT CORP	4,384	104	812	19
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	- (△ 12,195)	- (△ 66)	-	-
NEXPOINT RESIDENTIAL	1,372	89	1,775	97
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	805	22	1,956	54
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	25,019	892	27,017	978
ORION OFFICE REIT INC	- ( 7,881)	- ( 139)	-	-
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,138	328	2,489	385
PARAMOUNT GROUP INC	5,522	54	9,248	93
PARK HOTELS & RESORTS INC	21,946	429	25,627	534
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10,978	246	13,805	328
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,178	23	-	-
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2,825	89	-	-
PHYSICIANS REALTY TRUST	16,317	298	18,876	341
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	10,616	188	13,780	244
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,001	51	1,014	23
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,959	38	-	-
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	2,583	35	3,270	36
PROLOGIS INC	73,065	8,768	86,199	9,792
PUBLIC STORAGE	15,467	4,331	18,102	4,850
QTS REALTY TRUST INC-CL A	4,231	289	15,342	1,129
RLJ LODGING TRUST	15,879	232	18,988	292
RPT REALTY	3,913	51	4,132	51
REALTY INCOME CORP	48,280 ( 23,003)	3,197 ( 1,292)	44,913 ( -)	2,930 ( 139)

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ		千米ドル		千米ドル
	REGENCY CENTERS CORP	17,370	1,053	20,565	1,245
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	6,438	112	8,586	146
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	15,105	167	21,595	245
				( 30,355)	( 305)
	RETAIL VALUE INC	—	—	1,380	26
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	15,440	910	14,457	767
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,975	457	6,837	544
	SL GREEN REALTY CORP	6,643	479	10,377	736
		(△ 25)	( 23)		
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	16,459	274	16,873	294
	SAFEHOLD INC	539	45	886	63
	SAUL CENTERS INC	244	12	348	16
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2,553	45	2,968	55
	SERVICE PROPERTIES TRUST	13,150	157	16,283	201
	SIMON PROPERTY GROUP INC	33,345	4,111	39,027	4,692
	SITE CENTERS CORP	17,784	258	15,991	231
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	11,294	515	12,326	546
	STAG INDUSTRIAL INC	15,970	598	15,207	541
	STORE CAPITAL CORP	28,389	958	30,992	1,049
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	7,923	74	10,474	103
	SUN COMMUNITIES INC	12,613	2,143	13,202	2,152
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	16,024	187	19,862	244
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	7,086	119	6,492	105
	TERRENO REALTY CORP	5,891	389	6,364	387
	UDR INC	30,831	1,478	36,502	1,713
	UMH PROPERTIES INC	1,626	36	1,915	37
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	501	28	842	54
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,200	57	5,593	97
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	428	8	1,497	25
	VENTAS INC	41,574	2,238	46,178	2,532
		( 1,903)	( 66)		
	VEREIT INC	25,685	1,082	29,843	1,247
	(△ 32,629)	(△ 1,292)			
VICI PROPERTIES INC	67,271	1,951	62,497	1,809	
VORNADO REALTY TRUST	16,558	722	18,851	855	
WP CAREY INC	19,750	1,448	21,091	1,527	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	1,800	22	4,054	12	
WASHINGTON REIT	6,536	160	8,038	191	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	7,263	198	10,337	286	
			( 17,645)	( 433)	
WELLTOWER INC	45,330	3,490	49,968	3,779	
WHITESTONE REIT	1,092	10	2,473	23	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	12,122	221	14,669	281	

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	アメリカ		千米ドル		千米ドル
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	82,100 ( - )	63 (△ 2)	89,000	67
	PRIME US REIT	50,200 ( - )	42 (△ 1)	43,500	36
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	29,300 ( - )	21 (△ 2)	57,400	42
	小計	2,250,918 ( 35,792)	108,830 ( 856)	2,529,287 ( 48,000)	120,672 ( 878)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,429	300	8,462	345
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	823	9	2,579	28
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	960	41	1,466	60
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	5,776	23	-	-
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,703	47	4,013	66
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,259	456	9,845	539
	CHOICE PROPERTIES REIT	18,123	253	20,278	281
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	3,908	40	4,881	47
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	481	8	2,100	33
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	11,573	169	7,479	100
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	7,098	33	-	-
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	8,112	143	10,112	172
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,430	289	3,596	290
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,225	312	22,850 ( - )	341 ( 58)
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,543	24	-	-
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	4,954	79	6,341	98
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,281	24	1,886	34
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	734	16	1,137	24
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	-	-	1,434	22
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	2,635	34	-	-
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	14,598	192	11,728	152
	PRIMARIS REIT	- ( 5,227)	- ( 58)	-	-
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	17,876	352	20,945	413
	SLATE GROCERY REIT	1,825	26	2,059	24
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,067	281	10,615	292	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	9,907	166	10,487	164	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	8,707	60	8,142	55	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	2,500	58	9,000	221	
小計	177,527 ( 5,227)	3,447 ( 58)	181,435 ( - )	3,814 ( 58)	

銘	柄	買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ	
	ドイツ					
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	17,362 ( - )	265 (△ 13)	39,709	674
		HAMBORNER REIT AG	8,395	79	7,861	72
		小 計	25,757 ( - )	345 (△ 13)	47,570	747
	イタリア					
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	-	-	4,000	17
		COIMA RES SPA	3,638	25	-	-
		小 計	3,638	25	4,000	17
	フランス					
		ICADE	3,676	246	4,253	280
		ALTAREA	344 ( - )	64 (△ 2)	387 ( - )	68 ( 2)
		KLEPIERRE	19,864 ( - )	411 (△ 28)	24,530	502
		GECINA SA	5,622	686	6,509	777
		COVIVIO	4,638	338	5,406	395
		MERCIALYS	3,776	35	3,080	27
		CARMILA	2,145 ( - )	26 (△ 2)	3,565	47
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,822	1,007	20,476	1,394
		(Right) ALTAREA-RTS	- ( 546)	- ( 2)	546	1
		小 計	54,887 ( 546)	2,817 (△ 31)	68,752 ( - )	3,495 ( 2)
	オランダ					
		EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	1,200 (△ 5,043)	24 (△ 83)	2,467	48
		VASTNED RETAIL NV	790	19	794	20
		WERELDHAVE NV	2,726	38	3,306	45
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	558 ( 5,323)	11 ( 83)	-	-
		NSI NV	1,977	67	1,933	65
		小 計	7,251 ( 280)	160 ( - )	8,500	179
スペイン						
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	34,724 ( - )	294 (△ 7)	36,824	309	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	- ( - )	- (△ 0.851)	3,494 ( - )	17 ( 0)	

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
スペイン				
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	36,237 ( - )	319 (△ 13)	40,731	363
小 計	70,961 ( - )	613 (△ 22)	81,049 ( - )	691 ( 0)
ベルギー				
BEFIMMO	1,120	39	1,645	57
COFINIMMO	3,423	447	3,609	462
RETAIL ESTATES	644	46	561	35
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1,108	28	1,820	41
MONTEA NV	831	91	1,040	106
AEDIFICA	4,789	507	4,789	492
WAREHOUSES DE PAUW SCA	15,988	514	16,675	508
CARE PROPERTY INVEST	1,162	31	1,468	38
(Right)XIOR STUDENT HOUSING NV-R	- ( 2,850)	- ( 1)	2,850	1
XIOR STUDENT HOUSING NV	1,283	63	819 ( - )	38 ( 1)
小 計	30,348 ( 2,850)	1,770 ( 1)	35,276 ( - )	1,782 ( 1)
アイルランド				
HIBERNIA REIT PLC	60,264	76	72,176	87
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	17,631	27	29,553	46
小 計	77,895	104	101,729	134
その他				
CROMWELL REIT EUR	6,000	15	-	-
その他				
CROMWELL EUROPEAN REIT	- (△ 149,760)	- ( - )	38,500	17
小 計	6,000 (△ 149,760)	15 ( - )	38,500	17
ユ ー ロ 計	276,737 (△ 146,084)	5,852 (△ 65)	385,376 ( - )	7,065 ( 3)
イギリス		千英ポンド		千英ポンド
BRITISH LAND CO PLC	110,773	555	126,059	639
DERWENT LONDON PLC	14,520	491	16,306	549
BIG YELLOW GROUP PLC	17,460	228	19,212	232
UNITE GROUP PLC	46,111	497	54,090	577
SHAFTESBURY PLC	29,750	179	38,338	240
STANDARD LIFE INV PROP INC	-	-	12,125	9
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	17,716	9	35,053	17
PICTON PROPERTY INCOME LTD	27,831	26	47,089	42
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	50,250	38	58,025	42
SAFESTORE HOLDINGS PLC	19,970	190	23,668	205

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	87,705	207	106,076	240
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	38,327	35	53,813	42
	SEGRO PLC	129,042	1,404	147,837	1,517
	CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	75,474	125	89,347	153
	WORKSPACE GROUP PLC	7,683	64	9,590	79
	GCP STUDENT LIVING PLC	8,156	13	85,583	171
	NEWRIVER REIT PLC	—	—	16,546	16
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	11,268	13	24,269	26
	PRS REIT PLC/THE	96,702	106	9,982	9
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	83,378	96	47,055	52
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	24,096	170	29,409	206
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	178,992	367	188,779	360
	RDI REIT PLC	—	—	48,350	58
	CUSTODIAN REIT PLC	7,226	6	23,439	21
	HOME REIT PLC	87,702	105	—	—
	HAMMERSON PLC	331,473	114	327,035	112
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	27,353	25	40,860	34
	ASSURA PLC	369,493	272	382,531	281
	LXI REIT PLC	101,627	140	75,546	100
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	102,569	154	121,405	180	
LAND SECURITIES GROUP PLC	91,802	638	104,174	725	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	22,684	26	27,194	31	
小 計	2,217,133	6,309	2,388,785	6,979	
国	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	BWP TRUST	47,768	201	56,151	226
	MIRVAC GROUP	434,917	1,137	511,754	1,311
	CROMWELL PROPERTY GROUP	59,090	50	156,221	132
	CHARTER HALL RETAIL REIT	28,512	110	34,180	128
	GPT GROUP	219,423	1,032	262,555	1,214
	ABACUS PROPERTY GROUP	36,566	110	50,521	147
	STOCKLAND	256,352	1,152	303,411	1,356
	DEXUS/AU	115,531	1,139	139,266	1,362
		(△ 155,449)	(△ 1,448)		
	GOODMAN GROUP	175,287	3,495	206,147	3,924
	CHARTER HALL GROUP	48,536	724	57,734	811
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	11,285	45	20,832	77
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	35,553	213	30,610	172
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	113,993	286	130,602	329
	ARENA REIT	32,994	116	45,117	149
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	48,829	179	48,521	170
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	71,447	347	67,844	327
	NATIONAL STORAGE REIT	50,980	112	48,135	101
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	5,214	18	5,366	19
GDI PROPERTY GROUP	—	—	21,956	23	

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	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
	CHARTER HALL SOCIAL INFRAS	14,373	54	21,303	69
	HOME CONSORTIUM LTD	22,011	124	19,479	113
		(△ 26,532)	(△ 134)		
	RURAL FUNDS GROUP	23,730	61	25,841	64
	IRONGATE GROUP	10,760	18	26,432	34
	CENTURIA OFFICE REIT	14,000	36	19,823	40
	WAYPOINT REIT	27,074	71	41,484	106
		(△ 6,941)	(△ 19)		
	SCENTRE GROUP	568,028	1,612	670,923	1,913
	HOME CONSORTIUM LTD	—	—	—	—
		( 26,532)	( 134)		
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	37,397	54	22,664	27
	DEXUS INDUSTRIA REIT	5,280	18	—	—
DEXUS/AU	—	—	—	—	
	( 155,449)	( 1,448)			
VICINITY CENTRES	429,256	695	495,913	815	
AVENTUS GROUP	29,396	95	31,203	96	
小 計	2,973,582	13,320	3,571,988	15,268	
	(△ 6,941)	(△ 19)			
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	
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	123,493	202	107,731	174	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	23,098	74	27,014	80	
GOODMAN PROPERTY TRUST	124,338	292	154,564	357	
ARGOSY PROPERTY LTD	73,744	117	84,640	129	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	92,747	115	119,175	148	
小 計	437,420	801	493,124	889	
香港		千香港ドル		千香港ドル	
LINK REIT	228,900	16,152	266,300	18,740	
PROSPERITY REIT	87,000	266	115,000	322	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	148,000	514	68,000	270	
			( — )	( 2 )	
CHAMPION REIT	86,000	374	124,000	542	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	47,000	230	70,000	316	
FORTUNE REIT	123,000	945	144,000	1,086	
(Right)YUEXIU REAL ESTATE -RTS	—	—	91,390	1	
	( 91,390)	( 2 )			
小 計	719,900	18,483	878,690	21,280	
	( 91,390)	( 2 )	( — )	( 2 )	
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	589,800	1,241	612,900	1,309	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	412,700	1,247	449,700	1,359	
	( — )	(△ 12)			
SUNTEC REIT	190,900	291	229,600	349	

銘	柄	買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	シンガポール		口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	390,300 ( - )	759 (△ 7)	422,600 ( - )	825 ( 0)	
	STARHILL GLOBAL REIT	84,300	52	124,100	73	
	KEPPEL REIT	235,600	279	231,600	273	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	123,800	305	190,900	456	
	ESR REIT	115,800 ( - )	47 (△ 0.011)	90,600 ( - )	35 ( 0)	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	42,800 ( - )	53 (△ 2)	59,800	69	
	CAPITALAND CHINA TRUST	115,800 ( - )	152 (△ 0.963)	114,200	150	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	176,000 ( - )	36 (△ 3)	116,100 ( - )	26 ( 1)	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	45,500 ( - )	203 (△ 1)	51,200	221	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	- ( - )	- (△ 1)	889,100	43	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	235,500 ( - )	660 (△ 0.261)	229,200	629	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	313,000 ( - )	650 (△ 1)	357,700	746	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	61,000 ( - )	51 (△ 0.217)	43,900 ( - )	32 ( 0)	
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	12,400 ( - )	17 (△ 0.908)	22,600 ( - )	29 ( 0)	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	-	-	160,100	65	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	200,300 ( - )	206 (△ 9)	220,100	226	
	SPH REIT	47,700	45	73,100	66	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	- ( - )	- (△ 0.452)	165,900 ( - )	88 ( 0)	
	EC WORLD REIT	- ( - )	- (△ 0.766)	-	-	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	21,300	17	27,800	24	
	ASCOTT TRUST	122,900 ( - )	129 (△ 3)	157,100 ( - )	164 ( 0)	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	60,000 ( - )	24 (△ 0.378)	95,700	37	
	(Right)FIRST REAL ESTATE INVT-RTS	- ( 105,252)	- ( 1)	105,252	0.315	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	- ( - )	- (△ 0.234)	133,700	59	
	IREIT GLOBAL	40,000	25	-	-	

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
KEPPEL DC REIT	133,200 ( - )	354 (△ 1)	152,900 ( - )	405 ( 0)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	271,400 ( - )	397 (△ 5)	290,600 ( - )	426 ( 0)
小計	4,042,000 ( 105,252)	7,252 (△ 53)	5,818,052 ( - )	8,198 ( 1)
韓国		千韓国ウォン		千韓国ウォン
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	-	-	5,889	26,200
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	-	-	3,586	26,417
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	- ( - )	- (△ 143)	-	-
LOTTE REIT CO LTD	11,532	60,937	6,439 ( - )	33,419 ( 751)
(Right)LOTTE REIT CO LTD	- ( 6,440)	- ( 751)	6,440	617
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	20,670	-	-
(Right)ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	- ( 7,311)	- ( 735)	7,311	598
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	21,100	153,119	- ( - )	- ( 735)
小計	36,831 ( 13,751)	234,727 ( 1,344)	29,665 ( - )	87,253 ( 1,487)
イスラエル		千イスラエルシェケル		千イスラエルシェケル
REIT 1 LTD	1,659	38	3,500	54
小計	1,659	38	3,500	54

(注) 金額は受け渡し代金。

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

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○株式売買比率

(2021年1月26日～2022年1月25日)

### 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	103,218千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	62,019千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.66

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年1月25日現在)

## 外国株式

銘	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		評 価 額
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
BROADSTONE NET LEASE INC-A		—	243	550	62,754	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	—	243	550	62,754	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.2%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
CENTURIA CAPITAL GROUP		840	990	299	24,426	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	840	990	299	24,426	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	840	1,234	—	87,180	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	2	—	<0.3%>	

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

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

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
ACADIA REALTY TRUST	14,937	13,471	270	30,885	0.1
AGREE REALTY CORP	10,042	10,530	683	77,914	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	12,439	11,055	253	28,887	0.1
ALEXANDER'S INC	368	312	79	9,107	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,932	21,402	4,178	476,442	1.7
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	—	1,626	31	3,579	0.0
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,604	8,003	283	32,290	0.1
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,231	21,117	1,091	124,422	0.5
AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,224	19,329	160	18,246	0.1
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	45,334	43,064	1,675	191,037	0.7
AMERICOLD REALTY TRUST	34,542	40,445	1,136	129,526	0.5
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,440	23,755	159	18,145	0.1
APARTMENT INCOME REIT CO	25,128	23,825	1,231	140,432	0.5
APPLE HOSPITALITY REIT INC	35,804	31,958	510	58,223	0.2
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,000	8,843	120	13,771	0.1
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	4,318	35	4,007	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,628	21,161	5,086	579,956	2.1
BRT APARTMENTS CORP	877	1,668	36	4,189	0.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	3,936	104	11,891	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	23,914	21,562	2,480	282,776	1.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	—	8,084	42	4,820	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	29,394	26,447	343	39,137	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	49,805	45,050	1,102	125,681	0.5
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,484	—	—	—	—
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	2,000	14	1,630	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,464	15,515	2,451	279,463	1.0
CARETRUST REIT INC	16,468	14,733	312	35,593	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	—	1,951	46	5,316	0.0
CENTERSPACE	2,204	2,173	205	23,481	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	8,481	7,087	92	10,536	0.0
CITY OFFICE REIT INC	8,644	6,494	115	13,186	0.0
CLIPPER REALTY INC	1,350	1,350	12	1,406	0.0
COLONY CAPITAL INC	82,849	—	—	—	—
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,730	—	—	—	—
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,736	3,398	153	17,530	0.1
CORESITE REALTY CORP	7,203	—	—	—	—
COREPOINT LODGING INC	7,200	6,315	98	11,260	0.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,324	17,016	433	49,450	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	24,951	22,528	865	98,652	0.4
CTO REALTY GROWTH INC	900	—	—	—	—
CTO REALTY GROWTH INC	—	900	53	6,085	0.0
CUBESMART	32,964	32,857	1,660	189,361	0.7

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
CYRUSONE INC	20,327	19,264	1,716	195,645	0.7	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	34,437	31,493	288	32,889	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	47,423	42,989	6,616	754,339	2.8	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	—	77,384	567	64,757	0.2	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	40,962	34,590	104	11,949	0.0	
DOUGLAS EMMETT INC	27,666	26,557	845	96,373	0.4	
DUKE REALTY CORP	62,866	57,807	3,296	375,860	1.4	
EPR PROPERTIES	12,914	11,533	508	58,012	0.2	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	14,000	13,347	286	32,625	0.1	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,660	6,169	1,228	140,032	0.5	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	24,101	22,071	197	22,521	0.1	
EQUINIX INC	15,087	13,642	9,970	1,136,693	4.2	
EQUITY COMMONWEALTH	20,932	18,314	471	53,723	0.2	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	28,651	25,952	1,982	225,992	0.8	
EQUITY RESIDENTIAL	57,958	51,672	4,564	520,421	1.9	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	18,144	18,752	477	54,474	0.2	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,031	9,883	3,290	375,098	1.4	
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,858	20,318	3,962	451,708	1.7	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	4,291	48	5,484	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	10,622	1,306	148,978	0.5	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,579	—	—	—	—	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,726	19,755	1,180	134,595	0.5	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,736	11,950	322	36,771	0.1	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,990	13,910	80	9,150	0.0	
GEO GROUP INC/THE	20,721	18,320	133	15,163	0.1	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	36,482	34,369	1,483	169,079	0.6	
GETTY REALTY CORP	6,175	5,766	168	19,156	0.1	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,178	5,758	132	15,144	0.1	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	4,670	138	15,791	0.1	
GLOBAL NET LEASE INC	15,387	15,387	215	24,577	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,453	9,087	151	17,270	0.1	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,411	22,241	693	79,113	0.3	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	36,762	33,492	1,064	121,349	0.4	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,945	81,829	2,852	325,220	1.2	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,093	5,878	52	6,038	0.0	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,895	15,739	681	77,643	0.3	
HOST HOTELS & RESORTS INC	118,920	108,290	1,840	209,884	0.8	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,204	22,963	540	61,627	0.2	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	16,444	15,821	350	39,971	0.1	
INDUS REALTY TRUST INC	—	935	71	8,101	0.0	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,229	9,982	224	25,628	0.1	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,815	3,669	714	81,414	0.3	
INVITATION HOMES INC	94,837	90,613	3,777	430,690	1.6	
IRON MOUNTAIN INC	48,685	43,954	1,950	222,346	0.8	
JBG SMITH PROPERTIES	19,165	17,595	477	54,483	0.2	

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
KILROY REALTY CORP	17,640	15,871	1,005	114,592	0.4	
KIMCO REALTY CORP	72,834	93,563	2,223	253,557	0.9	
KITE REALTY GROUP TRUST	14,475	33,050	689	78,601	0.3	
LTC PROPERTIES INC	6,749	5,856	206	23,587	0.1	
LXP INDUSTRIAL TRUST	47,646	42,633	596	67,999	0.2	
LIFE STORAGE INC	8,199	12,432	1,661	189,403	0.7	
MACERICH CO/THE	19,273	32,808	536	61,118	0.2	
VERIS RESIDENTIAL INC	14,687	12,245	204	23,314	0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	95,869	90,497	2,080	237,200	0.9	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,348	17,482	3,545	404,205	1.5	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	16,864	14,862	310	35,345	0.1	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,696	7,063	414	47,220	0.2	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	29,251	26,641	1,166	133,035	0.5	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,752	12,355	756	86,220	0.3	
NETSTREIT CORP	2,174	5,746	127	14,530	0.1	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	—	—	—	—	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,850	3,447	270	30,842	0.1	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	8,332	7,181	179	20,426	0.1	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	38,243	36,245	1,098	125,249	0.5	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	2,195	66	7,607	0.0	
ORION OFFICE REIT INC	—	7,881	131	15,041	0.1	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,452	3,101	515	58,752	0.2	
PARAMOUNT GROUP INC	28,845	25,119	217	24,772	0.1	
PARK HOTELS & RESORTS INC	39,454	35,773	649	74,024	0.3	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,575	19,748	433	49,442	0.2	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	—	9,178	8	977	0.0	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	—	2,825	88	10,058	0.0	
PHYSICIANS REALTY TRUST	35,829	33,270	601	68,579	0.3	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21,718	18,554	331	37,801	0.1	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	5,087	135	15,490	0.1	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	—	1,959	33	3,839	0.0	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	8,584	7,897	132	15,125	0.1	
PROLOGIS INC	125,169	112,035	17,176	1,958,245	7.2	
PUBLIC STORAGE	25,747	23,112	8,138	927,862	3.4	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	11,111	—	—	—	—	
RLJ LODGING TRUST	28,462	25,353	354	40,409	0.1	
RPT REALTY	12,940	12,721	160	18,288	0.1	
REALTY INCOME CORP	59,337	85,707	5,863	668,465	2.5	
REGENCY CENTERS CORP	26,579	23,384	1,657	188,993	0.7	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	20,290	18,142	328	37,437	0.1	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	36,845	—	—	—	—	
RETAIL VALUE INC	3,515	2,135	6	764	0.0	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	21,996	22,979	1,649	188,078	0.7	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,194	8,332	713	81,342	0.3	
SL GREEN REALTY CORP	13,998	—	—	—	—	

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
SL GREEN REALTY CORP	—	10,239	776	88,496	0.3	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,605	35,191	465	53,080	0.2	
SAFEHOLD INC	2,502	2,155	129	14,820	0.1	
SAUL CENTERS INC	2,130	2,026	101	11,611	0.0	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,386	4,971	52	5,933	0.0	
SERVICE PROPERTIES TRUST	28,456	25,323	216	24,626	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	55,469	49,787	7,273	829,295	3.0	
SITE CENTERS CORP	25,914	27,707	401	45,772	0.2	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19,657	18,625	856	97,614	0.4	
STAG INDUSTRIAL INC	25,677	26,440	1,103	125,822	0.5	
STORE CAPITAL CORP	39,807	37,204	1,151	131,235	0.5	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,040	16,489	156	17,877	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	18,197	17,608	3,288	374,958	1.4	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37,190	33,352	369	42,131	0.2	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,237	15,831	278	31,730	0.1	
TERRENO REALTY CORP	11,764	11,291	829	94,551	0.3	
UDR INC	49,795	44,124	2,479	282,668	1.0	
UMH PROPERTIES INC	7,056	6,767	161	18,415	0.1	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,201	1,860	106	12,172	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	18,861	16,468	301	34,339	0.1	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,449	4,380	84	9,677	0.0	
VENTAS INC	63,296	60,595	3,133	357,304	1.3	
VEREIT INC	36,787	—	—	—	—	
VICI PROPERTIES INC	90,714	95,488	2,625	299,381	1.1	
VORNADO REALTY TRUST	26,368	24,075	997	113,689	0.4	
WP CAREY INC	29,605	28,264	2,144	244,546	0.9	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	2,254	—	—	—	—	
WASHINGTON REIT	14,167	12,665	315	35,997	0.1	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,719	—	—	—	—	
WELLTOWER INC	70,569	65,931	5,671	646,594	2.4	
WHITESTONE REIT	7,716	6,335	65	7,475	0.0	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,627	17,080	298	34,038	0.1	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	118,000	111,100	86	9,879	0.0	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	82,000	—	—	—	
PRIME US REIT	85,000	91,700	75	8,625	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	241,500	213,400	142	16,300	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	4,157,413	3,866,836	181,252	20,664,639	
	銘 柄 数 < 比 率 >	155	155	—	< 75.8% >	
(カナダ)			千カナダドル			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,612	9,579	415	37,511	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,925	9,169	107	9,737	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	3,500	49	4,443	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,838	3,332	177	16,033	0.1	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	—	5,776	23	2,079	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,959	7,649	125	11,339	0.0	

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	口	口	千カナダドル	千円	%	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,376	12,790	689	62,249	0.2	
CHOICE PROPERTIES REIT	27,139	24,984	353	31,920	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	14,714	13,741	160	14,469	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,506	6,887	119	10,781	0.0	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	3,882	93	8,462	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,223	17,317	269	24,343	0.1	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	—	7,098	29	2,683	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,666	16,666	291	26,346	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,129	4,963	468	42,268	0.2	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23,760	22,135	279	25,185	0.1	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	—	2,543	24	2,209	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,727	10,340	159	14,358	0.1	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,477	7,872	170	15,342	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,394	2,991	63	5,705	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,847	2,413	40	3,616	0.0	
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	—	2,635	30	2,734	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13,780	16,650	218	19,755	0.1	
PLAZA RETAIL REIT	10,000	10,000	46	4,150	0.0	
PRIMARIS REIT	—	5,227	73	6,626	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26,437	23,368	507	45,796	0.2	
SLATE OFFICE REIT	4,169	4,169	20	1,892	0.0	
SLATE GROCERY REIT	4,620	4,386	62	5,615	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,590	11,042	332	30,029	0.1	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,293	12,713	265	23,916	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	5,365	38	3,466	0.0	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,500	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	289,863	291,182	5,708	515,070	
	銘 柄 数 < 比 率 >	27	31	—	< 1.9% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG	11,172	—	—	—	—	—
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	30,156	7,809	152	19,652	0.1	
HAMBORNER REIT AG	—	11,706	112	14,545	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	41,328	19,515	264	34,198	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.1% >	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,951	6,951	27	3,561	0.0	
COIMA RES SPA	—	3,638	25	3,333	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	10,951	10,589	53	6,895	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	2	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)						
ICADE	5,365	4,788	304	39,300	0.1	
ALTAREA	659	616	95	12,290	0.0	
KLEPIERRE	35,026	30,360	698	90,159	0.3	
GECINA SA	9,126	8,239	957	123,611	0.5	
COVIVIO	8,048	7,280	534	68,944	0.3	

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)			千ユーロ	千円	%	
MERCIALYS	7,081	7,777	71	9,264	0.0	
CARMILA	8,000	6,580	89	11,566	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,321	17,667	1,088	140,431	0.5	
小 計	口 数 ・ 金 額	96,626	83,307	3,839	495,569	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	-	< 1.8% >	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPETIE-CV	6,310	-	-	-	-	
VASTNED RETAIL NV	2,832	2,828	68	8,832	0.0	
WERELDHAVE NV	7,169	6,589	84	10,901	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	-	5,881	114	14,838	0.1	
NSI NV	2,572	2,616	94	12,137	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	18,883	17,914	361	46,710	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	-	< 0.2% >	
(ユーロ…スペイン)						
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	43,462	41,362	318	41,130	0.2	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,511	8,017	40	5,214	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	55,027	50,533	484	62,570	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	110,000	99,912	843	108,915	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	-	< 0.4% >	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO	4,423	3,898	126	16,274	0.1	
COFINIMMO	4,644	4,458	583	75,370	0.3	
RETAIL ESTATES	1,704	1,787	126	16,374	0.1	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,158	3,446	91	11,807	0.0	
MONTEA NV	1,744	1,535	180	23,337	0.1	
AEDIFICA	5,499	5,499	579	74,731	0.3	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	21,949	21,262	784	101,256	0.4	
CARE PROPERTY INVEST	4,100	3,794	95	12,363	0.0	
XIOR STUDENT HOUSING NV	2,300	2,764	130	16,783	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	50,521	48,443	2,698	348,300	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	-	< 1.3% >	
(ユーロ…アイルランド)						
HIBERNIA REIT PLC	111,215	99,303	127	16,430	0.1	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	75,761	63,839	107	13,841	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	186,976	163,142	234	30,271	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	-	< 0.1% >	
(ユーロ…その他)						
CROMWELL REIT EUR	-	43,440	108	13,959	0.1	
CROMWELL EUROPEAN REIT	225,700	-	-	-	-	
小 計	口 数 ・ 金 額	225,700	43,440	108	13,959	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	-	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	740,985	486,262	8,405	1,084,820	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	31	-	< 4.0% >	
(イギリス)						
BRITISH LAND CO PLC	157,255	141,969	千英ポンド	750	115,343	0.4

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	口	口	千英ポンド	千円	%	
DERWENT LONDON PLC	18,727	16,941	577	88,790	0.3	
BIG YELLOW GROUP PLC	28,298	26,546	391	60,140	0.2	
INTU PROPERTIES PLC	117,549	117,549	—	—	—	
UNITE GROUP PLC	68,405	60,426	618	95,057	0.3	
SHAFTESBURY PLC	51,758	43,170	269	41,437	0.2	
STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	56,875	46	7,098	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	86,166	47	7,350	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	98,400	79,142	81	12,602	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	131,710	123,935	97	15,048	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	36,057	32,359	398	61,274	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	155,203	136,832	362	55,732	0.2	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	125,514	141	21,760	0.1	
SEGRE PLC	201,220	182,425	2,335	359,035	1.3	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	144,605	130,732	224	34,500	0.1	
WORKSPACE GROUP PLC	21,840	19,933	174	26,838	0.1	
GCP STUDENT LIVING PLC	77,427	—	—	—	—	
NEWRIVER REIT PLC	56,051	39,505	36	5,586	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	105,935	92,934	88	13,626	0.0	
PRS REIT PLC/THE	—	86,720	90	13,928	0.1	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	58,694	54	8,317	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	112,136	148,459	182	28,066	0.1	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	43,363	38,050	285	43,891	0.2	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	292,379	282,592	649	99,899	0.4	
RDI REIT PLC	48,350	—	—	—	—	
CUSTODIAN REIT PLC	77,000	60,787	65	10,015	0.0	
HOME REIT PLC	—	87,702	104	16,040	0.1	
HAMMERSON PLC	647,780	652,218	226	34,765	0.1	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,057	87,550	75	11,545	0.0	
ASSURA PLC	454,400	441,362	293	45,043	0.2	
AEW UK REIT PLC	20,000	20,000	22	3,492	0.0	
LXI REIT PLC	82,361	108,442	157	24,267	0.1	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	224,444	205,608	292	45,001	0.2	
REGIONAL REIT LTD	63,471	63,471	57	8,877	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	126,145	113,773	881	135,418	0.5	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	60,000	55,490	66	10,166	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	4,195,523	4,023,871	10,149	1,559,962	
	銘 柄 数 < 比 率 >	34	34	—	< 5.7% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BWP TRUST	82,774	74,391	298	24,356	0.1	
MIRVAC GROUP	675,645	598,808	1,652	134,943	0.5	
CROMWELL PROPERTY GROUP	319,051	221,920	184	15,039	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	86,920	81,252	329	26,934	0.1	
GPT GROUP	334,068	290,936	1,509	123,288	0.5	
ABACUS PROPERTY GROUP	74,490	60,535	212	17,348	0.1	
STOCKLAND	409,621	362,562	1,468	119,892	0.4	

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	口	口	千オーストラリアドル	千円	%	
DEXUS/AU	186,958	163,223	1,757	143,533	0.5	
GOODMAN GROUP	289,070	258,210	6,049	493,971	1.8	
CHARTER HALL GROUP	79,767	70,569	1,247	101,871	0.4	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,477	42,930	171	13,985	0.1	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	49,989	54,932	310	25,386	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	183,048	166,439	469	38,323	0.1	
ARENA REIT	64,396	52,273	248	20,316	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	82,504	82,812	316	25,829	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	87,329	90,932	442	36,157	0.1	
NATIONAL STORAGE REIT	159,326	162,171	400	32,705	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,020	29,868	103	8,437	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	88,291	66,335	70	5,768	0.0	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	55,561	48,631	187	15,287	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	27,219	—	—	—	—	
HOME CONSORTIUM LTD	24,000	26,532	188	15,380	0.1	
RURAL FUNDS GROUP	57,679	55,568	164	13,429	0.0	
TRONGATE GROUP	96,000	80,328	135	11,051	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	69,642	63,819	141	11,568	0.0	
WAYPOINT REIT	132,972	111,621	298	24,333	0.1	
SCENTRE GROUP	891,541	788,646	2,342	191,247	0.7	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	66,745	81,478	115	9,413	0.0	
DEXUS INDUSTRIA REIT	—	32,499	103	8,491	0.0	
VICINITY CENTRES	662,595	595,938	995	81,259	0.3	
AVENTUS GROUP	62,000	60,193	202	16,513	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	5,481,698	4,876,351	22,119	1,806,068	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	30	—	< 6.6% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	185,741	201,503	323	24,692	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	64,548	60,632	189	14,443	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	189,584	159,358	402	30,721	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	145,533	134,637	201	15,419	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	270,793	244,365	274	20,989	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	856,199	800,495	1,391	106,266	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.4% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	354,400	317,000	21,793	319,060	1.2	
PROSPERITY REIT	226,000	198,000	613	8,986	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	270,000	350,000	1,169	17,114	0.1	
CHAMPION REIT	338,000	300,000	1,218	17,831	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	164,000	141,000	609	8,917	0.0	
FORTUNE REIT	240,000	219,000	1,765	25,841	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,592,400	1,525,000	27,168	397,751	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 1.5% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	778,332	755,232	1,518	128,818	0.5	

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	口	口	千シンガポールドル	千円	%	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	544,500	507,500	1,451	123,170	0.5	
SUNTEC REIT	368,400	329,700	504	42,806	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	482,900	450,600	793	67,298	0.2	
STARHILL GLOBAL REIT	251,500	211,700	134	11,407	0.0	
KEPPEL REIT	292,500	296,500	343	29,186	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	229,000	161,900	370	31,461	0.1	
ESR REIT	403,200	428,400	194	16,541	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	129,100	112,100	131	11,129	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	166,100	167,700	199	16,934	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	107,400	167,300	51	4,401	0.0	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	66,200	60,500	298	25,362	0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	889,100	—	—	—	—	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	286,300	292,600	766	65,054	0.2	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	374,800	330,100	607	51,542	0.2	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	190,300	207,400	184	15,663	0.1	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	81,100	70,900	100	8,543	0.0	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	160,100	—	—	—	—	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	350,300	330,500	360	30,570	0.1	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	160,200	91	7,748	0.0	
SPH REIT	161,200	135,800	131	11,178	0.0	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	165,900	—	—	—	—	
EC WORLD REIT	50,000	50,000	36	3,097	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	92,100	85,600	70	5,956	0.0	
ASCOTT TRUST	320,196	285,996	297	25,240	0.1	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	403,100	367,400	156	13,250	0.0	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	139,100	118	10,092	0.0	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	—	—	—	—	
IREIT GLOBAL	55,000	95,000	61	5,240	0.0	
KEPPEL DC REIT	219,600	199,900	449	38,167	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	456,379	437,179	629	53,422	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	8,507,607	6,836,807	10,055	853,290	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	27	—	<3.1%>	
(韓国)			千韓国ウォン			
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,000	10,111	46,358	4,422	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,600	5,014	40,462	3,860	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	4,000	22,640	2,159	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	15,600	20,693	109,465	10,443	0.0	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	—	4,199	26,747	2,551	0.0	
JR REIT XXVII	18,000	18,000	95,400	9,101	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	—	21,100	127,655	12,178	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	62,200	83,117	468,730	44,716	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	7	—	<0.2%>	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル) REIT 1 LTD	口 29,265	口 27,424	千イスラエルシケル 598	千円 21,580	% 0.1	
小 計	口 数・金 額 29,265	口 数・金 額 27,424	598	21,580		
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	< 0.1% >		
合 計	口 数・金 額 25,913,153	口 数・金 額 22,817,345	—	27,054,166		
	銘 柄 数 < 比 率 >	324	327	< 99.2% >		

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	87,180	0.3
投資証券	27,054,166	98.0
コール・ローン等、その他	471,126	1.7
投資信託財産総額	27,612,472	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産(27,306,164千円)の投資信託財産総額(27,612,472千円)に対する比率は98.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=114.01円、1カナダドル=90.23円、1ユーロ=129.06円、1英ポンド=153.70円、1オーストラリアドル=81.65円、1ニュージーランドドル=76.35円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=84.86円、1韓国ウォン=0.0954円、1イスラエルシケル=36.0642円。

## ○特定資産の価格等の調査

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	27,692,105,035
コール・ローン等	303,133,983
株式(評価額)	87,180,845
投資証券(評価額)	27,054,166,655
未収入金	222,894,541
未収配当金	24,729,011
(B) 負債	430,767,125
未払金	84,422,818
未払解約金	346,343,500
未払利息	807
(C) 純資産総額(A-B)	27,261,337,910
元本	19,224,785,743
次期繰越損益金	8,036,552,167
(D) 受益権総口数	19,224,785,743口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,180円

(注) 当ファンドの期首元本額は21,976,415,392円、期中追加設定元本額は16,984,745,384円、期中一部解約元本額は19,736,375,033円です。

(注) 2022年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWリそな先進国リートインデックスオープン	5,189,762,193円
・FWリそな先進国リートインデックスファンド	4,238,707,039円
・Smart-i 先進国リートインデックス	2,052,843,142円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	1,334,825,469円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,327,298,879円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	1,106,566,227円
・つみたてバランスファンド	654,664,447円
・りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	570,220,887円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	391,752,294円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-09	267,903,885円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	238,177,948円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	230,641,588円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	207,487,244円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-03	200,757,251円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	187,239,175円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-06	166,284,733円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-10	164,218,959円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	153,769,864円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-12	98,805,007円
・九州SDGs・グローバルバランス	80,707,460円
・りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	78,225,097円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	73,243,068円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	52,961,430円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,176,196円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	33,379,326円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	31,409,711円
・DCりそな グローバルバランス	20,420,800円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	17,805,771円
・リスクコントロール・オープン	9,487,428円
・りそなV1グローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	4,579,533円
・りそなV1グローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	3,197,595円
・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	3,061,144円
・りそなV1グローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	204,953円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.4180円です。

## ○損益の状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	724,033,251
受取配当金	724,160,528
受取利息	8,260
支払利息	△ 135,537
(B) 有価証券売買損益	6,775,779,609
売買益	7,238,186,421
売買損	△ 462,406,812
(C) 保管費用等	△ 14,614,694
(D) 当期損益金(A+B+C)	7,485,198,166
(E) 前期繰越損益金	811,237,052
(F) 追加信託差損益金	4,057,141,816
(G) 解約差損益金	△4,317,024,867
(H) 計(D+E+F+G)	8,036,552,167
次期繰越損益金(H)	8,036,552,167

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

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

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

## ○お知らせ

---

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

# RMマネーマザーファンド

## 運用報告書

第3期（決算日 2022年2月15日）  
（2021年2月16日～2022年2月15日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2019年1月17日から無期限です。
運用方針	主として、残存期間の短い国内の公社債への投資により利息等収益の獲得および流動性の確保を図ります。
主要投資対象	国内の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"><li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）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。</li><li>・外貨建資産への投資は行いません。</li></ul>

りそなアセットマネジメント 株式会社

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 組 入 比	券 率	純 資 産 額
		騰 落	中 率			
(設定日)	円		%		%	百万円
2019年1月17日	10,000		—		—	590
1期(2020年2月17日)	9,984		△0.2		54.6	15,576
2期(2021年2月15日)	9,977		△0.1		68.8	25,015
3期(2022年2月15日)	9,965		△0.1		64.9	17,715

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比	券 率
		騰 落	率		
(期 首)	円		%		%
2021年2月15日	9,977		—		68.8
2月末	9,977		0.0		69.7
3月末	9,976		△0.0		66.2
4月末	9,975		△0.0		76.5
5月末	9,974		△0.0		75.2
6月末	9,973		△0.0		76.6
7月末	9,971		△0.1		75.8
8月末	9,970		△0.1		73.2
9月末	9,969		△0.1		72.4
10月末	9,968		△0.1		75.2
11月末	9,968		△0.1		68.9
12月末	9,966		△0.1		68.4
2022年1月末	9,965		△0.1		71.9
(期 末)					
2022年2月15日	9,965		△0.1		64.9

(注) 騰落率は期首比です。

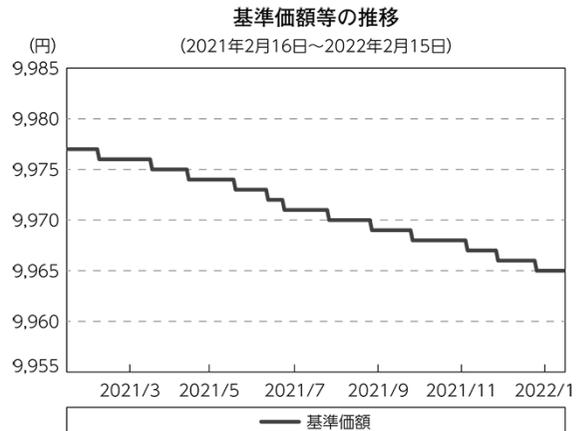
## ○運用経過

(2021年2月16日～2022年2月15日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末9,977円から当期末9,965円となり、12円の値下がりとなりました。日銀による低金利政策の下で残存期間の短い国内の公社債を中心に投資したことが、主な基準価額の下落要因となりました。



## 投資環境

## 国内短期金融市況

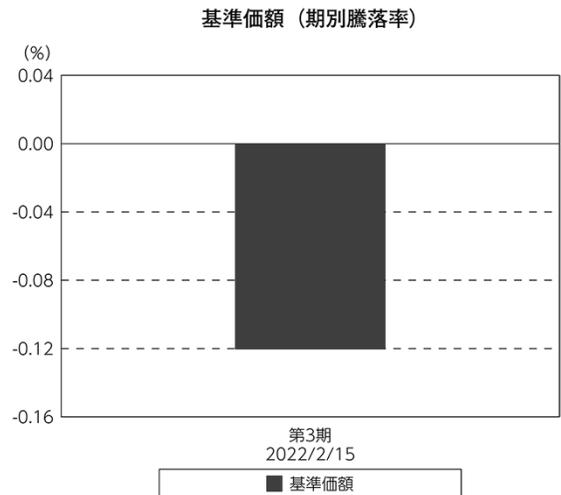
国内の短期国債利回りは、期を通じてマイナス圏で概ね横ばい推移となりました。世界的な新型コロナウイルス変異株の感染拡大による景気回復の後ずれ懸念の高まりから、利回りが低下する場面も見られましたが、期末にかけて、主要国中央銀行による利上げ前倒し観測が強まる中、海外金利の上昇につれて、上昇する展開となりました。無担保コール翌日物金利は、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の政策枠組みを維持し、マイナス圏で推移しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

国内の公社債を主要投資対象とし、利息等収益の獲得および流動性の確保を目指して残存期間の短い国内の公社債へ投資することによりポートフォリオを構築しました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定していません。



## ○今後の運用方針

引き続き、残存期間の短い国内の公社債へ投資し、利息等収益の獲得および流動性の確保を目指して運用を行います。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年2月16日～2022年2月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、9,971円です。			

(注) 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・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年2月16日～2022年2月15日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	28,906,910	16,400,991 (18,200,000)

(注) 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年2月16日～2022年2月15日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年2月16日～2022年2月15日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年2月15日現在)

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	11,500,000	11,501,790	64.9	—	—	—	64.9
	(11,500,000)	(11,501,790)	(64.9)	(—)	(—)	(—)	(64.9)
合 計	11,500,000	11,501,790	64.9	—	—	—	64.9
	(11,500,000)	(11,501,790)	(64.9)	(—)	(—)	(—)	(64.9)

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 格付のない債券については、BB格以下組入比率に含まれておりません。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第1037回国庫短期証券	—	300,000	300,003	2022/2/21
第1039回国庫短期証券	—	500,000	500,015	2022/2/28
第1042回国庫短期証券	—	300,000	300,019	2022/3/14
第1044回国庫短期証券	—	1,300,000	1,300,113	2022/3/22
第1047回国庫短期証券	—	1,300,000	1,300,133	2022/3/28
第1050回国庫短期証券	—	1,300,000	1,300,182	2022/4/11
第1051回国庫短期証券	—	1,300,000	1,300,205	2022/4/18
第1053回国庫短期証券	—	1,300,000	1,300,230	2022/4/25
第1055回国庫短期証券	—	1,300,000	1,300,276	2022/5/9
第1056回国庫短期証券	—	1,300,000	1,300,300	2022/5/16
第1058回国庫短期証券	—	1,300,000	1,300,310	2022/5/23
合 計		11,500,000	11,501,790	

## ○投資信託財産の構成

(2022年2月15日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	11,501,790	42.7
コール・ローン等、その他	15,415,179	57.3
投資信託財産総額	26,916,969	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

## ○特定資産の価格等の調査

(2021年2月16日～2022年2月15日)

該当事項はございません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年2月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	26,916,969,710
コール・ローン等	5,915,178,910
公社債(評価額)	11,501,790,800
未収入金	9,500,000,000
(B) 負債	9,201,542,843
未払金	9,201,526,800
未払利息	16,043
(C) 純資産総額(A-B)	17,715,426,867
元本	17,777,661,119
次期繰越損益金	△ 62,234,252
(D) 受益権総口数	17,777,661,119口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,965円

(注) 当ファンドの期首元本額は25,073,134,387円、期中追加設定元本額は19,599,374,083円、期中一部解約元本額は26,894,847,351円です。

(注) 2022年2月15日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・リソナ・リスクコントロールファンド2019-09	6,021,073,759円
・リソナ・リスクコントロールファンド2019-10	3,512,293,026円
・リソナ・リスクコントロールファンド2019-12	3,010,536,880円
・リソナ・リスクコントロールファンド2019-06	2,007,024,587円
・リソナDAA先物ファンド(適格機関投資家専用)	1,838,971,800円
・リソナDAA先物Ⅱファンド(適格機関投資家専用)	1,387,207,141円
・リソナマネー・プール・ファンド(適格機関投資家専用)	553,926円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は0.9965円です。

(注) 2022年2月15日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は62,234,252円です。

## ○損益の状況 (2021年2月16日～2022年2月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,444,457
支払利息	△ 2,444,457
(B) 有価証券売買損益	△ 6,640,300
売買益	40,300
売買損	△ 6,680,600
(C) 保管費用等	△ 4,758
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 9,089,515
(E) 前期繰越損益金	△ 57,286,541
(F) 追加信託差損益金	△ 64,084,083
(G) 解約差損益金	68,225,887
(H) 計(D+E+F+G)	△ 62,234,252
次期繰越損益金(H)	△ 62,234,252

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

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

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

## ○お知らせ

・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)