

# 野村ターゲットデートファンド2016

## 愛称：未来図

### 2032-2034年目標型

## 運用報告書(全体版)

第7期（決算日2022年12月26日）

作成対象期間（2021年12月28日～2022年12月26日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商 品 分 類     | 追加型投信／内外／資産複合／インデックス型                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 信 託 期 間     | 2016年4月1日から2035年3月16日までです。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 運 用 方 針     | 別に定める親投資信託証券への投資を通じて、国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国（新興国を含む）の各債券に実質的に投資し、信託財産の成長を目的に運用を行なうことを基本とします。「投資基礎期」、「資産形成期」、ターゲット時期を含む「目標前準備期」を定め、各期間毎に株式および債券の配分比率（以下「株式・債券配分」といいます。）を変化させます。また、各期間において、株式・債券配分および各親投資信託証券への基本となる投資割合（以下「基本投資割合」といいます。）を定期的に変更します。なお、ターゲット時期は2032年から2034年とします。各期間における株式・債券配分および各親投資信託証券への基本投資割合の最終決定は、家計や市場の構造変化等を考慮した上で行ないます。<br>「投資基礎期」は信託契約締結日から2019年12月までの期間、「資産形成期」は2020年1月から2028年12月までの期間、「目標前準備期」は2029年1月以降とします。<br>投資を行なう親投資信託証券は、原則として、金融指標の動きに連動する投資成果を目指すものとし、別に定める親投資信託証券の中から、市場構造等を勘案し、各期間の株式・債券配分の範囲内で各親投資信託証券への投資比率を決定します。なお、一部の親投資信託証券への投資比率がゼロとなる場合があります。また、基本投資割合の変更に際し、新たに親投資信託証券を投資対象に追加する場合があります。<br>実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行なう親投資信託証券を通じて投資する部分を除き、原則として為替ヘッジを行ないません。ただし、2029年1月以降、安定運用を行なう場合においては為替ヘッジを行なう場合があります。 |
| 主 な 投 資 対 象 | 別に定める親投資信託証券を主要投資対象とします。なお、株式、公社債および短期有価証券等に直接投資する場合があります。また、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等を取引対象とします。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 主 な 投 資 制 限 | 株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。<br>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 分 配 方 針     | 毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

## 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時



ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |        |       | ベンチマーク |       | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|-------|
|                 | (分配落)  | 税込み分配金 | 期中騰落率 |        | 期中騰落率 |        |        |        |        |            |       |
|                 | 円      | 円      | %     |        | %     | %      | %      | %      | %      | %          | 百万円   |
| 3期(2018年12月26日) | 10,320 | 0      | △11.0 | 105.04 | △10.5 | 48.8   | 1.0    | 48.6   | —      | 0.5        | 19    |
| 4期(2019年12月26日) | 11,848 | 0      | 14.8  | 121.17 | 15.4  | 57.0   | 0.9    | 40.6   | —      | 1.0        | 28    |
| 5期(2020年12月28日) | 12,479 | 0      | 5.3   | 128.29 | 5.9   | 55.4   | 1.1    | 42.1   | —      | 0.8        | 37    |
| 6期(2021年12月27日) | 13,648 | 0      | 9.4   | 141.00 | 9.9   | 53.7   | 1.1    | 43.7   | —      | 0.9        | 39    |
| 7期(2022年12月26日) | 12,801 | 0      | △6.2  | 132.87 | △5.8  | 51.0   | 1.1    | 45.8   | —      | 0.8        | 39    |

\* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| 資産        | 実質的な投資をするマザーファンド        | 各マザーファンドの対象指数                                                 |
|-----------|-------------------------|---------------------------------------------------------------|
| 国内株式      | 国内株式マザーファンド             | 東証株価指数（TOPIX）                                                 |
| 外国株式（新興国） | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）                                  |
|           | 新興国株式マザーファンド            | MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）                          |
| 国内債券      | 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | NOMURA-BPI総合                                                  |
|           | 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド       | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）                                |
| 外国債券（新興国） | 外国債券マザーファンド             | FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）                               |
|           | 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド    | JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） |

\* 「MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）」は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

\* 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

\* 「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）」は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets（GBI-EM）Global Diversified（USドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

## 【当作成期間中の基本投資割合】

|                                                                                         | 2021年<br>12月 | 2022年<br>1月 | 2022年<br>2月 | 2022年<br>3月 | 2022年<br>4月 | 2022年<br>5月 | 2022年<br>6月 | 2022年<br>7月 | 2022年<br>8月 | 2022年<br>9月 | 2022年<br>10月 | 2022年<br>11月 | 2022年<br>12月 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|--------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------|--------------|--------------|
| 【国内株式マザーファンド】<br>東証株価指数（TOPIX）                                                          | 27.7%        | 27.6%       | 27.5%       | 27.5%       | 27.3%       | 27.3%       | 27.3%       | 27.2%       | 27.1%       | 27.1%       | 27.0%        | 26.9%        | 26.9%        |
| 【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）                               | 15.9%        | 15.9%       | 15.8%       | 15.8%       | 15.8%       | 15.7%       | 15.7%       | 15.9%       | 15.8%       | 15.8%       | 15.8%        | 15.7%        | 15.7%        |
| 【新興国株式マザーファンド】<br>MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）                                  | 11.8%        | 11.7%       | 11.8%       | 11.7%       | 11.7%       | 11.6%       | 11.6%       | 11.3%       | 11.3%       | 11.3%       | 11.2%        | 11.2%        | 11.2%        |
| 【国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド】<br>NOMURA-BPI総合                                               | 14.8%        | 14.9%       | 14.9%       | 15.0%       | 15.1%       | 15.2%       | 15.2%       | 15.3%       | 15.4%       | 15.4%       | 15.5%        | 15.6%        | 15.6%        |
| 【外国債券為替ヘッジ型マザーファンド】<br>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）                                   | 14.8%        | 14.9%       | 14.9%       | 15.0%       | 15.1%       | 15.2%       | 15.2%       | 15.3%       | 15.4%       | 15.4%       | 15.5%        | 15.6%        | 15.6%        |
| 【外国債券マザーファンド】<br>FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）                                        | 9.7%         | 9.7%        | 9.7%        | 9.7%        | 9.7%        | 9.7%        | 9.7%        | 11.5%       | 11.5%       | 11.5%       | 11.5%        | 11.5%        | 11.5%        |
| 【新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド】<br>JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 5.3%         | 5.3%        | 5.4%        | 5.3%        | 5.3%        | 5.3%        | 5.3%        | 3.5%        | 3.5%        | 3.5%        | 3.5%         | 3.5%         | 3.5%         |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式（新興国を含む）については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日       | 基 準 価 額 |       | ベンチマーク |       | 株<br>組入比率 | 株<br>先物比率 | 債<br>組入比率 | 債<br>先物比率 | 投資信託<br>組入比率 |
|-------------|---------|-------|--------|-------|-----------|-----------|-----------|-----------|--------------|
|             | 騰 落 率   | 騰 落 率 | 騰 落 率  | 騰 落 率 |           |           |           |           |              |
| (期 首)       | 円       | %     |        | %     | %         | %         | %         | %         | %            |
| 2021年12月27日 | 13,648  | —     | 141.00 | —     | 53.7      | 1.1       | 43.7      | —         | 0.9          |
| 12月末        | 13,720  | 0.5   | 141.73 | 0.5   | 53.8      | 1.3       | 43.5      | —         | 0.9          |
| 2022年1月末    | 13,281  | △2.7  | 137.29 | △2.6  | 52.0      | 1.3       | 45.1      | —         | 0.9          |
| 2月末         | 13,134  | △3.8  | 136.06 | △3.5  | 53.0      | 1.3       | 44.1      | —         | 0.9          |
| 3月末         | 13,562  | △0.6  | 139.94 | △0.8  | 53.8      | 1.5       | 44.0      | —         | 0.9          |
| 4月末         | 13,250  | △2.9  | 136.76 | △3.0  | 51.7      | 1.5       | 45.5      | —         | 0.8          |
| 5月末         | 13,255  | △2.9  | 137.10 | △2.8  | 52.4      | 1.4       | 44.6      | —         | 0.9          |
| 6月末         | 13,122  | △3.9  | 135.88 | △3.6  | 52.2      | 1.2       | 45.3      | —         | 0.9          |
| 7月末         | 13,362  | △2.1  | 138.38 | △1.9  | 52.5      | 1.2       | 44.3      | —         | 0.9          |
| 8月末         | 13,370  | △2.0  | 138.67 | △1.7  | 52.4      | 1.4       | 44.9      | —         | 0.9          |
| 9月末         | 12,816  | △6.1  | 132.49 | △6.0  | 50.8      | 1.4       | 46.7      | —         | 0.8          |
| 10月末        | 13,209  | △3.2  | 136.74 | △3.0  | 52.8      | 1.4       | 44.8      | —         | 0.8          |
| 11月末        | 13,297  | △2.6  | 137.82 | △2.3  | 51.7      | 1.4       | 44.4      | —         | 0.8          |
| (期 末)       |         |       |        |       |           |           |           |           |              |
| 2022年12月26日 | 12,801  | △6.2  | 132.87 | △5.8  | 51.0      | 1.1       | 45.8      | —         | 0.8          |

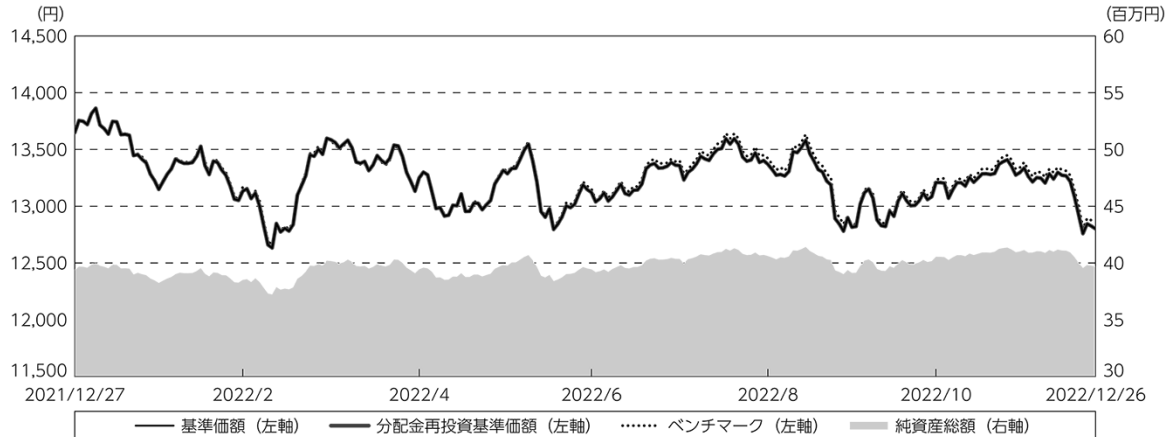
\*騰落率は期首比です。

\*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年12月27日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年12月27日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

投資対象とする7本のマザーファンドの当期間の値動きは、ヘッジ外国債券(−16.2%)、新興国株式(−6.8%)、国内債券(−4.9%)、外国債券(−4.5%)、外国株式(−4.3%)、国内株式(−1.2%)が下落し、新興国債券(+2.2%)は上昇しました。

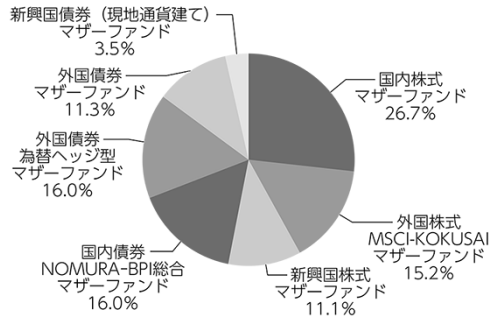
ヘッジ外国債券や国内債券の下落が主な値下がり要因となりました。

## ○投資環境

| 資 産                               | 変動要因等                                                                                                                                           |
|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 国 内 株 式                           | 円安に伴う国内輸出関連企業の業績回復期待といったプラス要因はありましたが、ウクライナ情勢の悪化や外国株式市場の下落などを受けて、下落しました。                                                                         |
| 外 国 株 式                           | ウクライナ情勢に伴う投資家心理の悪化や、インフレの長期化懸念に伴うFRB（米連邦準備制度理事会）やECB（欧州中央銀行）による政策金利の引上げ実施、金融引き締め期間の長期化観測などを背景に、下落しました。為替レートは、内外金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。 |
| 新 興 国 株 式                         | ウクライナ情勢の悪化などを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、中国で新型コロナウイルスの感染拡大に伴う行動制限が続いたことで中国景気の減速が懸念されたこと、外国株式市場の下落などを背景に、アジアを中心に下落しました。主要新興国通貨は概ね対円で上昇（円安）しました。       |
| 国 内 債 券                           | 外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことや、12月の金融政策決定会合で日銀が金融緩和政策の修正（長期金利の変動上限引上げ）を発表したことなどを背景に、国内債券利回りは上昇しました。                                                     |
| 外 国 債 券<br>（為替ヘッジあり）<br>/ 外 国 債 券 | インフレの長期化懸念に伴うFRB（米連邦準備制度理事会）やECB（欧州中央銀行）による政策金利の引上げ実施、金融引き締め期間の長期化観測などを背景に、外国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。      |
| 新 興 国 債 券                         | 米長期金利の上昇に伴い新興国からの資金流出懸念が高まったこと、一部の新興国における政策金利の引上げ、ウクライナ情勢の悪化などを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨は概ね対円で上昇（円安）しました。      |

## ○当ファンドのポートフォリオ

＜投資比率(2022年12月26日現在)＞



期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、7本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

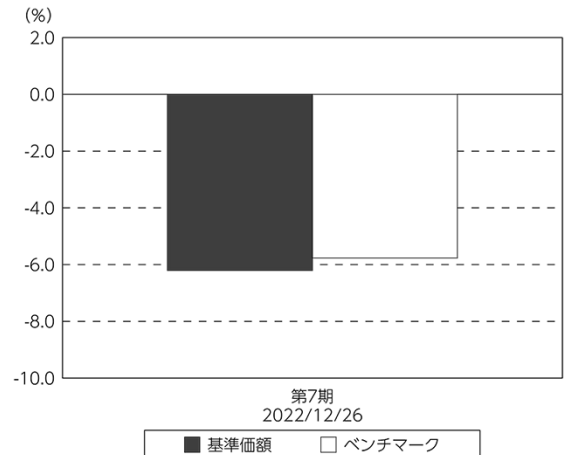
マザーファンドの運用経過については、7ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は-6.2%となり、ベンチマーク(各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数)の-5.8%を0.4ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当が計上されたことです。また、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ることから、評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

- (1) 収益分配金は、基準価額水準等を勘案し決定しました。
- (2) 留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目       | 第7期                         |
|-----------|-----------------------------|
|           | 2021年12月28日～<br>2022年12月26日 |
| 当期分配金     | —                           |
| (対基準価額比率) | — %                         |
| 当期の収益     | —                           |
| 当期の収益以外   | —                           |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,943                       |

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

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

## ◎今後の運用方針

国内および外国(新興国を含む)の各株式、国内および外国(新興国を含む)の各債券に分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行ないます。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう7つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## マザーファンドの運用経過

### [国内株式マザーファンド]

東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目指し、先物を含む実質の株式組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。現物株式につきましては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行なっていました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。また、組入比率を高位に維持するため、TOPIX先物を利用してまいりました。

### [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、株式（投資信託証券や先物を含む）組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行ない、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

### [新興国株式マザーファンド]

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指すため、新興国の株式（ETF（上場投資信託証券）やDR（預託証券）を含む）に幅広く分散投資し、株式先物への投資も一部行ないました。当運用期間中の資金流入出や「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行ないました。実質株式組入比率（投資信託証券や株式先物を含む）は当運用期間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）は行ないませんでした。

### [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

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ない、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した債券銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。

### [外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

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すため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、

ファンドの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、外貨建資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジ（為替の売り予約）を行ないました。

### **【外国債券マザーファンド】**

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間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）は行なっておりません。

### **【新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド】**

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債などに分散投資しました。毎月の指数構成銘柄の変更に対応し、ポートフォリオの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間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）は行なっておりません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年12月28日～2022年12月26日)

| 項 目                   | 当 期      |            | 項 目 の 概 要                                                              |
|-----------------------|----------|------------|------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額      | 比 率        |                                                                        |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>138 | %<br>1.042 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                                               |
| ( 投 信 会 社 )           | ( 66 )   | (0.494)    | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等                             |
| ( 販 売 会 社 )           | ( 66 )   | (0.494)    | 購入後の情報提供、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および事務手続き等                           |
| ( 受 託 会 社 )           | ( 7 )    | (0.055)    | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等                                            |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料     | 1        | 0.005      | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| ( 株 式 )               | ( 0 )    | (0.004)    |                                                                        |
| ( 投 資 信 託 証 券 )       | ( 0 )    | (0.000)    |                                                                        |
| ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )   | ( 0 )    | (0.001)    |                                                                        |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税     | 0        | 0.003      | (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<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| ( 株 式 )               | ( 0 )    | (0.003)    |                                                                        |
| ( 投 資 信 託 証 券 )       | ( 0 )    | (0.000)    |                                                                        |
| (d) そ の 他 費 用         | 3        | 0.020      | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                                          |
| ( 保 管 費 用 )           | ( 2 )    | (0.014)    | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用                      |
| ( 監 査 費 用 )           | ( 0 )    | (0.003)    | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                            |
| ( そ の 他 )             | ( 0 )    | (0.003)    | 信託事務の処理に要するその他の諸費用                                                     |
| 合 計                   | 142      | 1.070      |                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、13,281円です。 |          |            |                                                                        |

\* 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。

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

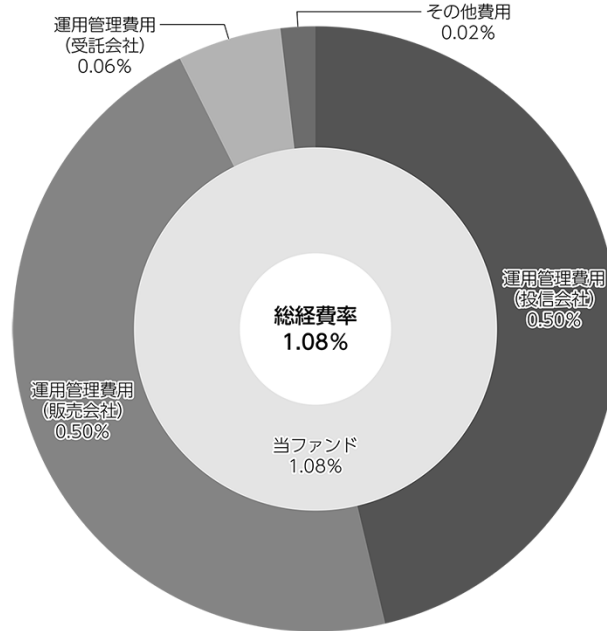
\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 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総額（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1.08%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12月28日～2022年12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    |
| 国内株式マザーファンド              | 600   | 1,222 | 743 | 1,553 |
| 外国債券マザーファンド              | 495   | 1,289 | 133 | 344   |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド  | 277   | 1,250 | 281 | 1,331 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 1,090 | 1,417 | 374 | 486   |
| 新興国株式マザーファンド             | 630   | 972   | 562 | 893   |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド     | 207   | 291   | 736 | 1,046 |
| 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド        | 1,702 | 1,886 | 201 | 228   |

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2021年12月28日～2022年12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             |                                 |                  |
|---------------------|-----------------|---------------------------------|------------------|
|                     | 国内株式<br>マザーファンド | 外国株式<br>MSCI-KOKUSAI<br>マザーファンド | 新興国株式<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 120,634,215千円   | 248,585,910千円                   | 18,104,099千円     |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 428,499,369千円   | 1,251,571,661千円                 | 67,530,334千円     |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.28            | 0.19                            | 0.26             |

\*(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12月28日～2022年12月26日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型&gt;

該当事項はございません。

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

| 区 分        | 買付額等<br>A |                    |               | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |               |
|------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|            |           | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ |           |                    | $\frac{D}{C}$ |
|            | 百万円       | 百万円                | %             | 百万円       | 百万円                | %             |
| 株式         | 83,734    | 197                | 0.2           | 36,899    | —                  | —             |
| 貸付有価証券(株式) | 86,866    | 4,597              | 5.3           | 84,154    | 4,518              | 5.4           |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

\*貸付有価証券（株式）の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

## &lt;外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;新興国株式マザーファンド&gt;

| 区 分    | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|---------------|---------------------|---------------|---------------|---------------------|---------------|
|        |               |                     |               |               |                     |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>34,870 | 百万円<br>7,252        | %<br>20.8     | 百万円<br>19,341 | 百万円<br>7,252        | %<br>37.5     |

平均保有割合 0.0%

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド&gt;

| 区 分 | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|----------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|---------------|
|     |                |                     |               |                |                     |               |
| 公社債 | 百万円<br>238,332 | 百万円<br>628          | %<br>0.3      | 百万円<br>146,369 | 百万円<br>2,000        | %<br>1.4      |

平均保有割合 0.0%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

| 区 分    | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|----------------|---------------------|---------------|---------------|---------------------|---------------|
|        |                |                     |               |               |                     |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>128,946 | 百万円<br>459          | %<br>0.4      | 百万円<br>67,025 | 百万円<br>171          | %<br>0.3      |

平均保有割合 0.0%

## &lt;外国債券為替ヘッジ型マザーファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド&gt;

| 区 分    | 買付額等<br>A    | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C    | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|--------------|---------------------|---------------|--------------|---------------------|---------------|
|        |              |                     |               |              |                     |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>6,024 | 百万円<br>1,549        | %<br>25.7     | 百万円<br>7,657 | 百万円<br>1,549        | %<br>20.2     |

平均保有割合 0.0%

利害関係人の発行する有価証券等

<国内株式マザーファンド>

| 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  | 341   | 26    | 1,441       |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|-------|
|     | 百万円   |
| 株式  | 46    |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目              | 当 期     |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 2千円     |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.002千円 |
| (B) / (A)        | 0.1%    |

\* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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野村證券株式会社、野村信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2021年12月28日～2022年12月26日)

| 期首残高<br>(元 本) | 当期設定<br>元 本 | 当期解約<br>元 本 | 期末残高<br>(元 本) | 取 引 の 理 由   |
|---------------|-------------|-------------|---------------|-------------|
| 百万円<br>1      | 百万円<br>—    | 百万円<br>—    | 百万円<br>1      | 当初設定時における取得 |

○組入資産の明細

(2022年12月26日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄                      | 期首(前期末) | 当 期 末 |        |
|--------------------------|---------|-------|--------|
|                          | 口 数     | 口 数   | 評 価 額  |
|                          | 千口      | 千口    | 千円     |
| 国内株式マザーファンド              | 5,284   | 5,141 | 10,609 |
| 外国債券マザーファンド              | 1,468   | 1,830 | 4,500  |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド  | 1,383   | 1,379 | 6,028  |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 4,318   | 5,034 | 6,368  |
| 新興国株式マザーファンド             | 2,890   | 2,958 | 4,408  |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド     | 1,515   | 986   | 1,406  |
| 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド        | 4,692   | 6,193 | 6,330  |

\* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年12月26日現在)

| 項 目                      | 当 期 末  |       |
|--------------------------|--------|-------|
|                          | 評 価 額  | 比 率   |
|                          | 千円     | %     |
| 国内株式マザーファンド              | 10,609 | 26.6  |
| 外国債券マザーファンド              | 4,500  | 11.3  |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド  | 6,028  | 15.1  |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 6,368  | 16.0  |
| 新興国株式マザーファンド             | 4,408  | 11.0  |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド     | 1,406  | 3.5   |
| 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド        | 6,330  | 15.9  |
| コール・ローン等、その他             | 250    | 0.6   |
| 投資信託財産総額                 | 39,899 | 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（663,735,226千円）の投資信託財産総額（907,403,720千円）に対する比率は73.1%です。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,336,722,419千円）の投資信託財産総額（1,339,591,595千円）に対する比率は99.8%です。

\*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（78,567,434千円）の投資信託財産総額（79,199,581千円）に対する比率は99.2%です。

\*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（7,308,871千円）の投資信託財産総額（7,330,178千円）に対する比率は99.7%です。

\*外国債券為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（82,115,350千円）の投資信託財産総額（85,876,970千円）に対する比率は95.6%です。

\*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 カタールリヤル=36.19円、1 米ドル=132.33円、1 カナダドル=97.13円、1 英ポンド=159.48円、1 スイスフラン=141.64円、1 スウェーデンクローナ=12.57円、1 ノルウェークローネ=13.40円、1 デンマーククローネ=18.87円、1 トルコリラ=7.0985円、1 ユーロ=140.28円、1 チェココルナ=5.8036円、1 フォリント=0.351587円、1 ズロチ=30.2642円、1 ルーブル=1.89円、1 レイ=28.537円、1 香港ドル=16.95円、1 シンガポールドル=97.49円、1 リンギ=29.9183円、1 パーツ=3.81円、1 フィリピンペソ=2.3977円、1 ルビア=0.0085円、1 ウォン=0.1036円、1 新台幣ドル=4.3058円、1 人民元=18.9304円、1 豪ドル=88.52円、1 ニュージーランドドル=82.84円、1 インドルピー=1.61円、1 新シェケル=37.7659円、1 メキシコペソ=6.8368円、1 レアル=25.6433円、1 チリペソ=0.150957円、1 コロンビアペソ=0.027963円、1 ソル=34.6666円、1 ウルグアイペソ=3.4007円、1 UAEディルハム=36.10円、1 セルビアディナール=1.197906円、1 エジプトポンド=5.3472円、1 ランド=7.76円、1 クウェートディナール=432.73円、1 サウジアラビアリヤル=35.25円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年12月26日現在)

| 項 目                           | 当 期 末       |
|-------------------------------|-------------|
|                               | 円           |
| (A) 資産                        | 39,899,198  |
| コール・ローン等                      | 246,459     |
| 国内株式マザーファンド(評価額)              | 10,609,371  |
| 外国債券マザーファンド(評価額)              | 4,500,747   |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)  | 6,028,585   |
| 国内債券NOMURA-BPT総合 マザーファンド(評価額) | 6,368,251   |
| 新興国株式マザーファンド(評価額)             | 4,408,689   |
| 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド(評価額)    | 1,406,520   |
| 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)        | 6,330,576   |
| (B) 負債                        | 210,915     |
| 未払信託報酬                        | 210,325     |
| その他未払費用                       | 590         |
| (C) 純資産総額(A－B)                | 39,688,283  |
| 元本                            | 31,004,467  |
| 次期繰越損益金                       | 8,683,816   |
| (D) 受益権総口数                    | 31,004,467口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)               | 12,801円     |

(注) 期首元本額は28,849,788円、期中追加設定元本額は2,250,616円、期中一部解約元本額は95,937円、1口当たり純資産額は1.2801円です。

○損益の状況 (2021年12月28日～2022年12月26日)

| 項 目            | 当 期          |
|----------------|--------------|
|                | 円            |
| (A) 有価証券売買損益   | △2,128,699   |
| 売買益            | 121,133      |
| 売買損            | △2,249,832   |
| (B) 信託報酬等      | △ 415,741    |
| (C) 当期損益金(A＋B) | △2,544,440   |
| (D) 前期繰越損益金    | 7,115,820    |
| (E) 追加信託差損益金   | 4,112,436    |
| (配当等相当額)       | ( 4,611,159) |
| (売買損益相当額)      | (△ 498,723)  |
| (F) 計(C＋D＋E)   | 8,683,816    |
| (G) 収益分配金      | 0            |
| 次期繰越損益金(F＋G)   | 8,683,816    |
| 追加信託差損益金       | 4,112,436    |
| (配当等相当額)       | ( 4,616,355) |
| (売買損益相当額)      | (△ 503,919)  |
| 分配準備積立金        | 7,611,514    |
| 繰越損益金          | △3,040,134   |

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

(注) 分配金の計算過程 (2021年12月28日～2022年12月26日) は以下の通りです。

| 項 目                          | 当 期                         |
|------------------------------|-----------------------------|
|                              | 2021年12月28日～<br>2022年12月26日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 495,694円                    |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 0円                          |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 4,616,355円                  |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 7,115,820円                  |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)           | 12,227,869円                 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)            | 3,943円                      |
| g. 分配金                       | 0円                          |
| h. 分配金(1万口当たり)               | 0円                          |

## ○分配金のお知らせ

|                 |    |
|-----------------|----|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 0円 |
|-----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。  
※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。  
※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

## ＜マザーファンドの対象指数について＞

- \* 東証株価指数（TOPIX）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）に係る標準又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）に係る標準又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。
- \* MSCI 指数は、MSCI が独占的に所有しています。MSCI 及び MSCI 指数は、MSCI 及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行なわず、いかなる責任も負いません。  
請求目録見書には、MSCI が野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。
- \* NOMURA-BPI 総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、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うものではありません。
- \* 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 により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLC は、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLC は、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利は FTSE Fixed Income LLC に帰属します。
- \* FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLC は、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLC は、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利は FTSE Fixed Income LLC に帰属します。
- \* 本書に含まれる JP モルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行なうものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、何らの運用成績は変化しません。JP モルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行ない、又はそのマーケット・メイカーとして行方している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。  
ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。  
本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。  
JPMSL は、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。  
「JP モルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。  
当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、[index.research@jpmorgan.com](mailto:index.research@jpmorgan.com) 宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、[www.morganmarkets.com](http://www.morganmarkets.com) もご覧ください。  
当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

# 国内株式マザーファンド

## 運用報告書

第21期（決算日2022年5月10日）

作成対象期間（2021年5月11日～2022年5月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                          |
|--------|------------------------------------------|
| 運用方針   | 東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。  |
| 主な投資対象 | わが国の株式を主要投資対象とします。                       |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資は行ないません。 |

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期             | 基 準 価 額 |        | ベ ン チ マ ー ク<br>東 証 株 価 指 数<br>( T O P I X ) |        | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 純 資 産 額  |
|-------------------|---------|--------|---------------------------------------------|--------|-----------|-----------|----------|
|                   |         | 騰 落 率  |                                             | 騰 落 率  |           |           |          |
|                   | 円       | %      |                                             | %      | %         | %         | 百万円      |
| 17期(2018年 5 月10日) | 17, 299 | 14. 5  | 1, 777. 62                                  | 12. 1  | 98. 4     | 1. 6      | 379, 913 |
| 18期(2019年 5 月10日) | 15, 442 | △10. 7 | 1, 549. 42                                  | △12. 8 | 97. 9     | 2. 1      | 394, 025 |
| 19期(2020年 5 月11日) | 15, 150 | △ 1. 9 | 1, 480. 62                                  | △ 4. 4 | 97. 5     | 2. 5      | 423, 056 |
| 20期(2021年 5 月10日) | 20, 400 | 34. 7  | 1, 952. 27                                  | 31. 9  | 97. 5     | 2. 5      | 385, 597 |
| 21期(2022年 5 月10日) | 19, 930 | △ 2. 3 | 1, 862. 38                                  | △ 4. 6 | 98. 0     | 2. 0      | 416, 408 |

\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

東証株価指数（TOPIX）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日        | 基 準 価 額 |       | ベ ン チ マ ー ク<br>東 証 株 価 指 数<br>( T O P I X ) |       | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|--------------|---------|-------|---------------------------------------------|-------|-----------|-----------|
|              |         | 騰 落 率 |                                             | 騰 落 率 |           |           |
| (期 首)        | 円       | %     |                                             | %     | %         | %         |
| 2021年 5 月10日 | 20, 400 | －     | 1, 952. 27                                  | －     | 97. 5     | 2. 5      |
| 5 月末         | 20, 106 | △1. 4 | 1, 922. 98                                  | △1. 5 | 97. 9     | 2. 1      |
| 6 月末         | 20, 344 | △0. 3 | 1, 943. 57                                  | △0. 4 | 98. 6     | 1. 4      |
| 7 月末         | 19, 901 | △2. 4 | 1, 901. 08                                  | △2. 6 | 98. 4     | 1. 6      |
| 8 月末         | 20, 531 | 0. 6  | 1, 960. 70                                  | 0. 4  | 98. 2     | 1. 3      |
| 9 月末         | 21, 426 | 5. 0  | 2, 030. 16                                  | 4. 0  | 96. 6     | 2. 6      |
| 10月末         | 21, 121 | 3. 5  | 2, 001. 18                                  | 2. 5  | 97. 5     | 2. 4      |
| 11月末         | 20, 353 | △0. 2 | 1, 928. 35                                  | △1. 2 | 97. 6     | 2. 4      |
| 12月末         | 21, 069 | 3. 3  | 1, 992. 33                                  | 2. 1  | 98. 3     | 1. 6      |
| 2022年 1 月末   | 20, 052 | △1. 7 | 1, 895. 93                                  | △2. 9 | 97. 6     | 2. 4      |
| 2 月末         | 19, 964 | △2. 1 | 1, 886. 93                                  | △3. 3 | 98. 7     | 1. 3      |
| 3 月末         | 20, 821 | 2. 1  | 1, 946. 40                                  | △0. 3 | 97. 2     | 2. 8      |
| 4 月末         | 20, 323 | △0. 4 | 1, 899. 62                                  | △2. 7 | 97. 7     | 2. 3      |
| (期 末)        |         |       |                                             |       |           |           |
| 2022年 5 月10日 | 19, 930 | △2. 3 | 1, 862. 38                                  | △4. 6 | 98. 0     | 2. 0      |

\* 騰落率は期首比です。

\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

国内株式の株価の変動

### ○投資環境

国内株式市場は、期首より国内企業の2021年度業績見通しの上方修正が一巡し株式市場全体を大きく押し上げる要因とはならなかったことや国内の新型コロナウイルス変異株による感染再拡大などが懸念材料となり横ばいで推移しました。

2021年9月以降は菅首相の自民党総裁選出馬見送りが報道され、新首相の下で内閣が一新されることから、内閣支持率の回復期待が浮上したことなどにより上昇しましたが、9月下旬以降は岸田新政権に対する期待が後退したことなどから下落しました。

10月以降は、原油価格や米長期金利上昇が一服し過度なインフレ懸念が落ち着いたこと、新型コロナウイルスの新たな変異株で感染力が高いと思われるオミクロン株への懸念が高まったこと、その後オミクロン株の重症化リスクについての楽観的な見方が広がったことなどから、一進一退の展開となりました。

2022年1月には、前年12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）の議事要旨において、FRB（米連邦準備制度理事会）の利上げや資産圧縮が早期に進むとの見方が広がったことで、米長期金利が上昇したことなどから下落しました。2月下旬にはロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受けて大きく下落しました。

3月中旬以降は、原油価格上昇が一服したことやロシアとウクライナの和平交渉が進展するとの期待が高まったことなどから上昇しましたが、4月以降は、米金融政策の引き締め加速への警戒感などから下落しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

実質株式組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指すため、現物株式につきましては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数（TOPIX）でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ないました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。

なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

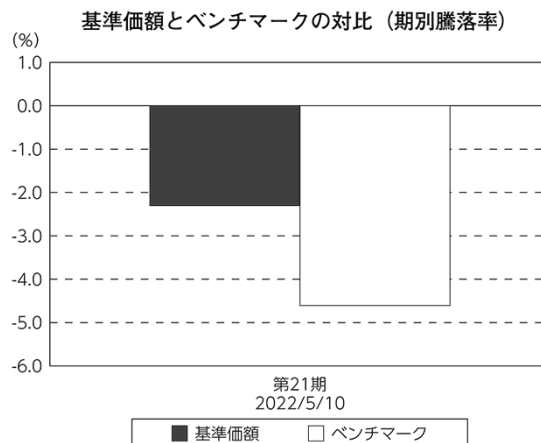
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は－2.3%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の－4.6%を2.3ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

### （プラス要因）

保有銘柄の配当権利落ちによりファンドには配当金が計上されたこと



（注）ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、実質株式組入比率をできるだけ高位に維持し、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月11日～2022年5月10日)

| 項 目                   | 当 期 |         | 項 目 の 概 要                                                              |
|-----------------------|-----|---------|------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額 | 比 率     |                                                                        |
|                       | 円   | %       |                                                                        |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 0   | 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<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株 式)                 | (0) | (0.000) |                                                                        |
| (先物・オプション)            | (0) | (0.001) |                                                                        |
| 合 計                   | 0   | 0.001   |                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、20,500円です。 |     |         |                                                                        |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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5月11日～2022年5月10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 |    | 30,813  | 75,248,302 | 9,969 | 24,183,614 |
|   |    | (6,166) | (—)        |       |            |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）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 |
| 国 | 内 | 証券       | 千円  | 証券       | 千円  |
|   |   | —        | —   | —        | —   |
|   |   | (10,500) | (—) | (10,500) | (—) |

\*（ ）内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

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 株式先物取引 | 百万円<br>92,449 | 百万円<br>93,660 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年5月11日～2022年5月10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       | 99,431,916千円  |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 401,423,321千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.24          |

\* (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5月11日～2022年5月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分        | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|------------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|            |               |                    |               |               |                    |               |
| 株式         | 百万円<br>75,248 | 百万円<br>158         | %<br>0.2      | 百万円<br>24,183 | 百万円<br>—           | %<br>—        |
| 貸付有価証券(株式) | 68,053        | 2,995              | 4.4           | 66,869        | 2,912              | 4.4           |

\*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

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<br>208 | 百万円<br>25 | 百万円<br>1,192 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額     |
|-----|-----------|
| 株式  | 百万円<br>41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目              | 当 期     |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 4,842千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 51千円    |
| (B) / (A)        | 1.1%    |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

〇組入資産の明細

(2022年5月10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                   | 6.2     | 7.6   | 24,510    |
| 日本水産                 | 176.8   | 217   | 124,124   |
| マルハニチロ               | 29.8    | 33    | 80,124    |
| 雪国まいたけ               | 15.6    | 16.2  | 16,605    |
| カネコ種苗                | 5.8     | 6.3   | 11,100    |
| サカタのタネ               | 22.7    | 25.7  | 111,923   |
| ホクト                  | 16      | 18.1  | 36,381    |
| ホクリョウ                | 2.9     | 3     | 2,001     |
| <b>鉱業 (0.3%)</b>     |         |       |           |
| 住石ホールディングス           | 33.3    | 38.9  | 6,729     |
| 日鉄鉱業                 | 4.4     | 4.8   | 28,896    |
| 三井松島ホールディングス         | 8       | 9.3   | 18,107    |
| I N P E X            | 700.1   | 822   | 1,209,162 |
| 石油資源開発               | 24.9    | 26.1  | 65,850    |
| K&Oエナジーグループ          | 9.2     | 9.6   | 16,070    |
| <b>建設業 (2.2%)</b>    |         |       |           |
| ヒノキヤグループ             | 4.7     | —     | —         |
| ショーボンドホールディングス       | 27.2    | 29.8  | 161,218   |
| ミライト・ホールディングス        | 66      | 71.5  | 131,560   |
| タマホーム                | 11.5    | 13.5  | 35,707    |
| サンヨーホームズ             | 2.2     | 2.6   | 1,898     |
| 日本アクア                | 7.6     | 8.8   | 5,244     |
| ファーストコーポレーション        | 5.8     | 5.4   | 4,352     |
| ベステラ                 | 3.6     | 4.5   | 5,364     |
| R o b o t H o m e    | 35.7    | 37    | 7,215     |
| キャンディル               | 3.3     | 3.6   | 1,846     |
| スペースバリューホールディングス     | 23.2    | —     | —         |
| ダイセキ環境ソリューション        | 3.7     | 4.3   | 4,295     |
| 第一カッター興業             | 4.7     | 5.3   | 7,006     |
| 安藤・間                 | 122.1   | 107.3 | 95,818    |
| 東急建設                 | 55.8    | 63.3  | 37,663    |
| コムシスホールディングス         | 67.5    | 71.6  | 194,895   |
| ピーアールホールディングス        | 25.5    | 29.5  | 8,850     |
| 高松コンストラクショングループ      | 11.8    | 13    | 28,665    |

| 銘柄            | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------|---------|-------|---------|
|               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|               | 千株      | 千株    | 千円      |
| 東建コーポレーション    | 5.9     | 6.2   | 53,506  |
| ソネック          | 2       | 2.3   | 2,309   |
| ヤマウラ          | 8.3     | 10.4  | 9,609   |
| オリエンタル白石      | 64      | 74.7  | 17,405  |
| 大成建設          | 136.8   | 136   | 478,720 |
| 大林組           | 439.6   | 501   | 451,401 |
| 清水建設          | 411.8   | 467.4 | 323,908 |
| 飛鳥建設          | 12.6    | 13.7  | 13,932  |
| 長谷工コーポレーション   | 144     | 147.7 | 205,450 |
| 松井建設          | 17.3    | 19.2  | 12,115  |
| 銭高組           | 1.9     | 2.1   | 7,717   |
| 鹿島建設          | 322.1   | 367.1 | 527,889 |
| 不動テトラ         | 10.8    | 10.9  | 16,884  |
| 大木建設          | 5.5     | 5.4   | 7,176   |
| 鉄建建設          | 8.9     | 10.9  | 20,165  |
| 西松建設          | 31.5    | 31.1  | 118,180 |
| 三井住友建設        | 106.2   | 115.7 | 48,594  |
| 大豊建設          | 9.6     | 7.5   | 33,487  |
| 前田建設工業        | 110.1   | —     | —       |
| 佐田建設          | 10.1    | 11    | 4,895   |
| ナカノフード建設      | 10.5    | 12.3  | 3,776   |
| 奥村組           | 24.2    | 28.9  | 89,734  |
| 東鉄工業          | 18.9    | 22.6  | 50,217  |
| イチケン          | 3.2     | 3.7   | 6,574   |
| 富士ビー・エス       | 5.7     | 6.6   | 3,135   |
| 浅沼組           | 5.3     | 5.7   | 28,899  |
| 戸田建設          | 182.6   | 207.7 | 154,321 |
| 熊谷組           | 20.4    | 25.4  | 68,656  |
| 北野建設          | 2.7     | 3.1   | 6,355   |
| 植木組           | 3.9     | 4.4   | 6,142   |
| 矢作建設工業        | 19.4    | 21.9  | 16,950  |
| ビーエス三菱        | 14.5    | 16.9  | 9,497   |
| 日本ハウスホールディングス | 30      | 34.9  | 14,343  |
| 大東建託          | 48      | 52.5  | 617,400 |
| 新日本建設         | 18.7    | 21.8  | 15,412  |

| 銘柄         | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|------------|---------|-------|-----------|
|            | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|            | 千株      | 千株    | 千円        |
| N I P P O  | 36.4    | —     | —         |
| 東亜道路工業     | 2.7     | 2.7   | 13,608    |
| 前田道路       | 27.2    | —     | —         |
| 日本道路       | 4.2     | 4.5   | 32,175    |
| 東亜建設工業     | 11.7    | 12.2  | 34,855    |
| 日本国土開発     | 42.8    | 46.6  | 25,257    |
| 若築建設       | 7.9     | 8.3   | 16,093    |
| 東洋建設       | 49.3    | 57.5  | 51,405    |
| 五洋建設       | 186.7   | 198.6 | 122,734   |
| 世紀東急工業     | 21.1    | 24.6  | 18,179    |
| 福田組        | 5.1     | 5.5   | 25,382    |
| 住友林業       | 103.4   | 125   | 242,875   |
| 日本基礎技術     | 13.4    | 13.6  | 9,941     |
| 巴コーポレーション  | 19.5    | 21.4  | 9,951     |
| 大和ハウス工業    | 406     | 451.3 | 1,383,685 |
| ライト工業      | 25.2    | 30.1  | 56,407    |
| 積水ハウス      | 476.8   | 533.4 | 1,185,748 |
| 日特建設       | 11.5    | 10.6  | 7,759     |
| 北陸電気工事     | 7.6     | 10.2  | 7,527     |
| ユアテック      | 25.1    | 29.4  | 20,021    |
| 日本リーテック    | 9.2     | 10.4  | 11,055    |
| 四電工        | 2.4     | 5.4   | 9,304     |
| 中電工        | 20.2    | 22.6  | 47,799    |
| 関電工        | 71.5    | 83.4  | 69,555    |
| きんでん       | 89.3    | 111.2 | 169,913   |
| 東京エネシス     | 14.6    | 16.4  | 15,202    |
| トーエネック     | 4.4     | 5.2   | 17,394    |
| 住友電設       | 12.4    | 12.7  | 29,387    |
| 日本電設工業     | 24.1    | 26.1  | 42,412    |
| エクシオグループ   | 66.7    | 75.2  | 164,462   |
| 新日本空調      | 11.6    | 12.7  | 23,025    |
| 九電工        | 30.8    | 37.2  | 106,912   |
| 三機工業       | 31.2    | 33.3  | 49,816    |
| 日揮ホールディングス | 146.7   | 153.7 | 217,485   |
| 中外炉工業      | 4.8     | 5     | 7,385     |
| ヤマト        | 14.1    | 14.1  | 10,307    |
| 太平電業       | 9.7     | 10.7  | 29,189    |
| 高砂熱学工業     | 39.7    | 44    | 74,052    |
| 三晃金属工業     | 1.7     | 2     | 5,204     |
| 朝日工業社      | 3.3     | 6.7   | 10,311    |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| 明星工業              | 28.4    | 29.6  | 19,891  |
| 大気社               | 21.4    | 23.8  | 75,327  |
| ダイダシ              | 9.8     | 10.8  | 22,410  |
| 日比谷総合設備           | 14.1    | 15.7  | 29,390  |
| フィル・カンパニー         | 2.5     | 2.8   | 3,088   |
| テスホールディングス        | 9.1     | 14.3  | 19,519  |
| インフロニア・ホールディングス   | —       | 209   | 201,685 |
| レイズネクスト           | 23.6    | 23.9  | 25,859  |
| <b>食料品 (3.4%)</b> |         |       |         |
| ニッポン              | 41.2    | 45.4  | 77,134  |
| 日清製粉グループ本社        | 159     | 175.3 | 303,269 |
| 日東富士製粉            | 1       | 2.4   | 9,612   |
| 昭和産業              | 11.8    | 14.7  | 38,352  |
| 鳥越製粉              | 12.5    | 13.7  | 8,781   |
| 中部飼料              | 17.2    | 18    | 17,838  |
| フィード・ワン           | 18.9    | 20.9  | 13,480  |
| 東洋精糖              | 2.4     | 2.8   | 2,730   |
| 日本甜菜製糖            | 7.3     | 8.6   | 14,207  |
| DM三井製糖ホールディングス    | 11.1    | 14.4  | 27,388  |
| 塩水港精糖             | 16.8    | 19.6  | 4,057   |
| 日新製糖              | 6.7     | 7.8   | 13,322  |
| 森永製菓              | 33      | 36.7  | 148,084 |
| 中村屋               | 3.4     | 3.7   | 11,544  |
| 江崎グリコ             | 38.7    | 42.9  | 155,727 |
| 名糖産業              | 6.2     | 6.8   | 11,029  |
| 井村屋グループ           | 8       | 8.9   | 20,336  |
| 不二家               | 9       | 9.2   | 21,896  |
| 山崎製パン             | 105.5   | 115.7 | 196,342 |
| 第一屋製パン            | 2.7     | 3.2   | 1,648   |
| モロゾフ              | 2.2     | 5.1   | 15,631  |
| 亀田製菓              | 8       | 9.1   | 38,220  |
| 寿スピリッツ            | 13.5    | 15.3  | 96,849  |
| カルビー              | 64.1    | 74.8  | 174,882 |
| 森永乳業              | 26      | 29.5  | 147,057 |
| 六甲バター             | 9.3     | 11.6  | 17,260  |
| ヤクルト本社            | 96.8    | 115.9 | 780,007 |
| 明治ホールディングス        | 93      | 100.5 | 658,275 |
| 雪印メグミルク           | 33.9    | 38.3  | 73,191  |
| プリマハム             | 19.8    | 20.5  | 44,259  |
| 日本ハム              | 53.8    | 61    | 247,050 |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |  |
|----------------------|---------|-------|-----------|--|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |  |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |  |
| 林兼産業                 | 4.7     | 5     | 2,495     |  |
| 丸大食品                 | 13.8    | 15.7  | 23,502    |  |
| S F o o d s          | 12.6    | 14.8  | 43,600    |  |
| 柿安本店                 | 4.9     | 5.7   | 13,577    |  |
| 伊藤ハム米久ホールディングス       | 90.6    | 105.8 | 69,828    |  |
| サッポロホールディングス         | 48      | 53.4  | 144,714   |  |
| アサヒグループホールディングス      | 307.4   | 369.2 | 1,739,670 |  |
| キリンホールディングス          | 596.7   | 603.7 | 1,157,292 |  |
| 宝ホールディングス            | 104.3   | 104.8 | 110,459   |  |
| オエノンホールディングス         | 40      | 45.5  | 13,695    |  |
| 養命酒製造                | 4.3     | 4.8   | 8,256     |  |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ | 107.7   | 111.8 | 164,793   |  |
| サントリー食品インターナショナル     | 94.1    | 109.9 | 550,599   |  |
| ダイドーグループホールディングス     | 7.9     | 8.4   | 42,168    |  |
| 伊藤園                  | 42.7    | 49.9  | 272,953   |  |
| キーコーヒー               | 13.8    | 15.8  | 32,010    |  |
| ユニカフェ                | 4.2     | 4.9   | 4,483     |  |
| ジャパンフーズ              | 2       | 2.3   | 2,622     |  |
| 日清オイリオグループ           | 18.1    | 20    | 61,500    |  |
| 不二製油グループ本社           | 34.3    | 35.6  | 66,216    |  |
| かどや製油                | 1.5     | 1.7   | 6,009     |  |
| Jーオイルミルズ             | 13.1    | 15.3  | 24,525    |  |
| キッコーマン               | 101.3   | 111.6 | 803,520   |  |
| 味の素                  | 334.6   | 345.6 | 1,041,292 |  |
| ブルドックソース             | 6.4     | 6.6   | 12,210    |  |
| キュービー                | 78.3    | 81.5  | 182,397   |  |
| ハウス食品グループ本社          | 52.6    | 58    | 174,000   |  |
| カゴメ                  | 57.5    | 62.3  | 199,983   |  |
| 焼津水産化学工業             | 6.8     | 7.5   | 6,855     |  |
| アリアケジャパン             | 12.9    | 15    | 76,500    |  |
| ビエトロ                 | 1.8     | 2.1   | 3,677     |  |
| エバラ食品工業              | 3.1     | 3.6   | 10,083    |  |
| やまみ                  | 1.5     | 1.4   | 2,291     |  |
| ニチレイ                 | 67      | 70.4  | 166,566   |  |
| 東洋水産                 | 72.4    | 77    | 320,320   |  |
| イートアンドホールディングス       | 4.9     | 6.2   | 13,528    |  |
| 大冷                   | 1.6     | 1.8   | 3,380     |  |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス    | 7.9     | 8.5   | 4,394     |  |
| 日清食品ホールディングス         | 55.2    | 60    | 535,800   |  |
| 永谷園ホールディングス          | 6.9     | 7.3   | 14,249    |  |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|----------------|---------|---------|-----------|
|                | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                | 千株      | 千株      | 千円        |
| 一正蒲鉾           | 5.5     | 6.8     | 5,555     |
| フジッコ           | 15.2    | 15.3    | 30,783    |
| ロック・フィールド      | 15.2    | 17.2    | 24,045    |
| 日本たばこ産業        | 754.4   | 880.6   | 1,988,835 |
| ケンコーマヨネーズ      | 8.6     | 8.9     | 12,442    |
| わらべや日洋ホールディングス | 9.2     | 10.4    | 17,534    |
| なとり            | 7.9     | 9.2     | 18,354    |
| イフジ産業          | 2.2     | 2.9     | 2,900     |
| ビックルスコーポレーション  | 3.4     | 7.8     | 9,945     |
| ファーマフーズ        | 13.3    | 20.7    | 33,720    |
| 北の達人コーポレーション   | 49.1    | —       | —         |
| ユーグレナ          | 71.7    | 84      | 67,620    |
| 紀文食品           | 6.9     | 12.8    | 13,299    |
| ミヨシ油脂          | 4.9     | 6.1     | 6,844     |
| 理研ビタミン         | 13.3    | 16      | 26,560    |
| 繊維製品 (0.5%)    |         |         |           |
| 片倉工業           | 18.4    | 16.7    | 41,098    |
| グンゼ            | 10.1    | 9.9     | 37,471    |
| 東洋紡            | 54.3    | 63.3    | 69,819    |
| ユニチカ           | 40.2    | 44      | 12,056    |
| 富士紡ホールディングス    | 6.6     | 6.9     | 22,045    |
| 倉敷紡績           | 12.6    | 13      | 23,907    |
| シキボウ           | 7.7     | 8.4     | 7,417     |
| 日本毛織           | 45.2    | 45.4    | 43,811    |
| ダイトウボウ         | 22.2    | 26.1    | 2,349     |
| トーア紡コーポレーション   | 5.4     | 5.9     | 2,271     |
| ダイドーリミテッド      | 18      | 21.7    | 2,972     |
| 帝国繊維           | 15.5    | 17.6    | 27,808    |
| 帝人             | 129.2   | 147.5   | 208,712   |
| 東レ             | 994.1   | 1,105.2 | 708,212   |
| サカイオーベックス      | 3.6     | —       | —         |
| 住江織物           | 3       | 3       | 5,835     |
| 日本フェルト         | 7.8     | 9.1     | 3,831     |
| イチカワ           | 1.8     | 2       | 2,796     |
| 日東製網           | 1.5     | 1.7     | 2,276     |
| アツギ            | 10.6    | 12      | 6,192     |
| ダイニック          | 5.2     | 5.8     | 4,100     |
| セーレン           | 33.8    | 31.7    | 65,714    |
| ソトー            | 5.5     | 5.8     | 4,814     |
| 東海染工           | 1.7     | 1.8     | 2,030     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|---------------------|---------|---------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株      | 千円        |
| 小松マテレー              | 22.5    | 25.6    | 36,352    |
| ワコホールディングス          | 34.3    | 37.8    | 69,249    |
| ホギメディカル             | 18.5    | 21      | 66,990    |
| クラウディアホールディングス      | 3.4     | 3.8     | 874       |
| T S I ホールディングス      | 41.7    | 51.9    | 16,089    |
| マツオカコーポレーション        | 4.4     | 5       | 5,595     |
| ワールド                | 18      | 21      | 28,350    |
| 三陽商会                | 7.1     | 7.5     | 6,157     |
| ナイガイ                | 5       | 5.4     | 1,647     |
| オンワードホールディングス       | 82.5    | 93.6    | 23,119    |
| ルックホールディングス         | 4.7     | 5.1     | 7,655     |
| ゴールドウイン             | 22.7    | 28.1    | 178,997   |
| デサント                | 23.4    | 30      | 67,050    |
| キング                 | 7.3     | 7.6     | 3,868     |
| ヤマトインターナショナル        | 12.1    | 13.3    | 3,763     |
| <b>パルプ・紙 (0.2%)</b> |         |         |           |
| 特種東海製紙              | 8.4     | 9.3     | 32,643    |
| 王子ホールディングス          | 618.1   | 652.9   | 395,004   |
| 日本製紙                | 60.7    | 72.8    | 76,876    |
| 三菱製紙                | 19.5    | 22      | 6,556     |
| 北越コーポレーション          | 98.2    | 101.9   | 69,190    |
| 中越パルプ工業             | 5.2     | 6.1     | 5,721     |
| 巴川製紙所               | 4.5     | 4.8     | 3,643     |
| 大王製紙                | 66.2    | 74.4    | 116,361   |
| 阿波製紙                | 3.5     | 4       | 1,308     |
| レンゴー                | 141.6   | 142.3   | 112,843   |
| トーモク                | 8.4     | 9.2     | 14,296    |
| ザ・バック               | 10.4    | 11.5    | 27,657    |
| <b>化学 (6.5%)</b>    |         |         |           |
| 北の達人コーポレーション        | —       | 57.3    | 10,256    |
| クラレ                 | 216.2   | 228.4   | 243,017   |
| 旭化成                 | 910.1   | 1,038.8 | 1,103,205 |
| 共和レザー               | 7.5     | 9.5     | 6,327     |
| 昭和電工                | 104.3   | 139.6   | 343,974   |
| 住友化学                | 1,080.8 | 1,149.6 | 659,870   |
| 住友精化                | 6.7     | 6.9     | 21,217    |
| 日産化学                | 75.7    | 82.3    | 576,100   |
| ラサ工業                | 4.5     | 5.7     | 9,393     |
| クレハ                 | 11.8    | 12.3    | 123,000   |
| 多木化学                | 5.4     | 5.9     | 29,234    |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------|---------|-------|-----------|
|                | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                | 千株      | 千株    | 千円        |
| テイカ            | 10.1    | 10.9  | 12,971    |
| 石原産業           | 24.6    | 27.4  | 28,167    |
| 片倉コープアグリ       | 3.5     | 3.6   | 4,543     |
| 日本曹達           | 19.2    | 19.5  | 67,372    |
| 東ソー            | 212.2   | 220.2 | 403,626   |
| トクヤマ           | 40.8    | 50.1  | 90,831    |
| セントラル硝子        | 26.2    | 25.5  | 61,939    |
| 東亜合成           | 83.8    | 84.8  | 88,531    |
| 大阪ソーダ          | 14      | 14    | 45,290    |
| 関東電化工業         | 32.6    | 33.1  | 31,709    |
| デンカ            | 50.1    | 57    | 200,355   |
| 信越化学工業         | 253.9   | 268.2 | 4,788,711 |
| 日本カーバイド工業      | 5       | 5.7   | 7,814     |
| 堺化学工業          | 9.6     | 10.9  | 20,393    |
| 第一稀元素化学工業      | 13.8    | 14.5  | 13,992    |
| エア・ウォーター       | 140     | 144   | 244,800   |
| 日本酸素ホールディングス   | 113.1   | 146.7 | 339,170   |
| 日本化学工業         | 3.9     | 4.8   | 11,160    |
| 東邦アセチレン        | 2.1     | 3.4   | 3,780     |
| 日本パーカライジング     | 69.3    | 76.4  | 70,822    |
| 高圧ガス工業         | 21.8    | 24.5  | 15,900    |
| チタン工業          | 1.7     | 1.8   | 3,099     |
| 四国化成工業         | 18.2    | 19.9  | 24,894    |
| 戸田工業           | 2.9     | 3.4   | 8,296     |
| ステラ ケミファ       | 7.5     | 8.1   | 20,217    |
| 保土谷化学工業        | 4       | 4.8   | 17,880    |
| 日本触媒           | 24.9    | 25.6  | 135,936   |
| 大日精化工業         | 11.3    | 12.6  | 24,381    |
| カネカ            | 35.5    | 39.2  | 136,416   |
| 三菱瓦斯化学         | 137.6   | 141.5 | 285,122   |
| 三井化学           | 118.5   | 138.6 | 419,958   |
| J S R          | 137.8   | 149.3 | 556,142   |
| 東京応化工業         | 23.6    | 25.3  | 175,582   |
| 大阪有機化学工業       | 12.7    | 12.9  | 33,927    |
| 三菱ケミカルホールディングス | 917.8   | 1,046 | 848,096   |
| KHネオケム         | 22.6    | 25.8  | 66,383    |
| ダイセル           | 184.6   | 225.8 | 179,059   |
| 住友ベークライト       | 21.6    | 24.4  | 104,554   |
| 積水化学工業         | 290.4   | 327.4 | 565,747   |
| 日本ゼオン          | 123.8   | 136.5 | 189,052   |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------|---------|-------|-----------|
|                | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                | 千株      | 千株    | 千円        |
| アイカ工業          | 38.2    | 42.4  | 128,684   |
| UBE            | 69.3    | 75.5  | 155,983   |
| 積水樹脂           | 22.7    | 23.5  | 41,501    |
| タキロンシーアイ       | 29.7    | 34.7  | 18,980    |
| 旭有機材           | 7.8     | 9.1   | 17,108    |
| ニチバン           | 7.2     | 9.1   | 15,561    |
| リケンテクノス        | 33.5    | 36.9  | 16,162    |
| 大倉工業           | 6.5     | 7.8   | 14,071    |
| 積水化成成品工業       | 18.4    | 20.7  | 8,776     |
| 群栄化学工業         | 3.1     | 3.5   | 9,408     |
| タイガースポリマー      | 7.2     | 8.2   | 3,542     |
| ミライアル          | 4.4     | 5.1   | 8,409     |
| ダイキアクシス        | 5.2     | 6.2   | 4,464     |
| ダイキョーニシカワ      | 28.9    | 33.8  | 17,373    |
| 竹本容器           | 4.9     | 5.7   | 4,491     |
| 森六ホールディングス     | 7.4     | 8.3   | 14,923    |
| 恵和             | 2.7     | 4.4   | 19,096    |
| 日本化薬           | 85      | 118.4 | 132,134   |
| カーリットホールディングス  | 13.6    | 15.1  | 9,603     |
| 日本精化           | 9.9     | 12    | 23,208    |
| 扶桑化学工業         | 10.8    | 13.8  | 51,888    |
| トリケミカル研究所      | 12.7    | 16.5  | 37,999    |
| ADEKA          | 63.2    | 70.3  | 166,821   |
| 日油             | 51.7    | 51.9  | 250,677   |
| 新日本理化          | 22.7    | 25.3  | 6,729     |
| ハリマ化成グループ      | 10.2    | 11.5  | 8,981     |
| 花王             | 335.7   | 354   | 1,872,660 |
| 第一工業製薬         | 4.7     | 5.8   | 14,824    |
| 石原ケミカル         | 3.5     | 7.9   | 9,993     |
| 日華化学           | 4.6     | 5.4   | 4,287     |
| ニイタカ           | 2.8     | 3.2   | 7,737     |
| 三洋化成工業         | 8.2     | 9.6   | 48,576    |
| 有機合成薬品工業       | 10.5    | 11.2  | 3,001     |
| 大日本塗料          | 15.5    | 19.1  | 14,878    |
| 日本ベイントホールディングス | 566.4   | 602.2 | 604,608   |
| 関西ベイント         | 154.3   | 157   | 281,030   |
| 神東塗料           | 10.8    | 12.6  | 1,940     |
| 中国塗料           | 33.1    | 36.8  | 35,180    |
| 日本特殊塗料         | 10.3    | 11.2  | 9,049     |
| 藤倉化成           | 18.5    | 19.9  | 9,213     |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|------------------|---------|-------|-----------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                  | 千株      | 千株    | 千円        |
| 太陽ホールディングス       | 10.1    | 23.6  | 73,750    |
| D I C            | 58      | 64.5  | 162,088   |
| サカタインクス          | 30      | 31.8  | 31,609    |
| 東洋インキＳＣホールディングス  | 29      | 32.9  | 65,142    |
| T&K TOKA         | 9.6     | 12.9  | 10,513    |
| 富士フイルムホールディングス   | 246.4   | 287.6 | 2,041,384 |
| 資生堂              | 278.6   | 304.8 | 1,632,813 |
| ライオン             | 182.3   | 183.3 | 255,886   |
| 高砂香料工業           | 8.8     | 10.6  | 27,697    |
| マンダム             | 29.4    | 33.5  | 42,210    |
| ミルボン             | 18.7    | 20.2  | 104,030   |
| ファンケル            | 51.1    | 66.2  | 161,197   |
| コーセー             | 26.4    | 30.8  | 365,288   |
| コタ               | 8.9     | 11.4  | 16,131    |
| シーボン             | 1.8     | 2.1   | 3,570     |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 59.8    | 69.8  | 107,422   |
| ノエビアホールディングス     | 11.9    | 13.3  | 68,229    |
| アジupanホールディングス   | 3.1     | 3.7   | 3,626     |
| 新日本製菓            | 3.8     | 5.6   | 7,616     |
| エステー             | 9       | 10.5  | 15,351    |
| アグロ カネショウ        | 5.3     | 5.4   | 6,204     |
| コニシ              | 23      | 26.2  | 39,876    |
| 長谷川香料            | 24.2    | 28.2  | 73,235    |
| 星光PMC            | 8       | 9.2   | 5,198     |
| 小林製菓             | 39.3    | 45.9  | 412,182   |
| 荒川化学工業           | 11.7    | 12.9  | 13,196    |
| メック              | 9.6     | 11.9  | 27,417    |
| 日本高純度化学          | 3.8     | 4.3   | 9,851     |
| タカラバイオ           | 36.7    | 42.8  | 90,265    |
| J C U            | 15.8    | 17.7  | 60,091    |
| 新田ゼラチン           | 8.8     | 10    | 6,200     |
| OATアグリオ          | 2.7     | 6.8   | 7,622     |
| デクセリアルズ          | 39.2    | 42.6  | 120,046   |
| アース製薬            | 10.6    | 13.5  | 74,655    |
| 北興化学工業           | 13.1    | 14.7  | 14,406    |
| 大成ラミック           | 4.3     | 4.8   | 12,321    |
| クミアイ化学工業         | 58      | 60.9  | 54,870    |
| 日本農薬             | 25      | 29.2  | 17,958    |
| アキレス             | 9.7     | 10.5  | 13,923    |
| 有沢製作所            | 19.5    | 23.3  | 21,342    |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|-------------------|---------|---------|-----------|
|                   | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                   | 千株      | 千株      | 千円        |
| 日東電工              | 84.7    | 98.9    | 896,034   |
| レック               | 16.6    | 20.7    | 17,967    |
| 三光合成              | 14.7    | 18.7    | 6,339     |
| きもと               | 21.5    | 25      | 5,275     |
| 藤森工業              | 12.6    | 14      | 49,350    |
| 前澤化成工業            | 8.9     | 10.1    | 13,079    |
| 未来工業              | 5       | 5.9     | 8,549     |
| ウェーブロックホールディングス   | 4.8     | 6.2     | 4,234     |
| J S P             | 8.2     | 9.6     | 14,160    |
| エフビコ              | 25.8    | 30.1    | 85,634    |
| 天馬                | 10.5    | 12.9    | 28,921    |
| 信越ポリマー            | 21.6    | 29.4    | 30,870    |
| 東リ                | 34.9    | 39.6    | 8,355     |
| ニフコ               | 51.5    | 54.6    | 149,549   |
| バルカー              | 11.4    | 13.3    | 34,659    |
| ユニ・チャーム           | 297.2   | 315.4   | 1,348,335 |
| ショーエイコーポレーション     | 3.1     | 4.4     | 2,552     |
| <b>医薬品 (5.4%)</b> |         |         |           |
| 協和キリン             | 141     | 182.9   | 480,844   |
| 武田薬品工業            | 1,166.4 | 1,286.2 | 4,854,118 |
| アステラス製薬           | 1,215.5 | 1,399.1 | 2,731,043 |
| 住友ファーマ            | 103.9   | 101.1   | 128,700   |
| 塩野義製薬             | 176.3   | 200.5   | 1,421,344 |
| わかもと製薬            | 16.7    | 18.3    | 4,886     |
| 日本新薬              | 39.7    | 40.5    | 351,945   |
| ビオフェルミン製薬         | 2.4     | —       | —         |
| 中外製薬              | 438.5   | 511.8   | 1,902,360 |
| 科研製薬              | 24      | 24.9    | 97,981    |
| エーザイ              | 154.9   | 190.9   | 1,067,512 |
| ロート製薬             | 66.8    | 82      | 277,980   |
| 小野薬品工業            | 321.9   | 357.9   | 1,216,144 |
| 久光製薬              | 40.8    | 40.4    | 145,440   |
| 持田製薬              | 19.5    | 19.7    | 72,594    |
| 参天製薬              | 244     | 298.6   | 326,668   |
| 扶桑薬品工業            | 4.5     | 5.6     | 11,799    |
| 日本ケミファ            | 1.7     | 1.9     | 3,649     |
| ツムラ               | 46.8    | 49.4    | 160,797   |
| 日医工               | 39.7    | 49.6    | 38,539    |
| キッセイ薬品工業          | 24.8    | 27.2    | 69,278    |
| 生化学工業             | 24.7    | 28.9    | 24,333    |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|------------------------|---------|---------|-----------|
|                        | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                        | 千株      | 千株      | 千円        |
| 栄研化学                   | 24.6    | 27.3    | 45,181    |
| 日水製薬                   | 5.2     | 6       | 5,862     |
| 鳥居薬品                   | 8.8     | 8.8     | 27,412    |
| J C R ファーマ             | 39.5    | 46.1    | 106,398   |
| 東和薬品                   | 20.2    | 23.6    | 65,041    |
| 富士製薬工業                 | 8.6     | 9.6     | 9,158     |
| ゼリア新薬工業                | 25.4    | 27.9    | 55,242    |
| 第一三共                   | 1,203.5 | 1,253.1 | 4,120,192 |
| キョーリン製薬ホールディングス        | 30.9    | 31.7    | 58,866    |
| 大幸薬品                   | 17.2    | 24.7    | 14,474    |
| ダイト                    | 9       | 10.5    | 27,982    |
| 大塚ホールディングス             | 291.4   | 330.7   | 1,468,638 |
| 大正製薬ホールディングス           | 33.4    | 36      | 186,480   |
| ペプチドリーム                | 72.3    | 85.9    | 163,038   |
| あすか製薬ホールディングス          | 16      | 17.6    | 20,292    |
| サワイグループホールディングス        | 30.7    | 34.4    | 142,416   |
| <b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>  |         |         |           |
| 日本コークス工業               | 118.4   | 138.2   | 18,518    |
| ニチレキ                   | 16.5    | 19.9    | 24,536    |
| ユシロ化学工業                | 7.9     | 8.2     | 8,388     |
| ビービー・カストロール            | 5       | 5.8     | 7,105     |
| 富士石油                   | 34      | 41      | 10,865    |
| MORESCO                | 5.1     | 5.4     | 6,399     |
| 出光興産                   | 155.6   | 176.6   | 610,153   |
| ENEOSホールディングス          | 2,108.9 | 2,461.7 | 1,156,752 |
| コスモエネルギーホールディングス       | 44.3    | 53.1    | 165,937   |
| <b>ゴム製品 (0.7%)</b>     |         |         |           |
| 横浜ゴム                   | 81.2    | 89      | 152,813   |
| TOYO TIRE              | 73.8    | 83.5    | 124,081   |
| ブリヂストン                 | 372.8   | 459.3   | 2,176,163 |
| 住友ゴム工業                 | 125.9   | 142.6   | 165,843   |
| 藤倉コンポジット               | 12.2    | 13.1    | 8,790     |
| オカモト                   | 8.5     | 9.1     | 36,036    |
| フコク                    | 6.1     | 7.2     | 6,739     |
| ニッタ                    | 14.5    | 16.4    | 46,838    |
| 住友理工                   | 27.2    | 31.7    | 18,005    |
| 三ツ星ベルト                 | 17      | 19.9    | 40,158    |
| バンドー化学                 | 24.7    | 26.4    | 22,704    |
| <b>ガラス・土石製品 (0.7%)</b> |         |         |           |
| 日東紡績                   | 20.9    | 23      | 56,097    |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|--------------------|---------|-------|-----------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                    | 千株      | 千株    | 千円        |
| A G C              | 128.7   | 146.4 | 718,092   |
| 日本板硝子              | 71.1    | 77.1  | 29,991    |
| 石塚硝子               | 2.4     | 2.7   | 4,695     |
| 日本山村硝子             | 5.8     | 6     | 4,680     |
| 日本電気硝子             | 52      | 64.1  | 174,095   |
| オハラ                | 5.5     | 6.5   | 7,137     |
| 住友大阪セメント           | 25.2    | 29    | 100,920   |
| 太平洋セメント            | 83      | 93    | 196,137   |
| 日本ヒューム             | 12.8    | 15.4  | 10,287    |
| 日本コンクリート工業         | 30.2    | 31.3  | 9,640     |
| 三谷セキサン             | 6.5     | 7.3   | 34,164    |
| アジアパイルホールディングス     | 21.6    | 24.5  | 10,412    |
| 東海カーボン             | 137.1   | 133.3 | 140,764   |
| 日本カーボン             | 7.7     | 8.4   | 35,238    |
| 東洋炭素               | 8.2     | 10.3  | 28,870    |
| ノリタケカンパニーリミテド      | 7.8     | 8.8   | 37,224    |
| T O T O            | 100.1   | 110.9 | 491,841   |
| 日本碍子               | 154.3   | 171.9 | 307,357   |
| 日本特殊陶業             | 106.6   | 121   | 278,421   |
| ダントーホールディングス       | 10.4    | 10.7  | 2,589     |
| MARUWA             | 4.8     | 5.7   | 89,376    |
| 品川リフラクトリーズ         | 3.3     | 3.8   | 13,813    |
| 黒崎播磨               | 2.4     | 2.8   | 11,396    |
| ヨータイ               | 10      | 10.4  | 13,894    |
| イソライト工業            | 6.2     | —     | —         |
| 東京窯業               | 17.8    | 19.3  | 5,404     |
| ニッカトー              | 6.3     | 7.2   | 3,420     |
| フジミインコーポレーテッド      | 11.2    | 13.1  | 73,622    |
| クニミネ工業             | 4.4     | 5.1   | 4,778     |
| エーアンドエーマテリアル       | 2.7     | 2.8   | 2,380     |
| ニチアス               | 35.4    | 36.8  | 83,057    |
| ニチハ                | 19.5    | 22.1  | 51,581    |
| <b>鉄鋼 (0.8%)</b>   |         |       |           |
| 日本製鉄               | 661.8   | 708.2 | 1,372,845 |
| 神戸製鋼所              | 253.7   | 295.4 | 165,128   |
| 中山製鋼所              | 19.2    | 24.6  | 10,356    |
| 合同製鐵               | 7.5     | 8.4   | 10,357    |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 401.1   | 416.2 | 628,045   |
| 東京製鐵               | 54      | 52.5  | 72,502    |
| 共英製鋼               | 15.6    | 17.5  | 22,242    |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|--------------------|---------|-------|-----------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                    | 千株      | 千株    | 千円        |
| 大和工業               | 29.5    | 28.6  | 118,404   |
| 東京鐵鋼               | 5.3     | 7     | 8,925     |
| 大阪製鐵               | 7.4     | 8.6   | 11,266    |
| 淀川製鋼所              | 18.2    | 20.1  | 47,415    |
| 丸一鋼管               | 45      | 49.8  | 136,402   |
| モリ工業               | 4.1     | 4.5   | 11,178    |
| 大同特殊鋼              | 22.7    | 25    | 88,750    |
| 日本高周波鋼業            | 5.1     | 6     | 1,986     |
| 日本冶金工業             | 10.8    | 11.5  | 24,472    |
| 山陽特殊製鋼             | 16.6    | 15.7  | 30,724    |
| 愛知製鋼               | 7.8     | 9.1   | 19,319    |
| 日立金属               | 130.7   | 174.3 | 353,829   |
| 日本金属               | 3.5     | 4.1   | 4,702     |
| 大平洋金属              | 9.4     | 9.9   | 31,680    |
| 新日本電工              | 89.4    | 99.5  | 30,447    |
| 栗本鐵工所              | 6.3     | 7.1   | 11,303    |
| 虹技                 | 1.9     | 2.2   | 1,995     |
| 日本鑄鉄管              | 1.6     | 1.7   | 1,708     |
| 三菱製鋼               | 10.3    | 10.4  | 10,764    |
| 日亜鋼業               | 20.3    | 20.2  | 5,211     |
| 日本精線               | 2       | 2.6   | 10,517    |
| エンビプロ・ホールディングス     | 5.9     | 10.7  | 9,651     |
| シンニッタン             | 16.8    | 19.6  | 4,174     |
| 新家工業               | 3.4     | 3.8   | 5,928     |
| <b>非鉄金属 (0.8%)</b> |         |       |           |
| 大紀アルミニウム工業所        | 20.9    | 22.9  | 30,113    |
| 日本軽金属ホールディングス      | 37.8    | 40.9  | 66,707    |
| 三井金属鉱業             | 37.4    | 43.7  | 139,184   |
| 東邦亜鉛               | 7.7     | 8.7   | 22,881    |
| 三菱マテリアル            | 91.6    | 102.4 | 203,980   |
| 住友金属鉱山             | 177.2   | 197   | 1,028,340 |
| DOWAホールディングス       | 35.1    | 42    | 218,400   |
| 古河機械金属             | 22.9    | 26    | 32,890    |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ     | 14.4    | 18.7  | 22,066    |
| 東邦チタニウム            | 24.8    | 29    | 39,237    |
| U A C J            | 21      | 23.7  | 49,959    |
| C Kサンエツ            | 2.9     | 3.3   | 12,870    |
| 古河電気工業             | 43.1    | 49.1  | 105,172   |
| 住友電気工業             | 483.8   | 591.7 | 842,876   |
| フジクラ               | 167.4   | 180.4 | 110,585   |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|--------------------|---------|-------|---------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |
| 昭和電線ホールディングス       | 13.4    | 14.1  | 23,758  |
| 東京特殊電線             | 1.8     | 2.3   | 6,145   |
| タツタ電線              | 24.4    | 28.5  | 13,081  |
| カナレ電気              | 2.3     | 2.4   | 4,034   |
| 平河ヒューテック           | 7.7     | 9     | 10,260  |
| リョービ               | 17.1    | 18.8  | 20,003  |
| アーレスティ             | 17      | 17.2  | 5,985   |
| アサヒホールディングス        | 52      | 64.8  | 134,784 |
| <b>金属製品 (0.6%)</b> |         |       |         |
| 稲葉製作所              | 7.8     | 8.8   | 11,369  |
| 宮地エンジニアリンググループ     | 4.5     | 4.8   | 16,008  |
| トーカロ               | 35.8    | 41.7  | 52,833  |
| アルファＣｏ             | 4.9     | 6     | 5,634   |
| SUMCO              | 177.4   | 255   | 489,600 |
| 川田テクノロジーズ          | 2.8     | 3.2   | 11,536  |
| RS Technologies    | 4.5     | 5.3   | 31,217  |
| ジェイテックコーポレーション     | 1.5     | 2.1   | 3,475   |
| 信和                 | 7.4     | 10    | 7,920   |
| 東洋製織グループホールディングス   | 88.3    | 96.2  | 136,507 |
| ホッカンホールディングス       | 7       | 8.4   | 10,500  |
| コロナ                | 7.7     | 8.6   | 7,095   |
| 横河ブリッジホールディングス     | 23.8    | 26.2  | 49,596  |
| 駒井ハルテック            | 2.8     | 2.9   | 5,457   |
| 高田機工               | 1.3     | 1.4   | 3,798   |
| 三和ホールディングス         | 130.7   | 152.6 | 179,152 |
| 文化シャッター            | 40.8    | 50.1  | 47,995  |
| 三協立山               | 17.9    | 20.3  | 12,119  |
| アルインコ              | 9.2     | 11.4  | 9,883   |
| 東洋シャッター            | 3.1     | 3.6   | 2,034   |
| LIXIL              | 190.9   | 254.7 | 619,685 |
| 日本フィルコン            | 9.6     | 10.9  | 5,493   |
| ノーリツ               | 28.7    | 29.3  | 43,950  |
| 長府製作所              | 14.1    | 16.5  | 30,921  |
| リンナイ               | 27      | 29.7  | 259,578 |
| ダイニチ工業             | 6.6     | 7.7   | 4,774   |
| 日東精工               | 17.4    | 19.6  | 9,721   |
| 三洋工業               | 1.7     | 2     | 3,482   |
| 岡部                 | 28.1    | 28.4  | 18,488  |
| ジーテクト              | 17.2    | 19.3  | 24,646  |
| 東ブレ                | 25.9    | 28.4  | 31,154  |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|------------------|---------|-------|---------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                  | 千株      | 千株    | 千円      |
| 高周波熱練            | 26.7    | 26.3  | 15,254  |
| 東京製綱             | 9.9     | 9.9   | 8,236   |
| サンコール            | 11.9    | 13.8  | 6,941   |
| モリテック スチール       | 10.8    | 12.6  | 3,666   |
| パイオラックス          | 20.5    | 22.6  | 32,815  |
| エイチワン            | 13.6    | 15.4  | 9,116   |
| 日本発條             | 138.1   | 144.7 | 122,416 |
| 中央発條             | 6.7     | 7.8   | 5,343   |
| アドバネクス           | 2       | 2.1   | 3,651   |
| 立川ブラインド工業        | 6.1     | 6.9   | 7,189   |
| 三益半導体工業          | 10.8    | 12.6  | 28,425  |
| <b>機械 (5.3%)</b> |         |       |         |
| 日本ドライケミカル        | 3.4     | 3.9   | 5,928   |
| 日本製鋼所            | 42.1    | 46.6  | 119,016 |
| 三浦工業             | 60      | 67.9  | 187,947 |
| タクマ              | 47      | 52    | 75,608  |
| ツガミ              | 28.7    | 34.7  | 41,223  |
| オークマ             | 16.2    | 17.7  | 84,075  |
| 芝浦機械             | 14.4    | 18.3  | 51,770  |
| アマダ              | 203.2   | 255.4 | 260,252 |
| アイダエンジニアリング      | 36.3    | 40    | 38,720  |
| 滝澤鉄工所            | 4       | 4.7   | 5,969   |
| F U J I          | 55.4    | 71.2  | 151,727 |
| 牧野フライス製作所        | 16.3    | 17.3  | 71,276  |
| オーエスジー           | 68.4    | 73.9  | 120,678 |
| ダイジェット工業         | 1.6     | 1.8   | 1,695   |
| 旭ダイヤモンド工業        | 36.4    | 41.5  | 23,779  |
| DMG森精機           | 87.7    | 93.9  | 153,150 |
| ソディック            | 29.2    | 35.2  | 25,907  |
| ディスコ             | 18.8    | 23.8  | 742,560 |
| 日東工器             | 6.6     | 8.5   | 12,843  |
| 日進工具             | 10.9    | 12.7  | 18,097  |
| パンチ工業            | 11.6    | 13.6  | 6,296   |
| 富士ダイス            | 7       | 8.1   | 5,167   |
| 豊和工業             | 7.6     | 8.3   | 6,573   |
| OKK              | 5.3     | 5.9   | 7,345   |
| 東洋機械金属           | 9.9     | 10.5  | 6,037   |
| 津田駒工業            | 2.7     | 3     | 1,713   |
| エンシュウ            | 3.3     | 3.6   | 2,376   |
| 島精機製作所           | 20.3    | 23.6  | 42,314  |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------|---------|-------|-----------|
|                | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                | 千株      | 千株    | 千円        |
| オプトラン          | 17.4    | 20.3  | 36,722    |
| N Cホールディングス    | 4.2     | 3.7   | 6,234     |
| イワキポンプ         | 8.8     | 10.3  | 10,639    |
| フリーュー          | 13.5    | 14.4  | 14,716    |
| ヤマシンフィルタ       | 27.9    | 30.2  | 10,358    |
| 日阪製作所          | 17.1    | 18.8  | 14,137    |
| やまびこ           | 26.9    | 29.9  | 41,232    |
| 野村マイクロ・サイエンス   | —       | 5.5   | 20,212    |
| 平田機工           | 6.6     | 7.5   | 35,700    |
| ベガサスミシン製造      | 14      | 16.4  | 9,708     |
| マルマエ           | 5.7     | 6.6   | 13,747    |
| タツモ            | 5.9     | 7.5   | 9,652     |
| ナブテスコ          | 81.7    | 90.2  | 262,121   |
| 三井海洋開発         | 14.7    | 17.2  | 20,519    |
| レオン自動機         | 13.6    | 17.3  | 19,081    |
| SMC            | 41.1    | 47.9  | 2,948,245 |
| ホソカワミクロン       | 4.9     | 11.1  | 27,084    |
| ユニオンツール        | 5.2     | 6     | 22,380    |
| オイレス工業         | 19.4    | 22.1  | 33,326    |
| 日精エー・エス・ビー機械   | 4.7     | 5.7   | 16,906    |
| サトーホールディングス    | 18.2    | 21.3  | 38,979    |
| 技研製作所          | 12.2    | 14.3  | 50,550    |
| 日本エアーテック       | 4.5     | 7.4   | 7,622     |
| カワタ            | 3.8     | 5     | 4,745     |
| 日精樹脂工業         | 10.7    | 10.9  | 10,267    |
| オカダアイヨン        | 4.4     | 5.1   | 7,619     |
| ワイエイシイホールディングス | 5.5     | 6.4   | 9,030     |
| 小松製作所          | 635.2   | 741.6 | 2,297,476 |
| 住友重機械工業        | 80.2    | 91.6  | 254,373   |
| 日立建機           | 65.5    | 65.6  | 198,768   |
| 日工             | 20.9    | 21.7  | 13,323    |
| 巴工業            | 5.5     | 6.2   | 14,359    |
| 井関農機           | 14      | 14.4  | 17,870    |
| T O W A        | 13.1    | 14    | 27,272    |
| 丸山製作所          | 2.8     | 3.1   | 4,761     |
| 北川鉄工所          | 6.3     | 7     | 8,876     |
| ローツェ           | 6.1     | 8.1   | 82,215    |
| タカキタ           | 4.9     | 5.5   | 3,201     |
| クボタ            | 736.4   | 792.7 | 1,813,301 |
| 荏原実業           | 3.5     | 7.5   | 17,557    |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|-----------------|---------|-------|-----------|
|                 | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                 | 千株      | 千株    | 千円        |
| 三菱化工機           | 4.5     | 5.1   | 9,888     |
| 月島機械            | 25.8    | 28.6  | 29,715    |
| 帝国電機製作所         | 9.8     | 11.1  | 18,115    |
| 東京機械製作所         | 5.7     | 6.7   | 5,440     |
| 新東工業            | 33.3    | 34.2  | 23,119    |
| 澁谷工業            | 12.3    | 13.8  | 32,071    |
| アイチ コーポレーション    | 23.8    | 23.3  | 20,760    |
| 小森コーポレーション      | 35.5    | 40.5  | 30,294    |
| 鶴見製作所           | 10.8    | 12.2  | 22,265    |
| 住友精密工業          | 2.1     | 2.4   | 5,304     |
| 日本ギア工業          | 5.6     | 5.8   | 1,490     |
| 酒井重工業           | 2.5     | 2.8   | 8,610     |
| 荏原製作所           | 58.1    | 65.5  | 381,865   |
| 石井鐵工所           | 2       | 2.2   | 6,300     |
| 西島製作所           | 14.1    | 14.3  | 18,075    |
| 北越工業            | 14.4    | 14.8  | 12,920    |
| ダイキン工業          | 178.6   | 198.6 | 3,897,525 |
| オルガノ            | 4.5     | 4.7   | 40,984    |
| トーヨーカネツ         | 5.3     | 6     | 14,394    |
| 栗田工業            | 75.9    | 86.6  | 389,700   |
| 椿本チエイン          | 20      | 21.4  | 63,793    |
| 大同工業            | 6.7     | 7     | 6,328     |
| 木村化工機           | 11.7    | 13.3  | 10,267    |
| アネスト岩田          | 23.6    | 25.5  | 20,502    |
| ダイフク            | 77.1    | 85.8  | 645,216   |
| サムコ             | 3.5     | 4.2   | 9,996     |
| 加藤製作所           | 7.7     | 7.8   | 6,021     |
| 油研工業            | 2.4     | 2.7   | 4,560     |
| タダノ             | 67.6    | 83.3  | 76,552    |
| フジテック           | 48.3    | 55.8  | 144,801   |
| C K D           | 32.5    | 46    | 75,578    |
| キトー             | 11.8    | 13.5  | 22,275    |
| 平和              | 39.1    | 45.6  | 86,776    |
| 理想科学工業          | 10.3    | 12.7  | 30,175    |
| S A N K Y O     | 33.3    | 35.4  | 133,281   |
| 日本金銭機械          | 15.5    | 16.6  | 11,719    |
| マースグループホールディングス | 8.9     | 10.4  | 17,056    |
| フクシマガリレイ        | 9.6     | 10.8  | 40,014    |
| オーイズミ           | 5.9     | 5.7   | 2,604     |
| ダイコク電機          | 6.4     | 7.5   | 9,262     |

| 銘柄            | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|---------------|---------|-------|-----------|
|               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|               | 千株      | 千株    | 千円        |
| 竹内製作所         | 23.5    | 24.9  | 61,278    |
| アマノ           | 36.7    | 42.8  | 107,085   |
| J U K I       | 19.5    | 22.8  | 16,188    |
| ジャノメ          | 12.7    | 13.9  | 9,604     |
| マックス          | 18.8    | 20.9  | 33,586    |
| グローリー         | 36      | 41    | 88,150    |
| 新晃工業          | 13      | 15.2  | 24,061    |
| 大和冷機工業        | 22.5    | 23.6  | 25,936    |
| セガサミーホールディングス | 127.5   | 162.3 | 360,306   |
| 日本ビストンリング     | 5.1     | 6     | 7,854     |
| リケン           | 6.5     | 6.7   | 16,200    |
| T P R         | 18.9    | 20.8  | 26,228    |
| ツバキ・ナカシマ      | 26.9    | 35.9  | 31,807    |
| ホシザキ          | 44.1    | 47.8  | 384,312   |
| 大豊工業          | 11.4    | 13.3  | 8,432     |
| 日本精工          | 287.9   | 298.8 | 217,227   |
| NTN           | 324.5   | 333.7 | 71,078    |
| ジェイテクト        | 134.5   | 151.2 | 141,069   |
| 不二越           | 13      | 13.1  | 48,339    |
| 日本トムソン        | 38.4    | 42.3  | 20,896    |
| THK           | 87.4    | 92.4  | 238,946   |
| ユースイン精機       | 9.3     | 12.7  | 7,975     |
| 前澤給装工業        | 9.8     | 11.7  | 10,553    |
| イーグル工業        | 17.3    | 19.4  | 20,098    |
| 前澤工業          | 8.4     | 10.5  | 6,594     |
| 日本ビラー工業       | 14.2    | 15.7  | 38,339    |
| キッツ           | 43.3    | 52.1  | 34,646    |
| マキタ           | 182.8   | 194.4 | 736,970   |
| 三井E&Sホールディングス | —       | 59.1  | 21,276    |
| 日立造船          | 111.1   | 135.5 | 94,579    |
| 三菱重工業         | 220.3   | 251.4 | 1,112,193 |
| I H I         | 94.3    | 102.2 | 291,678   |
| サノヤスホールディングス  | —       | 19.6  | 2,469     |
| スター精密         | 21.6    | 23.6  | 34,857    |
| 電気機器 (17.5%)  |         |       |           |
| 日清紡ホールディングス   | 85.7    | 94.5  | 90,909    |
| イビデン          | 67.4    | 83.5  | 381,595   |
| コニカミノルタ       | 284.4   | 349.1 | 171,059   |
| ブラザー工業        | 171.2   | 195.4 | 450,787   |
| ミネベアミツミ       | 241.6   | 274.9 | 676,803   |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |  |
|----------------------|---------|---------|-----------|--|
|                      | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |  |
|                      | 千株      | 千株      | 千円        |  |
| 日立製作所                | 674     | 787.1   | 5,075,220 |  |
| 東芝                   | 277.4   | 286     | 1,528,670 |  |
| 三菱電機                 | 1,401.8 | 1,600.1 | 2,161,735 |  |
| 富士電機                 | 84.5    | 96.1    | 546,809   |  |
| 東洋電機製造               | 5.5     | 5.8     | 5,428     |  |
| 安川電機                 | 150.9   | 171.6   | 716,430   |  |
| シンフォニアテクノロジー         | 18.2    | 18.7    | 23,468    |  |
| 明電舎                  | 23.8    | 26.2    | 59,945    |  |
| オリジン                 | 3.8     | 4       | 5,236     |  |
| 山洋電気                 | 6.8     | 6.8     | 37,060    |  |
| デンヨー                 | 11.9    | 13.2    | 21,040    |  |
| PHCホールディングス          | —       | 25.2    | 39,816    |  |
| 東芝テック                | 15      | 17.6    | 77,264    |  |
| 芝浦メカトロニクス            | 2.5     | 2.9     | 20,068    |  |
| マブチモーター              | 38.8    | 37.9    | 131,513   |  |
| 日本電産                 | 337.4   | 403.9   | 3,358,428 |  |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス    | 7.3     | 6.7     | 2,626     |  |
| トレックス・セミコンダクター       | 7.5     | 7.8     | 17,362    |  |
| 東光高岳                 | 7.1     | 9.1     | 14,969    |  |
| ダブル・スコープ             | 33.2    | 47.1    | 40,929    |  |
| ダイヘン                 | 15.3    | 17      | 62,560    |  |
| ヤーマン                 | 22.9    | 26.7    | 31,559    |  |
| J V Cケンウッド           | 121.3   | 133.3   | 26,793    |  |
| ミマキエンジニアリング          | 12.6    | 14.7    | 10,157    |  |
| I - P E X            | 6.5     | 7.6     | 10,928    |  |
| 日新電機                 | 32.9    | 38.3    | 51,896    |  |
| 大崎電気工業               | 27.9    | 29.2    | 14,570    |  |
| オムロン                 | 116.7   | 136.2   | 964,977   |  |
| 日東工業                 | 20.6    | 20.6    | 31,765    |  |
| I D E C              | 18.8    | 20.3    | 45,472    |  |
| 正興電機製作所              | 4.4     | 4.9     | 5,296     |  |
| 不二電機工業               | 2.3     | 3       | 3,402     |  |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション    | 50.4    | 51.9    | 117,190   |  |
| サクサホールディングス          | 3.3     | 3.8     | 5,669     |  |
| メルコホールディングス          | 4.8     | 3.9     | 15,093    |  |
| テクノメディカ              | 3.1     | 3.7     | 5,727     |  |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 4.1     | 4.6     | 4,052     |  |
| 日本電気                 | 178.1   | 203.3   | 1,087,655 |  |
| 富士通                  | 126.1   | 147.2   | 2,865,984 |  |
| 沖電気工業                | 56.9    | 65      | 56,160    |  |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末   |            |
|-----------------|---------|---------|------------|
|                 | 株 数     | 株 数     | 評 価 額      |
|                 | 千株      | 千株      | 千円         |
| 岩崎通信機           | 6.1     | 6.7     | 5,373      |
| 電気興業            | 6.7     | 8.3     | 20,077     |
| サンケン電気          | 16.4    | 14.9    | 71,222     |
| ナカヨ             | 2.7     | 2.8     | 2,990      |
| アイホン            | 7.9     | 8.6     | 14,946     |
| ルネサスエレクトロニクス    | 603.4   | 888.9   | 1,203,570  |
| セイコーエプソン        | 173.9   | 196.3   | 384,355    |
| ワコム             | 101.5   | 126.9   | 121,062    |
| アルバック           | 25.8    | 32.6    | 162,674    |
| アクセル            | 5.9     | 6.6     | 5,550      |
| E I Z O         | 11.9    | 12.3    | 42,373     |
| 日本信号            | 32.7    | 39.4    | 35,893     |
| 京三製作所           | 30.1    | 34.1    | 14,628     |
| 能美防災            | 18.5    | 20.6    | 40,190     |
| ホーチキ            | 10.2    | 11.2    | 13,507     |
| 星和電機            | 6.9     | 7.2     | 3,679      |
| エレコム            | 32.1    | 37.5    | 58,425     |
| パナソニック ホールディングス | 1,495.1 | 1,745.4 | 2,016,809  |
| シャープ            | 186.4   | 176.2   | 191,177    |
| アンリツ            | 84.3    | 105.4   | 156,729    |
| 富士通ゼネラル         | 42.8    | 44.4    | 96,170     |
| ソニーグループ         | 878.2   | 1,025.1 | 10,763,550 |
| TDK             | 67.7    | 237     | 963,405    |
| 帝国通信工業          | 6.2     | 7.2     | 10,008     |
| タムラ製作所          | 50.4    | 61.7    | 33,564     |
| アルプスアルパイン       | 114.5   | 141.1   | 187,098    |
| 池上通信機           | 4.4     | 4.8     | 2,889      |
| 日本電波工業          | 13.6    | 16.4    | 18,318     |
| 鈴木              | 6.3     | 8.1     | 6,139      |
| メイコー            | —       | 17.7    | 59,560     |
| 日本トリム           | 3       | 3.1     | 7,288      |
| ローランド ディー・ジー    | 8.3     | 9.6     | 30,816     |
| フォスター電機         | 14.1    | 16.1    | 11,736     |
| SMK             | 3.6     | 3.8     | 8,215      |
| ヨコオ             | 10.8    | 11.7    | 29,647     |
| ティアック           | 8.8     | 26      | 2,990      |
| ホシデン            | 38.3    | 38.4    | 49,920     |
| ヒロセ電機           | 21.6    | 24.6    | 436,158    |
| 日本航空電子工業        | 32.1    | 36      | 67,824     |
| T O A           | 16.5    | 17.5    | 13,860     |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|-----------------|---------|-------|-----------|
|                 | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                 | 千株      | 千株    | 千円        |
| マクセル            | 27.9    | 31.6  | 36,182    |
| 古野電気            | 18      | 19.4  | 18,876    |
| ユニデンホールディングス    | 3.6     | 3.6   | 12,582    |
| スミダコーポレーション     | 11.9    | 15.3  | 12,347    |
| アイコム            | 5.8     | 5.8   | 14,285    |
| リオン             | 5.9     | 6     | 14,364    |
| 本多通信工業          | 10.9    | 12.7  | 5,829     |
| 船井電機            | 15.7    | —     | —         |
| 横河電機            | 140.3   | 159.2 | 319,514   |
| 新電元工業           | 5.4     | 6.1   | 17,378    |
| アズビル            | 94.8    | 95.9  | 366,338   |
| 東亜ディーケーケー       | 6.9     | 8.1   | 7,387     |
| 日本光電工業          | 57.9    | 66.1  | 206,893   |
| チノー             | 4.4     | 5.2   | 8,444     |
| 共和電業            | 14.7    | 15.7  | 5,353     |
| 日本電子材料          | 5.4     | 8.1   | 15,049    |
| 堀場製作所           | 27.8    | 29.5  | 184,080   |
| アドバンテスト         | 104.2   | 121.7 | 1,019,846 |
| 小野測器            | 5.8     | 6.6   | 3,095     |
| エスベック           | 12.4    | 12.9  | 22,239    |
| キーエンス           | 137.6   | 148.3 | 7,474,320 |
| 日置電機            | 6.7     | 7.8   | 55,692    |
| シスメックス          | 109.4   | 131.4 | 1,002,713 |
| 日本マイクロニクス       | 24.4    | 27.1  | 39,593    |
| メガチップス          | 14      | 14.5  | 47,270    |
| OBARA GROUP     | 6.4     | 7.1   | 20,313    |
| 澤藤電機            | 1.5     | 2     | 2,904     |
| 原田工業            | 5.7     | 7.7   | 7,091     |
| コーセル            | 17.1    | 18.1  | 13,882    |
| イリソ電子工業         | 11.8    | 13.7  | 42,607    |
| オプテックスグループ      | 23      | 26.8  | 43,764    |
| 千代田インテグレ        | 5.9     | 6.6   | 13,721    |
| アイ・オー・データ機器     | 5.2     | 1.5   | 1,945     |
| レーザーテック         | 61.6    | 70.3  | 1,204,239 |
| スタンレー電気         | 98.1    | 111.3 | 254,097   |
| 岩崎電気            | 5.1     | 5.7   | 13,161    |
| ウシオ電機           | 71.9    | 81.7  | 137,664   |
| 岡谷電機産業          | 10      | 11.6  | 3,166     |
| ヘリオス テクノホールディング | 12.9    | 13.9  | 3,989     |
| エノモト            | 3.9     | 4.5   | 6,885     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|---------------------|---------|-------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株    | 千円        |
| 日本セラミック             | 14.2    | 15.2  | 35,309    |
| 遠藤照明                | 7.1     | 7.5   | 6,052     |
| 古河電池                | 10      | 11.7  | 13,946    |
| 双信電機                | 6.8     | 7.8   | 4,141     |
| 山一電機                | 9.1     | 11.5  | 19,446    |
| 図研                  | 9.1     | 10.6  | 26,945    |
| 日本電子                | 25.5    | 33.2  | 192,560   |
| カシオ計算機              | 112.7   | 109.7 | 147,107   |
| ファナック               | 123     | 143.6 | 2,794,456 |
| 日本シイエムケイ            | 30.2    | 31    | 16,120    |
| エンブラス               | 6.3     | 4     | 13,900    |
| 大真空                 | 4.7     | 21.5  | 23,779    |
| ローム                 | 58.3    | 71.5  | 664,235   |
| 浜松ホトニクス             | 100.6   | 114.6 | 652,074   |
| 三井ハイテック             | 13.7    | 15.4  | 169,092   |
| 新光電気工業              | 47.1    | 48.1  | 240,259   |
| 京セラ                 | 213.7   | 230.2 | 1,593,214 |
| 太陽誘電                | 62.3    | 77.2  | 403,756   |
| 村田製作所               | 411.8   | 469.3 | 3,871,725 |
| 双葉電子工業              | 24      | 28    | 18,620    |
| 北陸電気工業              | 5.2     | 6.1   | 7,393     |
| ニチコン                | 44.1    | 48.9  | 60,880    |
| 日本ケミコン              | 14.1    | 15.5  | 29,605    |
| KOA                 | 19.4    | 24    | 38,352    |
| 市光工業                | 21      | 19.6  | 7,291     |
| 小糸製作所               | 84      | 87.1  | 402,837   |
| ミツバ                 | 25.8    | 28.6  | 9,952     |
| S C R E E Nホールディングス | 24.3    | 27.5  | 288,475   |
| キャノン電子              | 12.9    | 15    | 22,500    |
| キャノン                | 696.6   | 813.1 | 2,545,003 |
| リコー                 | 356.6   | 432.6 | 428,274   |
| 象印マホービン             | 37.9    | 43    | 57,663    |
| M U T O Hホールディングス   | 1.8     | 2.1   | 4,678     |
| 東京エレクトロン            | 82.1    | 103.8 | 5,548,110 |
| 輸送用機器 (8.3%)        |         |       |           |
| トヨタ紡織               | 40.8    | 63.6  | 131,652   |
| 芦森工業                | 2.6     | 3.1   | 2,972     |
| ユニプレス               | 23      | 25.2  | 19,202    |
| 豊田自動織機              | 113.5   | 126.9 | 1,048,194 |
| モリタホールディングス         | 22.5    | 26.2  | 34,688    |

| 銘柄            | 期首(前期末) | 当 期 末   |            |
|---------------|---------|---------|------------|
|               | 株 数     | 株 数     | 評 価 額      |
|               | 千株      | 千株      | 千円         |
| 三櫻工業          | 19.4    | 22.6    | 15,887     |
| デンソー          | 308.7   | 347     | 2,598,683  |
| 東海理化電機製作所     | 36.9    | 43.1    | 58,702     |
| 三井E&Sホールディングス | 54.3    | —       | —          |
| 川崎重工業         | 109.1   | 116.6   | 262,699    |
| 名村造船所         | 42.1    | 46.8    | 16,146     |
| サノヤスホールディングス  | 17.2    | —       | —          |
| 日本車輛製造        | 5.1     | 5.7     | 11,753     |
| 三菱ロジスネクスト     | 18.6    | 21.7    | 16,730     |
| 近畿車輛          | 2.4     | 2.5     | 2,915      |
| 日産自動車         | 1,653.3 | 1,929.9 | 978,652    |
| いすゞ自動車        | 372.2   | 500.4   | 759,106    |
| トヨタ自動車        | 1,420.2 | 8,013.7 | 17,457,845 |
| 日野自動車         | 175.1   | 204.3   | 143,010    |
| 三菱自動車工業       | 518.9   | 605.7   | 201,698    |
| エフテック         | 9.8     | 11.1    | 5,960      |
| レシップホールディングス  | 5.6     | 6.5     | 3,627      |
| GMB           | 2.5     | 2.9     | 2,056      |
| ファルテック        | 2.4     | 2.9     | 1,835      |
| 武蔵精密工業        | 31.2    | 36.5    | 48,545     |
| 日産車体          | 20.5    | 24      | 13,680     |
| 新明和工業         | 39.6    | 45.1    | 43,656     |
| 極東開発工業        | 24.2    | 29      | 38,135     |
| トビー工業         | 11.5    | 13      | 13,676     |
| ティラド          | 4.4     | 4       | 8,996      |
| タチエス          | 21.5    | 28.1    | 28,830     |
| NOK           | 67.8    | 73.3    | 84,441     |
| フタバ産業         | 35.1    | 39.4    | 14,735     |
| KYB           | 15.7    | 16.1    | 45,981     |
| 大同メタル工業       | 29      | 31.4    | 17,458     |
| プレス工業         | 69.5    | 77.1    | 30,146     |
| ミクニ           | 17.8    | 20.2    | 7,635      |
| 太平洋工業         | 29.4    | 33.2    | 32,536     |
| 河西工業          | 18.9    | 20.1    | 5,467      |
| アイシン          | 102.6   | 119.8   | 452,844    |
| マツダ           | 440     | 502.9   | 480,269    |
| 今仙電機製作所       | 12.3    | 10.7    | 6,216      |
| 本田技研工業        | 1,103.8 | 1,257.9 | 4,212,707  |
| スズキ           | 277.9   | 357.7   | 1,403,972  |
| S U B A R U   | 401.7   | 456     | 893,304    |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|------------------|---------|-------|-----------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                  | 千株      | 千株    | 千円        |
| 安永               | 6.8     | 7.5   | 5,085     |
| ヤマハ発動機           | 198.1   | 213.5 | 593,530   |
| T B K            | 16.6    | 17.4  | 5,985     |
| エクセディ            | 19      | 24.7  | 41,570    |
| 豊田合成             | 45.3    | 50.7  | 97,039    |
| 愛三工業             | 21.9    | 25.6  | 19,046    |
| 盟和産業             | 2.1     | 2.3   | 2,329     |
| 日本プラス            | 11.8    | 12.5  | 6,137     |
| ヨロズ              | 12      | 14.4  | 10,656    |
| エフ・シー・シー         | 22.9    | 26.7  | 36,312    |
| シマノ              | 52.5    | 63.9  | 1,427,845 |
| テイ・エス テック        | 65.1    | 69.1  | 97,016    |
| ジャムコ             | 8.2     | 9.6   | 7,497     |
| 精密機器 (2.5%)      |         |       |           |
| テルモ              | 429.7   | 463.1 | 1,725,973 |
| クリエートメディック       | 4.6     | 4.9   | 4,777     |
| 日機装              | 45.3    | 46.6  | 38,911    |
| 日本エム・ディ・エム       | 8.1     | 9.4   | 14,137    |
| 島津製作所            | 180.4   | 205.6 | 888,192   |
| J M S            | 11.8    | 13.4  | 7,678     |
| クボテック            | 3.6     | 3.5   | 892       |
| 長野計器             | 10.1    | 11.5  | 12,788    |
| ブイ・テクノロジ         | 6.6     | 7.2   | 22,032    |
| 東京計器             | 8.9     | 10.4  | 11,824    |
| 愛知時計電機           | 1.8     | 6.7   | 9,587     |
| インターアクション        | 7       | 8.2   | 15,457    |
| オーバル             | 12.5    | 14.6  | 4,482     |
| 東京精密             | 23.6    | 26.9  | 117,956   |
| マニー              | 55.8    | 63.4  | 89,267    |
| ニコン              | 214.1   | 243.5 | 350,640   |
| トプコン             | 70.6    | 76.9  | 122,578   |
| オリンパス            | 775.7   | 836.2 | 1,851,764 |
| 理研計器             | 12.4    | 12.4  | 47,554    |
| タムロン             | 11.3    | 12.3  | 28,622    |
| H O Y A          | 275.9   | 319.3 | 3,994,443 |
| シード              | 5.4     | 7.6   | 3,974     |
| ノーリツ銅機           | 12.6    | 14.7  | 30,546    |
| A & Dホロンホールディングス | 11.8    | 18.4  | 15,676    |
| 朝日インテック          | 147.6   | 179.4 | 425,895   |
| シチズン時計           | 177.9   | 181   | 86,880    |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|-------------------|---------|-------|-----------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                   | 千株      | 千株    | 千円        |
| リズム               | 4.4     | 5.1   | 8,787     |
| 大研医器              | 11.1    | 12.9  | 6,514     |
| メニコン              | 21.5    | 53.1  | 138,856   |
| シンシア              | 1.5     | 1.7   | 720       |
| 松風                | 6.4     | 6.4   | 10,105    |
| セイコーホールディングス      | 19.8    | 23.1  | 47,955    |
| ニプロ               | 104.5   | 119.1 | 120,648   |
| その他製品 (2.4%)      |         |       |           |
| 中本パックス            | 3.6     | 4.6   | 7,217     |
| スノーピーク            | 8.3     | 21.3  | 45,901    |
| パラマウントベッドホールディングス | 26.9    | 31.4  | 66,411    |
| トランザクション          | 7.7     | 9.5   | 9,348     |
| 粧美堂               | 4.1     | 4.5   | 1,899     |
| ニホンフラッシュ          | 12      | 13.6  | 12,892    |
| 前田工織              | 15.4    | 16.9  | 44,649    |
| 永大産業              | 18.3    | 20.2  | 5,494     |
| アートネイチャー          | 13.5    | 14    | 10,346    |
| バンダイナムコホールディングス   | 115.9   | 142.9 | 1,177,353 |
| アイフィスジャパン         | 3.6     | 4.2   | 2,629     |
| 共立印刷              | 23.4    | 25.7  | 3,392     |
| SHOEI             | 13.2    | 15    | 70,425    |
| フランスベッドホールディングス   | 18      | 21    | 18,354    |
| パイロットコーポレーション     | 23.7    | 26.2  | 134,144   |
| 萩原工業              | 7.8     | 10.3  | 10,969    |
| トップパン・フォームズ       | 25      | —     | —         |
| フジシールインターナショナル    | 28.8    | 37.7  | 65,975    |
| タカラトミー            | 62.9    | 67.6  | 77,469    |
| 広済堂ホールディングス       | 9.8     | 10.1  | 7,878     |
| エステールホールディングス     | 3.7     | 3.8   | 2,420     |
| タカノ               | 4.8     | 5.6   | 4,452     |
| プロネクス             | 11.2    | 12.7  | 13,284    |
| ホクシン              | 8.6     | 11.5  | 2,058     |
| ウッドワン             | 4.7     | 5     | 6,420     |
| 大建工業              | 9.4     | 9.2   | 19,356    |
| 凸版印刷              | 213.1   | 236.9 | 516,915   |
| 大日本印刷             | 169.3   | 188.1 | 520,284   |
| 共同印刷              | 4.3     | 4.5   | 12,325    |
| N I S S H A       | 28.8    | 31.9  | 47,562    |
| 光村印刷              | 1.2     | 1.4   | 1,821     |
| TAKARA & COMPANY  | 6.9     | 9.8   | 18,884    |

| 銘柄            | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|---------------|---------|---------|-----------|
|               | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|               | 千株      | 千株      | 千円        |
| アシックス         | 124     | 138.3   | 259,589   |
| ツツミ           | 3.5     | 4.1     | 7,781     |
| ローランド         | 10.9    | 11.4    | 48,279    |
| 小松ウオール工業      | 4.3     | 5       | 9,175     |
| ヤマハ           | 83.4    | 95.2    | 475,524   |
| 河合楽器製作所       | 3.9     | 4.4     | 12,676    |
| クリナップ         | 13      | 15.2    | 7,980     |
| ビジョン          | 90      | 98.9    | 210,063   |
| オリバー          | 3       | —       | —         |
| 兼松サステック       | 0.9     | 1.1     | 1,912     |
| キングジム         | 11.7    | 13.6    | 12,580    |
| リンテック         | 30      | 33.8    | 81,660    |
| イトーキ          | 27.8    | 30.2    | 10,811    |
| 任天堂           | 80.2    | 92.4    | 5,207,664 |
| 三菱鉛筆          | 23.1    | 25.3    | 33,750    |
| タカラスタンダード     | 29      | 31.3    | 40,971    |
| コクヨ           | 67.2    | 76.3    | 133,067   |
| ナカバヤシ         | 13.8    | 14.1    | 6,880     |
| グローブライド       | 6.8     | 13.8    | 33,451    |
| オカムラ          | 48.2    | 52.8    | 63,148    |
| 美津濃           | 13.9    | 15.3    | 31,931    |
| 電気・ガス業 (1.3%) |         |         |           |
| 東京電力ホールディングス  | 1,189.1 | 1,224.7 | 635,619   |
| 中部電力          | 428.9   | 487.9   | 656,225   |
| 関西電力          | 531.2   | 604.2   | 766,729   |
| 中国電力          | 202.2   | 249.2   | 228,018   |
| 北陸電力          | 128.2   | 146.1   | 81,085    |
| 東北電力          | 328.3   | 374.8   | 290,470   |
| 四国電力          | 116.5   | 143.6   | 115,023   |
| 九州電力          | 309.6   | 329.3   | 290,113   |
| 北海道電力         | 131.2   | 142.2   | 73,233    |
| 沖縄電力          | 27.3    | 34.7    | 43,201    |
| 電源開発          | 111.5   | 133.3   | 243,939   |
| エフオン          | 8.5     | 9.9     | 5,296     |
| イーレックス        | 20.6    | 23.1    | 42,273    |
| レノバ           | 23.8    | 32.1    | 48,663    |
| 東京瓦斯          | 269.6   | 306.2   | 779,891   |
| 大阪瓦斯          | 253.9   | 289.3   | 698,080   |
| 東邦瓦斯          | 68.9    | 71.3    | 225,308   |
| 北海道瓦斯         | 7.5     | 8.1     | 12,530    |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|------------------|---------|-------|-----------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                  | 千株      | 千株    | 千円        |
| 広島ガス             | 28.9    | 30.3  | 9,726     |
| 西部ガスホールディングス     | 15.8    | 17.5  | 35,980    |
| 静岡ガス             | 39.8    | 41.3  | 37,500    |
| メタウォーター          | 15.8    | 17    | 34,731    |
| 陸運業 (3.1%)       |         |       |           |
| SBSホールディングス      | 10.4    | 12.1  | 35,549    |
| 東武鉄道             | 146.1   | 156.4 | 464,977   |
| 相鉄ホールディングス       | 48.1    | 51.1  | 114,617   |
| 東急               | 353.6   | 402.2 | 635,073   |
| 京浜急行電鉄           | 180     | 200.8 | 260,236   |
| 小田急電鉄            | 224.5   | 230.9 | 434,553   |
| 京王電鉄             | 78.3    | 80.6  | 376,402   |
| 京成電鉄             | 105.1   | 108   | 351,000   |
| 富士急行             | 19.1    | 18.6  | 71,331    |
| 新京成電鉄            | 3.6     | 3.8   | 10,100    |
| 東日本旅客鉄道          | 246.7   | 275.2 | 1,819,072 |
| 西日本旅客鉄道          | 124.9   | 190.1 | 906,777   |
| 東海旅客鉄道           | 116.6   | 129.1 | 2,086,256 |
| 西武ホールディングス       | 168.9   | 208.2 | 267,953   |
| 鴻池運輸             | 22.3    | 25.1  | 28,764    |
| 西日本鉄道            | 38.9    | 43.3  | 111,540   |
| ハマキョウレックス        | 10.8    | 11.3  | 33,289    |
| サカイ引越センター        | 6.4     | 7.5   | 34,425    |
| 近鉄グループホールディングス   | 132.8   | 151.8 | 567,732   |
| 阪急阪神ホールディングス     | 177.1   | 189.5 | 649,985   |
| 南海電気鉄道           | 62.9    | 67.7  | 166,745   |
| 京阪ホールディングス       | 59.1    | 66.1  | 193,210   |
| 神戸電鉄             | 3.2     | 3.7   | 11,951    |
| 名古屋鉄道            | 109.2   | 163.2 | 350,716   |
| 山陽電気鉄道           | 9.5     | 11.6  | 23,930    |
| アルプス物流           | 9.3     | 10.8  | 11,469    |
| 日本通運             | 46      | —     | —         |
| ヤマトホールディングス      | 186     | 217.2 | 527,578   |
| 山九               | 34.1    | 39.7  | 147,882   |
| 丸運               | 7.6     | 8.3   | 1,983     |
| 丸全昭和運輸           | 10.8    | 11.9  | 37,842    |
| センコーグループホールディングス | 73.2    | 77.2  | 68,630    |
| トナミホールディングス      | 3.2     | 3.5   | 12,512    |
| ニッコンホールディングス     | 44.6    | 50.9  | 101,494   |
| 日本石油輸送           | 1.4     | 1.7   | 4,341     |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|------------------------|---------|-------|-----------|
|                        | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                        | 千株      | 千株    | 千円        |
| 福山通運                   | 17      | 23.6  | 90,034    |
| セイノーホールディングス           | 99.4    | 98.5  | 107,857   |
| エスライン                  | 3.6     | 4.5   | 3,924     |
| 神奈川中央交通                | 3.3     | 3.8   | 12,540    |
| 日立物流                   | 29.2    | 29.9  | 254,449   |
| 丸和運輸機関                 | 28      | 30.6  | 45,869    |
| C＆Fロジホールディングス          | 13.4    | 14.8  | 16,487    |
| 九州旅客鉄道                 | 102.7   | 114.6 | 289,365   |
| S Gホールディングス            | 250.9   | 282   | 656,778   |
| NIPPON EXPRESSホールディン   | —       | 51.1  | 388,871   |
| <b>海運業 (0.6%)</b>      |         |       |           |
| 日本郵船                   | 111     | 129.6 | 1,201,392 |
| 商船三井                   | 78.8    | 251.3 | 791,595   |
| 川崎汽船                   | 40.9    | 47.7  | 391,140   |
| N Sユニテッド海運             | 6.3     | 8.1   | 31,023    |
| 明治海運                   | 14.1    | 17.1  | 12,431    |
| 飯野海運                   | 61.6    | 68.2  | 47,058    |
| 共栄タンカー                 | 2.3     | 2.7   | 3,045     |
| 乾汽船                    | 9.1     | 10.2  | 16,595    |
| <b>空運業 (0.4%)</b>      |         |       |           |
| 日本航空                   | 323.4   | 348   | 742,632   |
| ANAホールディングス            | 358.3   | 385.5 | 926,163   |
| バスコ                    | 2.6     | 2.9   | 3,767     |
| <b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b> |         |       |           |
| トランコム                  | 4       | 4.3   | 30,530    |
| 日新                     | 10.6    | 12    | 19,440    |
| 三菱倉庫                   | 45.9    | 46.2  | 142,527   |
| 三井倉庫ホールディングス           | 14.1    | 16    | 37,888    |
| 住友倉庫                   | 46.9    | 51    | 103,377   |
| 澁澤倉庫                   | 7.3     | 8.8   | 19,685    |
| 東陽倉庫                   | 22.3    | 24.6  | 7,576     |
| 日本トランスシティ              | 29.2    | 31.8  | 18,539    |
| ケイヒン                   | 2.6     | 2.7   | 3,599     |
| 中央倉庫                   | 8.1     | 9     | 8,532     |
| 川西倉庫                   | 2.4     | 2.8   | 3,155     |
| 安田倉庫                   | 10.9    | 12    | 11,532    |
| フェイスホールディングス           | 2.4     | 3.3   | 2,240     |
| 東洋埠頭                   | 4       | 4.6   | 6,518     |
| 宇徳                     | 9.5     | —     | —         |
| 上組                     | 73      | 82.1  | 182,754   |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------------|---------|-------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |
| サンリツ                 | 3.4     | 4.2   | 3,267     |
| キムラユニティ              | 3.5     | 4     | 5,760     |
| キューソー流通システム          | 3.3     | 7.7   | 8,277     |
| 近鉄エクスプレス             | 25.1    | 29.3  | 89,951    |
| 東海運                  | 7.6     | 8.8   | 2,613     |
| エーアイテイ               | 8.3     | 9.7   | 14,724    |
| 内外トランスライン            | 4.7     | 6     | 11,394    |
| 日本コンセプト              | 4.2     | 4.9   | 6,526     |
| <b>情報・通信業 (8.7%)</b> |         |       |           |
| NECネットエスアイ           | 45.5    | 53.1  | 95,633    |
| クロスキャット              | 3.6     | 8.7   | 7,412     |
| システナ                 | 49.1    | 229.1 | 94,847    |
| デジタルアーツ              | 8       | 8.6   | 58,222    |
| 日鉄ソリューションズ           | 19.9    | 24.8  | 92,132    |
| キューブシステム             | 7.3     | 8.1   | 7,241     |
| WOW WORLD            | 2.1     | 2.2   | 2,415     |
| コア                   | 5.8     | 6.8   | 9,384     |
| 手問いらず                | —       | 2.3   | 10,925    |
| ラクーンホールディングス         | 9.7     | 13.6  | 18,985    |
| ソリトンシステムズ            | 6.9     | 8     | 10,336    |
| ソフトクリエイトホールディングス     | 5.4     | 7     | 26,285    |
| T I S                | 137.6   | 148.9 | 437,617   |
| J N Sホールディングス        | 6.8     | 7.4   | 2,908     |
| 電算システム               | 5.2     | —     | —         |
| グリー                  | 84.4    | 73.1  | 66,813    |
| GMOペパボ               | 1.2     | 1.7   | 3,219     |
| コーエーテクモホールディングス      | 36.6    | 51.2  | 210,176   |
| 三菱総合研究所              | 5.9     | 8.3   | 35,731    |
| ボルテージ                | 3.7     | 4.3   | 1,513     |
| 電算                   | 1.5     | 1.8   | 3,972     |
| AG S                 | 7       | 7.6   | 5,730     |
| ファインデックス             | 11.6    | 13.5  | 8,032     |
| ブレインパッド              | 3.6     | 13.6  | 15,449    |
| K L a b              | 25.2    | 28.8  | 12,297    |
| ポータルトゥウィンホールディングス    | 18.3    | 23.3  | 23,416    |
| イーブックイニシアティブジャパン     | 2.2     | —     | —         |
| ネクソン                 | 348.1   | 363.6 | 1,070,438 |
| アイスタイル               | 42      | 41.4  | 6,417     |
| エムアップホールディングス        | 3.6     | 18.5  | 17,482    |
| エイチーム                | 9.5     | 10.7  | 7,468     |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|----------------------|---------|-------|---------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                      | 千株      | 千株    | 千円      |
| エニグモ                 | 13      | 17.3  | 9,532   |
| テクノスジャパン             | 10.7    | 12.4  | 5,518   |
| e n i s h            | 7.2     | 10.8  | 3,380   |
| コロブラ                 | 45.2    | 52.8  | 32,524  |
| オルトプラス               | 10.6    | 12.1  | 3,751   |
| ブロードリーフ              | 68.2    | 79.6  | 28,656  |
| クロス・マーケティンググループ      | 6.1     | 6.1   | 5,233   |
| デジタルハーツホールディングス      | 6.2     | 7.3   | 12,052  |
| システム情報               | 10.3    | 12    | 10,908  |
| メディアドゥ               | 5.4     | 5.6   | 9,441   |
| じげん                  | 34      | 45.4  | 13,120  |
| ブイキューブ               | 7.5     | 16.3  | 17,196  |
| エンカレッジ・テクノロジー        | 2.4     | 3.5   | 1,816   |
| サイバーリンクス             | 4.5     | 5.4   | 5,535   |
| ディー・エル・イー            | 11.1    | 10.8  | 3,088   |
| フィックスターズ             | 14.6    | 16.5  | 12,243  |
| CARTA HOLDINGS       | 5.6     | 6.5   | 14,898  |
| オブティム                | 9.6     | 11.2  | 8,982   |
| セレス                  | 4.5     | 6     | 7,962   |
| SHIFT                | 6.9     | 8.7   | 185,745 |
| ティーガイア               | 14.6    | 14.2  | 24,296  |
| セック                  | 2       | 2.3   | 5,018   |
| 日本アジアグループ            | 13.3    | —     | —       |
| テクマトリックス             | 21.3    | 27.1  | 43,197  |
| プロシップ                | 4       | 5.3   | 7,287   |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 33.2    | 41.7  | 107,419 |
| GMOペイメントゲートウェイ       | 26.3    | 31.1  | 303,225 |
| ザッパラス                | 5.3     | 6     | 2,502   |
| システムリサーチ             | 4       | 4.7   | 9,033   |
| インターネットイニシアティブ       | 36.6    | 42.8  | 167,990 |
| さくらインターネット           | 14.7    | 17.2  | 9,752   |
| ヴィンクス                | 3.9     | 4.5   | 4,936   |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 3.1     | 3.6   | 18,108  |
| SRAホールディングス          | 7.3     | 7.7   | 21,544  |
| システムインテグレータ          | 3.9     | 5.1   | 2,442   |
| 朝日ネット                | 11.1    | 14.6  | 8,351   |
| eBASE                | 16.4    | 19.2  | 7,968   |
| アバント                 | 14.7    | 17.2  | 20,485  |
| アドソル日進               | 4.9     | 5.7   | 8,789   |
| ODKソリューションズ          | 2.9     | 3.3   | 1,986   |

| 銘柄                          | 期首(前期末) | 当 期 末 |        |
|-----------------------------|---------|-------|--------|
|                             | 株 数     | 株 数   | 評 価 額  |
|                             | 千株      | 千株    | 千円     |
| フリービット                      | 8.2     | 8.3   | 7,644  |
| コムチュア                       | 12.6    | 18    | 51,336 |
| サイバーコム                      | 2.4     | 2.4   | 2,690  |
| アステリア                       | 9.9     | 11.6  | 10,208 |
| アイル                         | 7.6     | 8.5   | 11,109 |
| マークラインズ                     | 5.7     | 8.1   | 20,241 |
| メディカル・データ・ビジョン              | 15.7    | 20.3  | 18,939 |
| g u m i                     | 19      | 22.2  | 11,499 |
| ショーケース                      | 3       | 3.5   | 1,501  |
| モバイルファクトリー                  | 3.1     | 3.6   | 3,549  |
| テラスカイ                       | 4.4     | 5.8   | 7,325  |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー       | 6.1     | 7.1   | 8,221  |
| P C I ホールディングス              | 5.2     | 6.9   | 6,741  |
| パイプドHD                      | 2.8     | 2.9   | 7,685  |
| アイビーシー                      | 2.2     | 2.5   | 1,205  |
| ネオジャパン                      | 2.6     | 4.5   | 5,211  |
| P R T I M E S               | 2.9     | 3.4   | 6,830  |
| ラクス                         | 41.4    | 73.7  | 98,242 |
| ランドコンピュータ                   | 2.1     | 3.7   | 3,330  |
| ダブルスタンダード                   | 1.8     | 4.8   | 8,457  |
| オープンドア                      | 8.2     | 9.5   | 15,618 |
| マイネット                       | 4.5     | 5.7   | 2,924  |
| アカツキ                        | 5.5     | 7.2   | 20,772 |
| ベネフィットジャパン                  | 1       | 1.2   | 2,406  |
| U b i c o mホールディングス         | 3.6     | 4.2   | 10,915 |
| カナミックネットワーク                 | 14.7    | 17.9  | 8,753  |
| ノムラシステムコーポレーション             | 6       | 8.3   | 1,884  |
| チェンジ                        | 25.3    | 30.9  | 53,271 |
| シンクロ・フード                    | 8.2     | 8.2   | 2,353  |
| オークネット                      | 7.3     | 8.5   | 12,469 |
| キャピタル・アセット・プランニング           | 2.7     | 3.1   | 2,241  |
| セグエグループ                     | 3.5     | 4.2   | 2,310  |
| エイトレッド                      | 2.6     | 2.3   | 4,606  |
| A O I T Y O H o l d i n g s | 13.9    | —     | —      |
| マクロミル                       | 28.1    | 33.6  | 36,859 |
| ビーグリー                       | 2.7     | 3.8   | 5,095  |
| オロ                          | 4.3     | 5.1   | 9,343  |
| ユーザローカル                     | 2.1     | 4.9   | 7,849  |
| テモナ                         | 3       | 3.3   | 1,214  |
| ニーズウェル                      | 2.8     | 4     | 2,712  |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|----------------------|---------|-------|---------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                      | 千株      | 千株    | 千円      |
| マネーフォワード             | —       | 32.6  | 112,959 |
| サインポスト               | 3.3     | 5.2   | 4,383   |
| 電算システムホールディングス       | —       | 6.6   | 16,909  |
| ソルクシーズ               | 5.3     | 13.6  | 5,168   |
| フェイス                 | 4.2     | 4.2   | 3,036   |
| プロトコーポレーション          | 16.4    | 17    | 17,544  |
| ハイマックス               | 3.9     | 4.3   | 5,456   |
| 野村総合研究所              | 238.9   | 300   | 999,000 |
| サイバネットシステム           | 9.8     | 11.4  | 9,085   |
| CEホールディングス           | 7.3     | 8.2   | 3,731   |
| 日本システム技術             | 2.4     | 3     | 7,200   |
| インテージホールディングス        | 17.2    | 18.5  | 28,490  |
| 東邦システムサイエンス          | 3.6     | 4.2   | 3,759   |
| ソースネクスト              | 65.2    | 69.2  | 11,971  |
| インフォコム               | 12.5    | 17.6  | 36,766  |
| シンプレクス・ホールディングス      | —       | 25.4  | 45,389  |
| HEROZ                | 3.9     | 4.6   | 4,052   |
| ラクスル                 | 14.9    | 18.1  | 41,992  |
| I P S                | 3.2     | 4.4   | 9,614   |
| F I G                | 14.9    | 17.4  | 4,941   |
| システムサポート             | 4.1     | 5.8   | 5,927   |
| イーソル                 | 7.5     | 9.8   | 5,919   |
| アルテリア・ネットワークス        | 15.2    | 18.6  | 25,389  |
| E d u L a b          | 1.3     | —     | —       |
| 東海ソフト                | 2.1     | 2.5   | 2,330   |
| ウイングアーク 1 s t        | 7.2     | 12.2  | 15,738  |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン | 3.1     | 3.6   | 5,382   |
| サーバーワークス             | 1.3     | 2.7   | 5,332   |
| 東名                   | 1.3     | 1.4   | 1,045   |
| ヴィッツ                 | 1.3     | 1.5   | 1,758   |
| トピラシステムズ             | 1.8     | 3.2   | 2,406   |
| S a n s a n          | 12.2    | 55    | 61,600  |
| L i n k - U          | 2.5     | 2.9   | 1,844   |
| ギフトィ                 | 8.3     | 14.2  | 12,936  |
| ベース                  | 1.6     | 2.7   | 16,065  |
| J M D C              | —       | 20.1  | 106,731 |
| フォーカスシステムズ           | 9.2     | 10.5  | 9,355   |
| クレスコ                 | 9       | 11.7  | 21,785  |
| フジ・メディア・ホールディングス     | 142.7   | 150.7 | 171,345 |
| オービック                | 43.4    | 50.6  | 922,944 |

| 銘柄                      | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|-------------------------|---------|---------|-----------|
|                         | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                         | 千株      | 千株      | 千円        |
| ジャストシステム                | 19.6    | 22.8    | 121,980   |
| T D C ソフト               | 12      | 13.6    | 15,436    |
| Z ホールディングス              | 1,889.8 | 2,315.6 | 1,010,527 |
| トレンドマイクロ                | 73.5    | 83.4    | 600,480   |
| I D ホールディングス            | 5.2     | 10.1    | 8,383     |
| 日本オラクル                  | 27.9    | 26.1    | 220,806   |
| アルファシステムズ               | 3.7     | 4.3     | 15,996    |
| フューチャー                  | 16.6    | 33.9    | 58,274    |
| C A C H o l d i n g s   | 8.9     | 9       | 12,213    |
| S B テクノロジー              | 4.9     | 6.9     | 14,193    |
| トーセ                     | 3.7     | 4.2     | 3,003     |
| オービックビジネスコンサルタント        | 14.1    | 15.3    | 66,708    |
| 伊藤忠テクノソリューションズ          | 62.7    | 73.2    | 219,966   |
| アイティフォー                 | 17.9    | 19.4    | 15,481    |
| 東計電算                    | 2       | 1.9     | 10,849    |
| エックスネット                 | 2.2     | 2.5     | 2,495     |
| 大塚商会                    | 74.4    | 86.9    | 359,331   |
| サイボウズ                   | 16.1    | 21.4    | 25,979    |
| 電通国際情報サービス              | 17      | 22.1    | 85,416    |
| A C C E S S             | 17.2    | 18.1    | 10,172    |
| デジタルガレージ                | 22.7    | 26.5    | 108,782   |
| EMシステムズ                 | 22.7    | 26.5    | 25,042    |
| ウェザーニューズ                | 4.1     | 5.2     | 33,072    |
| C I J                   | 9.4     | 12.4    | 9,275     |
| ビジネスエンジニアリング            | 1.4     | 1.8     | 7,047     |
| 日本エンタープライズ              | 14      | 16.3    | 2,673     |
| WOWOW                   | 6.6     | 7.3     | 11,322    |
| スカラ                     | 12.2    | 13.5    | 10,111    |
| インテリジェント ウェイブ           | 8       | 8       | 4,656     |
| I M A G I C A G R O U P | 11.7    | 12.9    | 8,359     |
| ネットワンシステムズ              | 56.1    | 59.2    | 175,113   |
| システムソフト                 | 28.4    | 38.8    | 3,918     |
| アルゴグラフィックス              | 10.7    | 12.5    | 37,300    |
| マーベラス                   | 21.7    | 25.3    | 19,050    |
| エイベックス                  | 23.7    | 27.7    | 37,505    |
| B I P R O G Y           | 47.7    | 50.1    | 143,286   |
| 兼松エレクトロニクス              | 7.5     | 8.7     | 32,929    |
| 都築電気                    | 6.1     | 7.9     | 11,581    |
| T B S ホールディングス          | 91.2    | 90.1    | 158,666   |
| 日本テレビホールディングス           | 114.8   | 134     | 170,046   |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|----------------------|---------|---------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株      | 千円        |
| 朝日放送グループホールディングス     | 13.7    | 14.9    | 10,564    |
| テレビ朝日ホールディングス        | 42.5    | 38.6    | 58,247    |
| スカパーJ S A Tホールディングス  | 90.5    | 136     | 63,648    |
| テレビ東京ホールディングス        | 9.8     | 10.8    | 21,654    |
| 日本BS放送               | 4.6     | 5.4     | 5,497     |
| ビジョン                 | 17.1    | 26.7    | 32,814    |
| スマートバリュー             | 3.6     | 3.7     | 2,053     |
| USEN-NEXT HOLDINGS   | 13.1    | 14.2    | 29,053    |
| ワイヤレスゲート             | 5.6     | 6.6     | 1,947     |
| コネクシオ                | 7.8     | 11.4    | 16,507    |
| 日本通信                 | 121.5   | 133.5   | 23,095    |
| クロップス                | 2.5     | 2.9     | 2,868     |
| 日本電信電話               | 1,609   | 1,719.7 | 6,622,564 |
| KDDI                 | 1,103.2 | 1,170.6 | 5,083,915 |
| ソフトバンク               | 1,250.1 | 2,432.1 | 3,677,335 |
| 光通信                  | 16.2    | 18.5    | 276,945   |
| エムティーアイ              | 13.3    | 14.5    | 6,467     |
| GMOインターネット           | 48.7    | 56.2    | 135,385   |
| ファイバーゲート             | 4.5     | 7.3     | 8,628     |
| アйдママーケティングコミュニケーション | 3.5     | 3.4     | 965       |
| KADOKAWA             | 35.6    | 87.2    | 268,576   |
| 学研ホールディングス           | 19.4    | 22.7    | 19,703    |
| ゼンリン                 | 24.9    | 26.2    | 23,999    |
| 昭文社ホールディングス          | 5.5     | 6.5     | 2,626     |
| インプレスホールディングス        | 11.4    | 13.3    | 2,992     |
| アイネット                | 7.1     | 8       | 9,864     |
| 松竹                   | 9.1     | 10.2    | 130,152   |
| 東宝                   | 81.2    | 94.7    | 454,560   |
| 東映                   | 4.5     | 5       | 85,600    |
| エヌ・ティ・ティ・データ         | 366.3   | 427.5   | 968,287   |
| ビー・シー・エー             | 2       | 9.4     | 12,032    |
| ビジネスブレイン太田昭和         | 4.7     | 4.7     | 7,073     |
| D T S                | 28.5    | 29.9    | 88,683    |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 58.7    | 74.7    | 394,416   |
| シーイーシー               | 14.7    | 17.2    | 20,812    |
| カブコン                 | 117.9   | 151.4   | 503,405   |
| アイ・エス・ビー             | 6.3     | 7.5     | 7,575     |
| ジャステック               | 8.8     | 9.3     | 10,509    |
| S C S K              | 31.7    | 111.2   | 239,858   |
| 日本システムウエア            | 4.5     | 6.1     | 13,981    |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|---------------------|---------|-------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株    | 千円        |
| アイネス                | 13.5    | 15    | 22,050    |
| T K C               | 23.3    | 26.3  | 93,628    |
| 富士ソフト               | 14.7    | 16.6  | 113,710   |
| N S D               | 44.2    | 50.3  | 116,243   |
| コナミホールディングス         | 50      | 58.3  | 441,331   |
| 福井コンピュータホールディングス    | 6.3     | 7.4   | 23,902    |
| J B C Cホールディングス     | 9.3     | 10.8  | 16,102    |
| ミロク情報サービス           | 13.6    | 14.1  | 18,104    |
| ソフトバンクグループ          | 1,091.5 | 962.9 | 4,718,210 |
| <b>卸売業 (5.8%)</b>   |         |       |           |
| ハウスイ                | 1.1     | —     | —         |
| 高千穂交易               | 5.3     | 6     | 9,072     |
| オルパヘルスケアホールディングス    | 2.2     | 2.6   | 4,427     |
| 伊藤忠食品               | 3.3     | 3.7   | 17,815    |
| エレマテック              | 11      | 12.9  | 15,222    |
| J A L U X           | 3.9     | 1.3   | 3,320     |
| あらた                 | 11      | 12.5  | 46,312    |
| トーマンデバイス            | 1.8     | 2.4   | 13,608    |
| 東京エレクトロン デバイス       | 4.5     | 4.8   | 26,784    |
| フィールズ               | 12.1    | 14.1  | 12,069    |
| 双日                  | 762.6   | 173.8 | 343,255   |
| アルフレッサ ホールディングス     | 143.2   | 175.1 | 318,682   |
| 横浜冷凍                | 38.7    | 43.2  | 37,152    |
| 神栄                  | 1.9     | 2.3   | 1,966     |
| ラサ商事                | 7.3     | 7.7   | 7,522     |
| アルコニックス             | 14.7    | 20.2  | 27,492    |
| 神戸物産                | 95.3    | 120.5 | 350,655   |
| ハイパー                | 2.8     | 4     | 1,876     |
| あい ホールディングス         | 19.7    | 23    | 38,226    |
| ディーブイエックス           | 4.2     | 5.5   | 5,566     |
| ダイワボウホールディングス       | 62.9    | 75.1  | 124,741   |
| マクニカ・富士エレホールディングス   | 32.9    | 38.4  | 105,715   |
| ラクト・ジャパン            | 6       | 5.5   | 11,044    |
| グリムス                | 4.1     | 7.2   | 11,498    |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 24      | 27.2  | 20,100    |
| 八洲電機                | 10.7    | 11.6  | 10,892    |
| メディアスホールディングス       | 7.8     | 9.2   | 8,859     |
| レスターホールディングス        | 14.4    | 15.3  | 31,028    |
| ジューテックホールディングス      | 3.1     | 3.5   | 3,664     |
| 大光                  | 5.3     | 6.8   | 4,848     |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|------------------|---------|-------|---------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                  | 千株      | 千株    | 千円      |
| OCH I ホールディングス   | 4       | 4.3   | 5,276   |
| TOKAI ホールディングス   | 66.9    | 78.1  | 69,118  |
| 黒谷               | 3.7     | 4.4   | 2,534   |
| C o m i n i x    | 2.4     | 2.8   | 2,038   |
| 三洋貿易             | 13.9    | 15.7  | 15,134  |
| ビューティガレージ        | 2.2     | 2.6   | 6,822   |
| ウイン・パートナーズ       | 10      | 11.6  | 11,484  |
| ミタチ産業            | 3.8     | 4     | 3,496   |
| シップヘルスケアホールディングス | 48.7    | 49.9  | 105,638 |
| 明治電機工業           | 4.7     | 5.1   | 5,247   |
| デリカフーズホールディングス   | 5.3     | 6.2   | 3,261   |
| スターティアホールディングス   | 2.7     | 3.6   | 1,908   |
| コメダホールディングス      | 30.1    | 35.2  | 78,918  |
| ビーバンドットコム        | 1.9     | 2.3   | 1,265   |
| アセンテック           | 3.5     | 5.5   | 3,811   |
| 富士興産             | 4.2     | 4     | 3,584   |
| 協栄産業             | 1.5     | 1.6   | 2,068   |
| フルサト・マルカホールディングス | —       | 15.1  | 52,397  |
| ヤマエグループホールディングス  | —       | 10.2  | 10,669  |
| 小野建              | 12.4    | 15.2  | 22,708  |
| 南陽               | 2.8     | 3.2   | 5,760   |
| 佐鳥電機             | 8.6     | 10    | 12,720  |
| エコートレーディング       | 2.9     | 3.4   | 1,938   |
| 伯東               | 8.4     | 9.8   | 28,302  |
| コンドーテック          | 10.7    | 12    | 13,080  |
| 中山福              | 7.9     | 8.5   | 2,941   |
| ナガイレーベン          | 18.3    | 20.7  | 39,764  |
| 三菱食品             | 15.2    | 15.5  | 47,430  |
| 松田産業             | 10.1    | 11.7  | 25,857  |
| 第一興商             | 27.4    | 30.6  | 109,395 |
| メディバルホールディングス    | 138.4   | 165.7 | 368,516 |
| S P K            | 5.9     | 6.4   | 8,345   |
| 萩原電気ホールディングス     | 5.1     | 5.8   | 10,991  |
| アズワン             | 9.9     | 23.1  | 147,840 |
| スズデン             | 4.8     | 5.4   | 10,611  |
| 尾家産業             | 4       | 4.1   | 3,644   |
| シモジマ             | 8.4     | 9.9   | 9,038   |
| ドウシシャ            | 13      | 15.2  | 23,560  |
| 小津産業             | 3       | 3.5   | 7,003   |
| 高速               | 7.3     | 9.2   | 14,168  |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|-----------------|---------|---------|-----------|
|                 | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                 | 千株      | 千株      | 千円        |
| たけびし            | 4.8     | 5.8     | 8,381     |
| リックス            | 3.1     | 3.5     | 5,544     |
| 丸文              | 12.2    | 13.8    | 9,342     |
| ハビネット           | 11.5    | 13      | 19,656    |
| 橋本総業ホールディングス    | 2.8     | 3.1     | 6,134     |
| 日本ライフライン        | 44.6    | 47.7    | 50,132    |
| タカショー           | 8.9     | 12.3    | 8,622     |
| マルカ             | 4.5     | —       | —         |
| I D O M         | 46.5    | 48.9    | 32,469    |
| 進和              | 8.2     | 9.5     | 19,028    |
| エスケイジャパン        | 3.3     | 3.9     | 1,684     |
| ダイトロン           | 5.8     | 6.6     | 13,239    |
| シークス            | 17.5    | 22.2    | 22,111    |
| 田中商事            | 4.2     | 4.9     | 2,944     |
| オーハシテクニカ        | 7.1     | 8.4     | 10,651    |
| 白銅              | 4.9     | 5.2     | 12,615    |
| ダイコー通産          | 1.6     | 1.9     | 2,437     |
| 伊藤忠商事           | 965.7   | 1,073.7 | 3,965,174 |
| 丸紅              | 1,361.6 | 1,531   | 1,967,335 |
| 高島              | 2.2     | 2.3     | 5,257     |
| 長瀬産業            | 75.8    | 81.9    | 154,053   |
| 蝶理              | 8.8     | 9       | 17,163    |
| 豊田通商            | 138.7   | 155.9   | 685,180   |
| 三共生興            | 20.9    | 20.6    | 11,062    |
| 兼松              | 55.2    | 58.7    | 79,362    |
| ツカモトコーポレーション    | 2.3     | 2.7     | 3,275     |
| 三井物産            | 1,121   | 1,223.9 | 3,852,837 |
| 日本紙パルプ商事        | 7.2     | 8.1     | 30,861    |
| カメイ             | 18      | 18.5    | 19,314    |
| 東都水産            | 1.6     | 0.8     | 3,572     |
| O U G ホールディングス  | 2.2     | 2.3     | 6,097     |
| スターゼン           | 10.2    | 11.6    | 22,620    |
| 山善              | 53.9    | 64.6    | 61,757    |
| 椿本興業            | 2.5     | 3.1     | 11,392    |
| 住友商事            | 871.4   | 996.1   | 1,860,714 |
| 内田洋行            | 5.9     | 6.7     | 32,193    |
| 三菱商事            | 840.6   | 1,157.5 | 4,777,002 |
| 第一実業            | 6.3     | 6.9     | 25,150    |
| キヤノンマーケティングジャパン | 34.2    | 40      | 121,800   |
| 西華産業            | 7.3     | 7.7     | 12,089    |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| 佐藤商事              | 11.4    | 12.6  | 14,439  |
| 菱洋エレクトロ           | 10.5    | 9.5   | 19,931  |
| 東京産業              | 12.5    | 14.1  | 9,827   |
| ユアサ商事             | 14.1    | 14.5  | 41,180  |
| 神鋼商事              | 3.1     | 3.6   | 13,014  |
| トルク               | 8.2     | 8.5   | 1,700   |
| 阪和興業              | 27.6    | 30.8  | 95,634  |
| 正栄食品工業            | 8.9     | 10.4  | 41,080  |
| カナデン              | 11.2    | 13.1  | 12,104  |
| 菱電商事              | 9.9     | 12.8  | 21,504  |
| フルサト工業            | 7       | —     | —       |
| 岩谷産業              | 33.1    | 37.7  | 193,024 |
| ナイス               | 5.5     | 5.3   | 9,995   |
| 昭光通商              | 2.9     | —     | —       |
| ニチモウ              | 2.1     | 2.2   | 5,662   |
| 極東貿易              | 4       | 4.6   | 10,074  |
| アステナホールディングス      | 18.4    | 22    | 9,614   |
| 三愛オブリ             | 34      | 38.5  | 36,459  |
| 稲畑産業              | 33.2    | 34    | 70,958  |
| G S I クレオス        | 6.8     | 7.7   | 9,347   |
| 明和産業              | 12.7    | 14.9  | 10,728  |
| クワザワホールディングス      | 4.9     | 6.2   | 3,050   |
| ヤマエ久野             | 10.1    | —     | —       |
| ワキタ               | 27.2    | 32.6  | 35,077  |
| 東邦ホールディングス        | 44.3    | 49    | 105,448 |
| サンゲツ              | 37.3    | 41.1  | 64,403  |
| ミツウロコグループホールディングス | 20.3    | 21.6  | 21,232  |
| シナネンホールディングス      | 5.1     | 5.7   | 18,268  |
| 伊藤忠エネクス           | 30.5    | 35.6  | 38,412  |
| サンリオ              | 38.8    | 48.3  | 122,875 |
| サンワテクノス           | 9.1     | 9.2   | 12,328  |
| リョーサン             | 15.2    | 17.4  | 41,220  |
| 新光商事              | 18.6    | 23.2  | 21,761  |
| トーホー              | 6.2     | 6.9   | 7,665   |
| 三信電気              | 7.4     | 7.1   | 10,721  |
| 東陽テクニカ            | 13.6    | 15.9  | 16,599  |
| モスフードサービス         | 19.5    | 21.1  | 63,616  |
| 加賀電子              | 12.5    | 14.1  | 43,921  |
| ソーダニッカ            | 13.1    | 15    | 9,570   |
| 立花エレテック           | 10.2    | 11.8  | 19,163  |

| 銘柄                          | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-----------------------------|---------|-------|---------|
|                             | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                             | 千株      | 千株    | 千円      |
| フォーバル                       | 4.8     | 6.6   | 5,313   |
| P A L T A C                 | 22.1    | 22.6  | 106,107 |
| 三谷産業                        | 18.1    | 25.1  | 7,881   |
| 太平洋興発                       | 5.4     | 5.9   | 3,681   |
| 西本W i s m e t t a cホールディングス | 3.1     | 3.6   | 9,223   |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス           | 1.2     | 1.4   | 2,857   |
| コーア商事ホールディングス               | 10.3    | 10.1  | 8,564   |
| 国際紙パルプ商事                    | 29.4    | 32.3  | 9,528   |
| ヤマタネ                        | 5.9     | 7.3   | 12,110  |
| 丸紅建材リース                     | 1.3     | 1.4   | 2,450   |
| 日鉄物産                        | 9.8     | 10.9  | 56,135  |
| 泉州電業                        | 3.9     | 4.3   | 20,726  |
| トラスコ中山                      | 31.6    | 33.5  | 65,325  |
| オートバックスセブン                  | 51.2    | 52.8  | 73,920  |
| モリト                         | 10.1    | 11.7  | 8,821   |
| 加藤産業                        | 19.9    | 21.3  | 70,929  |
| 北恵                          | 3.5     | 4.1   | 3,632   |
| イノテック                       | 7.8     | 9.7   | 13,172  |
| イエローハット                     | 26.1    | 27.1  | 45,175  |
| J Kホールディングス                 | 12.5    | 12.4  | 12,672  |
| 日伝                          | 11.4    | 12.6  | 26,926  |
| 北沢産業                        | 9.3     | 10.1  | 2,232   |
| 杉南商事                        | 6.9     | 7.5   | 15,982  |
| 因幡電機産業                      | 36.8    | 42    | 108,360 |
| 東テク                         | 4.6     | 5.2   | 13,546  |
| ミスミグループ本社                   | 173.2   | 202.3 | 575,948 |
| アルテック                       | 10.1    | 10.5  | 2,604   |
| タキヒヨー                       | 4.6     | 4.7   | 4,902   |
| 蔵王産業                        | 2.7     | 3.1   | 6,010   |
| スズケン                        | 58.5    | 61.3  | 240,296 |
| ジェコス                        | 9.5     | 11.1  | 8,780   |
| グローセル                       | 15      | 18.4  | 7,507   |
| <b>小売業 (4.2%)</b>           |         |       |         |
| ローソン                        | 34.9    | 35.7  | 177,250 |
| サンエー                        | 10.4    | 11.8  | 48,321  |
| カワチ薬品                       | 9.6     | 12.5  | 25,837  |
| エービーシー・マート                  | 21.6    | 25.2  | 138,096 |
| ハードオフコーポレーション               | 6.1     | 7.1   | 5,793   |
| アスクル                        | 11.2    | 36.5  | 55,407  |
| ゲオホールディングス                  | 18.5    | 20.8  | 26,686  |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|--------------------|---------|-------|---------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |
| アダストリア             | 19.1    | 17.4  | 38,575  |
| ジーフット              | 8.3     | 9.7   | 3,045   |
| シー・ヴィ・エス・ペリエリア     | 2       | 2.3   | 901     |
| くら寿司               | 16.2    | 16.8  | 51,912  |
| キャンドウ              | 6.6     | 6     | 14,130  |
| アイケイ               | 4       | 5.1   | 2,815   |
| バルグループホールディングス     | 12.1    | 14.1  | 21,206  |
| エディオン              | 58.5    | 74    | 90,428  |
| サーラコーポレーション        | 28      | 32.7  | 20,306  |
| ワッツ                | 6.7     | 7.8   | 5,616   |
| ハローズ               | 5.5     | 7.3   | 22,922  |
| フジオフードグループ本社       | 11.6    | 13    | 17,108  |
| あみやき亭              | 3       | 3.8   | 11,039  |
| ひらまつ               | 25.4    | 34.2  | 6,395   |
| 大黒天物産              | 4.4     | 5.1   | 24,811  |
| ハニースホールディングス       | 10.9    | 13.7  | 14,891  |
| ファーマライズホールディングス    | 3.3     | 3.8   | 2,751   |
| アルベン               | 10.6    | 12    | 23,184  |
| ハブ                 | 4.4     | 5.2   | 2,506   |
| クオールホールディングス       | 18.6    | 19.8  | 21,384  |
| ジンズホールディングス        | 9.4     | 10.2  | 42,942  |
| ビックカメラ             | 81.9    | 95.6  | 107,836 |
| DCMホールディングス        | 85.2    | 99.4  | 109,041 |
| Monotaro           | 196.4   | 203.8 | 411,472 |
| 東京一番フーズ            | 3.5     | 3.9   | 2,320   |
| DDホールディングス         | 6.6     | 8.4   | 4,368   |
| きちりホールディングス        | 3.7     | 4.3   | 1,586   |
| アークランドサービスホールディングス | 11.5    | 11.8  | 24,237  |
| J. フロント リテイリング     | 164.9   | 187.9 | 186,021 |
| ドトール・日レスホールディングス   | 21.8    | 27    | 40,662  |
| マツキヨココカラ&カンパニー     | 57.1    | 97.6  | 415,776 |
| ブロンコビリー            | 7.2     | 8.9   | 20,309  |
| ZOZO               | 81.4    | 110.8 | 297,387 |
| トレジャー・ファクトリー       | 4       | 4.7   | 4,502   |
| 物語コーポレーション         | 7.4     | 8     | 41,280  |
| ココラファイン            | 12.3    | —     | —       |
| 三越伊勢丹ホールディングス      | 241.6   | 268.8 | 262,886 |
| Hamee              | 3.5     | 5.8   | 6,090   |
| マーケットエンタープライズ      | 0.9     | 1.6   | 1,179   |
| ウエルシアホールディングス      | 73      | 85.2  | 221,008 |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------------|---------|-------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |
| クリエイトSDホールディングス      | 20.4    | 23.8  | 69,972    |
| 丸善CH I ホールディングス      | 16.1    | 18.8  | 7,106     |
| ミサワ                  | 2.8     | 3.3   | 2,006     |
| ティーライフ               | 1.8     | 2.2   | 3,108     |
| エー・ビーホールディングス        | 2.6     | 3.1   | 1,388     |
| チムニー                 | 4.2     | 4.9   | 5,561     |
| シュッピン                | 9.4     | 13.4  | 14,646    |
| オイシックス・ラ・大地          | 18.2    | 23.2  | 57,234    |
| ネクステージ               | 24.3    | 32.7  | 62,620    |
| ジョイフル本田              | 40.4    | 48.4  | 76,859    |
| 鳥貴族ホールディングス          | 5.1     | 5.7   | 9,838     |
| ホットランド               | 10.3    | 12    | 16,320    |
| すかいらくホールディングス        | 154.7   | 204.2 | 311,200   |
| SFPホールディングス          | 6.7     | 7.9   | 10,894    |
| 綿半ホールディングス           | 10.3    | 11.8  | 15,587    |
| ヨシックスホールディングス        | 2.7     | 3.1   | 6,206     |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 40.1    | 46.8  | 51,105    |
| ゴルフダイジェスト・オンライン      | 7.2     | 8.4   | 7,938     |
| BEENOS               | 7       | 8.1   | 11,137    |
| あさひ                  | 10.3    | 13.3  | 17,689    |
| 日本調剤                 | 8.4     | 9.8   | 11,671    |
| コスモス薬品               | 13.9    | 16.3  | 193,481   |
| トーエル                 | 6.7     | 7.6   | 6,270     |
| オンリー                 | 2.3     | —     | —         |
| セブン&アイ・ホールディングス      | 540.1   | 600.5 | 3,425,852 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 74.2    | 93.2  | 75,026    |
| ツルハホールディングス          | 30.1    | 35.2  | 236,896   |
| サンマルクホールディングス        | 10.9    | 12.7  | 18,948    |
| フェリシモ                | 3.1     | 3.6   | 4,262     |
| トリドールホールディングス        | 34.2    | 40.1  | 89,783    |
| TOKYO BASE           | 12.4    | 14.8  | 4,588     |
| ウイルプラスホールディングス       | 2.2     | 3     | 2,763     |
| JMホールディングス           | 9.3     | 11.3  | 18,396    |
| サツドラホールディングス         | 2.1     | 7.2   | 4,744     |
| アレンザホールディングス         | 10.5    | 11.8  | 11,670    |
| 串カツ田中ホールディングス        | 3.7     | 4.3   | 7,125     |
| パロックジャパンリミテッド        | 9.6     | 11.2  | 8,769     |
| クスリのアオキホールディングス      | 13.7    | 15.5  | 84,010    |
| 力の源ホールディングス          | 6.3     | 8.2   | 4,747     |
| FOOD & LIFE COMPANIE | 80.8    | 90.4  | 287,472   |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|----------------------|---------|-------|---------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                      | 千株      | 千株    | 千円      |
| メディカルシステムネットワーク      | 12      | 15.1  | 6,523   |
| 一冢ホールディングス           | —       | 3.4   | 1,808   |
| 藤久ホールディングス           | —       | 5     | 3,435   |
| はるやまホールディングス         | 6.5     | 7.5   | 3,397   |
| ノジマ                  | 24.6    | 26.1  | 76,629  |
| カップ・クリエイト            | 19.4    | 22.6  | 29,990  |
| ライトオン                | 10.3    | 12    | 8,412   |
| 良品計画                 | 158.9   | 185.4 | 234,345 |
| バリミキホールディングス         | 17.1    | 19.9  | 5,213   |
| アドヴァングループ            | 14.1    | 15.5  | 12,074  |
| アルビス                 | 4.4     | 5     | 11,145  |
| コナカ                  | 16.3    | 18.5  | 6,142   |
| ハウス オブ ローゼ           | 1.7     | 2     | 3,324   |
| G-7ホールディングス          | 6.7     | 17.9  | 27,852  |
| イオン北海道               | 18.2    | 26    | 26,598  |
| コジマ                  | 23.7    | 27.7  | 16,869  |
| ヒマラヤ                 | 4.8     | 5.4   | 4,941   |
| コーナン商事               | 19.6    | 22.9  | 84,730  |
| エコス                  | 5.1     | 5.7   | 11,400  |
| ワタミ                  | 18.1    | 19.5  | 17,452  |
| マルシェ                 | 3.6     | 5.2   | 2,402   |
| バン・パンフィック・インターナショナルホ | 276     | 322.3 | 645,244 |
| 西松屋チェーン              | 30.3    | 34.2  | 53,112  |
| ゼンショーホールディングス        | 74.1    | 78.7  | 231,220 |
| 幸楽苑ホールディングス          | 8.8     | 9.9   | 12,335  |
| ハークスレイ               | 2.9     | 6.7   | 3,068   |
| サイゼリヤ                | 20.5    | 23.9  | 55,209  |
| VTホールディングス           | 52      | 60.7  | 27,739  |
| 魚力                   | 4.3     | 4.5   | 9,850   |
| ポプラ                  | 3.6     | 4     | 548     |
| フジ・コーポレーション          | 7.3     | 8.5   | 9,605   |
| ユナイテッドアローズ           | 15.8    | 16.9  | 31,146  |
| ハイデイ日高               | 19.9    | 23.3  | 44,363  |
| YU-WA Creation Holdi | 8.8     | 9.4   | 1,917   |
| コロワイド                | 45.9    | 66.2  | 106,913 |
| ピーシーデポコーポレーション       | 16      | 18.7  | 5,853   |
| 壱番屋                  | 9.7     | 11.4  | 55,518  |
| トップカルチャー             | 5       | 5.8   | 1,618   |
| P L A N T            | 3.5     | 4     | 2,684   |
| スギホールディングス           | 27.6    | 32.2  | 170,016 |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|--------------------|---------|-------|-----------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                    | 千株      | 千株    | 千円        |
| 薬王堂ホールディングス        | 6       | 8     | 15,000    |
| スクロール              | 19.7    | 24.8  | 20,931    |
| ヨンドシーホールディングス      | 12.7    | 14.4  | 24,710    |
| 木曽路                | 18      | 21.8  | 45,322    |
| S R S ホールディングス     | 17.7    | 22.8  | 18,536    |
| 千趣会                | 24.9    | 29.1  | 11,436    |
| タカキュー              | 10.7    | 12    | 1,248     |
| リテールパートナーズ         | 16.7    | 24.5  | 28,052    |
| ケーヨー               | 25.5    | 29.8  | 28,548    |
| 上新電機               | 15.8    | 17.5  | 33,285    |
| 日本瓦斯               | 68.2    | 78.3  | 147,282   |
| ロイヤルホールディングス       | 24.1    | 28.2  | 57,217    |
| 東天紅                | 1       | 1.2   | 1,105     |
| いなげや               | 15.4    | 18.6  | 24,626    |
| チヨダ                | 14.5    | 15    | 10,590    |
| ライフコーポレーション        | 14      | 14.2  | 40,697    |
| リンガーハット            | 17      | 19.4  | 42,505    |
| M r M a x H D      | 19      | 20.1  | 12,200    |
| テンアライド             | 12.7    | 15.6  | 4,820     |
| A O K I ホールディングス   | 27.6    | 31.2  | 19,531    |
| オークワ               | 21.7    | 24.5  | 21,633    |
| コメリ                | 21.3    | 24.9  | 70,367    |
| 青山商事               | 30.7    | 32.4  | 22,842    |
| しまむら               | 16.1    | 18.8  | 219,208   |
| はせがわ               | 7.3     | 8.5   | 2,252     |
| 高島屋                | 100.6   | 114.4 | 139,339   |
| 松屋                 | 30.2    | 30.7  | 23,823    |
| エイチ・ツー・オー リテイリング   | 65.4    | 74.2  | 64,776    |
| 近鉄百貨店              | 5.3     | 5.7   | 14,369    |
| 丸井グループ             | 116.8   | 123.7 | 276,345   |
| アクシアル リテイリング       | 11.5    | 11.9  | 36,473    |
| 井筒屋                | 7       | 7.6   | 2,280     |
| イオン                | 531.3   | 590.7 | 1,410,000 |
| イズミ                | 28.1    | 27.9  | 78,566    |
| 平和堂                | 25.5    | 28.8  | 56,361    |
| フジ                 | 16.7    | 41.2  | 97,602    |
| ヤオコー               | 15.7    | 18.3  | 125,538   |
| ゼビオホールディングス        | 16.7    | 21.9  | 20,235    |
| ケーズホールディングス        | 117.5   | 144.8 | 200,403   |
| O l y m p i c グループ | 7.1     | 7.9   | 5,087     |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末  |           |
|-------------------|---------|--------|-----------|
|                   | 株 数     | 株 数    | 評 価 額     |
|                   | 千株      | 千株     | 千円        |
| 日産東京販売ホールディングス    | 20.3    | 23.7   | 5,214     |
| シルバーライフ           | 2.8     | 3.3    | 4,458     |
| 一家ダイニングプロジェクト     | 2.8     | —      | —         |
| Genky Drug Stores | 6.1     | 7.1    | 22,329    |
| ナルミヤ・インターナショナル    | 2.6     | 3.6    | 3,045     |
| ブックオフグループホールディングス | 8       | 9.4    | 9,578     |
| ギフトホールディングス       | 1.7     | 2.5    | 5,152     |
| アインホールディングス       | 20      | 21     | 117,810   |
| 元気寿司              | 3.9     | 4.5    | 11,034    |
| ヤマダホールディングス       | 462.8   | 603.04 | 289,459   |
| アークランドサカモト        | 21.6    | 25.2   | 39,387    |
| ニトリホールディングス       | 54.8    | 64     | 813,120   |
| グルメ杵屋             | 9.8     | 12.8   | 12,800    |
| 愛眼                | 11      | 11.8   | 2,324     |
| ケーユーホールディングス      | 7.2     | 8.4    | 8,937     |
| 吉野家ホールディングス       | 45.4    | 56.3   | 133,712   |
| 松屋フーズホールディングス     | 6.6     | 7.7    | 28,836    |
| サガミホールディングス       | 19.3    | 24.1   | 26,775    |
| 関西フードマーケット        | 10.4    | 15.1   | 19,916    |
| 王将フードサービス         | 9.1     | 10.6   | 64,766    |
| ブレナス              | 15.5    | 18     | 34,920    |
| ミニストップ            | 10.2    | 11.9   | 16,457    |
| アークス              | 26.3    | 30     | 62,340    |
| パローホールディングス       | 28.2    | 34.7   | 69,226    |
| 藤久                | 3.2     | —      | —         |
| ベルク               | 6.8     | 7.2    | 39,168    |
| 大庄                | 7.4     | 8.6    | 8,815     |
| ファーストリテイリング       | 18.5    | 21.6   | 1,253,232 |
| サンドラッグ            | 51.9    | 60.6   | 179,073   |
| サックスパー ホールディングス   | 11.7    | 15.2   | 7,843     |
| ヤマザワ              | 3.2     | 3.6    | 5,400     |
| やまや               | 2.8     | 3.3    | 8,184     |
| ベルーナ              | 29.6    | 34.6   | 24,600    |
| <b>銀行業 (5.5%)</b> |         |        |           |
| 島根銀行              | 4.8     | 5.1    | 2,657     |
| じもとホールディングス       | 9.3     | 11.2   | 6,944     |
| めぶきフィナンシャルグループ    | 718.4   | 737.8  | 196,992   |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 17.3    | 19.7   | 34,297    |
| 九州フィナンシャルグループ     | 282.4   | 313.9  | 126,187   |
| ゆうちょ銀行            | 391.7   | 381    | 373,761   |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|---------------------|---------|---------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株      | 千円        |
| 富山第一銀行              | 33      | 37.6    | 12,295    |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 842.4   | 880.9   | 421,070   |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | 90.3    | 95      | 74,385    |
| 三十三フィナンシャルグループ      | 12      | 14.3    | 20,406    |
| 第四北越フィナンシャルグループ     | 22.5    | 25.1    | 62,925    |
| ひろぎんホールディングス        | 203.9   | 227.5   | 144,007   |
| おきなわフィナンシャルグループ     | —       | 14.3    | 31,674    |
| 十六フィナンシャルグループ       | —       | 20.7    | 46,140    |
| 北國フィナンシャルホールディングス   | —       | 14.6    | 63,437    |
| プロクレアホールディングス       | —       | 17      | 31,076    |
| 新生銀行                | 112.7   | 105.3   | 233,450   |
| あおぞら銀行              | 82.4    | 90.1    | 237,503   |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 9,458.4 | 9,897.9 | 7,425,404 |
| りそなホールディングス         | 1,595.6 | 1,789.2 | 976,724   |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 261.3   | 292.4   | 1,197,962 |
| 三井住友フィナンシャルグループ     | 956.9   | 1,094   | 4,290,668 |
| 千葉銀行                | 461.4   | 511     | 382,228   |
| 群馬銀行                | 284.6   | 288.5   | 107,610   |
| 武蔵野銀行               | 20.6    | 22.9    | 40,762    |
| 千葉興業銀行              | 35.2    | 36.9    | 9,926     |
| 筑波銀行                | 57.5    | 62.9    | 12,517    |
| 七十七銀行               | 43.4    | 48      | 80,064    |
| 青森銀行                | 10.7    | —       | —         |
| 秋田銀行                | 8.3     | 10.1    | 16,806    |
| 山形銀行                | 15.5    | 16.5    | 14,553    |
| 岩手銀行                | 9.1     | 10.3    | 19,652    |
| 東邦銀行                | 123.6   | 128.3   | 26,301    |
| 東北銀行                | 6.6     | 7.6     | 7,524     |
| みちのく銀行              | 8.9     | —       | —         |
| ふくおかフィナンシャルグループ     | 124.8   | 129.5   | 304,195   |
| 静岡銀行                | 336.7   | 372.9   | 318,456   |
| 十六銀行                | 17.3    | —       | —         |
| スルガ銀行               | 121.2   | 141.5   | 58,722    |
| 八十二銀行               | 311.4   | 346.2   | 157,521   |
| 山梨中央銀行              | 16.1    | 17.1    | 16,980    |
| 大垣共立銀行              | 27.3    | 30.5    | 58,316    |
| 福井銀行                | 11.8    | 13.5    | 18,279    |
| 北國銀行                | 12.8    | —       | —         |
| 清水銀行                | 5.7     | 6.4     | 9,638     |
| 富山銀行                | 2.7     | 2.8     | 5,300     |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |  |
|-----------------|---------|---------|-----------|--|
|                 | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |  |
|                 | 千株      | 千株      | 千円        |  |
| 滋賀銀行            | 27.7    | 29      | 72,326    |  |
| 南都銀行            | 20.1    | 24.1    | 49,091    |  |
| 百五銀行            | 124.4   | 148.5   | 50,490    |  |
| 京都銀行            | 49.5    | 55.2    | 311,328   |  |
| 紀陽銀行            | 49      | 52.4    | 74,512    |  |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 92      | 96      | 85,248    |  |
| 山陰合同銀行          | 87.1    | 93.7    | 61,842    |  |
| 中国銀行            | 119     | 125.7   | 121,174   |  |
| 鳥取銀行            | 4.4     | 5.1     | 6,053     |  |
| 伊予銀行            | 183.2   | 202.9   | 128,232   |  |
| 百十四銀行           | 14.7    | 16.4    | 28,109    |  |
| 四国銀行            | 19.6    | 23.4    | 18,766    |  |
| 阿波銀行            | 21.2    | 23.6    | 50,787    |  |
| 大分銀行            | 8       | 9.1     | 17,044    |  |
| 宮崎銀行            | 8.6     | 9.6     | 19,872    |  |
| 佐賀銀行            | 7.8     | 8.9     | 13,011    |  |
| 沖縄銀行            | 12.7    | —       | —         |  |
| 琉球銀行            | 30      | 35      | 28,595    |  |
| セブン銀行           | 462     | 479.3   | 119,345   |  |
| みずほフィナンシャルグループ  | 1,878.8 | 2,021.3 | 3,203,760 |  |
| 高知銀行            | 5       | 5.6     | 4,172     |  |
| 山口フィナンシャルグループ   | 172.6   | 179.1   | 130,743   |  |
| 長野銀行            | 4.5     | 5.2     | 6,817     |  |
| 名古屋銀行           | 11.1    | 11.1    | 34,021    |  |
| 北洋銀行            | 208.4   | 229.8   | 55,381    |  |
| 愛知銀行            | 4.6     | 5.6     | 26,544    |  |
| 中京銀行            | 5       | 5.5     | 9,262     |  |
| 大光銀行            | 4.7     | 5.3     | 6,725     |  |
| 愛媛銀行            | 19.3    | 22      | 20,570    |  |
| トマト銀行           | 5.3     | 5.5     | 5,615     |  |
| 京葉銀行            | 59      | 67.3    | 33,178    |  |
| 栃木銀行            | 66.8    | 76.1    | 18,948    |  |
| 北日本銀行           | 4.3     | 4.9     | 7,653     |  |
| 東和銀行            | 24.3    | 27.7    | 14,847    |  |
| 福島銀行            | 15.8    | 18      | 3,888     |  |
| 大東銀行            | 6.6     | 7.5     | 4,897     |  |
| トモニホールディングス     | 106.9   | 122     | 39,772    |  |
| フィデアホールディングス    | 134.2   | 14.7    | 18,933    |  |
| 池田泉州ホールディングス    | 159     | 180.9   | 33,828    |  |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|----------------------|---------|---------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株      | 千円        |
| 証券、商品先物取引業 (0.8%)    |         |         |           |
| F P G                | 46.5    | 54.3    | 43,494    |
| ジャパンインベストメントアドバイザー   | 9.3     | 12.5    | 14,212    |
| マーキュリアインベストメント       | 5.4     | —       | —         |
| マーキュリアホールディングス       | —       | 7.2     | 4,197     |
| S B I ホールディングス       | 170.4   | 199.3   | 569,798   |
| 日本アジア投資              | 11.7    | 12.7    | 2,959     |
| ジャフコ グループ            | 21.3    | 61.7    | 94,832    |
| 大和証券グループ本社           | 1,035.5 | 1,180.1 | 737,090   |
| 野村ホールディングス           | 2,111.1 | 2,464.2 | 1,192,672 |
| 岡三証券グループ             | 117.8   | 123.4   | 44,177    |
| 丸三証券                 | 41.1    | 47.9    | 24,476    |
| 東洋証券                 | 45.6    | 51.8    | 9,272     |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 147.4   | 176.5   | 68,129    |
| 光世証券                 | 3.3     | 3.4     | 1,581     |
| 水戸証券                 | 36.9    | 41.9    | 10,852    |
| いちよし証券               | 27.7    | 29.5    | 16,756    |
| 松井証券                 | 67.7    | 79      | 65,096    |
| マネックスグループ            | 124     | 133     | 70,889    |
| 極東証券                 | 18.5    | 20.5    | 14,329    |
| 岩井コスモホールディングス        | 14.2    | 15.2    | 19,167    |
| アイザワ証券グループ           | 24.8    | 25      | 16,225    |
| マネーパートナーズグループ        | 14.7    | 17.2    | 4,093     |
| スパークス・グループ           | 63.9    | 74.5    | 18,476    |
| 小林洋行                 | 4       | 5.7     | 1,282     |
| 保険業 (2.2%)           |         |         |           |
| かんぽ生命保険              | 171.4   | 162.5   | 348,887   |
| S O M P Oホールディングス    | 243.7   | 253.2   | 1,323,982 |
| アニコム ホールディングス        | 38.9    | 49.6    | 31,148    |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 335.8   | 351.9   | 1,382,263 |
| 第一生命ホールディングス         | 730.5   | 751     | 1,950,347 |
| 東京海上ホールディングス         | 455.4   | 495.2   | 3,427,279 |
| T & Dホールディングス        | 413.3   | 399     | 668,724   |
| アドバンスクリエイト           | 6.5     | 7.7     | 7,161     |
| その他金融業 (1.1%)        |         |         |           |
| 全国保証                 | 36      | 38.5    | 174,982   |
| あんしん保証               | —       | 6.4     | 1,868     |
| ジェイリース               | 4.6     | 5.4     | 7,959     |
| イントラスト               | 3.9     | 6.8     | 3,529     |
| 日本モーゲージサービス          | 7       | 9       | 8,676     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|---------------------|---------|-------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株    | 千円        |
| C a s a             | 3.9     | 5.7   | 4,577     |
| アルヒ                 | 20.4    | 23.8  | 23,704    |
| プレミアグループ            | 6.4     | 8.2   | 30,422    |
| ネットプロテクションズホールディングス | —       | 49    | 29,498    |
| クレディセゾン             | 80.7    | 100.5 | 155,875   |
| 芙蓉総合リース             | 14.5    | 15.9  | 115,434   |
| みずほリース              | 21.3    | 23.2  | 69,948    |
| 東京センチュリー            | 32.1    | 29.2  | 123,078   |
| 日本証券金融              | 58.5    | 63.4  | 60,230    |
| アイフル                | 232     | 270.8 | 102,633   |
| リコーリース              | 10.9    | 14.3  | 49,192    |
| イオンフィナンシャルサービス      | 84.6    | 87.8  | 105,711   |
| アコム                 | 277.9   | 318.4 | 109,848   |
| ジャックス               | 15.3    | 17.2  | 56,416    |
| オリエントコーポレーション       | 374     | 436.6 | 55,884    |
| オリックス               | 839.4   | 958.9 | 2,209,305 |
| 三菱HCキャピタル           | 478.2   | 571.5 | 334,327   |
| 九州リースサービス           | 6.8     | 7.6   | 4,400     |
| 日本取引所グループ           | 373.5   | 393.9 | 750,970   |
| イー・ギャランティ           | 15.9    | 23.8  | 48,409    |
| アサックス               | 7.2     | 8.4   | 4,888     |
| NECキャピタルソリューション     | 5.6     | 6.6   | 12,975    |
| <b>不動産業 (2.0%)</b>  |         |       |           |
| いちご                 | 154     | 179.7 | 49,776    |
| 日本駐車場開発             | 151.6   | 171.1 | 26,862    |
| スター・マイカ・ホールディングス    | 7.1     | 8.7   | 12,554    |
| SREホールディングス         | 2       | 4     | 9,272     |
| ADワークスグループ          | 27.4    | 31.9  | 4,753     |
| ヒューリック              | 293.3   | 374.1 | 389,064   |
| 三栄建築設計              | 5.5     | 6.5   | 10,699    |
| 野村不動産ホールディングス       | 84      | 83.5  | 260,520   |
| 三重交通グループホールディングス    | 28      | 32.7  | 15,238    |
| サムティ                | 19.6    | 25.2  | 51,735    |
| ディア・ライフ             | 17.8    | 20.5  | 10,619    |
| コーセーアールイー           | 4.1     | 4.7   | 3,008     |
| 地主                  | 8.8     | 10.2  | 19,757    |
| プレサンスコーポレーション       | 22.7    | 19.9  | 29,591    |
| ハウスコム               | 2.4     | 2.8   | 3,164     |
| 日本管理センター            | 7.5     | 7.7   | 7,607     |
| サンセイランディック          | 4.1     | 4.7   | 3,811     |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|-------------------|---------|---------|-----------|
|                   | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                   | 千株      | 千株      | 千円        |
| エストラスト            | 1.6     | 1.9     | 1,046     |
| フージャースホールディングス    | 22.5    | 20.6    | 13,307    |
| オープンハウスグループ       | 43.9    | 51.3    | 243,418   |
| 東急不動産ホールディングス     | 376     | 463.3   | 300,681   |
| 飯田グループホールディングス    | 115.3   | 134.6   | 284,140   |
| イーグランド            | 2.2     | 2.5     | 3,352     |
| ムゲンエステート          | 8.5     | 9.9     | 4,969     |
| ビーロッド             | 6.5     | 11      | 5,412     |
| ファーストブラザーズ        | 2.5     | 3.7     | 3,034     |
| A n d D oホールディングス | 6.8     | 7.9     | 7,181     |
| シーアールイー           | 3.6     | 5       | 7,445     |
| プロパティエージェンツ       | 2.2     | 1.9     | 2,907     |
| ケイアイスター不動産        | 4.3     | 7.3     | 38,836    |
| アグレ都市デザイン         | 2.5     | 2.6     | 4,089     |
| グッドコムアセット         | 6.6     | 7       | 7,651     |
| ジェイ・エス・ビー         | 2.6     | 3.3     | 11,385    |
| ロードスターキャピタル       | —       | 4.1     | 5,805     |
| テンボイノベーション        | 3.9     | 4.5     | 3,636     |
| グローバル・リンク・マネジメント  | 2.4     | 2.8     | 2,598     |
| フェイスネットワーク        | 1.1     | 2       | 2,656     |
| パーク 2 4           | 74.2    | 95.6    | 173,609   |
| バラカ               | 3.6     | 4.4     | 7,634     |
| 三井不動産             | 630.2   | 698.7   | 1,874,961 |
| 三菱地所              | 908.4   | 1,013.3 | 1,847,752 |
| 平和不動産             | 23.7    | 27      | 103,950   |
| 東京建物              | 136.6   | 152.3   | 271,094   |
| ダイビル              | 35.1    | —       | —         |
| 京阪神ビルディング         | 23.8    | 23.6    | 31,340    |
| 住友不動産             | 310.8   | 322.5   | 1,075,537 |
| テアオーシー            | 27.1    | 27.4    | 18,440    |
| 東京楽天地             | 2.3     | 2.5     | 9,887     |
| レオパレス 2 1         | 114.7   | 167.3   | 31,787    |
| スターツコーポレーション      | 16.5    | 21.9    | 50,720    |
| フジ住宅              | 16      | 18.7    | 11,594    |
| 空港施設              | 13.8    | 16.1    | 8,822     |
| 明和地所              | 6.5     | 7.6     | 4,514     |
| ゴールドクレスト          | 12.5    | 12.7    | 21,094    |
| エスリード             | 5.4     | 6.3     | 10,489    |
| 日神グループホールディングス    | 20.4    | 26.2    | 11,685    |
| 日本エスコン            | 25.1    | 30.1    | 22,213    |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| タカラレーベン           | 57.9    | 67.6  | 19,739  |
| A V A N T I A     | 7.1     | 8.1   | 6,804   |
| イオンモール            | 69.3    | 80.9  | 126,284 |
| 毎日コムネット           | 4.7     | 5.5   | 3,850   |
| ファースト住建           | 5.9     | 6     | 6,624   |
| カチタス              | 34.2    | 40    | 115,560 |
| トーセイ              | 19.1    | 22.3  | 24,842  |
| 穴吹興産              | 3       | 3.5   | 7,777   |
| サンフロンティア不動産       | 17      | 22.3  | 23,660  |
| F J ネクストホールディングス  | 13.6    | 15.8  | 16,052  |
| インテリックス           | 3.1     | 3.6   | 2,293   |
| ランドビジネス           | 5.8     | 6.4   | 1,510   |
| サンネクスタグループ        | 4.4     | 5.1   | 5,706   |
| グランディハウス          | 9.4     | 11    | 5,731   |
| 日本空港ビルデング         | 48      | 58.4  | 302,512 |
| サービス業 (5.4%)      |         |       |         |
| 明豊ファシリティワークス      | 6.1     | 7.1   | 4,828   |
| 日本工営              | 8.3     | 9.9   | 28,789  |
| L I F U L L       | 40.9    | 47.7  | 10,255  |
| ミクシィ              | 34      | 35.8  | 80,657  |
| ジェイエイシーリクルートメント   | 9.2     | 12.6  | 21,974  |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 219.7   | 256.5 | 359,100 |
| メンバーズ             | 4       | 4.5   | 12,928  |
| 中広                | 1.8     | 2.5   | 947     |
| U T グループ          | 19.3    | 22.6  | 58,421  |
| アイティメディア          | 4.5     | 7.4   | 12,284  |
| タケエイ              | 14.9    | —     | —       |
| E・J ホールディングス      | 7       | 9     | 10,251  |
| 夢真ビーネックスグループ      | 35.5    | 51    | 68,697  |
| コシダカホールディングス      | 35.8    | 41.8  | 29,928  |
| アルトナー             | 3.2     | 3.8   | 3,165   |
| バソナグループ           | 14.5    | 16.9  | 32,617  |
| C D S             | 3.3     | 3.9   | 6,981   |
| リンクアンドモチベーション     | 24.6    | 34.5  | 15,007  |
| G C A             | 17.5    | —     | —       |
| エス・エム・エス          | 45.5    | 53.1  | 155,901 |
| サニーサイドアップグループ     | 4.6     | 5.4   | 4,212   |
| バーソルホールディングス      | 133.9   | 156.3 | 361,834 |
| リニカル              | 7.5     | 8.8   | 6,960   |
| クックパッド            | 42.1    | 49.1  | 12,225  |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |  |
|------------------|---------|-------|-----------|--|
|                  | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |  |
|                  | 千株      | 千株    | 千円        |  |
| エスクリ             | 4.2     | 7     | 2,877     |  |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス | 6.5     | 7.6   | 4,301     |  |
| 学情               | 4.7     | 6.3   | 5,802     |  |
| スタジオアリス          | 6.7     | 7     | 15,449    |  |
| シミックホールディングス     | 7.4     | 8.3   | 12,093    |  |
| エブコ              | 3.2     | 3.3   | 2,267     |  |
| N J S            | 3.3     | 3.4   | 6,878     |  |
| 総合警備保障           | 53.3    | 60.5  | 224,152   |  |
| カカコム             | 99      | 114.7 | 301,087   |  |
| セントケア・ホールディング    | 9.8     | 10.2  | 7,966     |  |
| サイネックス           | 2.3     | 2.6   | 1,536     |  |
| ルネサンス            | 8.4     | 10.9  | 9,319     |  |
| ディップ             | 20.9    | 27.5  | 108,350   |  |
| デジタルホールディングス     | 9.3     | 10.9  | 15,270    |  |
| 新日本科学            | 16.3    | 19    | 25,365    |  |
| ツクイホールディングス      | 6.3     | —     | —         |  |
| キャリアデザインセンター     | 3.4     | 3.7   | 3,818     |  |
| ベネフィット・ワン        | 48.7    | 56.9  | 106,858   |  |
| エムスリー            | 236.3   | 275.9 | 1,058,352 |  |
| ツカダ・グローバルホールディング | 10.7    | 9.9   | 3,019     |  |
| プラス              | 1.7     | 2     | 1,406     |  |
| アウトソーシング         | 76.7    | 89.6  | 104,742   |  |
| ウエルネット           | 13.5    | 15.1  | 6,719     |  |
| ワールドホールディングス     | 4.6     | 6.3   | 14,571    |  |
| ディー・エヌ・エー        | 56.7    | 59.5  | 112,217   |  |
| 博報堂D Yホールディングス   | 186.4   | 211.1 | 318,972   |  |
| ぐるなび             | 23.3    | 24.7  | 9,558     |  |
| タカミヤ             | 16.2    | 18.9  | 6,293     |  |
| ジャパンベストレスキューシステム | 9.1     | 10    | 7,430     |  |
| ファンコミュニケーションズ    | 36.8    | 37.8  | 15,838    |  |
| ライク              | 3.5     | 5.2   | 10,888    |  |
| ビジネス・ブレークスルー     | 5.6     | 5.8   | 2,366     |  |
| エスプール            | 34.4    | 44.2  | 52,774    |  |
| W D Bホールディングス    | 6.1     | 7.1   | 18,346    |  |
| 手間いらず            | 1.7     | —     | —         |  |
| ティア              | 7.8     | 9.1   | 3,922     |  |
| C D G            | 1.2     | 1.7   | 2,210     |  |
| アドウェイズ           | 21.8    | 23.4  | 18,228    |  |
| バリユーコマース         | 9       | 12.3  | 37,761    |  |
| インフォマート          | 135.5   | 171.3 | 84,622    |  |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|--------------------|---------|-------|-----------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                    | 千株      | 千株    | 千円        |
| J Pホールディングス        | 38.2    | 40.2  | 8,361     |
| E P Sホールディングス      | 20.2    | —     | —         |
| C Lホールディングス        | 3.3     | 3.3   | 3,524     |
| プレステージ・インターナショナル   | 50.2    | 58.6  | 35,394    |
| アミューズ              | 7.3     | 8.5   | 16,481    |
| ドリームインキュベータ        | 4.1     | 4.4   | 8,580     |
| クイック               | 8.3     | 10.4  | 15,204    |
| T A C              | 7.2     | 8.5   | 1,904     |
| 電通グループ             | 150.6   | 156.3 | 729,139   |
| テイクアンドギヴ・ニーズ       | 6.3     | 7.3   | 8,942     |
| びあ                 | 3.8     | 5.2   | 15,553    |
| イオンファンタジー          | 5.2     | 6     | 12,342    |
| シーティーエス            | 15.1    | 17.6  | 14,924    |
| ネクシィーズグループ         | 4.7     | 5.2   | 2,662     |
| H. U. グループホールディングス | 37.5    | 40.9  | 120,982   |
| アルプス技研             | 11.8    | 12.5  | 24,062    |
| ダイオーズ              | 2.6     | 3.1   | 3,199     |
| 日本空調サービス           | 14      | 16.4  | 13,169    |
| オリエンタルランド          | 142.5   | 178.6 | 3,071,920 |
| ダスキン               | 31.1    | 35.4  | 98,978    |
| 明光ネットワークジャパン       | 15.7    | 18.4  | 10,543    |
| ファルコホールディングス       | 6.4     | 7.3   | 15,351    |
| 秀英予備校              | 2.9     | 3.4   | 1,424     |
| ラウンドワン             | 45.7    | 43.6  | 55,372    |
| リゾートトラスト           | 61.4    | 69.8  | 145,044   |
| ビー・エム・エル           | 17.2    | 19.9  | 66,565    |
| りらいあコミュニケーションズ     | 20.4    | 23.1  | 23,839    |
| リソー教育              | 68      | 71.4  | 26,203    |
| 早稲田アカデミー           | 5.7     | 8.7   | 8,934     |
| ユー・エス・エス           | 150     | 175.1 | 383,118   |
| 東京個別指導学院           | 11.8    | 13.8  | 8,017     |
| サイバーエージェント         | 330.2   | 368.3 | 505,307   |
| 楽天グループ             | 624.9   | 777.9 | 664,326   |
| クリーク・アンド・リバー社      | 7       | 8.2   | 16,113    |
| モーニングスター           | 19.5    | 27.3  | 14,632    |
| デー・オー・ダブリュー        | 23.4    | 29.9  | 9,538     |
| 山田コンサルティンググループ     | 7.8     | 8.1   | 9,412     |
| セントラルスポーツ          | 5       | 5.8   | 13,386    |
| フルキャストホールディングス     | 11.4    | 13.3  | 29,233    |
| エン・ジャパン            | 23.8    | 26.1  | 80,649    |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|---------------------|---------|---------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株      | 千円        |
| リソルホールディングス         | 1.5     | 1.7     | 7,497     |
| テクノプロ・ホールディングス      | 26.7    | 93.6    | 270,878   |
| アトラグループ             | 3.1     | 3.5     | 885       |
| インターワークス            | 3.8     | 4.5     | 1,692     |
| アイ・アールジャパンホールディングス  | 5.4     | 7.3     | 28,214    |
| K e e P e r 技研      | 8.6     | 10.1    | 23,432    |
| ファーストロジック           | 2.6     | 2.8     | 2,153     |
| 三機サービス              | 2.6     | 2.7     | 3,191     |
| G u n o s y         | 8.3     | 8.6     | 8,058     |
| デザインワン・ジャパン         | 3.3     | 4.1     | 746       |
| イー・ガーディアン           | 5.4     | 6       | 16,848    |
| リブセンス               | 7.4     | 8.6     | 1,393     |
| ジャパンマテリアル           | 41.2    | 48.1    | 89,417    |
| ベクトル                | 16.7    | 21.9    | 25,885    |
| ウチヤマホールディングス        | 6.6     | 7.7     | 2,356     |
| チャーム・ケア・コーポレーション    | 10      | 11.6    | 12,435    |
| キャリアリンク             | 4.4     | 5.8     | 8,282     |
| I B J               | 11      | 12.8    | 8,512     |
| アサンテ                | 4.8     | 6.9     | 10,101    |
| N・フィールド             | 1.7     | —       | —         |
| バリュエHR              | 5.3     | 12.8    | 16,524    |
| M&Aキャピタルパートナーズ      | 11      | 12.9    | 41,796    |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 5.2     | 6.1     | 6,990     |
| E R I ホールディングス      | 3.7     | 4.4     | 5,618     |
| アビスト                | 2.1     | 2.4     | 6,607     |
| シグマクシス・ホールディングス     | 7.3     | 18.8    | 19,533    |
| ウィルグループ             | 9.8     | 11.6    | 12,423    |
| エスクロー・エージェント・ジャパン   | 19.9    | 19.4    | 3,181     |
| メドピア                | 10.3    | 11.7    | 30,408    |
| レアジョブ               | 2.5     | 2.9     | 2,224     |
| リクルートホールディングス       | 959.6   | 1,177.7 | 5,144,193 |
| エラン                 | 18.5    | 21.6    | 20,433    |
| 土木管理総合試験所           | 6.5     | 7.2     | 2,354     |
| ネットマーケティング          | 6.4     | 7.6     | 5,107     |
| 日本郵政                | 1,013.5 | 1,956.9 | 1,784,497 |
| ベルシステム24ホールディングス    | 22.4    | 22.5    | 32,490    |
| 鎌倉新書                | 13.5    | 17.8    | 9,790     |
| SMN                 | 2.9     | 3.4     | 2,006     |
| 一蔵                  | 1.7     | 2       | 776       |
| グローバルキッズCOMPANY     | 2.4     | 2.7     | 1,884     |

| 銘柄                    | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-----------------------|---------|-------|---------|
|                       | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                       | 千株      | 千株    | 千円      |
| エアトリ                  | 8.4     | 9.8   | 28,037  |
| アトラエ                  | 9.3     | 10.9  | 17,222  |
| ストライク                 | 5.1     | 6.2   | 23,405  |
| ソラスト                  | 32.9    | 38.4  | 31,680  |
| セラク                   | 4.2     | 5     | 5,930   |
| インソース                 | 13      | 15.9  | 30,114  |
| ペイカレント・コンサルティング       | 8.8     | 11.1  | 462,315 |
| Orchestra Holdings    | 3       | 3     | 7,116   |
| アイモバイル                | 3.8     | 5.6   | 7,330   |
| キャリアインデックス            | 5.5     | 5.3   | 2,766   |
| MS-Japan              | 5.4     | 6.3   | 5,121   |
| 船場                    | 2.7     | 3.1   | 2,154   |
| グレイステクノロジー            | 13.6    | —     | —       |
| ジャパンエレベーターサービスホールディング | 38.6    | 49.6  | 80,848  |
| フルテック                 | 1.9     | 2.2   | 2,937   |
| グリーンズ                 | 5       | 5.9   | 3,658   |
| ツナググループ・ホールディングス      | 2.9     | 3.8   | 1,007   |
| GameWith              | 4       | 4.7   | 2,199   |
| ソウルドアウト               | 3.2     | —     | —       |
| MS&Consulting         | 2.1     | 2.3   | 1,619   |
| ウェルビー                 | 4.9     | 10.2  | 9,159   |
| エル・ティー・エス             | 1.3     | 2     | 5,412   |
| ミダックホールディングス          | 2.9     | 7.1   | 13,965  |
| 日総工産                  | 10.5    | 12.2  | 7,612   |
| キュービーネットホールディングス      | 6.1     | 7.2   | 9,640   |
| RPAホールディングス           | 15.4    | 22    | 8,844   |
| スプリックス                | 3.8     | 4.7   | 5,522   |
| マネジメントソリューションズ        | 6.5     | 7.7   | 34,611  |
| プロレド・パートナーズ           | 2.4     | 3.4   | 1,890   |
| and factory           | 3       | 3.8   | 1,554   |
| テノ・ホールディングス           | 1.4     | 1.9   | 1,159   |
| フロンティア・マネジメント         | 3       | 4.1   | 3,821   |
| ピアラ                   | 0.9     | 2.5   | 2,065   |
| コプロ・ホールディングス          | 1.7     | 3     | 3,009   |
| ギークス                  | 2.3     | 2.7   | 3,053   |
| カープスホールディングス          | 36.8    | 42.9  | 28,828  |
| フォーラムエンジニアリング         | 9.3     | 10.4  | 8,663   |
| Fast Fitness Japan    | —       | 2.9   | 5,257   |
| ダイレクトマーケティングミックス      | 7       | 17.4  | 27,057  |
| ポピンズ                  | 3.5     | 3.6   | 6,976   |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|------------------|---------|-------|-----------|
|                  | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                  | 千株      | 千株    | 千円        |
| LITALICO         | 5.4     | 12.7  | 29,718    |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 6.8     | 7.9   | 3,871     |
| リログループ           | 73.2    | 85.5  | 156,465   |
| 東洋               | 8.3     | 11.7  | 17,690    |
| ビーウィズ            | —       | 4.2   | 6,123     |
| TREホールディングス      | —       | 24.1  | 49,790    |
| 人・夢・技術グループ       | —       | 6.2   | 13,751    |
| エイチ・アイ・エス        | 20.6    | 34    | 68,408    |
| ラックランド           | 3.8     | 4.7   | 13,827    |
| 共立メンテナンス         | 22.2    | 27.9  | 126,666   |
| イチネンホールディングス     | 13.9    | 16    | 19,552    |
| 建設技術研究所          | 8.6     | 8.9   | 20,345    |
| スペース             | 8.7     | 10.8  | 9,687     |
| 長大               | 5.3     | —     | —         |
| 燎ホールディングス        | 5.8     | 6.8   | 10,676    |
| スバル興業            | 0.8     | 0.9   | 7,533     |
| 東京テアトル           | 5.2     | 6     | 7,266     |
| タナベ経営            | 2.6     | 6     | 3,840     |
| ナガワ              | 4.3     | 4.8   | 42,960    |
| 東京都競馬            | 8.8     | 11.7  | 44,986    |
| 常磐興産             | 5.4     | 6     | 7,350     |
| カナモト             | 23.6    | 26.9  | 52,481    |
| 西尾レントオール         | 12.4    | 13.9  | 38,225    |
| トランス・コスモス        | 12.7    | 19.8  | 62,370    |
| 乃村工藝社            | 57.4    | 67    | 58,022    |
| 藤田観光             | 5.3     | 6.8   | 15,130    |
| KNT-CTホールディングス   | 7.1     | 9.7   | 13,744    |
| 日本管財             | 14.3    | 16.7  | 46,025    |
| トーカイ             | 12.9    | 13.3  | 22,689    |
| 白洋舎              | 1.5     | 1.7   | 2,079     |
| セコム              | 132     | 154.1 | 1,434,362 |
| セントラル警備保障        | 6.4     | 7.5   | 16,095    |
| 丹青社              | 25.3    | 31.2  | 24,273    |
| メイテック            | 16.2    | 18.6  | 117,738   |
| 応用地質             | 15.1    | 16.7  | 31,429    |
| 船井総研ホールディングス     | 27.4    | 31.1  | 63,879    |
| 進学会ホールディングス      | 5.2     | 5.1   | 1,637     |
| オオバ              | 9.4     | 10.4  | 8,018     |
| いであ              | 3.3     | 4.1   | 7,322     |
| 学究社              | 3.9     | 5     | 7,930     |

| 銘柄           | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|--------------|---------|-------|---------|
|              | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|              | 千株      | 千株    | 千円      |
| ベネッセホールディングス | 49.1    | 52.1  | 118,996 |
| イオンディライト     | 16.5    | 19.3  | 55,661  |
| ナック          | 6.3     | 7.4   | 7,022   |
| ダイセキ         | 22.5    | 28.5  | 127,537 |

| 銘柄   | 期首(前期末)   | 当 期 末   |               |
|------|-----------|---------|---------------|
|      | 株 数       | 株 数     | 評 価 額         |
|      | 千株        | 千株      | 千円            |
| ステップ | 4.9       | 5.7     | 10,020        |
| 合 計  | 株 数 ・ 金 額 | 147,249 | 174,260       |
|      | 銘柄数<比率>   | 2,172   | 2,155 <98.0%> |

\*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。

\*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。

\*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

## 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   | 株式先物取引 | TOPIX | 百万円 百万円     |
|      |        |       | 8,289 —     |

\*単位未満は切り捨て。

## 〇有価証券の貸付及び借入の状況

(2022年5月10日現在)

| 区 分                                  | 当 期 末                        |
|--------------------------------------|------------------------------|
|                                      | 数 量                          |
| 貸付有価証券<株式>総株数<br>( 野 村 證 券 株 式 会 社 ) | 株<br>2,998,800<br>( 416,600) |

\*（ ）内は利害関係人との貸付状況です。

## 〇投資信託財産の構成

(2022年5月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |
|--------------|-------------------|
|              | 評 価 額 比 率         |
|              | 千円 %              |
| 株式           | 408,079,157 96.2  |
| コール・ローン等、その他 | 15,900,604 3.8    |
| 投資信託財産総額     | 423,979,761 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月10日現在)

| 項 目             | 当 期 末            |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 423,972,417,764  |
| コール・ローン等        | 10,419,754,580   |
| 株式(評価額)         | 408,079,157,300  |
| 未収配当金           | 4,896,873,805    |
| その他未収収益         | 31,734,079       |
| 差入委託証拠金         | 544,898,000      |
| (B) 負債          | 7,564,044,954    |
| 未払金             | 192,322,780      |
| 未払解約金           | 2,362,945,778    |
| 未払利息            | △ 179,217        |
| 受入担保金           | 5,008,955,613    |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 416,408,372,810  |
| 元本              | 208,940,390,653  |
| 次期繰越損益金         | 207,467,982,157  |
| (D) 受益権総口数      | 208,940,390,653口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 19,930円          |

(注) 期首元本額は189,017,112,223円、期中追加設定元本額は41,110,277,398円、期中一部解約元本額は21,186,998,968円、1口当たり純資産額は1.9930円です。

○損益の状況 (2021年5月11日～2022年5月10日)

| 項 目              | 当 期              |
|------------------|------------------|
|                  | 円                |
| (A) 配当等収益        | 9,926,264,230    |
| 受取配当金            | 9,719,581,766    |
| その他収益金           | 202,162,295      |
| 支払利息             | 4,520,169        |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 18,818,983,746 |
| 売買益              | 26,583,789,625   |
| 売買損              | △ 45,402,773,371 |
| (C) 先物取引等取引損益    | △ 231,233,365    |
| 取引益              | 1,288,483,892    |
| 取引損              | △ 1,519,717,257  |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | △ 9,123,952,881  |
| (E) 前期繰越損益金      | 196,580,429,703  |
| (F) 追加信託差損益金     | 42,682,688,477   |
| (G) 解約差損益金       | △ 22,671,183,142 |
| (H) 計(D＋E＋F＋G)   | 207,467,982,157  |
| 次期繰越損益金(H)       | 207,467,982,157  |

\*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。

\*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。

\*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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                              | 当期末<br>元本額     |
|------------------------------------|----------------|
|                                    | 円              |
| 野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)   | 35,710,628,987 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け)                 | 29,442,899,467 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け)                 | 25,496,576,299 |
| のむらっ・ファンド(普通型)                     | 13,347,421,672 |
| 野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)            | 13,052,448,062 |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX           | 11,299,120,093 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け)                 | 8,975,671,251  |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース)                 | 8,384,417,155  |
| マイバランスDC70                         | 6,446,099,587  |
| マイバランスDC50                         | 5,979,652,235  |
| のむらっ・ファンド(積極型)                     | 4,718,663,304  |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 4,226,843,980  |
| マイバランスDC30                         | 3,440,264,387  |
| マイ・ロード                             | 3,348,794,091  |
| 野村6資産均等バランス                        | 2,990,153,290  |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース)                 | 2,943,389,760  |
| 野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)          | 2,702,352,545  |
| のむらっ・ファンド(保守型)                     | 2,502,792,368  |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース)                 | 2,265,273,139  |
| 野村インデックスファンド・TOPIX                 | 2,218,758,615  |

| ファンド名                               | 当期末<br>元本額    |
|-------------------------------------|---------------|
|                                     | 円             |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)        | 2,190,276,651 |
| ノムラFOPs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用) | 1,819,019,926 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式              | 1,757,759,800 |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型       | 1,522,368,319 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け)               | 1,489,902,709 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け)               | 1,259,175,047 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け)               | 1,142,042,598 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)                | 719,501,005   |
| のむらっ・ファンド(やや積極型)                    | 714,475,593   |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け)               | 609,785,722   |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け)               | 509,436,528   |
| バランスセレクト70                          | 452,803,529   |
| マイターゲット2060(確定拠出年金向け)               | 448,502,266   |
| のむらっ・ファンド(やや保守型)                    | 436,682,300   |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)    | 412,983,407   |
| マイターゲット2055(確定拠出年金向け)               | 320,448,449   |
| バランスセレクト50                          | 308,241,556   |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)    | 300,130,381   |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)    | 286,025,212   |
| ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)      | 240,260,393   |

| ファンド名                               | 当期末         |
|-------------------------------------|-------------|
|                                     | 元本額         |
|                                     | 円           |
| 野村DC運用戦略ファンド                        | 233,339,640 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用) | 191,919,845 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10) (確定拠出年金向け)      | 163,817,987 |
| 野村資産設計ファンド2040                      | 163,449,531 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)   | 140,570,680 |
| バランスセレクト30                          | 134,959,101 |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)           | 116,966,979 |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け)              | 112,448,690 |
| 野村資産設計ファンド2030                      | 101,553,505 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース                | 94,633,963  |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用) | 91,173,034  |
| 野村資産設計ファンド2035                      | 86,406,302  |
| 世界6資産分散ファンド                         | 83,338,450  |
| 野村資産設計ファンド2025                      | 67,845,637  |
| 野村・国内株式インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用)   | 60,194,423  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)  | 48,227,972  |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用)            | 44,798,217  |
| 野村資産設計ファンド2050                      | 40,703,877  |
| 野村資産設計ファンド2020                      | 38,235,284  |
| 野村資産設計ファンド2015                      | 37,141,415  |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)               | 34,272,472  |
| 野村資産設計ファンド2045                      | 32,496,253  |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030         | 30,132,764  |
| インデックス・ブレンド(タイプV)                   | 29,998,908  |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)  | 29,771,197  |
| 野村資産設計ファンド2060                      | 28,914,036  |

| ファンド名                                         | 当期末        |
|-----------------------------------------------|------------|
|                                               | 元本額        |
|                                               | 円          |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)                         | 27,783,282 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040                   | 27,219,768 |
| インデックス・ブレンド(タイプIII)                           | 22,147,332 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050                   | 21,402,678 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)                            | 19,026,248 |
| みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)                   | 15,812,686 |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)              | 15,575,120 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060                   | 13,998,979 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)                | 13,239,498 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース                          | 12,719,596 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型              | 12,009,412 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)            | 7,958,277  |
| ネクストコア                                        | 7,518,455  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型              | 6,721,245  |
| インデックス・ブレンド(タイプIV)                            | 6,653,112  |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)                         | 5,955,912  |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース                        | 5,811,791  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型              | 5,300,690  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)             | 5,251,826  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型              | 4,574,384  |
| インデックス・ブレンド(タイプI)                             | 4,179,405  |
| インデックス・ブレンド(タイプII)                            | 3,383,145  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)              | 3,060,887  |
| 野村VFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 2,552,879  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)              | 1,182,206  |

## 〇お知らせ

投資信託約款に記載されている市場の名称が廃止となることに伴う所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2022年4月4日＞

# 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2022年3月31日）

作成対象期間（2021年4月1日～2022年3月31日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                              |
|--------|--------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。 |
| 主な投資対象 | 外国の株式を主要投資対象とします。                                            |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。                |

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期           | 基 準 価 額 |           | ベ ン チ マ ー ク                          |           | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 組 入 比 率 | 純 資 産 額   |
|-----------------|---------|-----------|--------------------------------------|-----------|-----------|-----------|-------------------|-----------|
|                 |         | 期 騰 落 中 率 | MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・<br>為替ヘッジなし) | 期 騰 落 中 率 |           |           |                   |           |
|                 | 円       | %         |                                      | %         | %         | %         | %                 | 百万円       |
| 16期(2018年4月2日)  | 24,752  | 7.2       | 265.15                               | 7.4       | 95.6      | 1.9       | 2.3               | 454,743   |
| 17期(2019年4月1日)  | 27,269  | 10.2      | 293.26                               | 10.6      | 95.6      | 1.7       | 2.6               | 566,435   |
| 18期(2020年3月31日) | 24,094  | △11.6     | 260.14                               | △11.3     | 95.8      | 1.5       | 2.7               | 556,023   |
| 19期(2021年3月31日) | 37,781  | 56.8      | 408.16                               | 56.9      | 95.9      | 1.9       | 2.2               | 927,648   |
| 20期(2022年3月31日) | 47,511  | 25.8      | 514.47                               | 26.0      | 95.8      | 1.4       | 2.4               | 1,315,344 |

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数（米ドルベース）をもとに、営業日当日の米ドル為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指数化しています。（以下同じ）

\*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。

ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

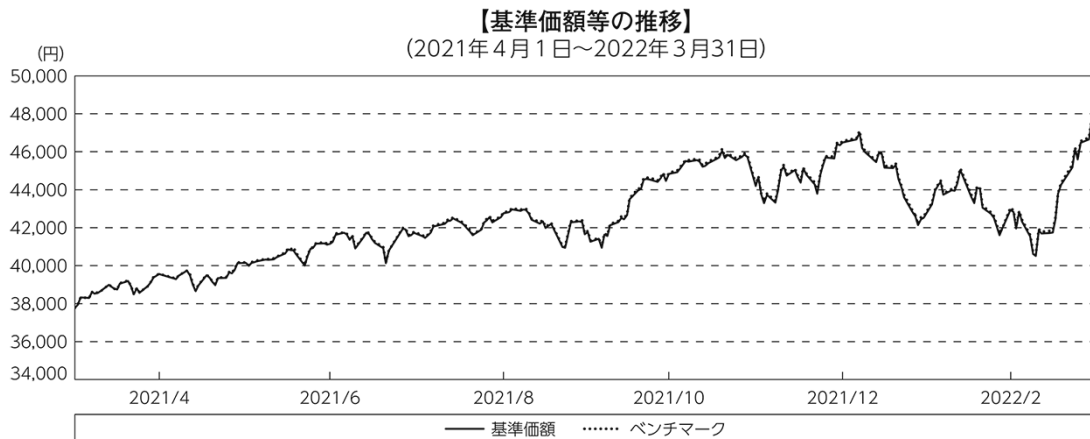
| 年 月 日      | 基 準 価 額 |       | ベ ン チ マ ー ク                          |       | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 組 入 比 率 |
|------------|---------|-------|--------------------------------------|-------|-----------|-----------|-------------------|
|            |         | 騰 落 率 | MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・<br>為替ヘッジなし) | 騰 落 率 |           |           |                   |
| (期 首)      | 円       | %     |                                      | %     | %         | %         | %                 |
| 2021年3月31日 | 37,781  | —     | 408.16                               | —     | 95.9      | 1.9       | 2.2               |
| 4月末        | 39,556  | 4.7   | 427.49                               | 4.7   | 95.8      | 2.0       | 2.2               |
| 5月末        | 40,142  | 6.2   | 434.03                               | 6.3   | 95.9      | 1.8       | 2.2               |
| 6月末        | 41,150  | 8.9   | 445.03                               | 9.0   | 95.8      | 1.9       | 2.2               |
| 7月末        | 41,737  | 10.5  | 451.47                               | 10.6  | 96.3      | 1.4       | 2.3               |
| 8月末        | 42,767  | 13.2  | 462.63                               | 13.3  | 96.0      | 1.7       | 2.3               |
| 9月末        | 41,777  | 10.6  | 451.95                               | 10.7  | 95.8      | 1.9       | 2.2               |
| 10月末       | 44,835  | 18.7  | 485.08                               | 18.8  | 96.0      | 1.4       | 2.3               |
| 11月末       | 44,662  | 18.2  | 483.01                               | 18.3  | 95.6      | 2.0       | 2.3               |
| 12月末       | 46,484  | 23.0  | 503.00                               | 23.2  | 95.7      | 1.9       | 2.3               |
| 2022年1月末   | 43,234  | 14.4  | 467.89                               | 14.6  | 96.5      | 1.1       | 2.3               |
| 2月末        | 42,941  | 13.7  | 465.14                               | 14.0  | 95.8      | 1.8       | 2.3               |
| (期 末)      |         |       |                                      |       |           |           |                   |
| 2022年3月31日 | 47,511  | 25.8  | 514.47                               | 26.0  | 95.8      | 1.4       | 2.4               |

\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン接種加速による経済正常化への期待が高まったこと、堅調な欧米企業の決算や欧米の経済指標が市場予想を上回ったことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から新型コロナウイルスのワクチン接種加速による経済正常化への期待が高まったこと、堅調な欧米企業の決算や欧米の経済指標が市場予想を上回ったことなどをを受けて上昇しました。2021年9月には、米国での新型コロナウイルスの感染再拡大や中国の大手不動産会社の債務問題を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり下落に転じましたが、10月以降は、新型コロナウイルスの経口治療薬の早期実用化への期待が台頭したことや米債務上限問題が先送りされたこと、堅調な欧米企業の決算発表が続いたことなどから再び上昇しました。2022年1月以降は、FRB（米連邦準備制度理事会）が金融政策の正常化を前倒しで進めるとの見方が強まったこと、ロシアがウクライナへ軍事侵攻したことや欧米を中心にロシアに対する経済制裁を強化する動きが広がったことで世界経済の先行き不透明感が強まったことなどをを受けて下落しました。3月中旬から下旬にかけては、ロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待などから上昇しました。

為替市場は、期首から主要通貨である米ドルは米金融緩和の早期縮小観測や米長期金利の行方を巡り一進一退となりました。2021年9月下旬から10月中旬にかけては、米金融政策の正常化が意識され米長期金利が上昇基調になったことなどから上昇（円安）しました。11月以降は、新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大への懸念や、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融政策正常化に対する姿勢などを巡り、再び一進一退となりました。2022年3月以降は、エネルギー価格の高騰などによる物価上昇に対応するべくFRBが金融引き締め姿勢を強めていることなどを背景に日米の金利差が拡大したことなどをを受けて上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行ない、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+25.8%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の+26.0%を0.2ポイント下回りました。

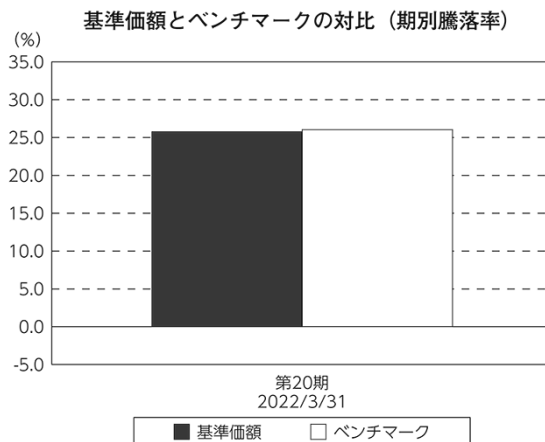
主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### （その他、差異を生じた要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）



（注）ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年 4 月 1 日～2022年 3 月31日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                                                                                    |
|-----------------------|--------|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                                                                                              |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円<br>1 | %<br>0.002 | (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<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料                                       |
| (株 式)                 | (0)    | (0.001)    |                                                                                                              |
| (投 資 信 託 証 券)         | (0)    | (0.000)    |                                                                                                              |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)     | (0)    | (0.001)    |                                                                                                              |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 2      | 0.005      | (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<br>※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)    | (0.005)    |                                                                                                              |
| (投 資 信 託 証 券)         | (0)    | (0.000)    |                                                                                                              |
| (c) そ の 他 費 用         | 4      | 0.010      | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br><br>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<br>信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (2)    | (0.004)    |                                                                                                              |
| (そ の 他)               | (2)    | (0.006)    |                                                                                                              |
| 合 計                   | 7      | 0.017      |                                                                                                              |
| 期中の平均基準価額は、42,255円です。 |        |            |                                                                                                              |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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4月1日～2022年3月31日)

## 株式

|     |         | 買 付                       |                                     | 売 付                      |                                    |
|-----|---------|---------------------------|-------------------------------------|--------------------------|------------------------------------|
|     |         | 株 数                       | 金 額                                 | 株 数                      | 金 額                                |
| 外 国 | アメリカ    | 百株<br>93,525<br>(△ 1,762) | 千米ドル<br>1,059,353<br>( 7,253)       | 百株<br>11,100<br>( 3,268) | 千米ドル<br>99,086<br>( 24,554)        |
|     | カナダ     | 11,780<br>( 1,741)        | 千カナダドル<br>69,488<br>( 7,287)        | 5,352<br>( 458)          | 千カナダドル<br>8,209<br>( 3,746)        |
|     | イギリス    | 68,195<br>( 11,455)       | 千英ポンド<br>41,463<br>( 4,740)         | 6,519<br>(18,083)        | 千英ポンド<br>3,316<br>( 12,729)        |
|     | スイス     | 4,400<br>( 91)            | 千スイスフラン<br>39,169<br>( 779)         | 778<br>( 91)             | 千スイスフラン<br>4,070<br>( 1,176)       |
|     | スウェーデン  | 10,692<br>( 16,002)       | 千スウェーデンクローナ<br>222,770<br>( 64,913) | 3,741<br>( 2,670)        | 千スウェーデンクローナ<br>25,672<br>( 64,913) |
|     | ノルウェー   | 1,553                     | 千ノルウェークローネ<br>28,813                | —                        | 千ノルウェークローネ<br>—                    |
|     | デンマーク   | 1,304<br>( 1,328)         | 千デンマーククローネ<br>66,286<br>( —)        | 224                      | 千デンマーククローネ<br>11,495               |
|     | ユーロ     |                           | 千ユーロ                                |                          | 千ユーロ                               |
|     | ドイツ     | 6,029<br>( 4,685)         | 31,347<br>( 6,350)                  | 1,250<br>( 2,900)        | 5,824<br>( 5,232)                  |
|     | イタリア    | 19,609<br>( 11)           | 8,596<br>( 5)                       | 12,030<br>( —)           | 686<br>( 106)                      |
|     | フランス    | 6,953<br>( 2,938)         | 39,382<br>( 724)                    | 3,852<br>( 996)          | 6,150<br>( 318)                    |
|     | オランダ    | 5,185<br>( 1,630)         | 25,395<br>(△ 23)                    | 1,594                    | 3,496                              |
|     | スペイン    | 12,397<br>( 42,855)       | 8,724<br>( 1,640)                   | 1,950<br>(41,377)        | 1,577<br>( 1,012)                  |
|     | ベルギー    | 589                       | 3,866                               | 70                       | 419                                |
|     | オーストリア  | 297                       | 1,159                               | —                        | —                                  |
|     | ルクセンブルグ | 379                       | 858                                 | —                        | —                                  |
|     | フィンランド  | 2,104                     | 3,344                               | 340                      | 172                                |
|     | アイルランド  | 291                       | 2,144                               | —<br>( 1,398)            | —<br>( —)                          |
|     | ポルトガル   | 1,230                     | 1,774                               | —                        | —                                  |
|     | 香港      | 22,822<br>( 930)          | 千香港ドル<br>97,155<br>(△ 147)          | 16,902                   | 千香港ドル<br>21,717                    |

|                |          | 買 付                     |                                | 売 付                     |                                  |
|----------------|----------|-------------------------|--------------------------------|-------------------------|----------------------------------|
|                |          | 株 数                     | 金 額                            | 株 数                     | 金 額                              |
| 外<br><br><br>国 | シンガポール   | 百株<br>5,270<br>( 9,816) | 千シンガポールドル<br>4,734<br>( 1,277) | 百株<br>5,016<br>( 4,800) | 千シンガポールドル<br>0.50032<br>( 1,822) |
|                | オーストラリア  | 17,624<br>( 5,171)      | 千豪ドル<br>43,365<br>( 15,255)    | 8,282<br>( 6,744)       | 千豪ドル<br>5,076<br>( 7,086)        |
|                | ニュージーランド | 1,750                   | 千ニュージーランドドル<br>1,360           | 1,170                   | 千ニュージーランドドル<br>714               |
|                | イスラエル    | 1,331                   | 千新シェケル<br>5,289                | —                       | 千新シェケル<br>—                      |

\*金額は受け渡し代金。  
\*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。  
\*（ ）内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 投資信託証券

| 銘 柄 | 買 付                          |                      | 売 付            |              |
|-----|------------------------------|----------------------|----------------|--------------|
|     | 口 数                          | 金 額                  | 口 数            | 金 額          |
| 外 国 | アメリカ                         | 口 千米ドル               | 口 千米ドル         |              |
|     | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 5,700                | 1,135          | —            |
|     | AMERICAN TOWER CORP          | 12,300               | 3,223          | —            |
|     | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT    | 29,000               | 234            | —            |
|     | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 3,900                | 860            | —            |
|     | BOSTON PROPERTIES            | 3,600                | 419            | —            |
|     | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 2,800                | 432            | —            |
|     | CROWN CASTLE INTL CORP       | 9,000                | 1,650          | —            |
|     | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 8,800                | 1,294          | —            |
|     | DUKE REALTY CORP             | 7,900                | 431            | —            |
|     | EQUINIX INC                  | 2,100                | 1,605          | —            |
|     | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 2,700                | 219            | —            |
|     | EQUITY RESIDENTIAL           | 10,300               | 853            | 3,200 245    |
|     | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 1,300                | 426            | —            |
|     | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 4,200                | 713            | —            |
|     | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 12,000               | 415            | —            |
|     | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 26,000               | 455            | —            |
|     | INVITATION HOMES INC         | 21,000               | 815            | —            |
|     | IRON MOUNTAIN INC            | 5,000                | 245            | —            |
|     | KIMCO REALTY CORP            | 115,000              | 2,784          | —            |
|     | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 9,000                | 181            | —            |
|     | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 2,100                | 420            | —            |
|     | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 6,500                | 237            | 43,000 1,201 |
|     | ORION OFFICE REIT INC        | —                    | —              | 9,551 184    |
|     |                              | ( 9,551)             | ( —)           |              |
|     | PROLOGIS INC                 | 18,100               | 2,468          | 1,700 228    |
|     | PUBLIC STORAGE               | 3,200                | 1,047          | —            |
|     | REALTY INCOME CORP           | 22,084               | 1,512          | —            |
|     |                              | ( 29,116)            | ( 1,643)       |              |
|     | REGENCY CENTERS CORP         | 6,400                | 450            | 3,800 244    |
|     | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 2,400                | 767            | —            |
|     | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 6,500                | 884            | —            |
|     | SUN COMMUNITIES INC          | 3,500                | 650            | —            |
|     | UDR INC                      | 13,000               | 689            | —            |
|     | VENTAS INC                   | 9,700                | 526            | —            |
|     | VEREIT INC                   | 4,300                | 210            | —            |
|     |                              | (△ 41,300)           | (△ 1,643)      |              |
|     | VICI PROPERTIES INC          | 33,000               | 976            | —            |
|     | VORNADO REALTY TRUST         | 5,000                | 205            | —            |
|     | WP CAREY INC                 | 6,600                | 501            | —            |
|     | WELLTOWER INC                | 14,200               | 1,150          | —            |
|     | WEYERHAEUSER CO              | 22,000               | 845            | —            |
|     | 小 計                          | 470,184<br>(△ 2,633) | 31,947<br>( —) | 61,251 2,104 |
|     | カナダ                          |                      | 千カナダドル         | 千カナダドル       |
|     | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 6,000                | 130            | —            |
|     | 小 計                          | 6,000                | 130            | —            |
|     | イギリス                         |                      | 千英ポンド          | 千英ポンド        |
|     | BRITISH LAND                 | 31,000               | 168            | —            |
|     | SEGRO PLC                    | 38,000               | 453            | —            |

| 銘 柄 |                                        | 買 付                   |                  | 売 付                  |             |
|-----|----------------------------------------|-----------------------|------------------|----------------------|-------------|
|     |                                        | 口 数                   | 金 額              | 口 数                  | 金 額         |
| 外 国 | イギリス                                   | 口                     | 千英ポンド            | 口                    | 千英ポンド       |
|     | LAND SECURITIES GROUP PLC              | 21,000                | 146              | —                    | —           |
|     | 小 計                                    | 90,000                | 768              | —                    | —           |
|     | ユーロ                                    |                       | 千ユーロ             |                      | 千ユーロ        |
|     | フランス                                   |                       |                  |                      |             |
|     | KLEPIERRE                              | 7,700<br>( — )        | 150<br>(△ 32)    | —                    | —           |
|     | GECINA SA                              | 1,000                 | 136              | —                    | —           |
|     | COVIVIO                                | 2,400                 | 151              | —                    | —           |
|     | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 2,700                 | 176              | 3,000                | 209         |
|     | 小 計                                    | 13,800<br>( — )       | 614<br>(△ 32)    | 3,000                | 209         |
|     | ユ ー ロ 計                                | 13,800<br>( — )       | 614<br>(△ 32)    | 3,000                | 209         |
|     | 香港                                     |                       | 千香港ドル            |                      | 千香港ドル       |
|     | LINK REIT                              | 39,000                | 2,793            | —                    | —           |
|     | 小 計                                    | 39,000                | 2,793            | —                    | —           |
|     | 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 COMMERCIAL TRUST | 123,200<br>( 74,242)  | 258<br>( 133)    | —                    | —           |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT           | 80,800<br>( — )       | 247<br>(△ 23)    | —                    | —           |
|     | SUNTEC REIT                            | —                     | —                | 300,000              | 429         |
|     | MAPLETREE LOGISTICS TRUST              | 122,000<br>( 20,349)  | 240<br>( 29)     | —                    | —           |
|     | MAPLETREE LOGISTICS TRUST-RTS          | ( 20,349)             | ( 37)            | ( 20,349)            | ( 1)        |
|     | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST             | ( — )<br>( — )        | ( — )<br>(△ 2)   | —                    | —           |
|     | 小 計                                    | 326,000<br>( 114,940) | 745<br>( 175)    | 300,000<br>( 20,349) | 429<br>( 1) |
|     | オーストラリア                                |                       | 千豪ドル             |                      | 千豪ドル        |
|     | MIRVAC GROUP                           | 90,000                | 265              | —                    | —           |
|     | GPT GROUP                              | 50,000                | 238              | —                    | —           |
|     | LENDLEASE GROUP                        | 24,000                | 257              | —                    | —           |
|     | STOCKLAND TRUST GROUP                  | 60,000                | 254              | —                    | —           |
|     | DEXUS/AU                               | 25,000<br>(△196,000)  | 259<br>(△ 1,892) | —                    | —           |
|     | GOODMAN GROUP                          | 36,000                | 823              | —                    | —           |
|     | SCENTRE GROUP                          | 190,000               | 546              | —                    | —           |
|     | DEXUS/AU                               | ( 196,000)            | ( 1,892)         | —                    | —           |
|     | 小 計                                    | 475,000               | 2,645            | —                    | —           |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、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<br>223,381 | 百万円<br>225,472 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

\*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4月1日～2022年3月31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       | 181,377,433千円   |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 1,080,869,998千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.16            |

\* (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4月1日～2022年3月31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。

## ○組入資産の明細

(2022年3月31日現在)

## 外国株式

| 銘<br>柄                       | 期首(前期末) | 当 期 末  |               | 業 種 等      |                         |
|------------------------------|---------|--------|---------------|------------|-------------------------|
|                              | 株 数     | 株 数    | 評 価 額         |            |                         |
|                              |         |        | 外貨建金額<br>千米ドル |            | 邦貨換算金額<br>千円            |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株     |               |            |                         |
| AFLAC INC                    | 1,089   | 1,169  | 7,656         | 937,134    | 保険                      |
| AES CORP                     | 1,100   | 1,270  | 3,232         | 395,582    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A  | —       | 910    | 2,336         | 286,010    | 娯楽                      |
| AT & T INC                   | 11,810  | 13,440 | 32,444        | 3,970,840  | 各種電気通信サービス              |
| ABBOTT LABORATORIES          | 2,937   | 3,328  | 40,062        | 4,903,244  | ヘルスケア機器・用品              |
| ABBVIE INC                   | 2,926   | 3,327  | 54,479        | 6,667,761  | バイオテクノロジー               |
| ABIOMED INC                  | 72      | 87     | 2,858         | 349,795    | ヘルスケア機器・用品              |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 1,290   | 1,475  | 11,853        | 1,450,700  | 娯楽                      |
| ADOBE INC                    | 794     | 895    | 41,198        | 5,042,268  | ソフトウェア                  |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 109     | 120    | 2,541         | 311,095    | 専門小売り                   |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 1,993   | 3,076  | 36,677        | 4,488,995  | 半導体・半導体製造装置             |
| AFFIRM HOLDINGS INC          | —       | 330    | 1,542         | 188,817    | 情報技術サービス                |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 519     | 566    | 7,667         | 938,368    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 87      | 555    | 9,636         | 1,179,406  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| AIR PRODUCTS                 | 363     | 420    | 10,632        | 1,301,338  | 化学                      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES          | 274     | 313    | 3,790         | 463,949    | 情報技術サービス                |
| ALBEMARLE CORP               | 197     | 218    | 4,864         | 595,386    | 化学                      |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 369     | —      | —             | —          | バイオテクノロジー               |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 125     | 143    | 6,323         | 773,875    | ヘルスケア機器・用品              |
| ALLEGHANY CORP               | 23      | 25     | 2,187         | 267,713    | 保険                      |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 409     | 484    | 3,043         | 372,480    | 電力                      |
| ALLSTATE CORP                | 496     | 535    | 7,510         | 919,254    | 保険                      |
| ALLY FINANCIAL INC           | 630     | 670    | 2,985         | 365,397    | 消費者金融                   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 187     | 230    | 3,800         | 465,145    | バイオテクノロジー               |
| ALPHABET INC-CL C            | 492     | 538    | 153,514       | 18,788,579 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALPHABET INC-CL A            | 498     | 566    | 160,702       | 19,668,411 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALTICE USA INC-A             | 360     | —      | —             | —          | メディア                    |
| ALTRIA GROUP INC             | 3,105   | 3,444  | 17,926        | 2,193,965  | タバコ                     |
| AMAZON.COM INC               | 706     | 858    | 285,671       | 34,963,378 | インターネット販売・通信販売          |
| AMERCO                       | 17      | 17     | 1,039         | 127,272    | 陸運・鉄道                   |
| AMEREN CORPORATION           | 415     | 494    | 4,634         | 567,241    | 総合公益事業                  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 834     | 949    | 9,434         | 1,154,744  | 電力                      |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 1,136   | 1,239  | 23,511        | 2,877,543  | 消費者金融                   |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 125     | 139    | 2,053         | 251,304    | 保険                      |
| AMERICAN INTL GROUP          | 1,450   | 1,549  | 9,834         | 1,203,656  | 保険                      |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 306     | 347    | 5,754         | 704,353    | 水道                      |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 257     | 289    | 4,483         | 548,741    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 192     | 213    | 6,615         | 809,705    | 資本市場                    |
| AMETEK INC                   | 373     | 438    | 5,931         | 725,997    | 電気設備                    |
| AMGEN INC                    | 961     | 1,060  | 25,712        | 3,146,943  | バイオテクノロジー               |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 1,004   | 1,126  | 8,637         | 1,057,149  | 電子装置・機器・部品              |
| ANALOG DEVICES INC           | 618     | 1,014  | 16,881        | 2,066,074  | 半導体・半導体製造装置             |
| ANSYS INC                    | 145     | 164    | 5,253         | 642,924    | ソフトウェア                  |
| ANTHEM INC                   | 409     | 457    | 22,963        | 2,810,482  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 275     | —      | —             | —          | 資本市場                    |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | —       | 665    | 4,192         | 513,078    | 各種金融サービス                |
| APPLE INC                    | 28,174  | 30,874 | 548,847       | 67,173,396 | コンピュータ・周辺機器             |
| APPLIED MATERIALS            | 1,507   | 1,699  | 23,072        | 2,823,833  | 半導体・半導体製造装置             |

| 銘柄                                 | 株数     | 期首(前期末) | 当期末    |            | 業種等                     |
|------------------------------------|--------|---------|--------|------------|-------------------------|
|                                    |        | 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         |                         |
| ARAMARK                            | 390    | 440     | 1,666  | 203,936    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ARCHER DANIELS MIDLAND             | 938    | 1,045   | 9,331  | 1,142,125  | 食品                      |
| ARISTA NETWORKS INC                | 96     | 440     | 6,080  | 744,175    | 通信機器                    |
| ARROW ELECTRS INC                  | 121    | 137     | 1,651  | 202,114    | 電子装置・機器・部品              |
| ASANA INC - CL A                   | —      | 119     | 496    | 60,719     | ソフトウェア                  |
| ASSURANT INC                       | 102    | 102     | 1,858  | 227,417    | 保険                      |
| ATMOS ENERGY CORP                  | 202    | 244     | 2,937  | 359,462    | ガス                      |
| AUTODESK INC.                      | 367    | 410     | 9,061  | 1,108,975  | ソフトウェア                  |
| AUTOLIV INC                        | 140    | —       | —      | —          | 自動車部品                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESS             | 706    | 790     | 17,993 | 2,202,168  | 情報技術サービス                |
| AUTOZONE                           | 37     | 39      | 8,153  | 997,859    | 専門小売り                   |
| AVALARA INC                        | 131    | 172     | 1,726  | 211,247    | ソフトウェア                  |
| AVANTOR INC                        | 840    | 1,050   | 3,608  | 441,687    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| AVERY DENNISON CORP                | 134    | 156     | 2,758  | 337,618    | 容器・包装                   |
| BAKER HUGHES CO                    | 1,110  | 1,580   | 5,901  | 722,260    | エネルギー設備・サービス            |
| BALL CORP                          | 551    | 618     | 5,654  | 692,003    | 容器・包装                   |
| BANK OF AMERICA CORP               | 12,900 | 13,860  | 59,598 | 7,294,199  | 銀行                      |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP        | 1,343  | 1,464   | 7,589  | 928,863    | 資本市場                    |
| BATH & BODY WORKS INC              | —      | 504     | 2,514  | 307,805    | 専門小売り                   |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.          | 855    | 933     | 7,406  | 906,439    | ヘルスケア機器・用品              |
| BECTON, DICKINSON                  | 484    | 534     | 14,396 | 1,761,939  | ヘルスケア機器・用品              |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B        | —      | 330     | 1,467  | 179,568    | ソフトウェア                  |
| WR BERKLEY CORP                    | 239    | 399     | 2,676  | 327,575    | 保険                      |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B        | 2,272  | 2,453   | 87,721 | 10,736,262 | 各種金融サービス                |
| BEST BUY COMPANY INC               | 393    | 424     | 4,088  | 500,407    | 専門小売り                   |
| BILL.COM HOLDINGS INC              | —      | 142     | 3,296  | 403,462    | ソフトウェア                  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A             | 36     | 43      | 2,494  | 305,361    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC        | 306    | 334     | 2,601  | 318,400    | バイオテクノロジー               |
| BIOGEN INC                         | 252    | 277     | 5,845  | 715,434    | バイオテクノロジー               |
| BIO TECHNE CORP                    | —      | 75      | 3,317  | 406,071    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| BLACK KNIGHT INC                   | 270    | 298     | 1,736  | 212,523    | ソフトウェア                  |
| BLACKROCK INC                      | 254    | 285     | 22,224 | 2,720,083  | 資本市場                    |
| BLACKSTONE INC                     | 1,126  | 1,299   | 16,527 | 2,022,761  | 資本市場                    |
| BOEING CO                          | 885    | 1,055   | 20,563 | 2,516,706  | 航空宇宙・防衛                 |
| BOOKING HOLDINGS INC               | 67     | 77      | 17,925 | 2,193,904  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS       | 226    | 248     | 2,217  | 271,383    | 専門サービス                  |
| BORGWARNER INC                     | 404    | 450     | 1,782  | 218,209    | 自動車部品                   |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP             | 2,350  | 2,680   | 11,979 | 1,466,183  | ヘルスケア機器・用品              |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO            | 3,742  | 4,177   | 30,792 | 3,768,736  | 医薬品                     |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 194    | 218     | 3,397  | 415,797    | 情報技術サービス                |
| BROADCOM INC                       | 668    | 774     | 48,884 | 5,982,941  | 半導体・半導体製造装置             |
| BROWN & BROWN INC                  | 388    | 460     | 3,344  | 409,352    | 保険                      |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B             | 527    | 585     | 3,937  | 481,927    | 飲料                      |
| BURLINGTON STORES INC              | 114    | 121     | 2,303  | 281,952    | 専門小売り                   |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC            | 179    | 195     | 2,236  | 273,719    | 資本市場                    |
| CBRE GROUP INC                     | 548    | 623     | 5,779  | 707,361    | 不動産管理・開発                |
| CDW CORPORATION                    | 239    | 250     | 4,470  | 547,144    | 電子装置・機器・部品              |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC         | 353    | 412     | 4,161  | 509,339    | 化学                      |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC        | 220    | 243     | 2,667  | 326,434    | 航空貨物・物流サービス             |
| CIGNA CORP                         | 595    | 622     | 15,290 | 1,871,419  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CME GROUP INC                      | 600    | 674     | 16,297 | 1,994,628  | 資本市場                    |
| CMS ENERGY CORP                    | 482    | 543     | 3,800  | 465,137    | 総合公益事業                  |
| CSX CORP                           | 1,279  | 4,190   | 15,838 | 1,938,437  | 陸運・鉄道                   |
| CVS HEALTH CORP                    | 2,184  | 2,484   | 25,721 | 3,148,093  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |

| 銘柄                            | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |
|-------------------------------|-------|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                               |       | 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        |                         |
| CABLE ONE INC                 | 8     | 9       | 1,514  | 185,388   | メディア                    |
| COTERRA ENERGY INC            | 640   | 1,450   | 3,929  | 480,931   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CADENCE DESIGN SYS INC        | 469   | 517     | 8,443  | 1,033,354 | ソフトウェア                  |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC     | —     | 397     | 3,077  | 376,709   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CAMPBELL SOUP CO              | 309   | 360     | 1,587  | 194,306   | 食品                      |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP    | 766   | 799     | 10,744 | 1,314,976 | 消費者金融                   |
| CARDINAL HEALTH INC           | 472   | 553     | 3,186  | 390,049   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARMAX INC                    | 279   | 313     | 3,177  | 388,941   | 専門小売り                   |
| CARLYLE GROUP INC/THE         | 220   | 290     | 1,354  | 165,717   | 資本市場                    |
| CARNIVAL CORP                 | 1,290 | 1,590   | 3,116  | 381,416   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CARRIER GLOBAL CORP           | 1,390 | 1,530   | 7,278  | 890,780   | 建設関連製品                  |
| CARVANA CO                    | 102   | 138     | 1,738  | 212,777   | 専門小売り                   |
| CATALENT INC                  | 280   | 323     | 3,579  | 438,132   | 医薬品                     |
| CATERPILLAR INC DEL           | 899   | 1,016   | 22,664 | 2,773,960 | 機械                      |
| CELANESE CORP-SERIES A        | 195   | 209     | 3,022  | 369,982   | 化学                      |
| CENTENE CORP                  | 975   | 1,107   | 9,560  | 1,170,054 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC        | 940   | 1,200   | 3,693  | 452,059   | 総合公益事業                  |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC      | 216   | 268     | 1,855  | 227,045   | ソフトウェア                  |
| CERNER CORP                   | 520   | 545     | 5,103  | 624,669   | ヘルスケア・テクノロジー            |
| CHARLES RIVER LABORATORIES    | —     | 96      | 2,782  | 340,569   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 230   | 235     | 13,426 | 1,643,248 | メディア                    |
| CHENIERE ENERGY INC           | 364   | 459     | 6,484  | 793,668   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHEVRON CORP                  | 3,190 | 3,628   | 60,036 | 7,347,823 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHEWY INC - CLASS A           | 123   | 151     | 646    | 79,079    | インターネット販売・通信販売          |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC    | 44    | 53      | 8,421  | 1,030,692 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CHURCH & DWIGHT CO INC        | 398   | 450     | 4,465  | 546,514   | 家庭用品                    |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 246   | 285     | 3,937  | 481,883   | 保険                      |
| CISCO SYSTEMS                 | 7,002 | 7,937   | 44,486 | 5,444,749 | 通信機器                    |
| CINTAS CORP                   | 143   | 177     | 7,646  | 935,864   | 商業サービス・用品               |
| CITIGROUP                     | 3,457 | 3,734   | 20,525 | 2,512,152 | 銀行                      |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP      | 700   | 788     | 3,687  | 451,354   | 銀行                      |
| CITRIX SYSTEMS INC            | 198   | 238     | 2,415  | 295,628   | ソフトウェア                  |
| CLOROX CO                     | 213   | 225     | 3,138  | 384,151   | 家庭用品                    |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A      | 329   | 493     | 6,132  | 750,608   | 情報技術サービス                |
| COCA COLA CO                  | 6,765 | 7,722   | 48,038 | 5,879,439 | 飲料                      |
| COGNEX CORP                   | 278   | 336     | 2,623  | 321,088   | 電子装置・機器・部品              |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 875   | 997     | 9,111  | 1,115,166 | 情報技術サービス                |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A  | —     | 78      | 1,534  | 187,778   | 資本市場                    |
| COLGATE PALMOLIVE CO.         | 1,363 | 1,504   | 11,484 | 1,405,593 | 家庭用品                    |
| COMCAST CORP-CL A             | 7,566 | 8,581   | 40,922 | 5,008,540 | メディア                    |
| CONAGRA BRANDS INC            | 821   | 930     | 3,106  | 380,167   | 食品                      |
| CONOCOPHILLIPS                | 2,231 | 2,475   | 25,022 | 3,062,473 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CONSOLIDATED EDISON INC       | 570   | 663     | 6,280  | 768,682   | 総合公益事業                  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A    | 283   | 312     | 7,272  | 890,031   | 飲料                      |
| CONSTELLATION ENERGY          | —     | 629     | 3,616  | 442,654   | 電力                      |
| THE COOPER COMPANIES, INC.    | 91    | 93      | 3,919  | 479,648   | ヘルスケア機器・用品              |
| COPART INC                    | 358   | 408     | 5,199  | 636,323   | 商業サービス・用品               |
| CORNING INC                   | 1,290 | 1,550   | 5,824  | 712,909   | 電子装置・機器・部品              |
| CORTEVA INC                   | 1,217 | 1,387   | 8,095  | 990,859   | 化学                      |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION  | 733   | 831     | 47,927 | 5,865,873 | 食品・生活必需品小売り             |
| COSTAR GROUP INC              | 66    | 757     | 5,146  | 629,922   | 専門サービス                  |
| COUPA SOFTWARE INC            | 114   | 142     | 1,476  | 180,658   | ソフトウェア                  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A  | 290   | 369     | 8,301  | 1,015,962 | ソフトウェア                  |
| CROWN HOLDINGS INC            | 228   | 247     | 3,148  | 385,346   | 容器・包装                   |

| 銘柄                          | 株数    | 期首(前期末) | 当期     |           | 業種等                     |
|-----------------------------|-------|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                             |       | 株数      | 評価額    | 期末        |                         |
|                             |       |         | 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        |                         |
| CUMMINS INC                 | 249   | 267     | 5,595  | 684,835   | 機械                      |
| DR HORTON INC               | 561   | 633     | 4,993  | 611,183   | 家庭用耐久財                  |
| DTE ENERGY COMPANY          | 328   | 362     | 4,798  | 587,309   | 総合公益事業                  |
| DANAHER CORP                | 1,060 | 1,210   | 35,980 | 4,403,660 | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| DARDEN RESTAURANTS INC      | 220   | 250     | 3,291  | 402,846   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DATADOG INC - CLASS A       | 293   | 413     | 6,180  | 756,487   | ソフトウェア                  |
| DAVITA INC                  | 125   | 125     | 1,432  | 175,369   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DEERE & COMPANY             | 494   | 552     | 22,938 | 2,807,425 | 機械                      |
| DELL TECHNOLOGIES-C         | 407   | 558     | 3,031  | 370,970   | コンピュータ・周辺機器             |
| DELTA AIR LINES INC         | 252   | 300     | 1,179  | 144,407   | 旅客航空輸送業                 |
| DENTSPLY SIRONA INC         | 352   | 422     | 2,091  | 255,918   | ヘルスケア機器・用品              |
| DEVON ENERGY CORP           | 1,000 | 1,204   | 7,291  | 892,397   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DEXCOM INC                  | 161   | 181     | 9,394  | 1,149,763 | ヘルスケア機器・用品              |
| DIAMONDBACK ENERGY INC      | —     | 321     | 4,466  | 546,681   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DISNEY (WALT) CO            | 3,000 | 3,421   | 48,222 | 5,901,941 | 娯楽                      |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 500   | 556     | 6,298  | 770,925   | 消費者金融                   |
| DISCOVERY INC - A           | 245   | 310     | 796    | 97,508    | メディア                    |
| DISCOVERY INC - C           | 491   | 580     | 1,492  | 182,647   | メディア                    |
| DISH NETWORK CORP-A         | 384   | 434     | 1,383  | 169,337   | メディア                    |
| DOCUSIGN INC                | 293   | 364     | 3,929  | 480,916   | ソフトウェア                  |
| DOLLAR GENERAL CORP         | 418   | 443     | 10,076 | 1,233,314 | 複合小売り                   |
| DOLLAR TREE INC             | 382   | 422     | 6,765  | 828,030   | 複合小売り                   |
| DOMINION ENERGY INC         | 1,340 | 1,534   | 13,104 | 1,603,916 | 総合公益事業                  |
| DOMINOS PIZZA INC           | 63    | 69      | 2,803  | 343,091   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DOORDASH INC-A              | —     | 196     | 2,317  | 283,615   | インターネット販売・通信販売          |
| DOVER CORP                  | 243   | 268     | 4,303  | 526,710   | 機械                      |
| DOW INC                     | 1,245 | 1,405   | 9,028  | 1,105,001 | 化学                      |
| DRAFTKINGS INC - CL A       | 277   | 584     | 1,191  | 145,882   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DROPBOX INC-CLASS A         | 510   | 570     | 1,350  | 165,266   | ソフトウェア                  |
| DUKE ENERGY CORP            | 1,230 | 1,444   | 16,097 | 1,970,198 | 電力                      |
| DUPONT DE NEMOURS INC       | 877   | 969     | 7,416  | 907,733   | 化学                      |
| DYNATRACE INC               | 290   | 330     | 1,577  | 193,098   | ソフトウェア                  |
| EOG RESOURCES INC           | 981   | 1,099   | 13,307 | 1,628,740 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| EASTMAN CHEMICAL CO.        | 230   | 250     | 2,857  | 349,729   | 化学                      |
| EBAY INC                    | 1,128 | 1,168   | 6,933  | 848,560   | インターネット販売・通信販売          |
| ECOLAB INC                  | 430   | 486     | 8,767  | 1,073,046 | 化学                      |
| EDISON INTERNATIONAL        | 612   | 727     | 5,049  | 618,037   | 電力                      |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP   | 1,042 | 1,172   | 13,722 | 1,679,551 | ヘルスケア機器・用品              |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC    | 740   | 810     | 2,199  | 269,253   | 医薬品                     |
| ELECTRONIC ARTS             | 485   | 532     | 6,792  | 831,343   | 娯楽                      |
| EMERSON ELEC                | 982   | 1,113   | 11,016 | 1,348,306 | 電気設備                    |
| ENPHASE ENERGY INC          | 195   | 246     | 4,837  | 592,072   | 半導体・半導体製造装置             |
| ENTEGRIS INC                | —     | 257     | 3,480  | 426,016   | 半導体・半導体製造装置             |
| ENTERGY CORP                | 336   | 376     | 4,400  | 538,602   | 電力                      |
| EPAM SYSTEMS INC            | 95    | 103     | 3,020  | 369,719   | 情報技術サービス                |
| EQUIFAX INC                 | 197   | 233     | 5,581  | 683,064   | 専門サービス                  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC      | 690   | 690     | 2,187  | 267,703   | 各種金融サービス                |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 44    | 44      | 790    | 96,771    | 保険                      |
| ESSENTIAL UTILITIES INC     | 396   | 440     | 2,287  | 279,974   | 水道                      |
| ETSY INC                    | 209   | 244     | 3,283  | 401,838   | インターネット販売・通信販売          |
| EVERGY INC                  | 359   | 429     | 2,928  | 358,401   | 電力                      |
| EVERSOURCE ENERGY           | 564   | 644     | 5,708  | 698,653   | 電力                      |
| EXACT SCIENCES CORP         | 258   | 323     | 2,303  | 281,942   | バイオテクノロジー               |
| EXELON CORPORATION          | 1,637 | 1,830   | 8,643  | 1,057,827 | 電力                      |

| 銘柄                                 | 株数     | 期首(前期末) | 当 期 末   |            | 業 種 等                   |
|------------------------------------|--------|---------|---------|------------|-------------------------|
|                                    |        | 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         |                         |
| EXPEDIA GROUP INC                  | 223    | 279     | 5,361   | 656,199    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC  | 271    | 327     | 3,437   | 420,746    | 航空貨物・物流サービス             |
| EXXON MOBIL CORP                   | 7,007  | 7,967   | 66,747  | 8,169,229  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FMC CORP                           | 212    | 232     | 3,080   | 376,993    | 化学                      |
| META PLATFORMS INC                 | 3,984  | 4,453   | 101,461 | 12,417,885 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC       | 64     | 69      | 3,035   | 371,491    | 資本市場                    |
| FAIR ISAAC CORP                    | 46     | 51      | 2,442   | 298,880    | ソフトウェア                  |
| FASTENAL CO                        | 969    | 1,089   | 6,502   | 795,831    | 商社・流通業                  |
| FEDEX CORPORATION                  | 417    | 479     | 11,268  | 1,379,148  | 航空貨物・物流サービス             |
| F5 INC                             | 104    | 113     | 2,404   | 294,276    | 通信機器                    |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION      | 1,035  | 1,139   | 11,506  | 1,408,241  | 情報技術サービス                |
| FNF GROUP                          | 454    | 500     | 2,489   | 304,689    | 保険                      |
| FIFTH THIRD BANCORP                | 1,200  | 1,270   | 5,623   | 688,267    | 銀行                      |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A         | —      | 22      | 1,524   | 186,576    | 銀行                      |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA             | 290    | 337     | 5,594   | 684,756    | 銀行                      |
| FISERV INC                         | 952    | 1,126   | 11,500  | 1,407,602  | 情報技術サービス                |
| FIRSTENERGY CORP                   | 866    | 1,040   | 4,763   | 582,968    | 電力                      |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          | 135    | 142     | 3,553   | 434,866    | 情報技術サービス                |
| FORD MOTOR COMPANY                 | 6,560  | 7,430   | 12,831  | 1,570,460  | 自動車                     |
| FORTINET INC                       | 224    | 259     | 8,855   | 1,083,884  | ソフトウェア                  |
| FORTIVE CORP                       | 518    | 648     | 4,026   | 492,745    | 機械                      |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 234    | 256     | 1,989   | 243,479    | 建設関連製品                  |
| FOX CORP-CLASS A                   | 580    | 620     | 2,488   | 304,589    | メディア                    |
| FOX CORP-CLASS B                   | 254    | 300     | 1,104   | 135,228    | メディア                    |
| FRANKLIN RESOURCES INC             | 510    | 570     | 1,618   | 198,055    | 資本市場                    |
| FREEPORT-MCMORAN INC               | 2,390  | 2,760   | 14,015  | 1,715,330  | 金属・鉱業                   |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR              | —      | 82      | 306     | 37,534     | 資本市場                    |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO            | 319    | 395     | 6,865   | 840,219    | 保険                      |
| GARTNER INC                        | 141    | 153     | 4,613   | 564,672    | 情報技術サービス                |
| GENERAC HOLDINGS INC               | 102    | 116     | 3,608   | 441,619    | 電気設備                    |
| GENERAL DYNAMICS                   | 410    | 446     | 10,896  | 1,333,643  | 航空宇宙・防衛                 |
| GENERAL ELEC CO                    | 14,530 | —       | —       | —          | コングロマリット                |
| GENERAL ELECTRIC CO                | —      | 2,058   | 19,464  | 2,382,267  | コングロマリット                |
| GENERAL MILLS                      | 1,028  | 1,133   | 7,697   | 942,109    | 食品                      |
| GENERAL MOTORS CO                  | 2,153  | 2,460   | 11,124  | 1,361,481  | 自動車                     |
| GENUINE PARTS CO                   | 232    | 266     | 3,426   | 419,415    | 販売                      |
| GILEAD SCIENCES INC                | 2,082  | 2,354   | 14,043  | 1,718,840  | バイオテクノロジー               |
| GLOBAL PAYMENTS INC                | 492    | 549     | 7,549   | 924,025    | 情報技術サービス                |
| GLOBE LIFE INC                     | 157    | 177     | 1,807   | 221,179    | 保険                      |
| GODADDY INC - CLASS A              | 269    | 323     | 2,738   | 335,191    | 情報技術サービス                |
| GOLDMAN SACHS GROUP                | 543    | 635     | 21,309  | 2,608,126  | 資本市場                    |
| GRAINGER(W.W.) INC                 | 74     | 83      | 4,321   | 528,885    | 商社・流通業                  |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC             | 136    | 158     | 1,507   | 184,519    | ソフトウェア                  |
| HCA HEALTHCARE INC                 | 454    | 467     | 11,906  | 1,457,252  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HP INC                             | 2,250  | 2,170   | 8,428   | 1,031,537  | コンピュータ・周辺機器             |
| HALLIBURTON CO                     | 1,500  | 1,670   | 6,432   | 787,315    | エネルギー設備・サービス            |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES        | 589    | 653     | 4,800   | 587,576    | 保険                      |
| HASBRO INC                         | 214    | 255     | 2,154   | 263,719    | レジャー用品                  |
| HEICO CORP                         | 63     | 79      | 1,224   | 149,827    | 航空宇宙・防衛                 |
| HEICO CORP-CLASS A                 | 123    | 139     | 1,766   | 216,225    | 航空宇宙・防衛                 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC        | 127    | 139     | 2,741   | 335,582    | 情報技術サービス                |
| HERSHEY CO/THE                     | 251    | 275     | 5,957   | 729,184    | 食品                      |
| HESS CORP                          | 473    | 524     | 5,688   | 696,220    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE         | 2,200  | 2,460   | 4,250   | 520,265    | コンピュータ・周辺機器             |

| 銘柄                                       | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |            | 業 種 等                   |
|------------------------------------------|-------|---------|--------|------------|-------------------------|
|                                          |       | 株数      | 評 価 額  |            |                         |
|                                          |       |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |                         |
| (アメリカ)                                   | 百株    | 百株      | 千円ドル   | 千円         |                         |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC            | 468   | 530     | 8,116  | 993,433    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HOLOGIC INC                              | 434   | 461     | 3,534  | 432,585    | ヘルスケア機器・用品              |
| HOME DEPOT                               | 1,784 | 1,965   | 60,612 | 7,418,350  | 専門小売り                   |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC              | 1,165 | 1,295   | 25,451 | 3,115,061  | コングロマリット                |
| HORMEL FOODS CORP                        | 500   | 550     | 2,832  | 346,669    | 食品                      |
| HOWMET AEROSPACE INC                     | 660   | 720     | 2,623  | 321,112    | 航空宇宙・防衛                 |
| HUBSPOT INC                              | 70    | 84      | 4,246  | 519,712    | ソフトウェア                  |
| HUMANA INC                               | 217   | 244     | 10,721 | 1,312,157  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC              | 132   | 157     | 3,238  | 396,333    | 陸運・鉄道                   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC                | 1,720 | 2,710   | 4,035  | 493,866    | 銀行                      |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE             | 65    | 75      | 1,524  | 186,632    | 航空宇宙・防衛                 |
| IAC/INTERACTIVE CORP                     | 136   | —       | —      | —          | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| IAC/INTERACTIVECORP                      | —     | 150     | 1,535  | 187,917    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| IPG PHOTONICS CORP                       | 59    | 69      | 782    | 95,714     | 電子装置・機器・部品              |
| IDEX CORP                                | 123   | 142     | 2,774  | 339,540    | 機械                      |
| IDEXX LABORATORIES INC                   | 142   | 158     | 8,713  | 1,066,388  | ヘルスケア機器・用品              |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC                  | 529   | 594     | 12,750 | 1,560,570  | 機械                      |
| ILLUMINA INC                             | 244   | 280     | 9,857  | 1,206,412  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| INCYTE CORP                              | 312   | 365     | 2,907  | 355,904    | バイオテクノロジー               |
| INGERSOLL-RAND INC                       | 580   | 764     | 3,881  | 475,010    | 機械                      |
| INSULET CORP                             | 106   | 133     | 3,506  | 429,166    | ヘルスケア機器・用品              |
| INTEL CORP                               | 6,791 | 7,655   | 39,369 | 4,818,453  | 半導体・半導体製造装置             |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC            | 930   | 1,066   | 14,321 | 1,752,834  | 資本市場                    |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES          | 1,485 | 1,688   | 22,303 | 2,729,730  | 情報技術サービス                |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE        | 371   | 481     | 6,311  | 772,427    | 化学                      |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO)               | 601   | 675     | 3,131  | 383,242    | 容器・包装                   |
| INTERPUBRIC GROUP                        | 670   | 730     | 2,664  | 326,108    | メディア                    |
| INTUIT INC                               | 433   | 506     | 23,885 | 2,923,332  | ソフトウェア                  |
| INTUITIVE SURGICAL INC                   | 194   | 672     | 20,458 | 2,503,899  | ヘルスケア機器・用品              |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC                | 214   | —       | —      | —          | バイオテクノロジー               |
| IQVIA HOLDINGS INC                       | 322   | 357     | 8,258  | 1,010,711  | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| JPMORGAN CHASE & CO                      | 5,051 | 5,561   | 78,154 | 9,565,304  | 銀行                      |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC             | 213   | 245     | 3,418  | 418,418    | 専門サービス                  |
| JOHNSON & JOHNSON                        | 4,362 | 4,954   | 88,968 | 10,888,901 | 医薬品                     |
| JUNIPER NETWORKS INC                     | 530   | 600     | 2,254  | 275,964    | 通信機器                    |
| KLA CORP                                 | 255   | 284     | 10,616 | 1,299,351  | 半導体・半導体製造装置             |
| KKR & CO INC-A                           | 855   | 974     | 5,776  | 707,021    | 資本市場                    |
| KANSAS CITY SOUTHERN                     | 151   | —       | —      | —          | 陸運・鉄道                   |
| KELLOGG CO                               | 433   | 494     | 3,165  | 387,371    | 食品                      |
| KEURIG DR PEPPER INC                     | 920   | 1,310   | 4,997  | 611,662    | 飲料                      |
| KEYCORP                                  | 1,580 | 1,780   | 4,095  | 501,282    | 銀行                      |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC                | 304   | 349     | 5,612  | 686,885    | 電子装置・機器・部品              |
| KIMBERLY-CLARK CORP                      | 572   | 640     | 7,926  | 970,112    | 家庭用品                    |
| KINDER MORGAN INC                        | 3,440 | 3,850   | 7,349  | 899,523    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 208   | 301     | 1,577  | 193,038    | 陸運・鉄道                   |
| KRAFT HEINZ CO/THE                       | 1,090 | 1,250   | 4,925  | 602,770    | 食品                      |
| KROGER CO                                | 1,260 | 1,330   | 7,497  | 917,583    | 食品・生活必需品小売り             |
| LKQ CORP                                 | 490   | 526     | 2,460  | 301,091    | 販売                      |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC                | 344   | 366     | 9,216  | 1,127,976  | 航空宇宙・防衛                 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS             | 158   | 183     | 4,922  | 602,489    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LAM RESEARCH                             | 237   | 263     | 14,471 | 1,771,107  | 半導体・半導体製造装置             |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC                 | 239   | —       | —      | —          | 食品                      |
| LAS VEGAS SANDS CORP                     | 586   | 640     | 2,537  | 310,576    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A              | 378   | 433     | 12,087 | 1,479,404  | パーソナル用品                 |

| 銘柄                           | 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         |                        |
| LEAR CORP                    |   | 97      | 109    | 1,587   | 194,277    | 自動車部品                  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          |   | 215     | 258    | 2,797   | 342,353    | 専門サービス                 |
| LENNAR CORP-A                |   | 465     | 506    | 4,257   | 521,135    | 家庭用耐久財                 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     |   | 57      | 64     | 1,708   | 209,108    | 建設関連製品                 |
| LIBERTY BROADBAND CORP-A     |   | 40      | 40     | 545     | 66,810     | メディア                   |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C     |   | 259     | 264    | 3,723   | 455,778    | メディア                   |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP       |   | 129     | 170    | 786     | 96,229     | メディア                   |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C       |   | 299     | 299    | 1,383   | 169,323    | メディア                   |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C |   | 340     | 371    | 2,587   | 316,711    | 娯楽                     |
| ELI LILLY & CO.              |   | 1,427   | 1,530  | 44,353  | 5,428,384  | 医薬品                    |
| LINCOLN NATIONAL CORP        |   | 299     | 332    | 2,223   | 272,163    | 保険                     |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN |   | 266     | 309    | 3,638   | 445,350    | 娯楽                     |
| LOCKHEED MARTIN              |   | 420     | 469    | 20,915  | 2,559,793  | 航空宇宙・防衛                |
| LOEWS CORP                   |   | 431     | 418    | 2,739   | 335,245    | 保険                     |
| LOWES COS INC                |   | 1,214   | 1,268  | 26,563  | 3,251,086  | 専門小売り                  |
| LUCID GROUP INC              |   | —       | 800    | 2,120   | 259,466    | 自動車                    |
| LULULEMON ATHLETICA INC      |   | 208     | 220    | 8,292   | 1,014,887  | 繊維・アパレル・贅沢品            |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC       |   | 1,470   | 1,620  | 1,843   | 225,633    | 各種電気通信サービ              |
| LYFT INC-A                   |   | —       | 520    | 2,009   | 245,979    | 陸運・鉄道                  |
| M & T BANK CORP              |   | 217     | 245    | 4,220   | 516,531    | 銀行                     |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    |   | 800     | 710    | 3,064   | 375,047    | ホテル・レストラン・レジャー         |
| MSCI INC                     |   | 137     | 153    | 7,853   | 961,154    | 資本市場                   |
| MARATHON PETROLEUM CORP      |   | 1,060   | 1,149  | 9,806   | 1,200,243  | 石油・ガス・消耗燃料             |
| MARKEL CORP                  |   | 23      | 25     | 3,732   | 456,787    | 保険                     |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     |   | 61      | 72     | 2,497   | 305,699    | 資本市場                   |
| MARSH & MCLENNAN COS         |   | 848     | 947    | 16,273  | 1,991,682  | 保険                     |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA   |   | 464     | 526    | 9,281   | 1,135,934  | ホテル・レストラン・レジャー         |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    |   | 105     | 116    | 4,527   | 554,061    | 建設資材                   |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       |   | —       | 1,562  | 11,404  | 1,395,755  | 半導体・半導体製造装置            |
| MASCO CORP                   |   | 425     | 458    | 2,443   | 299,051    | 建設関連製品                 |
| MASIMO CORP                  |   | 82      | 93     | 1,445   | 176,880    | ヘルスケア機器・用品             |
| MASTERCARD INC               |   | 1,474   | 1,651  | 59,805  | 7,319,634  | 情報技術サービス               |
| MATCH GROUP INC              |   | 416     | 509    | 5,635   | 689,746    | インタラクティブ・メディアおよびサービ    |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    |   | 452     | —      | —       | —          | 半導体・半導体製造装置            |
| MCCORMICK & CO INC.          |   | 402     | 477    | 4,639   | 567,804    | 食品                     |
| MCDONALD'S CORP              |   | 1,236   | 1,406  | 35,013  | 4,285,316  | ホテル・レストラン・レジャー         |
| MCKESSON CORP                |   | 262     | 287    | 8,811   | 1,078,436  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービ |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   |   | 340     | 340    | 275     | 33,664     | ホテル・レストラン・レジャー         |
| MERCADOLIBRE INC             |   | 74      | 85     | 10,344  | 1,266,028  | インターネット販売・通信販          |
| MERCK & CO INC               |   | 4,193   | 4,753  | 39,164  | 4,793,370  | 医薬品                    |
| METLIFE INC                  |   | 1,254   | 1,334  | 9,555   | 1,169,490  | 保険                     |
| METTLER-TOLEDO INTL          |   | 38      | 43     | 6,157   | 753,572    | ライフサイエンス・ツール/サービ       |
| MICROSOFT CORP               |   | 11,902  | 13,422 | 421,262 | 51,558,365 | ソフトウェア                 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY         |   | 427     | 1,056  | 8,066   | 987,293    | 半導体・半導体製造装置            |
| MICRON TECHNOLOGY            |   | 1,845   | 2,115  | 16,742  | 2,049,094  | 半導体・半導体製造装置            |
| MODERNA INC                  |   | 463     | 648    | 11,334  | 1,387,268  | バイオテクノロジー              |
| MOHAWK INDUSTRIES            |   | 102     | 102    | 1,335   | 163,450    | 家庭用耐久財                 |
| MOLINA HEALTHCARE INC        |   | 97      | 111    | 3,789   | 463,774    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービ |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B   |   | 314     | 350    | 1,900   | 232,602    | 飲料                     |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC   |   | 2,386   | 2,637  | 16,547  | 2,025,208  | 食品                     |
| MONGODB INC                  |   | 88      | 113    | 4,861   | 594,997    | 情報技術サービス               |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC |   | 69      | 84     | 4,102   | 502,112    | 半導体・半導体製造装置            |
| MONSTER BEVERAGE CORP        |   | 666     | 750    | 6,004   | 734,890    | 飲料                     |
| MOODYS CORP                  |   | 283     | 317    | 10,724  | 1,312,601  | 資本市場                   |

| 銘柄                           | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末   |            | 業 種 等             |        |
|------------------------------|-------|---------|---------|------------|-------------------|--------|
|                              |       | 株数      | 評 価 額   | 外貨建金額      |                   | 邦貨換算金額 |
|                              |       |         | 株数      |            |                   |        |
| (アメリカ)                       | 百株    | 百株      | 千米ドル    | 千円         |                   |        |
| MORGAN STANLEY               | 2,331 | 2,533   | 22,865  | 2,798,495  | 資本市場              |        |
| MOSAIC CO/THE                | 560   | 690     | 4,520   | 553,310    | 化学                |        |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 276   | 316     | 7,608   | 931,222    | 通信機器              |        |
| NRG ENERGY INC               | 405   | 450     | 1,710   | 209,397    | 電力                |        |
| NVR INC                      | 5     | 6       | 2,835   | 347,090    | 家庭用耐久財            |        |
| NASDAQ INC                   | 184   | 225     | 4,092   | 500,856    | 資本市場              |        |
| NETAPP INC                   | 352   | 431     | 3,731   | 456,657    | コンピュータ・周辺機器       |        |
| NETFLIX INC                  | 732   | 833     | 31,784  | 3,890,053  | 娯楽                |        |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | 142   | 170     | 1,571   | 192,354    | バイオテクノロジー         |        |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 1,840 | 2,200   | 1,108   | 135,706    | 不動産管理・開発          |        |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 354   | 414     | 2,358   | 288,714    | コングロマリット          |        |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | 403   | —       | —       | —          | コングロマリット          |        |
| NEWELL BRANDS INC            | 660   | 750     | 1,667   | 204,054    | 家庭用耐久財            |        |
| NEWMONT CORP                 | 1,317 | 1,511   | 12,081  | 1,478,710  | 金属・鉱業             |        |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I       | 670   | 750     | 1,707   | 209,011    | メディア              |        |
| NEXTERA ENERGY INC           | 3,252 | 3,692   | 31,566  | 3,863,436  | 電力                |        |
| NIKE INC-B                   | 2,083 | 2,405   | 33,318  | 4,077,896  | 繊維・アパレル・贅沢品       |        |
| NISOURCE INC                 | 650   | 730     | 2,307   | 282,418    | 総合公益事業            |        |
| NORDSON CORP                 | 87    | 96      | 2,207   | 270,131    | 機械                |        |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 418   | 459     | 13,271  | 1,624,358  | 陸運・鉄道             |        |
| NORTHERN TRUST CORP          | 321   | 363     | 4,383   | 536,462    | 資本市場              |        |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 260   | 283     | 12,829  | 1,570,170  | 航空宇宙・防衛           |        |
| NORTONLIFELOCK INC           | 910   | 1,100   | 2,990   | 366,056    | ソフトウェア            |        |
| NOVAVAX INC                  | —     | 130     | 971     | 118,932    | バイオテクノロジー         |        |
| NUCOR CORP                   | 509   | 539     | 8,056   | 986,026    | 金属・鉱業             |        |
| NVIDIA CORP                  | 1,025 | 4,704   | 130,264 | 15,943,113 | 半導体・半導体製造装置       |        |
| OGE ENERGY CORP              | 325   | —       | —       | —          | 電力                |        |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,      | 118   | 127     | 8,887   | 1,087,768  | 専門小売り             |        |
| OCCIDENTAL PETE CORP         | 1,580 | 1,772   | 10,185  | 1,246,597  | 石油・ガス・消耗燃料        |        |
| OKTA INC                     | 203   | 280     | 4,272   | 522,947    | 情報技術サービス          |        |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 153   | 181     | 5,634   | 689,654    | 陸運・鉄道             |        |
| OMNICOM GROUP                | 345   | 400     | 3,453   | 422,686    | メディア              |        |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 680   | 817     | 5,263   | 644,252    | 半導体・半導体製造装置       |        |
| ONEOK INC                    | 740   | 851     | 6,102   | 746,887    | 石油・ガス・消耗燃料        |        |
| ORACLE CORPORATION           | 3,230 | 3,087   | 25,733  | 3,149,490  | ソフトウェア            |        |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 696   | 753     | 5,854   | 716,541    | 機械                |        |
| OWENS CORNING INC            | 168   | 189     | 1,785   | 218,571    | 建設関連製品            |        |
| PG&E CORP                    | 2,370 | 2,770   | 3,348   | 409,875    | 電力                |        |
| PNC FINANCIAL                | 698   | 800     | 15,258  | 1,867,475  | 銀行                |        |
| PPG INDUSTRIES               | 398   | 440     | 5,849   | 715,903    | 化学                |        |
| PPL CORPORATION              | 1,290 | 1,420   | 4,075   | 498,788    | 電力                |        |
| PPD INC                      | 200   | —       | —       | —          | ライフサイエンス・ツール/サービス |        |
| PTC INC                      | 187   | 203     | 2,216   | 271,284    | ソフトウェア            |        |
| PACCAR                       | 583   | 657     | 5,873   | 718,867    | 機械                |        |
| PACKAGING CORP OP AMERICA    | 161   | 177     | 2,776   | 339,827    | 容器・包装             |        |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  | —     | 3,090   | 4,288   | 524,920    | ソフトウェア            |        |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 156   | 185     | 11,422  | 1,397,958  | ソフトウェア            |        |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 216   | 239     | 6,970   | 853,111    | 機械                |        |
| PAYCHEX INC                  | 548   | 605     | 8,281   | 1,013,615  | 情報技術サービス          |        |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 81    | 96      | 3,333   | 408,011    | ソフトウェア            |        |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 1,845 | 2,100   | 24,882  | 3,045,418  | 情報技術サービス          |        |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A    | 402   | 520     | 1,478   | 181,000    | レジャー用品            |        |
| PEPSICO INC                  | 2,290 | 2,602   | 43,703  | 5,348,833  | 飲料                |        |
| PERKINELMER INC              | 188   | 212     | 3,783   | 463,122    | ライフサイエンス・ツール/サービス |        |

| 銘柄                            | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |
|-------------------------------|-------|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                               |       | 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        |                         |
| PFIZER INC                    | 9,210 | 10,563  | 55,392 | 6,779,472 | 医薬品                     |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL   | 2,586 | 2,930   | 27,524 | 3,368,713 | タバコ                     |
| PHILLIPS 66                   | 711   | 907     | 7,930  | 970,651   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP    | 191   | —       | —      | —         | 電力                      |
| PINTEREST INC- CLASS A        | 847   | 1,030   | 2,646  | 323,852   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO  | 335   | 436     | 11,245 | 1,376,367 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PLUG POWER INC                | 776   | 940     | 2,668  | 326,617   | 電気設備                    |
| POOL CORP                     | 65    | 73      | 3,307  | 404,851   | 販売                      |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 382   | 421     | 6,445  | 788,865   | 資本市場                    |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     | 444   | 507     | 3,780  | 462,657   | 保険                      |
| PROCTER & GAMBLE CO           | 4,109 | 4,554   | 70,309 | 8,605,143 | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CO                | 961   | 1,099   | 12,876 | 1,576,013 | 保険                      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      | 666   | 706     | 8,493  | 1,039,480 | 保険                      |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE         | 858   | 956     | 6,686  | 818,331   | 総合公益事業                  |
| PULTEGROUP INC                | 430   | 470     | 2,083  | 255,058   | 家庭用耐久財                  |
| QORVO INC                     | 194   | 207     | 2,637  | 322,840   | 半導体・半導体製造装置             |
| QUALCOMM INC                  | 1,868 | 2,108   | 32,195 | 3,940,405 | 半導体・半導体製造装置             |
| QUEST DIAGNOSTICS INC         | 219   | 237     | 3,293  | 403,073   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| RPM INTERNATIONAL INC         | 211   | 235     | 1,938  | 237,254   | 化学                      |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 196   | 342     | 3,830  | 468,760   | 資本市場                    |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP    | 2,506 | 2,817   | 28,403 | 3,476,342 | 航空宇宙・防衛                 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     | 175   | 200     | 13,861 | 1,696,502 | バイオテクノロジー               |
| REGIONS FINANCIAL CORP        | 1,620 | 1,800   | 4,077  | 498,984   | 銀行                      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA  | 105   | —       | —      | —         | 保険                      |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A    | 361   | 418     | 5,630  | 689,060   | 商業サービス・用品               |
| RESMED INC                    | 245   | 275     | 6,847  | 838,099   | ヘルスケア機器・用品              |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A       | 125   | 145     | 1,764  | 215,922   | ソフトウェア                  |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A       | —     | 346     | 1,799  | 220,246   | 自動車                     |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 203   | 203     | 2,404  | 294,266   | 専門サービス                  |
| ROBINHOOD MARKETS INC -A      | —     | 320     | 465    | 57,023    | 資本市場                    |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       | 196   | 219     | 6,147  | 752,425   | 電気設備                    |
| ROKU INC                      | 175   | 220     | 2,858  | 349,900   | 娯楽                      |
| ROLLINS INC                   | 358   | 410     | 1,453  | 177,837   | 商業サービス・用品               |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        | 175   | 200     | 9,566  | 1,170,831 | コングロマリット                |
| ROSS STORES INC               | 598   | 663     | 6,140  | 751,479   | 専門小売り                   |
| S&P GLOBAL INC                | 396   | 666     | 27,941 | 3,419,805 | 資本市場                    |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 191   | 225     | 1,379  | 168,778   | 資本市場                    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS    | 370   | 427     | 3,243  | 397,023   | ソフトウェア                  |
| SVB FINANCIAL GROUP           | 87    | 108     | 6,175  | 755,766   | 銀行                      |
| SALESFORCE.COM INC            | 1,508 | 1,842   | 39,600 | 4,846,710 | ソフトウェア                  |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC      | 126   | —       | —      | —         | バイオテクノロジー               |
| HENRY SCHEIN INC              | 231   | 257     | 2,257  | 276,325   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD              | 2,340 | 2,640   | 11,143 | 1,363,845 | エネルギー設備・サービス            |
| SCHWAB (CHARLES) CORP         | 2,539 | 2,727   | 24,204 | 2,962,431 | 資本市場                    |
| SEA LTD-ADR                   | —     | 603     | 7,443  | 911,001   | 娯楽                      |
| SEAGEN INC                    | 207   | 258     | 3,652  | 446,998   | バイオテクノロジー               |
| SEALED AIR CORP               | 265   | 265     | 1,809  | 221,454   | 容器・包装                   |
| SEMPRA ENERGY                 | 473   | 606     | 10,157 | 1,243,209 | 総合公益事業                  |
| SERVICENOW INC                | 323   | 374     | 21,495 | 2,630,886 | ソフトウェア                  |
| SHERWIN-WILLIAMS              | 134   | 472     | 11,942 | 1,461,590 | 化学                      |
| SIGNATURE BANK                | —     | 115     | 3,524  | 431,351   | 銀行                      |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC        | 1,750 | 1,750   | 1,162  | 142,217   | メディア                    |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC        | 271   | 317     | 4,323  | 529,199   | 半導体・半導体製造装置             |
| SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A   | 761   | —       | —      | —         | ソフトウェア                  |

| 銘柄                                | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末   |            | 業 種 等                |
|-----------------------------------|-------|---------|---------|------------|----------------------|
|                                   |       | 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         |                      |
| SMITH (A.O.) CORP                 | 218   | 247     | 1,636   | 200,275    | 建設関連製品               |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW             | 186   | 201     | 2,711   | 331,810    | 食品                   |
| SNAP-ON INC                       | 84    | 97      | 2,027   | 248,121    | 機械                   |
| SNAP INC-A                        | 1,522 | 2,040   | 7,515   | 919,804    | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A             | 39    | 392     | 9,079   | 1,111,288  | 情報技術サービス             |
| SOFI TECHNOLOGIES INC             | —     | 920     | 898     | 110,009    | 消費者金融                |
| SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC       | 82    | 100     | 3,142   | 384,586    | 半導体・半導体製造装置          |
| SOUTHERN CO.                      | 1,767 | 2,006   | 14,543  | 1,779,978  | 電力                   |
| SOUTHWEST AIRLINES                | 249   | 290     | 1,321   | 161,742    | 旅客航空輸送業              |
| SPLUNK INC                        | 270   | 304     | 4,319   | 528,668    | ソフトウェア               |
| BLOCK INC                         | 636   | 955     | 13,379  | 1,637,523  | 情報技術サービス             |
| STANLEY BLACK & DECKER INC        | 259   | 309     | 4,421   | 541,107    | 機械                   |
| STARBUCKS CORP                    | 1,949 | 2,217   | 20,181  | 2,469,995  | ホテル・レストラン・レジャー       |
| STATE STREET CORP                 | 596   | 698     | 6,429   | 786,879    | 資本市場                 |
| STEEL DYNAMICS                    | 334   | 371     | 3,103   | 379,781    | 金属・鉱業                |
| STRYKER CORP                      | 565   | 637     | 17,144  | 2,098,280  | ヘルスケア機器・用品           |
| SUNRUN INC                        | 185   | 360     | 1,114   | 136,410    | 電気設備                 |
| SYNOPSYS INC                      | 255   | 285     | 9,478   | 1,160,112  | ソフトウェア               |
| SYNCHRONY FINANCIAL               | 860   | 1,038   | 3,708   | 453,916    | 消費者金融                |
| SYSCO CORP                        | 813   | 956     | 7,933   | 971,023    | 食品・生活必需品小売り          |
| TJX COS INC                       | 2,003 | 2,276   | 14,111  | 1,727,069  | 専門小売り                |
| T-MOBILE US INC                   | 931   | 1,172   | 15,073  | 1,844,795  | 無線通信サービス             |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 194   | 219     | 3,417   | 418,294    | 娯楽                   |
| TARGET CORP                       | 836   | 898     | 19,932  | 2,439,478  | 複合小売り                |
| TELADOC HEALTH INC                | 193   | 276     | 2,016   | 246,827    | ヘルスケア・テクノロジー         |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC         | 58    | 86      | 4,068   | 497,984    | 電子装置・機器・部品           |
| TELEFLEX INC                      | 75    | 87      | 3,030   | 370,878    | ヘルスケア機器・用品           |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A          | 100   | 144     | 1,076   | 131,722    | ライフサイエンス・ツール/サービス    |
| TERADYNE INC                      | 272   | 302     | 3,655   | 447,348    | 半導体・半導体製造装置          |
| TESLA INC                         | 1,256 | 1,606   | 175,738 | 21,508,641 | 自動車                  |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR        | 1,730 | 2,150   | 2,016   | 246,823    | 医薬品                  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC             | 1,521 | 1,738   | 32,578  | 3,987,320  | 半導体・半導体製造装置          |
| TEXTRON INC                       | 379   | 407     | 3,060   | 374,591    | 航空宇宙・防衛              |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A       | 68    | 823     | 5,895   | 721,507    | ソフトウェア               |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC      | 655   | 741     | 44,130  | 5,401,116  | ライフサイエンス・ツール/サービス    |
| 3M CORP                           | 956   | 1,081   | 16,369  | 2,003,473  | コングロマリット             |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY            | 195   | 215     | 5,006   | 612,717    | 専門小売り                |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A      | 164   | 187     | 1,645   | 201,336    | 資本市場                 |
| TRANSIGM GROUP INC                | 86    | 100     | 6,723   | 822,840    | 航空宇宙・防衛              |
| TRUNSONIC                         | 311   | 352     | 3,654   | 447,226    | 専門サービス               |
| TRAVELERS COS INC/THE             | 426   | 466     | 8,646   | 1,058,261  | 保険                   |
| TRIMBLE INC                       | 422   | 473     | 3,448   | 422,079    | 電子装置・機器・部品           |
| TRUIST FINANCIAL CORP             | 2,253 | 2,504   | 14,708  | 1,800,172  | 銀行                   |
| TWILIO INC - A                    | 233   | 322     | 5,429   | 664,563    | 情報技術サービス             |
| TWITTER INC                       | 1,328 | 1,490   | 5,811   | 711,208    | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| TYLER TECHNOLOGIES INC            | 65    | 75      | 3,334   | 408,102    | ソフトウェア               |
| TYSON FOODS INC-CL A              | 501   | 549     | 4,870   | 596,061    | 食品                   |
| UGI CORP                          | 360   | 400     | 1,460   | 178,738    | ガス                   |
| US BANCORP                        | 2,231 | 2,643   | 14,584  | 1,784,944  | 銀行                   |
| UBER TECHNOLOGIES INC             | 1,615 | 2,740   | 10,022  | 1,226,705  | 陸運・鉄道                |
| ULTA BEAUTY INC                   | 86    | 99      | 3,977   | 486,784    | 専門小売り                |
| UNION PAC CORP                    | 1,113 | 1,213   | 33,562  | 4,107,714  | 陸運・鉄道                |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B        | 1,174 | 1,372   | 30,211  | 3,697,578  | 航空貨物・物流サービス          |
| UNITED RENTALS INC                | 122   | 135     | 4,849   | 593,477    | 商社・流通業               |

| 銘柄                           | 株数    | 期首(前期末) | 当期     |            | 業種等                     |
|------------------------------|-------|---------|--------|------------|-------------------------|
|                              |       | 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         |                         |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 1,572 | 1,772   | 92,310 | 11,297,837 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNITY SOFTWARE INC           | —     | 112     | 1,133  | 138,735    | ソフトウェア                  |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 130   | 144     | 2,096  | 256,554    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UPSTART HOLDINGS INC         | —     | 82      | 935    | 114,550    | 消費者金融                   |
| V F CORP                     | 563   | 617     | 3,603  | 441,080    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VAIL RESORTS INC             | 67    | 74      | 1,956  | 239,427    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| VALERO ENERGY CORP           | 665   | 759     | 7,627  | 933,584    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 153   | —       | —      | —          | ヘルスケア機器・用品              |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 227   | 265     | 5,671  | 694,106    | ヘルスケア・テクノロジー            |
| VERISIGN INC                 | 176   | 185     | 4,109  | 502,927    | 情報技術サービス                |
| VERIZON COMMUNICATIONS       | 6,857 | 7,791   | 40,209 | 4,921,222  | 各種電気通信サービス              |
| VERISK ANALYTICS INC         | 260   | 285     | 6,183  | 756,816    | 専門サービス                  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS       | 436   | 482     | 12,364 | 1,513,262  | バイオテクノロジー               |
| PARAMOUNT GLOBAL             | 951   | 1,140   | 4,343  | 531,588    | メディア                    |
| VIATRIS INC                  | 2,007 | 2,290   | 2,516  | 308,020    | 医薬品                     |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 2,804 | 3,142   | 70,365 | 8,611,983  | 情報技術サービス                |
| VISTRA CORP                  | 700   | 800     | 1,848  | 226,176    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| VMWARE INC - CLASS A         | 142   | 398     | 4,624  | 565,975    | ソフトウェア                  |
| VOYA FINANCIAL INC           | 217   | —       | —      | —          | 各種金融サービス                |
| VULCAN MATERIALS CO          | 223   | 247     | 4,621  | 565,669    | 建設資材                    |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 536   | 602     | 6,037  | 738,924    | 総合公益事業                  |
| WABTEC CORP                  | 288   | 341     | 3,379  | 413,593    | 機械                      |
| WALMART INC                  | 2,348 | 2,886   | 43,252 | 5,293,671  | 食品・生活必需品小売り             |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 1,203 | 1,390   | 6,596  | 807,399    | 食品・生活必需品小売り             |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 445   | 496     | 6,928  | 847,994    | 商業サービス・用品               |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 693   | 792     | 12,628 | 1,545,594  | 商業サービス・用品               |
| WATERS CORP                  | 105   | 112     | 3,602  | 440,921    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| WAYFAIR INC - CLASS A        | 115   | 146     | 1,773  | 217,054    | インターネット販売・通信販売          |
| WEBSTER FINANCIAL CORP       | —     | 330     | 1,903  | 233,002    | 銀行                      |
| WELLS FARGO CO               | 6,500 | 7,503   | 37,597 | 4,601,562  | 銀行                      |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 124   | 140     | 5,852  | 716,243    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 516   | 586     | 2,966  | 363,049    | コンピュータ・周辺機器             |
| WESTERN UNION CO             | 660   | 750     | 1,443  | 176,608    | 情報技術サービス                |
| WESTROCK CO                  | 432   | 520     | 2,461  | 301,285    | 容器・包装                   |
| WHIRLPOOL CORP               | 103   | 113     | 2,037  | 249,383    | 家庭用耐久財                  |
| WILLIAMS COS                 | 1,980 | 2,310   | 7,773  | 951,355    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 291   | 364     | 8,792  | 1,076,148  | ソフトウェア                  |
| WYNN RESORTS LTD             | 171   | 193     | 1,566  | 191,733    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| XPO LOGISTICS INC            | 143   | —       | —      | —          | 陸運・鉄道                   |
| XCEL ENERGY INC              | 885   | 1,025   | 7,412  | 907,252    | 電力                      |
| XILINX INC                   | 412   | —       | —      | —          | 半導体・半導体製造装置             |
| XYLEM INC                    | 303   | 338     | 2,977  | 364,450    | 機械                      |
| YUM BRANDS INC               | 508   | 558     | 6,742  | 825,260    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 89    | 103     | 4,424  | 541,573    | 電子装置・機器・部品              |
| ZENDESK INC                  | 188   | 226     | 2,704  | 331,064    | ソフトウェア                  |
| ZILLOW GROUP INC - A         | 98    | 98      | 501    | 61,386     | 不動産管理・開発                |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 246   | 332     | 1,743  | 213,407    | 不動産管理・開発                |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 349   | 400     | 5,147  | 630,014    | ヘルスケア機器・用品              |
| ZOETIS INC                   | 794   | 894     | 17,104 | 2,093,359  | 医薬品                     |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A  | —     | 541     | 3,142  | 384,631    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ZSCALER INC                  | 119   | 154     | 3,694  | 452,164    | ソフトウェア                  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 323   | 406     | 4,969  | 608,160    | ソフトウェア                  |
| ALLEGION PLC                 | 148   | 163     | 1,847  | 226,128    | 建設関連製品                  |
| AMCOR PLC                    | 2,680 | 2,860   | 3,297  | 403,590    | 容器・包装                   |

| 銘                                      | 柄             | 期首(前期末) | 当 期 末   |           | 業 種 等       |                |
|----------------------------------------|---------------|---------|---------|-----------|-------------|----------------|
|                                        |               | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |             |                |
|                                        |               |         |         | 外貨建金額     |             | 邦貨換算金額         |
| (アメリカ)                                 |               | 百株      | 百株      | 千米ドル      | 千円          |                |
| AON PLC                                |               | 375     | 414     | 13,512    | 1,653,800   | 保険             |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                 |               | 650     | 750     | 3,633     | 444,642     | 保険             |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A             |               | 212     | —       | —         | —           | 保険             |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD             |               | 360     | —       | —         | —           | 化学             |
| ACCENTURE PLC-CL A                     |               | 1,050   | 1,189   | 40,242    | 4,925,327   | 情報技術サービス       |
| BUNGE LIMITED                          |               | 220     | 268     | 2,940     | 359,854     | 食品             |
| CLARIVATE PLC                          |               | —       | 650     | 1,088     | 133,172     | 専門サービス         |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS         |               | 326     | 393     | 1,920     | 235,013     | 飲料             |
| EATON CORP PLC                         |               | 654     | 749     | 11,643    | 1,425,103   | 電気設備           |
| EVEREST RE GROUP LTD                   |               | 62      | 71      | 2,163     | 264,792     | 保険             |
| GRAB HOLDINGS LTD-CL A                 |               | —       | 2,030   | 720       | 88,200      | インターネット販売・通信販売 |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC               |               | 359     | 411     | 4,348     | 532,248     | バイオテクノロジー      |
| IHS MARKIT LTD                         |               | 638     | —       | —         | —           | 専門サービス         |
| INVESCO LTD                            |               | 680     | 650     | 1,522     | 186,314     | 資本市場           |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC               |               | 90      | 120     | 1,889     | 231,214     | 医薬品            |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC     |               | 1,185   | 1,316   | 8,817     | 1,079,137   | 建設関連製品         |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A                   |               | 240     | 310     | 803       | 98,304      | 各種電気通信サービス     |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C                   |               | 640     | 640     | 1,685     | 206,320     | 各種電気通信サービス     |
| LINDE PLC                              |               | 872     | 965     | 31,422    | 3,845,778   | 化学             |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD           |               | 1,128   | —       | —         | —           | 半導体・半導体製造装置    |
| MEDTRONIC PLC                          |               | 2,230   | 2,531   | 28,235    | 3,455,783   | ヘルスケア機器・用品     |
| APTIV PLC                              |               | 454     | 502     | 6,132     | 750,548     | 自動車部品          |
| NOVOCURE LTD                           |               | 140     | 164     | 1,378     | 168,744     | ヘルスケア機器・用品     |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD             |               | 78      | —       | —         | —           | 保険             |
| ROYALTY PHARMA PLC-CL A                |               | 289     | 630     | 2,457     | 300,712     | 医薬品            |
| SEAGATE TECHNOLOGY                     |               | 373     | —       | —         | —           | コンピュータ・周辺機器    |
| SEAGATE TECHNOLOGY                     |               | —       | 384     | 3,508     | 429,418     | コンピュータ・周辺機器    |
| PENTAIR PLC                            |               | 275     | 300     | 1,692     | 207,157     | 機械             |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING           |               | 245     | 283     | 1,471     | 180,143     | 電気設備           |
| STERIS PLC                             |               | 138     | 191     | 4,696     | 574,804     | ヘルスケア機器・用品     |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC                 |               | 403     | 452     | 7,168     | 877,324     | 建設関連製品         |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC               |               | 218     | 238     | 5,712     | 699,120     | 保険             |
| CHUBB LTD                              |               | 743     | 808     | 17,574    | 2,150,881   | 保険             |
| GARMIN LTD                             |               | 242     | 288     | 3,464     | 424,002     | 家庭用耐久財         |
| TE CONNECTIVITY LTD                    |               | 554     | 614     | 8,202     | 1,003,894   | 電子装置・機器・部品     |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. |               | 187     | 201     | 2,779     | 340,124     | ソフトウェア         |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL           |               | 71      | 71      | 1,199     | 146,803     | ソフトウェア         |
| FIVERR INTERNATIONAL LTD               |               | —       | 52      | 407       | 49,851      | インターネット販売・通信販売 |
| INMODE LTD                             |               | —       | 88      | 338       | 41,411      | ヘルスケア機器・用品     |
| KORNIT DIGITAL LTD                     |               | —       | 82      | 694       | 84,944      | 機械             |
| WIX.COM LTD                            |               | 94      | 102     | 1,062     | 129,993     | 情報技術サービス       |
| AERCAP HOLDINGS NV                     |               | —       | 251     | 1,291     | 158,023     | 商社・流通業         |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A               |               | 452     | 494     | 5,187     | 634,957     | 化学             |
| NXP SEMICONDUCTORS NV                  |               | 468     | 500     | 9,366     | 1,146,365   | 半導体・半導体製造装置    |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD            |               | 386     | 437     | 3,560     | 435,791     | ホテル・レストラン・レジャー |
| 小 計                                    | 株 数 ・ 金 額     | 519,005 | 596,398 | 7,570,222 | 926,519,476 |                |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > | 593     | 606     | —         | <70.4%>     |                |
| (カナダ)                                  |               |         |         | 千カナダドル    |             |                |
| AGNICO EAGLE MINES LTD                 |               | 410     | 868     | 6,685     | 654,494     | 金属・鉱業          |
| AIR CANADA                             |               | 320     | 320     | 778       | 76,221      | 旅客航空輸送業        |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES            |               | 970     | 1,260   | 2,436     | 238,566     | 総合公益事業         |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B             |               | 1,450   | —       | —         | —           | 食品・生活必需品小売り    |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC           |               | —       | 1,610   | 8,903     | 871,633     | 食品・生活必需品小売り    |
| ALTAGAS LTD                            |               | 420     | 520     | 1,464     | 143,356     | ガス             |

| 銘柄                                 | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等              |
|------------------------------------|-------|---------|--------|-----------|--------------------|
|                                    |       | 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        |                    |
| ATCO LTD CL1                       | 130   | —       | —      | —         | 総合公益事業             |
| BCE INC                            | 256   | 144     | 985    | 96,512    | 各種電気通信サービス         |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC          | 370   | 370     | 547    | 53,610    | 電気設備               |
| BANK OF MONTREAL                   | 1,056 | 1,214   | 17,979 | 1,760,177 | 銀行                 |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX        | 1,994 | 2,297   | 20,996 | 2,055,594 | 銀行                 |
| BARRICK GOLD                       | 2,990 | 3,360   | 10,419 | 1,020,055 | 金属・鉱業              |
| BAUSCH HEALTH COS INC              | 510   | 580     | 1,677  | 164,213   | 医薬品                |
| BLACKBERRY LTD                     | 940   | 940     | 892    | 87,332    | ソフトウェア             |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A       | 2,108 | 2,671   | 19,199 | 1,879,596 | 資本市場               |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A         | 187   | 240     | 1,298  | 127,113   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| B2GOLD CORP                        | 1,750 | —       | —      | —         | 金属・鉱業              |
| CAE INC                            | 500   | 600     | 1,957  | 191,609   | 航空宇宙・防衛            |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B          | 247   | 282     | 1,615  | 158,192   | 容器・包装              |
| CGI INC                            | 372   | 421     | 4,255  | 416,651   | 情報技術サービス           |
| CAMECO CORP                        | 720   | 720     | 2,521  | 246,848   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 750   | 846     | 13,124 | 1,284,922 | 銀行                 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO           | 1,186 | 1,326   | 22,608 | 2,213,352 | 陸運・鉄道              |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD     | 1,990 | 2,205   | 17,240 | 1,687,883 | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD       | 221   | 1,759   | 18,330 | 1,794,559 | 陸運・鉄道              |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A           | 102   | 102     | 1,977  | 193,594   | 複合小売り              |
| CANADIAN UTILITIES LTD A           | 203   | 270     | 1,031  | 101,000   | 総合公益事業             |
| CANOPY GROWTH CORP                 | 350   | 350     | 347    | 34,025    | 医薬品                |
| CENOVUS ENERGY INC                 | 2,160 | 2,520   | 5,244  | 513,399   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC         | 34    | 38      | 8,141  | 797,098   | ソフトウェア             |
| DOLLARAMA INC                      | 466   | 556     | 3,958  | 387,504   | 複合小売り              |
| EMERA INC                          | 425   | 470     | 2,885  | 282,473   | 電力                 |
| EMPIRE CO LTD A                    | 260   | 320     | 1,408  | 137,843   | 食品・生活必需品小売り        |
| ENBRIDGE INC                       | 3,330 | 3,800   | 21,960 | 2,149,903 | 石油・ガス・消耗燃料         |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD        | 41    | 46      | 3,120  | 305,487   | 保険                 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD         | 930   | 1,110   | 4,830  | 472,927   | 金属・鉱業              |
| FIRSTSERVICE CORP                  | 60    | 72      | 1,303  | 127,618   | 不動産管理・開発           |
| FORTIS INC                         | 753   | 890     | 5,479  | 536,465   | 電力                 |
| FRANCO-NEVADA CORP                 | 323   | 365     | 7,359  | 720,458   | 金属・鉱業              |
| GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT     | 300   | 300     | 1,191  | 116,628   | 商業サービス・用品          |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC              | 318   | 370     | 1,794  | 175,645   | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| GREAT-WEST LIFE CO INC             | 420   | 500     | 1,841  | 180,282   | 保険                 |
| HYDRO ONE LTD                      | 550   | 630     | 2,109  | 206,494   | 電力                 |
| IGM FINANCIAL INC                  | 150   | 150     | 675    | 66,082    | 資本市場               |
| IA FINANCIAL CORP INC              | 183   | 211     | 1,617  | 158,355   | 保険                 |
| IMPERIAL OIL                       | 375   | 460     | 2,763  | 270,519   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| INTACT FINANCIAL CORP              | 245   | 329     | 6,093  | 596,544   | 保険                 |
| INTER PIPELINE LTD                 | 750   | —       | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料         |
| IVANHOE MINES LTD-CL A             | —     | 1,220   | 1,444  | 141,414   | 金属・鉱業              |
| KEYERA CORP                        | 340   | 410     | 1,309  | 128,203   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| KINROSS GOLD CORP                  | 2,170 | 2,500   | 1,850  | 181,115   | 金属・鉱業              |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD             | 427   | —       | —      | —         | 金属・鉱業              |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC            | —     | 194     | 754    | 73,843    | ソフトウェア             |
| LOBLAW COMPANIES                   | 285   | 314     | 3,490  | 341,712   | 食品・生活必需品小売り        |
| LUNDIN MINING CORP                 | 1,180 | 1,180   | 1,504  | 147,290   | 金属・鉱業              |
| MAGNA INTERNATIONAL INC            | 482   | 528     | 4,275  | 418,543   | 自動車部品              |
| MANULIFE FINANCIAL CORP            | 3,260 | 3,700   | 9,956  | 974,760   | 保険                 |
| METRO INC                          | 435   | 467     | 3,343  | 327,350   | 食品・生活必需品小売り        |
| NATIONAL BANK OF CANADA            | 550   | 634     | 6,161  | 603,182   | 銀行                 |
| NORTHLAND POWER INC                | 300   | 400     | 1,654  | 161,926   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |

| 銘<br>柄                              | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |                 | 業<br>種<br>等 |                |
|-------------------------------------|---------|-------------|-----------------|-------------|----------------|
|                                     | 株<br>数  | 株<br>数      | 評<br>価<br>額     |             |                |
|                                     |         |             | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |             |                |
| (カナダ)                               | 百株      | 百株          | 千カナダドル<br>千円    |             |                |
| NUTRIEN LTD                         | 961     | 1,082       | 13,785          | 1,349,626   | 化学             |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG          | —       | 140         | 1,327           | 129,973     | 情報技術サービス       |
| ONEX CORPORATION                    | 132     | 132         | 1,116           | 109,313     | 資本市場           |
| OPEN TEXT CORP                      | 470     | 510         | 2,729           | 267,220     | ソフトウェア         |
| PAN AMERICAN SILVER CORP            | 353     | 430         | 1,476           | 144,561     | 金属・鉱業          |
| PARKLAND CORP                       | 217     | 280         | 1,025           | 100,355     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| PEMBINA PIPELINE CORP               | 880     | 1,020       | 4,817           | 471,629     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| POWER CORPORATION OF CANADA         | 970     | 1,030       | 4,020           | 393,566     | 保険             |
| QUEBECOR INC-CL B                   | 270     | 340         | 1,017           | 99,658      | メディア           |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 494     | 524         | 3,808           | 372,896     | ホテル・レストラン・レジャー |
| RITCHIE BROS. AUCTIONEERS           | 183     | 211         | 1,563           | 153,108     | 商業サービス・用品      |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B          | 582     | 670         | 4,694           | 459,610     | 無線通信サービス       |
| ROYAL BANK OF CANADA                | 2,348   | 2,682       | 37,515          | 3,672,798   | 銀行             |
| SSR MINING INC                      | 340     | —           | —               | —           | 金属・鉱業          |
| SAPUTO INC                          | 410     | 500         | 1,487           | 145,577     | 食品             |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B           | 770     | 840         | 3,267           | 319,898     | メディア           |
| SHOPIFY INC - CLASS A               | 182     | 213         | 18,753          | 1,835,946   | 情報技術サービス       |
| SUN LIFE FINANCIAL INC              | 988     | 1,108       | 7,796           | 763,325     | 保険             |
| SUNCOR ENERGY INC                   | 2,490   | 2,720       | 11,225          | 1,098,970   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TFI INTERNATIONAL INC               | —       | 149         | 2,003           | 196,123     | 陸運・鉄道          |
| TMX GROUP LTD                       | 95      | 113         | 1,459           | 142,874     | 資本市場           |
| TC ENERGY CORP                      | 1,580   | 1,860       | 13,272          | 1,299,422   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B            | 790     | 870         | 4,437           | 434,467     | 金属・鉱業          |
| TELUS CORP                          | 586     | 786         | 2,535           | 248,238     | 各種電気通信サービス     |
| THOMSON REUTERS CORP                | 278     | 326         | 4,435           | 434,240     | 専門サービス         |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD             | 128     | 150         | 1,792           | 175,441     | 商社・流通業         |
| TORONTO DOMINION BANK               | 3,007   | 3,430       | 34,787          | 3,405,653   | 銀行             |
| TOURMALINE OIL CORP                 | —       | 610         | 3,438           | 336,636     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| WSP GLOBAL INC                      | 198     | 228         | 3,786           | 370,732     | 建設・土木          |
| WEST FRASER TIMBER                  | 140     | 178         | 1,924           | 188,429     | 紙製品・林産品        |
| WESTON(GEORGE)LTD                   | 123     | 141         | 2,168           | 212,276     | 食品・生活必需品小売り    |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP        | 761     | 850         | 5,124           | 501,703     | 金属・鉱業          |
| YAMANA GOLD INC                     | 1,640   | —           | —               | —           | 金属・鉱業          |
| 小計                                  | 株数・金額   | 66,371      | 74,082          | 501,394     | 49,086,475     |
|                                     | 銘柄数<比率> | 87          | 86              | —           | <3.7%>         |
| (イギリス)                              |         |             | 千英ポンド           |             |                |
| ANTOFAGASTA PLC                     | 620     | 700         | 1,194           | 192,191     | 金属・鉱業          |
| ASHTED GROUP PLC                    | 735     | 832         | 4,031           | 648,554     | 商社・流通業         |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC            | 1,590   | 1,810       | 946             | 152,303     | 家庭用耐久財         |
| AVIVA PLC                           | 6,700   | 7,120       | 3,233           | 520,188     | 保険             |
| DIAGEO PLC                          | 3,901   | 4,390       | 17,121          | 2,754,597   | 飲料             |
| SCHRODERS PLC                       | 197     | 240         | 782             | 125,957     | 資本市場           |
| DCC PLC                             | 160     | 184         | 1,093           | 175,964     | コングロマリット       |
| BAE SYSTEMS PLC                     | 5,470   | 5,990       | 4,376           | 704,101     | 航空宇宙・防衛        |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC        | 3,830   | 4,120       | 13,357          | 2,149,014   | タバコ            |
| HALMA PLC                           | 650     | 700         | 1,742           | 280,318     | 電子装置・機器・部品     |
| STANDARD CHARTERED PLC              | 4,430   | 4,790       | 2,442           | 393,038     | 銀行             |
| IMPERIAL BRANDS PLC                 | 1,610   | 1,800       | 2,943           | 473,644     | タバコ            |
| HSBC HOLDINGS PLC                   | 33,620  | 38,290      | 20,163          | 3,244,107   | 銀行             |
| LEGAL & GENERAL                     | 10,100  | 11,400      | 3,113           | 500,905     | 保険             |
| MORRISON SUPERMARKETS               | 3,700   | —           | —               | —           | 食品・生活必需品小売り    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC        | 620     | 680         | 1,176           | 189,325     | 食品             |
| PEARSON                             | 1,260   | 1,480       | 1,094           | 176,016     | メディア           |
| PERSIMMON PLC                       | 526     | 580         | 1,245           | 200,349     | 家庭用耐久財         |

| 銘柄                              | 株数      | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |        |
|---------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-------------------------|--------|
|                                 |         | 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        |                         |        |
| PRUDENTIAL PLC                  | 4,280   | 5,180   | 5,819  | 936,336   | 保険                      |        |
| RIO TINTO PLC-REG               | 1,850   | 2,107   | 12,802 | 2,059,735 | 金属・鉱業                   |        |
| ST JAMES S PLACE PLC            | 950     | 1,040   | 1,515  | 243,793   | 資本市場                    |        |
| SSE PLC                         | 1,770   | 2,040   | 3,571  | 574,541   | 電力                      |        |
| BP PLC                          | 33,390  | 37,300  | 14,276 | 2,296,958 | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC        | 115,900 | 133,700 | 6,433  | 1,035,108 | 銀行                      |        |
| TAYLOR WIMPEY PLC               | 6,200   | 7,100   | 957    | 154,098   | 家庭用耐久財                  |        |
| SMITH & NEPHEW PLC              | 1,500   | 1,700   | 2,105  | 338,745   | ヘルスケア機器・用品              |        |
| GLAXOSMITHKLINE PLC             | 8,270   | 9,430   | 15,661 | 2,519,753 | 医薬品                     |        |
| ASTRAZENECA PLC                 | 2,179   | 2,914   | 29,614 | 4,764,655 | 医薬品                     |        |
| BT GROUP PLC                    | 15,300  | 17,000  | 3,184  | 512,289   | 各種電気通信サービス              |        |
| BARCLAYS PLC                    | 29,200  | 31,900  | 4,830  | 777,249   | 銀行                      |        |
| INTERTEK GROUP PLC              | 256     | 310     | 1,635  | 263,145   | 専門サービス                  |        |
| BURBERRY GROUP PLC              | 660     | 730     | 1,250  | 201,250   | 繊維・アパレル・贅沢品             |        |
| NEXT PLC                        | 219     | 260     | 1,631  | 262,450   | 複合小売り                   |        |
| KINGFISHER PLC                  | 3,490   | 3,900   | 1,033  | 166,279   | 専門小売り                   |        |
| SAINSBURY                       | 2,990   | 3,400   | 888    | 142,937   | 食品・生活必需品小売り             |        |
| ADMIRAL GROUP PLC               | 308     | 350     | 900    | 144,889   | 保険                      |        |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS       | 195     | —       | —      | —         | 家庭用耐久財                  |        |
| SHELL PLC                       | 6,760   | —       | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| SHELL PLC                       | 6,100   | —       | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| BUNZLE                          | 550     | 660     | 1,951  | 313,996   | 商社・流通業                  |        |
| RENTOKIL INTIAL PLC             | 3,180   | 3,450   | 1,807  | 290,856   | 商業サービス・用品               |        |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC       | 296     | 296     | 612    | 98,485    | 医薬品                     |        |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 532     | 627     | 4,960  | 798,146   | 資本市場                    |        |
| UNILEVER PLC                    | 4,342   | 4,836   | 17,158 | 2,760,571 | パーソナル用品                 |        |
| EXPERIAN PLC                    | 1,529   | 1,720   | 5,122  | 824,104   | 専門サービス                  |        |
| MONDI PLC                       | 840     | 910     | 1,395  | 224,446   | 紙製品・林産品                 |        |
| SEVERN TRENT PLC                | 370     | 480     | 1,459  | 234,770   | 水道                      |        |
| WHITBREAD PLC                   | 316     | 363     | 1,045  | 168,142   | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC         | 520     | 650     | 672    | 108,134   | 資本市場                    |        |
| SMITHS GROUP PLC                | 610     | 710     | 1,050  | 169,063   | コングロマリット                |        |
| ANGLO AMERICAN PLC              | 2,060   | 2,423   | 9,633  | 1,549,989 | 金属・鉱業                   |        |
| 3I GROUP PLC                    | 1,670   | 1,780   | 2,458  | 395,496   | 資本市場                    |        |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC     | 1,190   | 1,355   | 7,860  | 1,264,652 | 家庭用品                    |        |
| RELX PLC                        | 3,240   | 3,640   | 8,645  | 1,390,894 | 専門サービス                  |        |
| FRESNILLO PLC                   | 300     | —       | —      | —         | 金属・鉱業                   |        |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC      | 1,060   | 1,220   | 1,360  | 218,956   | 水道                      |        |
| OCADO GROUP PLC                 | 830     | 920     | 1,072  | 172,515   | 食品・生活必需品小売り             |        |
| GLENCORE PLC                    | 16,800  | 18,610  | 9,318  | 1,499,177 | 金属・鉱業                   |        |
| ENTAIN PLC                      | 1,020   | 1,100   | 1,832  | 294,847   | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC        | 13,800  | 15,200  | 1,566  | 252,036   | 航空宇宙・防衛                 |        |
| EVRAZ PLC                       | 760     | —       | —      | —         | 金属・鉱業                   |        |
| NMC HEALTH PLC                  | 133     | 133     | 0.0532 | 8         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| NATWEST GROUP PLC               | 7,700   | 10,700  | 2,346  | 377,529   | 銀行                      |        |
| SAGE GROUP PLC (THE)            | 1,750   | 1,970   | 1,378  | 221,740   | ソフトウェア                  |        |
| WPP PLC                         | 2,000   | 2,180   | 2,295  | 369,329   | メディア                    |        |
| COCA-COLA HBC AG-DI             | 340     | 390     | 637    | 102,591   | 飲料                      |        |
| AVEVA GROUP PLC                 | 199     | 199     | 498    | 80,151    | ソフトウェア                  |        |
| COMPASS GROUP PLC               | 2,920   | 3,330   | 5,571  | 896,332   | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| NATIONAL GRID PLC               | 5,910   | 6,800   | 7,938  | 1,277,196 | 総合公益事業                  |        |
| ABRDN PLC                       | 3,660   | 4,200   | 900    | 144,878   | 資本市場                    |        |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC      | 890     | 1,220   | 773    | 124,484   | 保険                      |        |
| BHP GROUP PLC                   | 3,470   | —       | —      | —         | 金属・鉱業                   |        |

| 銘柄                                |               | 期首(前期末) | 当 期 末   |         | 業 種 等      |                      |
|-----------------------------------|---------------|---------|---------|---------|------------|----------------------|
|                                   |               | 株 数     | 株 数     | 評 価 額   |            |                      |
|                                   |               |         |         | 外貨建金額   |            | 邦貨換算金額               |
| (イギリス)                            |               | 百株      | 百株      | 千英ポンド   | 千円         |                      |
| VODAFONE GROUP PLC                |               | 45,000  | 51,200  | 6,626   | 1,066,106  | 無線通信サービス             |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC |               | 288     | 354     | 1,857   | 298,900    | ホテル・レストラン・レジャー       |
| CRODA INTERNATIONAL PLC           |               | 223     | 263     | 2,079   | 334,535    | 化学                   |
| FERGUSON PLC                      |               | 366     | 418     | 4,345   | 699,084    | 商社・流通業               |
| M&G PLC                           |               | 4,400   | 5,000   | 1,108   | 178,266    | 各種金融サービス             |
| RSA INSURANCE GROUP PLC           |               | 1,620   | —       | —       | —          | 保険                   |
| TESCO PLC                         |               | 13,026  | 14,700  | 4,157   | 668,963    | 食品・生活必需品小売り          |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS         |               | —       | 208     | 803     | 129,213    | 家庭用耐久財               |
| JD SPORTS FASHION PLC             |               | —       | 4,650   | 710     | 114,390    | 専門小売り                |
| INFORMA PLC                       |               | 2,480   | 2,750   | 1,665   | 267,946    | メディア                 |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            |               | —       | 8,700   | 1,118   | 179,936    | コングロマリット             |
| SHELL PLC-NEW                     |               | —       | 14,490  | 30,595  | 4,922,531  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| AUTO TRADER GROUP PLC             |               | 1,710   | 1,710   | 1,097   | 176,573    | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC      |               | 116     | 141     | 1,758   | 283,001    | 機械                   |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP       |               | 2,190   | —       | —       | —          | 保険                   |
| JD SPORTS FASHION PLC             |               | 930     | —       | —       | —          | 専門小売り                |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            |               | 8,500   | —       | —       | —          | コングロマリット             |
| JOHNSON MATTHEY PLC               |               | 302     | 348     | 651     | 104,840    | 化学                   |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額     | 487,424 | 542,472 | 350,069 | 56,322,614 |                      |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 86      | 79      | —       | < 4.3% >   |                      |
| (スイス)                             |               |         |         | 千スイスフラン |            |                      |
| SGS SA-REG                        |               | 9       | 11      | 3,082   | 408,562    | 専門サービス               |
| BARRY CALLEBAUT AG                |               | 4       | 7       | 1,553   | 205,898    | 食品                   |
| SWISSCOM AG-REG                   |               | 44      | 48      | 2,742   | 363,449    | 各種電気通信サービス           |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC        |               | 1       | 1       | 2,195   | 291,018    | 食品                   |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG       |               | 0.16    | 0.2     | 2,294   | 304,046    | 食品                   |
| GIVAUDAN-REG                      |               | 15      | 17      | 6,658   | 882,581    | 化学                   |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG         |               | 251     | 285     | 13,024  | 1,726,267  | 保険                   |
| NOVARTIS AG-REG                   |               | 3,670   | 4,123   | 33,664  | 4,461,865  | 医薬品                  |
| ABB LTD                           |               | 3,030   | 3,090   | 9,350   | 1,239,294  | 電気設備                 |
| ROCHE HOLDINGS AG-BEARER          |               | 53      | 58      | 2,384   | 316,102    | 医薬品                  |
| ROCHE HOLDING (GENUSSSCHEINE)     |               | 1,164   | 1,322   | 49,019  | 6,497,078  | 医薬品                  |
| ADECCO GROUP AG-REG               |               | 249     | 281     | 1,211   | 160,520    | 専門サービス               |
| HOLCIM LTD                        |               | 884     | 965     | 4,402   | 583,484    | 建設資材                 |
| CLARIANT AG-REG                   |               | 320     | 410     | 680     | 90,152     | 化学                   |
| NESTLE SA-REG                     |               | 4,774   | 5,297   | 63,871  | 8,465,492  | 食品                   |
| BALOISE HOLDING AG                |               | 74      | 86      | 1,418   | 187,960    | 保険                   |
| TEMENOS AG-REG                    |               | 104     | 120     | 1,140   | 151,222    | ソフトウェア               |
| BACHEM HOLDING AG-REG B           |               | —       | 11      | 592     | 78,582     | ライフサイエンス・ツール/サービス    |
| SONOVA HOLDING AG-REG             |               | 88      | 103     | 3,943   | 522,720    | ヘルスケア機器・用品           |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG          |               | 17      | 19      | 2,836   | 375,976    | ヘルスケア機器・用品           |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG        |               | 4,120   | 5,040   | 3,792   | 502,604    | 資本市場                 |
| THE SWATCH GROUP AG-B             |               | 47      | 55      | 1,484   | 196,749    | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| THE SWATCH GROUP AG-REG           |               | 74      | 105     | 542     | 71,879     | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| LONZA AG-REG                      |               | 121     | 138     | 9,306   | 1,233,457  | ライフサイエンス・ツール/サービス    |
| SWISS LIFE HOLDING AG             |               | 52      | 60      | 3,589   | 475,708    | 保険                   |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG         |               | 14      | 13      | 1,235   | 163,784    | 化学                   |
| SWISS PRIME SITE-REG              |               | 135     | 135     | 1,248   | 165,419    | 不動産管理・開発             |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG         |               | 31      | 42      | 4,899   | 649,337    | 資本市場                 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT       |               | 67      | 74      | 1,493   | 197,924    | 機械                   |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG          |               | 30      | 37      | 742     | 98,373     | 機械                   |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG        |               | 84      | 101     | 2,728   | 361,570    | 海運業                  |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG        |               | 270     | 316     | 2,246   | 297,785    | コンピュータ・周辺機器          |
| GEBERIT AG-REG                    |               | 62      | 68      | 3,978   | 527,246    | 建設関連製品               |

| 銘                                | 柄       | 期首(前期末) | 当      |        | 期           | 末          | 業              | 種 | 等 |        |   |
|----------------------------------|---------|---------|--------|--------|-------------|------------|----------------|---|---|--------|---|
|                                  |         | 株       | 数      | 株      | 数           | 評          |                |   |   | 価      | 額 |
|                                  |         |         |        |        |             | 外貨建金額      |                |   |   | 邦貨換算金額 |   |
| (スイス)                            |         | 百株      | 百株     |        | 千スイスフラン     | 千円         |                |   |   |        |   |
| JULIUS BAER GROUP LTD            |         | 358     | 422    |        | 2,299       | 304,828    | 資本市場           |   |   |        |   |
| SWISS RE LTD                     |         | 483     | 571    |        | 5,072       | 672,344    | 保険             |   |   |        |   |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A    |         | 857     | 989    |        | 11,976      | 1,587,403  | 繊維・アパレル・贅沢品    |   |   |        |   |
| SIKA AG-REG                      |         | 238     | 270    |        | 8,253       | 1,093,971  | 化学             |   |   |        |   |
| ALCON INC                        |         | 827     | 951    |        | 7,147       | 947,358    | ヘルスケア機器・用品     |   |   |        |   |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG     |         | 54      | —      |        | —           | —          | 銀行             |   |   |        |   |
| VIFOR PHARMA AG/NEW              |         | —       | 91     |        | 1,495       | 198,224    | 医薬品            |   |   |        |   |
| UBS GROUP AG                     |         | 6,020   | 6,610  |        | 11,914      | 1,579,151  | 資本市場           |   |   |        |   |
| VAT GROUP AG                     |         | —       | 53     |        | 1,904       | 252,464    | 機械             |   |   |        |   |
| VIFOR PHARMA AG                  |         | 76      | —      |        | —           | —          | 医薬品            |   |   |        |   |
| 小                                | 計       | 株数・金額   | 28,779 | 32,400 | 293,419     | 38,889,867 |                |   |   |        |   |
|                                  | 銘柄数<比率> |         | 40     | 41     | —           | <3.0%>     |                |   |   |        |   |
| (スウェーデン)                         |         |         |        |        | 千スウェーデンクローナ |            |                |   |   |        |   |
| LUNDBERGS AB-B SHS               |         | 126     | 155    |        | 7,562       | 100,051    | 各種金融サービス       |   |   |        |   |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB |         | 2,670   | 3,140  |        | 32,875      | 434,946    | 銀行             |   |   |        |   |
| SWEDBANK AB                      |         | 1,480   | 1,700  |        | 27,159      | 359,316    | 銀行             |   |   |        |   |
| SWEDISH MATCH AB                 |         | 260     | —      |        | —           | —          | タバコ            |   |   |        |   |
| SECURITAS AB-B SHS               |         | 540     | 540    |        | 5,988       | 79,229     | 商業サービス・用品      |   |   |        |   |
| INVESTOR AB-B SHS                |         | 767     | —      |        | —           | —          | 各種金融サービス       |   |   |        |   |
| HENNES&MAURITZ AB-B              |         | 1,300   | 1,330  |        | 19,269      | 254,929    | 専門小売り          |   |   |        |   |
| ERICSSON LM-B                    |         | 4,910   | 5,470  |        | 47,884      | 633,510    | 通信機器           |   |   |        |   |
| TELIA CO AB                      |         | 4,280   | 4,800  |        | 18,086      | 239,283    | 各種電気通信サービス     |   |   |        |   |
| SKANSKA AB-B SHS                 |         | 600     | 660    |        | 14,097      | 186,511    | 建設・土木          |   |   |        |   |
| LUNDIN ENERGY AB                 |         | 288     | 370    |        | 14,788      | 195,657    | 石油・ガス・消耗燃料     |   |   |        |   |
| ALFA LAVAL AB                    |         | 510     | 570    |        | 18,108      | 239,580    | 機械             |   |   |        |   |
| GETINGE AB-B SHS                 |         | —       | 450    |        | 17,253      | 228,257    | ヘルスケア機器・用品     |   |   |        |   |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS      |         | 151     | 187    |        | 11,496      | 152,102    | 不動産管理・開発       |   |   |        |   |
| ICA GRUPPEN AB                   |         | 171     | —      |        | —           | —          | 食品・生活必需品小売り    |   |   |        |   |
| HUSQVARNA AB-B SHS               |         | 730     | 730    |        | 7,380       | 97,641     | 機械             |   |   |        |   |
| ELECTROLUX AB-B                  |         | 340     | —      |        | —           | —          | 家庭用耐久財         |   |   |        |   |
| SKF AB-B SHARES                  |         | 600     | 680    |        | 10,506      | 138,994    | 機械             |   |   |        |   |
| VOLVO AB-A SHS                   |         | —       | 400    |        | 7,388       | 97,743     | 機械             |   |   |        |   |
| VOLVO AB-B SHS                   |         | 2,330   | 2,690  |        | 48,333      | 639,457    | 機械             |   |   |        |   |
| SANDVIK AB                       |         | 1,840   | 2,100  |        | 42,840      | 566,773    | 機械             |   |   |        |   |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS          |         | 150     | 240    |        | 6,610       | 87,461     | 各種金融サービス       |   |   |        |   |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS          |         | 250     | 320    |        | 8,608       | 113,883    | 各種金融サービス       |   |   |        |   |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B           |         | 1,000   | 1,120  |        | 20,328      | 268,939    | 紙製品・林産品        |   |   |        |   |
| HEXAGON AB-B SHS                 |         | 456     | —      |        | —           | —          | 電子装置・機器・部品     |   |   |        |   |
| TELE 2 AB-B SHS                  |         | 780     | 920    |        | 12,857      | 170,098    | 無線通信サービス       |   |   |        |   |
| SAGAX AB-B                       |         | —       | 290    |        | 8,160       | 107,964    | 不動産管理・開発       |   |   |        |   |
| ATLAS COPCO AB-A                 |         | 1,129   | 1,269  |        | 61,800      | 817,617    | 機械             |   |   |        |   |
| ATLAS COPCO AB-B                 |         | 627     | 731    |        | 31,257      | 413,537    | 機械             |   |   |        |   |
| EPIROC AB - A                    |         | 1,130   | —      |        | —           | —          | 機械             |   |   |        |   |
| EPIROC AB - B                    |         | 690     | —      |        | —           | —          | 機械             |   |   |        |   |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B              |         | 1,030   | 1,160  |        | 25,879      | 342,387    | 家庭用品           |   |   |        |   |
| EQT AB                           |         | 420     | 590    |        | 21,564      | 285,298    | 資本市場           |   |   |        |   |
| BOLIDEN AB                       |         | 440     | —      |        | —           | —          | 金属・鉱業          |   |   |        |   |
| EVOLUTION AB                     |         | 273     | 329    |        | 33,110      | 438,052    | ホテル・レストラン・レジャー |   |   |        |   |
| SINCH AB                         |         | —       | 920    |        | 6,800       | 89,972     | ソフトウェア         |   |   |        |   |
| LIFCO AB-B SHS                   |         | —       | 420    |        | 10,143      | 134,191    | コングロマリット       |   |   |        |   |
| EPIROC AB - A                    |         | —       | 1,210  |        | 24,127      | 319,205    | 機械             |   |   |        |   |
| EPIROC AB - B                    |         | —       | 690    |        | 11,581      | 153,225    | 機械             |   |   |        |   |
| EMBRACER GROUP AB                |         | —       | 1,100  |        | 8,826       | 116,773    | 娯楽             |   |   |        |   |
| INVESTOR AB-A SHS                |         | —       | 960    |        | 21,456      | 283,862    | 各種金融サービス       |   |   |        |   |

| 銘<br>柄                           | 株<br>数        | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |           | 業<br>種<br>等          |        |
|----------------------------------|---------------|---------|-------------|-----------|----------------------|--------|
|                                  |               | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 | 外貨建金額     |                      | 邦貨換算金額 |
|                                  |               |         |             |           |                      |        |
| (スウェーデン)                         | 百株            | 百株      | 千スウェーデンクローナ | 千円        |                      |        |
| INVESTOR AB-B SHS                | —             | 3,440   | 71,724      | 948,908   | 各種金融サービス             |        |
| BOLIDEN AB                       | —             | 530     | 25,090      | 331,943   | 金属・鉱業                |        |
| KINNEVIK AB - B                  | 390           | —       | —           | —         | 各種金融サービス             |        |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS         | —             | 2,730   | 27,873      | 368,763   | 建設関連製品               |        |
| KINNEVIK AB - B                  | —             | 440     | 11,039      | 146,053   | 各種金融サービス             |        |
| HEXAGON AB-B SHS                 | —             | 3,630   | 48,097      | 636,329   | 電子装置・機器・部品           |        |
| SWEDISH MATCH AB                 | —             | 3,080   | 22,366      | 295,914   | タバコ                  |        |
| ELECTROLUX AB-B                  | —             | 410     | 6,340       | 83,886    | 家庭用耐久財               |        |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A          | 2,670         | 2,830   | 25,045      | 331,351   | 銀行                   |        |
| ASSA ABLOY AB-B                  | 1,700         | 1,900   | 48,735      | 644,764   | 建設関連製品               |        |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS         | 510           | —       | —           | —         | 建設関連製品               |        |
| NORDEA BANK ABP                  | 5,480         | 6,070   | 60,329      | 798,162   | 銀行                   |        |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS       | 260           | 260     | 7,909       | 104,638   | コングロマリット             |        |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額     | 43,278  | 63,561      | 1,018,682 | 13,477,175           |        |
|                                  | 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                          | 1,550         | —       | —           | —         | 銀行                   |        |
| TELENOR ASA                      | 1,160         | 1,290   | 16,679      | 238,019   | 各種電気通信サービス           |        |
| SCHIBSTED ASA-CL A               | 106           | 144     | 3,162       | 45,125    | メディア                 |        |
| EQUINOR ASA                      | 1,600         | 1,850   | 60,430      | 862,339   | 石油・ガス・消耗燃料           |        |
| YARA INTERNATIONAL ASA           | 296           | 331     | 15,196      | 216,849   | 化学                   |        |
| MOWI ASA                         | 700           | 840     | 20,412      | 291,279   | 食品                   |        |
| NORSK HYDRO                      | 2,180         | 2,460   | 21,795      | 311,023   | 金属・鉱業                |        |
| AKER BP ASA                      | —             | 220     | 7,156       | 102,124   | 石油・ガス・消耗燃料           |        |
| ORKLA ASA                        | 1,330         | 1,330   | 10,472      | 149,441   | 食品                   |        |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA        | 310           | 400     | 8,920       | 127,288   | 保険                   |        |
| ADEVINTA ASA                     | 450           | 630     | 5,276       | 75,301    | インタラクティブ・メディアおよびサービス |        |
| DNB BANK ASA                     | —             | 1,740   | 35,461      | 506,031   | 銀行                   |        |
| SCHIBSTED ASA-B SHS              | 181           | 181     | 3,411       | 48,687    | メディア                 |        |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額     | 9,863   | 11,416      | 208,374   | 2,973,510            |        |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 11      | 12          | —         | <0.2%>               |        |
| (デンマーク)                          |               |         | 千デンマーククローネ  |           |                      |        |
| CARLSBERG B                      | 168           | 193     | 16,393      | 301,311   | 飲料                   |        |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B           | 10            | 10      | 22,323      | 410,300   | 海運業                  |        |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A        | 5             | 5       | 11,116      | 204,312   | 海運業                  |        |
| GN STORE NORD A/S                | 212           | 241     | 8,018       | 147,372   | ヘルスケア機器・用品           |        |
| DANSKE BANK AS                   | 1,090         | 1,320   | 15,503      | 284,952   | 銀行                   |        |
| GENMAB A/S                       | 110           | 126     | 31,248      | 574,338   | バイオテクノロジー            |        |
| ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS | 11            | 17      | 3,932       | 72,271    | 建設関連製品               |        |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S          | 332           | —       | —           | —         | 電気設備                 |        |
| H LUNDBECK A/S                   | 105           | —       | —           | —         | 医薬品                  |        |
| DSV A/S                          | 338           | 388     | 51,410      | 944,915   | 航空貨物・物流サービス          |        |
| PANDORA A/S                      | 160           | 177     | 11,618      | 213,543   | 繊維・アパレル・贅沢品          |        |
| CHR HANSEN HOLDING A/S           | 182           | 204     | 10,018      | 184,138   | 化学                   |        |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES           | 337           | 376     | 17,220      | 316,518   | 化学                   |        |
| COLOPLAST-B                      | 194           | 221     | 22,265      | 409,244   | ヘルスケア機器・用品           |        |
| AMBU A/S-B                       | 290           | 290     | 2,946       | 54,154    | ヘルスケア機器・用品           |        |
| NOVO NORDISK A/S-B               | 2,842         | 3,169   | 239,481     | 4,401,666 | 医薬品                  |        |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S          | —             | 1,910   | 38,371      | 705,275   | 電気設備                 |        |
| TRYG A/S-NEW                     | 326           | —       | —           | —         | 保険                   |        |
| TRYG A/S                         | 280           | 680     | 11,118      | 204,348   | 保険                   |        |
| ORSTED A/S                       | 318           | 351     | 28,852      | 530,303   | 電力                   |        |

| 銘柄                                | 株数    | 当期    |         | 業種等                     |
|-----------------------------------|-------|-------|---------|-------------------------|
|                                   |       | 株数    | 金額      |                         |
| (デンマーク)                           | 百株    | 百株    | 千円      |                         |
| DEMANT A/S                        | 160   | 201   | 6,088   | ヘルスケア機器・用品              |
| 小計                                | 7,472 | 9,880 | 547,925 | 10,070,872              |
| 銘柄数<比率>                           | 20    | 18    | —       | <0.8%>                  |
| (ユーロ…ドイツ)                         |       |       | 千ユーロ    |                         |
| ADIDAS AG                         | 313   | 362   | 7,833   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| FRESENIUS SE & CO KGAA            | 673   | 780   | 2,550   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE      | 168   | 168   | 537     | 各種電気通信サービス              |
| FUCHS PETROLUB SE -PFD            | 105   | —     | —       | 化学                      |
| HANNOVER RUECK SE                 | 96    | 109   | 1,675   | 保険                      |
| GEA GROUP AG                      | 242   | 290   | 1,093   | 機械                      |
| CONTINENTAL AG                    | 189   | 206   | 1,388   | 自動車部品                   |
| DEUTSCHE POST AG-REG              | 1,659 | 1,846 | 8,175   | 航空貨物・物流サービス             |
| MERCK KGAA                        | 211   | 243   | 4,675   | 医薬品                     |
| RWE AG                            | 1,085 | 1,190 | 4,599   | 総合公益事業                  |
| SAP SE                            | 1,724 | 1,973 | 20,136  | ソフトウェア                  |
| E.ON SE                           | 3,800 | 4,250 | 4,539   | 総合公益事業                  |
| HENKEL AG & CO KGAA               | 180   | 203   | 1,226   | 家庭用品                    |
| PUMA SE                           | 163   | 189   | 1,481   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| BAYER AG-REG                      | 1,616 | 1,863 | 11,526  | 医薬品                     |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG        | 289   | 332   | 2,037   | 家庭用品                    |
| BASF SE                           | 1,512 | 1,726 | 9,197   | 化学                      |
| BEIERSDORF AG                     | 160   | 198   | 1,900   | パーソナル用品                 |
| HOCHTIEF AG                       | 38    | —     | —       | 建設・土木                   |
| HEIDELBERGCEMENT AG               | 249   | 274   | 1,464   | 建設資材                    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE            | 366   | 399   | 2,394   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE-REG                    | 680   | 772   | 16,698  | 保険                      |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG            | 560   | 1,120 | 831     | 旅客航空輸送業                 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG        | 229   | 267   | 6,520   | 保険                      |
| VOLKSWAGEN AG                     | 51    | 58    | 1,357   | 自動車                     |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                | 312   | 344   | 5,471   | 自動車                     |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG            | 1,431 | 1,607 | 10,501  | 自動車                     |
| NEMETSCHEK SE                     | 92    | 110   | 977     | ソフトウェア                  |
| SIEMENS AG                        | 1,263 | 1,433 | 18,631  | コングロマリット                |
| DEUTSCHE BANK AG-REG              | 3,340 | 3,870 | 4,502   | 資本市場                    |
| BAYER MOTOREN WERK                | 559   | 620   | 4,976   | 自動車                     |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD      | 102   | 102   | 740     | 自動車                     |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG              | 5,580 | 6,150 | 10,584  | 各種電気通信サービス              |
| SARTORIUS AG-VORZUG               | 57    | 51    | 2,086   | ヘルスケア機器・用品              |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 2,188 | 2,440 | 7,706   | 半導体・半導体製造装置             |
| RATIONAL AG                       | 8     | 10    | 670     | 機械                      |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR          | 72    | 72    | 1,077   | ヘルスケア機器・用品              |
| BECHTLE AG                        | 44    | 157   | 818     | 情報技術サービス                |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 320   | 359   | 5,928   | 資本市場                    |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE      | 254   | 294   | 2,600   | 自動車                     |
| LANXESS                           | 127   | 155   | 653     | 化学                      |
| MTU AERO ENGINES AG               | 92    | 101   | 2,112   | 航空宇宙・防衛                 |
| DEUTSCHE WOHNEN SE                | 555   | —     | —       | 不動産管理・開発                |
| SYMRISE AG                        | 209   | 255   | 2,775   | 化学                      |
| BRENTAG SE                        | 268   | 290   | 2,144   | 商社・流通業                  |
| EVONIK INDUSTRIES AG              | 330   | 390   | 1,005   | 化学                      |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 1,500 | 2,100 | 522     | 各種電気通信サービス              |
| COMMERZBANK AG                    | 1,580 | 1,880 | 1,377   | 銀行                      |
| LEG IMMOBILIEN SE                 | 125   | 140   | 1,479   | 不動産管理・開発                |
| KION GROUP AG                     | 110   | 131   | 813     | 機械                      |

| 銘柄                                  |               | 期首(前期末) | 当 期 末  |         | 業 種 等      |                         |
|-------------------------------------|---------------|---------|--------|---------|------------|-------------------------|
|                                     |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額   |            |                         |
|                                     |               |         |        | 外貨建金額   |            | 邦貨換算金額                  |
| (ユーロ…ドイツ)                           |               | 百株      | 百株     | 千ユーロ    | 千円         |                         |
| VONOVIA SE                          |               | 878     | 1,392  | 6,025   | 823,749    | 不動産管理・開発                |
| KNORR-BREMSE AG                     |               | 127     | 127    | 910     | 124,408    | 機械                      |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG             |               | 460     | 539    | 3,056   | 417,772    | ヘルスケア機器・用品              |
| TEAMVIEWER AG                       |               | 252     | —      | —       | —          | ソフトウェア                  |
| SIEMENS ENERGY AG                   |               | 660     | 730    | 1,502   | 205,369    | 電気設備                    |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF              |               | —       | 150    | 505     | 69,101     | 化学                      |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG            |               | —       | 759    | 1,998   | 273,135    | 機械                      |
| ZALANDO SE                          |               | 249     | 402    | 1,979   | 270,645    | インターネット販売・通信販売          |
| SCOUT24 SE                          |               | 171     | 152    | 801     | 109,502    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| COVESTRO AG                         |               | 305     | 380    | 1,783   | 243,782    | 化学                      |
| HELLOFRESH SE                       |               | 240     | 318    | 1,419   | 194,096    | 食品・生活必需品小売り             |
| QIAGEN N.V.                         |               | 394     | 440    | 1,976   | 270,124    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| UNIPER SE                           |               | 311     | 151    | 373     | 51,046     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| DELIVERY HERO SE                    |               | 221     | 290    | 1,237   | 169,156    | インターネット販売・通信販売          |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 41,145  | 47,709 | 227,571 | 31,109,007 |                         |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 62      | 60     | —       | <2.4%>     |                         |
| (ユーロ…イタリア)                          |               |         |        |         |            |                         |
| ASSICURAZIONI GENERALI              |               | 1,880   | 2,080  | 4,184   | 572,084    | 保険                      |
| INTESA SANPAOLO                     |               | 27,800  | 30,800 | 6,572   | 898,490    | 銀行                      |
| MEDIOBANCA S. P. A.                 |               | 1,070   | 1,240  | 1,132   | 154,862    | 銀行                      |
| ENEL SPA                            |               | 13,580  | 15,290 | 9,322   | 1,274,360  | 電力                      |
| ENI SPA                             |               | 4,110   | 4,720  | 6,316   | 863,438    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SNAM SPA                            |               | 3,500   | 3,840  | 1,979   | 270,547    | ガス                      |
| TENARIS SA                          |               | 710     | 880    | 1,212   | 165,707    | エネルギー設備・サービス            |
| TELECOM ITALIA SPA                  |               | 11,700  | 19,300 | 692     | 94,662     | 各種電気通信サービス              |
| TELECOM ITALIA-RNC                  |               | 8,800   | —      | —       | —          | 各種電気通信サービス              |
| ATLANTIA SPA                        |               | 790     | 890    | 1,684   | 230,308    | 運送インフラ                  |
| TERNA SPA                           |               | 2,220   | 2,750  | 2,071   | 283,221    | 電力                      |
| RECORDATI SPA                       |               | 168     | 199    | 932     | 127,529    | 医薬品                     |
| AMPLIFON SPA                        |               | 203     | 240    | 974     | 133,233    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PRYSMIAN SPA                        |               | 430     | 480    | 1,501   | 205,312    | 電気設備                    |
| DIASORIN SPA                        |               | 40      | 48     | 680     | 93,043     | ヘルスケア機器・用品              |
| FERRARI NV                          |               | 213     | 241    | 4,841   | 661,859    | 自動車                     |
| CNH INDUSTRIAL NV                   |               | 1,700   | 1,930  | 2,802   | 383,082    | 機械                      |
| MONCLER SPA                         |               | 321     | 376    | 1,958   | 267,789    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NEXI SPA                            |               | 740     | 1,040  | 1,140   | 155,958    | 情報技術サービス                |
| STELLANTIS NV                       |               | 3,340   | 3,840  | 5,823   | 796,105    | 自動車                     |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA         |               | 1,010   | 1,110  | 1,581   | 216,225    | 銀行                      |
| UNICREDIT SPA                       |               | 3,610   | 4,060  | 4,116   | 562,772    | 銀行                      |
| EXOR NV                             |               | 172     | 195    | 1,388   | 189,794    | 各種金融サービス                |
| POSTE ITALIANE SPA                  |               | 880     | 1,030  | 1,089   | 148,897    | 保険                      |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL        |               | 550     | 550    | 558     | 76,387     | 各種電気通信サービス              |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 89,537  | 97,129 | 64,562  | 8,825,674  |                         |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 25      | 24     | —       | <0.7%>     |                         |
| (ユーロ…フランス)                          |               |         |        |         |            |                         |
| BOUYGUES                            |               | 400     | 460    | 1,471   | 201,096    | 建設・土木                   |
| AIRBUS SE                           |               | 968     | 1,106  | 12,316  | 1,683,654  | 航空宇宙・防衛                 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                |               | 870     | 1,250  | 3,638   | 497,417    | 総合公益事業                  |
| LOREAL-ORD                          |               | 420     | 470    | 17,232  | 2,355,689  | パーソナル用品                 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE |               | 460     | 522    | 34,504  | 4,716,767  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| DASSAULT AVIATION SA                |               | 3       | —      | —       | —          | 航空宇宙・防衛                 |
| THALES SA                           |               | 186     | 206    | 2,353   | 321,730    | 航空宇宙・防衛                 |
| CAPGEMINI SA                        |               | 273     | 300    | 6,009   | 821,430    | 情報技術サービス                |
| PUBLICIS GROUPE                     |               | 380     | 433    | 2,478   | 338,809    | メディア                    |

| 銘柄                           | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |        |
|------------------------------|-------|---------|--------|-----------|-------------------------|--------|
|                              |       | 株数      | 評 価 額  | 外貨建金額     |                         | 邦貨換算金額 |
|                              |       |         | 株数     |           |                         |        |
| (ユーロ…フランス)                   | 百株    | 百株      | 千ユーロ   | 千円        |                         |        |
| FAURECIA                     | 150   | 206     | 503    | 68,806    | 自動車部品                   |        |
| BOLLORE SE                   | 1,380 | 1,680   | 796    | 108,902   | 娯楽                      |        |
| MICHELIN (CGDE)              | 287   | 312     | 3,845  | 525,666   | 自動車部品                   |        |
| PERNOD RICARD SA             | 343   | 391     | 7,702  | 1,052,959 | 飲料                      |        |
| RENAULT SA                   | 337   | 337     | 833    | 113,971   | 自動車                     |        |
| REMY COINTREAU               | 39    | 39      | 726    | 99,268    | 飲料                      |        |
| SEB SA                       | 41    | 54      | 689    | 94,265    | 家庭用耐久財                  |        |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 887   | 1,023   | 15,619 | 2,135,139 | 電気設備                    |        |
| VIVENDI SE                   | 1,400 | 1,450   | 1,724  | 235,776   | メディア                    |        |
| ORANGE SA                    | 3,250 | 3,820   | 4,110  | 561,880   | 各種電気通信サービス              |        |
| HERMES INTERNATIONAL         | 53    | 59      | 7,778  | 1,063,376 | 繊維・アパレル・贅沢品             |        |
| DASSAULT SYSTEMES SA         | 223   | —       | —      | —         | ソフトウェア                  |        |
| KERING SA                    | 127   | 141     | 8,274  | 1,131,070 | 繊維・アパレル・贅沢品             |        |
| CNP ASSURANCES               | 280   | 360     | 786    | 107,479   | 保険                      |        |
| CARREFOUR SUPERMARCHE        | 950   | 1,190   | 2,324  | 317,781   | 食品・生活必需品小売り             |        |
| ATOS SE                      | 153   | —       | —      | —         | 情報技術サービス                |        |
| SANOFI                       | 1,869 | 2,148   | 20,100 | 2,747,804 | 医薬品                     |        |
| ACCOR SA                     | 320   | 320     | 948    | 129,657   | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| STMICROELECTRONICS NV        | 1,078 | 1,280   | 5,216  | 713,027   | 半導体・半導体製造装置             |        |
| SOCIETE GENERALE             | 1,290 | 1,510   | 3,830  | 523,576   | 銀行                      |        |
| TELEPERFORMANCE              | 96    | 113     | 3,908  | 534,315   | 専門サービス                  |        |
| EURAZEO SE                   | 59    | 78      | 599    | 81,995    | 各種金融サービス                |        |
| SODEXO                       | 138   | 159     | 1,183  | 161,841   | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| AXA SA                       | 3,170 | 3,660   | 9,709  | 1,327,354 | 保険                      |        |
| ESSILORLUXOTTICA             | 478   | 541     | 9,244  | 1,263,737 | 繊維・アパレル・贅沢品             |        |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 1,840 | 2,260   | 2,516  | 344,037   | 銀行                      |        |
| BNP PARIBAS                  | 1,850 | 2,112   | 11,210 | 1,532,474 | 銀行                      |        |
| ORPEA                        | 93    | 93      | 363    | 49,733    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)   | 828   | 939     | 5,206  | 711,763   | 建設関連製品                  |        |
| WENDEL                       | 43    | 43      | 401    | 54,872    | 各種金融サービス                |        |
| ILIAD SA                     | 24    | —       | —      | —         | 各種電気通信サービス              |        |
| SES FDR                      | 560   | —       | —      | —         | メディア                    |        |
| SAFRAN SA                    | 538   | 644     | 6,957  | 951,127   | 航空宇宙・防衛                 |        |
| ENGIE                        | 3,080 | 3,370   | 4,067  | 556,039   | 総合公益事業                  |        |
| ALSTOM                       | 433   | 610     | 1,331  | 181,950   | 機械                      |        |
| ELECTRICITE DE FRANCE        | 1,090 | 790     | 691    | 94,472    | 電力                      |        |
| ELECTRICITE DE FRANCE SA-RTS | —     | 790     | 31     | 4,319     | 電力                      |        |
| IPSEN                        | 55    | 73      | 827    | 113,162   | 医薬品                     |        |
| ARKEMA                       | 116   | 116     | 1,306  | 178,552   | 化学                      |        |
| LEGRAND SA                   | 452   | 512     | 4,441  | 607,096   | 電気設備                    |        |
| EIFFAGE SA                   | 141   | 159     | 1,482  | 202,703   | 建設・土木                   |        |
| TOTALENERGIES SE             | 4,159 | 4,736   | 22,242 | 3,040,566 | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| ADP                          | 47    | 61      | 837    | 114,532   | 運送インフラ                  |        |
| NATIXIS                      | 1,580 | —       | —      | —         | 資本市場                    |        |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | 144   | 173     | 703    | 96,109    | 娯楽                      |        |
| SCOR SE                      | 232   | —       | —      | —         | 保険                      |        |
| VINCI                        | 873   | 1,012   | 9,485  | 1,296,664 | 建設・土木                   |        |
| DANONE                       | 1,038 | 1,244   | 6,320  | 864,048   | 食品                      |        |
| AIR LIQUIDE SA               | 791   | 897     | 14,298 | 1,954,561 | 化学                      |        |
| BUREAU VERITAS SA            | 470   | 540     | 1,443  | 197,389   | 専門サービス                  |        |
| GETLINK                      | 720   | 830     | 1,345  | 183,920   | 運送インフラ                  |        |
| SUEZ                         | 520   | —       | —      | —         | 総合公益事業                  |        |
| EDENRED                      | 424   | 470     | 2,119  | 289,762   | 情報技術サービス                |        |
| VALEO SA                     | 373   | 440     | 738    | 100,958   | 自動車部品                   |        |

| 銘柄                                   |               | 期首(前期末) |        | 当 期 末   |            | 業 種 等             |
|--------------------------------------|---------------|---------|--------|---------|------------|-------------------|
|                                      |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額   |            |                   |
|                                      |               |         |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                   |
| (ユーロ…フランス)                           |               | 百株      | 百株     | 千ユーロ    | 千円         |                   |
| BIOMERIEUX                           |               | 69      | 69     | 685     | 93,757     | ヘルスケア機器・用品        |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM           |               | 154     | 200    | 731     | 99,927     | ホテル・レストラン・レジャー    |
| FAURECIA                             |               | 56      | —      | —       | —          | 自動車部品             |
| DASSAULT SYSTEMES SE                 |               | —       | 1,250  | 5,704   | 779,788    | ソフトウェア            |
| DASSAULT AVIATION SA                 |               | —       | 50     | 714     | 97,603     | 航空宇宙・防衛           |
| WORLDLINE SA                         |               | 386     | 448    | 1,895   | 259,051    | 情報技術サービス          |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH             |               | 45      | 49     | 1,884   | 257,606    | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| AMUNDI SA                            |               | 100     | 128    | 814     | 111,372    | 資本市場              |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額     | 45,686  | 50,728 | 303,263 | 41,456,179 |                   |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 68      | 62     | —       | <3.2%>     |                   |
| (ユーロ…オランダ)                           |               |         |        |         |            |                   |
| ASM INTERNATIONAL NV                 |               | 78      | 90     | 3,025   | 413,626    | 半導体・半導体製造装置       |
| RANDSTAD NV                          |               | 184     | 214    | 1,254   | 171,485    | 専門サービス            |
| WOLTERS KLUWER                       |               | 444     | 503    | 4,842   | 662,022    | 専門サービス            |
| VOPAK                                |               | 114     | —      | —       | —          | 石油・ガス・消耗燃料        |
| AEGON NV                             |               | 2,930   | 3,290  | 1,593   | 217,765    | 保険                |
| KONINKLIJKE KPN NV                   |               | 5,600   | 6,100  | 1,913   | 261,585    | 各種電気通信サービス        |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV               |               | 1,527   | 1,740  | 4,895   | 669,213    | ヘルスケア機器・用品        |
| HEINEKEN NV                          |               | 438     | 496    | 4,338   | 593,006    | 飲料                |
| HEINEKEN HOLDING NV                  |               | 200     | 220    | 1,582   | 216,382    | 飲料                |
| KONINKLIJKE DSM NV                   |               | 291     | 333    | 5,421   | 741,083    | 化学                |
| ASML HOLDING NV                      |               | 703     | 777    | 48,394  | 6,615,557  | 半導体・半導体製造装置       |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV        |               | 1,860   | 1,990  | 5,800   | 792,976    | 食品・生活必需品小売り       |
| AKZO NOBEL                           |               | 312     | 345    | 2,724   | 372,481    | 化学                |
| PROSUS NV                            |               | 816     | 1,754  | 8,770   | 1,198,859  | インターネット販売・通信販売    |
| JDE PEET'S BV                        |               | 110     | 210    | 552     | 75,556     | 食品                |
| DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV             |               | 910     | 910    | 963     | 131,674    | 飲料                |
| EURONEXT NV                          |               | —       | 153    | 1,272   | 173,909    | 資本市場              |
| IMCD NV                              |               | —       | 102    | 1,579   | 215,913    | 商社・流通業            |
| NN GROUP NV                          |               | 470     | 494    | 2,286   | 312,595    | 保険                |
| ARGENX SE                            |               | 76      | 83     | 2,343   | 320,413    | バイオテクノロジー         |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV             |               | —       | 1,350  | 3,225   | 440,878    | 娯楽                |
| ARCELORMITTAL                        |               | 1,190   | 1,190  | 3,536   | 483,382    | 金属・鉱業             |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV             |               | 206     | 329    | 1,054   | 144,142    | インターネット販売・通信販売    |
| ABN AMRO BANK NV-CVA                 |               | 700     | 820    | 973     | 133,122    | 銀行                |
| ADYEN NV                             |               | 30      | 37     | 7,001   | 957,156    | 情報技術サービス          |
| ING GROEP NV                         |               | 6,390   | 7,270  | 7,107   | 971,547    | 銀行                |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額     | 25,580  | 30,800 | 126,454 | 17,286,339 |                   |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 23      | 25     | —       | <1.3%>     |                   |
| (ユーロ…スペイン)                           |               |         |        |         |            |                   |
| ENDESA S.A.                          |               | 500     | 570    | 1,101   | 150,539    | 電力                |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. |               | 10,900  | 12,450 | 6,710   | 917,332    | 銀行                |
| NATURGY ENERGY GROUP SA              |               | 500     | 340    | 926     | 126,606    | ガス                |
| REPSOL SA                            |               | 2,448   | 2,740  | 3,294   | 450,293    | 石油・ガス・消耗燃料        |
| BANCO SANTANDER SA                   |               | 28,500  | 32,600 | 10,244  | 1,400,429  | 銀行                |
| TELEFONICA SA                        |               | 8,200   | 9,900  | 4,367   | 597,089    | 各種電気通信サービス        |
| ENAGAS SA                            |               | 390     | 480    | 957     | 130,838    | ガス                |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA   |               | 380     | 450    | 725     | 99,192     | 電気設備              |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV         |               | 370     | 461    | 1,139   | 155,822    | 建設・土木             |
| FERROVIAL SA                         |               | 797     | 950    | 2,287   | 312,714    | 建設・土木             |
| CAIXABANK                            |               | 6,000   | 8,300  | 2,609   | 356,721    | 銀行                |
| IBERDROLA SA                         |               | 10,220  | 10,940 | 10,872  | 1,486,225  | 電力                |
| AMADEUS IT GROUP SA                  |               | 760     | 861    | 5,112   | 698,894    | 情報技術サービス          |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA         |               | 700     | 790    | 1,449   | 198,167    | 電力                |

| 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…スペイン)                       |               | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                   |
| INDITEX SA                       |               | 1,840   | 2,090  | 4,351  | 594,833   | 専門小売り             |
| AENA SME SA                      |               | 117     | 144    | 2,186  | 298,913   | 運送インフラ            |
| CELLNEX TELECOM SA               |               | 539     | 950    | 4,212  | 575,821   | 各種電気通信サービス        |
| GRIFOLS SA                       |               | 468     | 540    | 891    | 121,836   | バイオテクノロジー         |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額     | 73,631  | 85,556 | 63,440 | 8,672,274 |                   |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 18      | 18     | —      | <0.7%>    |                   |
| (ユーロ…ベルギー)                       |               |         |        |        |           |                   |
| KBC GROEP NV                     |               | 409     | 460    | 3,058  | 418,039   | 銀行                |
| SOFINA SA                        |               | 23      | 29     | 974    | 133,200   | 各種金融サービス          |
| SOLVAY SA                        |               | 116     | 142    | 1,321  | 180,603   | 化学                |
| UCB SA                           |               | 206     | 245    | 2,632  | 359,866   | 医薬品               |
| COLRUYT SA                       |               | 87      | 87     | 330    | 45,157    | 食品・生活必需品小売り       |
| GROUPE BRUXELLES LAM             |               | 195     | 214    | 2,043  | 279,315   | 各種金融サービス          |
| PROXIMUS                         |               | 260     | 260    | 442    | 60,421    | 各種電気通信サービス        |
| GALAPAGOS NV                     |               | 70      | —      | —      | —         | バイオテクノロジー         |
| ELIA GROUP SA/NV                 |               | 48      | 62     | 845    | 115,604   | 電力                |
| AGEAS                            |               | 289     | 320    | 1,490  | 203,803   | 保険                |
| UMICORE                          |               | 343     | 390    | 1,546  | 211,439   | 化学                |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV       |               | 1,277   | 1,633  | 9,014  | 1,232,235 | 飲料                |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額     | 3,323   | 3,842  | 23,699 | 3,239,686 |                   |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 12      | 11     | —      | <0.2%>    |                   |
| (ユーロ…オーストリア)                     |               |         |        |        |           |                   |
| OMV AG                           |               | 250     | 281    | 1,224  | 167,440   | 石油・ガス・消耗燃料        |
| VERBUND AG                       |               | 110     | 127    | 1,185  | 162,064   | 電力                |
| VOESTALPINE AG                   |               | 200     | 200    | 554    | 75,841    | 金属・鉱業             |
| ERSTE GROUP BANK AG              |               | 490     | 650    | 2,226  | 304,417   | 銀行                |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG |               | 201     | 290    | 389    | 53,280    | 銀行                |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額     | 1,251   | 1,548  | 5,581  | 763,043   |                   |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5       | 5      | —      | <0.1%>    |                   |
| (ユーロ…ルクセンブルグ)                    |               |         |        |        |           |                   |
| AROUNDTOWN SA                    |               | 1,730   | 1,730  | 919    | 125,671   | 不動産管理・開発          |
| INPOST SA                        |               | —       | 340    | 225    | 30,856    | 航空貨物・物流サービス       |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE           |               | 216     | 255    | 2,342  | 320,245   | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額     | 1,946   | 2,325  | 3,487  | 476,773   |                   |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2       | 3      | —      | <0.0%>    |                   |
| (ユーロ…フィンランド)                     |               |         |        |        |           |                   |
| KESKO OYJ-B SHS                  |               | 440     | 500    | 1,313  | 179,487   | 食品・生活必需品小売り       |
| WARTSILA OYJ                     |               | 660     | 820    | 715    | 97,858    | 機械                |
| UPM-KYMMENE OYJ                  |               | 910     | 1,020  | 3,083  | 421,508   | 紙製品・林産品           |
| STORA ENSO OYJ-R                 |               | 960     | 1,080  | 1,958  | 267,664   | 紙製品・林産品           |
| SAMPO OYJ-A SHS                  |               | 804     | 950    | 4,222  | 577,249   | 保険                |
| FORTUM OYJ                       |               | 720     | 890    | 1,501  | 205,306   | 電力                |
| ELISA OYJ                        |               | 221     | 257    | 1,407  | 192,382   | 各種電気通信サービス        |
| NOKIA OYJ                        |               | 9,230   | 10,020 | 5,045  | 689,661   | 通信機器              |
| NESTE OYJ                        |               | 714     | 780    | 3,130  | 427,996   | 石油・ガス・消耗燃料        |
| KONE OYJ                         |               | 574     | 635    | 3,047  | 416,574   | 機械                |
| ORION OYJ                        |               | 165     | 210    | 874    | 119,593   | 医薬品               |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額     | 15,398  | 17,162 | 26,300 | 3,595,282 |                   |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 11      | 11     | —      | <0.3%>    |                   |
| (ユーロ…アイルランド)                     |               |         |        |        |           |                   |
| CRH PLC                          |               | 1,322   | 1,460  | 5,378  | 735,260   | 建設資材              |
| KINGSPAN GROUP PLC               |               | 264     | 299    | 2,644  | 361,565   | 建設関連製品            |
| KERRY GROUP PLC-A                |               | 259     | 293    | 2,978  | 407,139   | 食品                |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD   |               | 1,398   | —      | —      | —         | 銀行                |

| 銘柄                                    |                  | 株数      | 期首(前期末) | 当 期 末     |             | 業 種 等              |
|---------------------------------------|------------------|---------|---------|-----------|-------------|--------------------|
|                                       |                  |         | 株数      | 評価額       | 外貨建金額       |                    |
| (ユーロ…アイルランド)                          |                  | 百株      | 百株      | 千ユーロ      | 千円          |                    |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC               |                  | 423     | 462     | 1,870     | 255,653     | 容器・包装              |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC             |                  | 266     | 311     | 3,254     | 444,905     | ホテル・レストラン・レジャー     |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,932   | 2,825   | 16,126    | 2,204,523   |                    |
| (ユーロ…ポルトガル)                           |                  |         |         |           |             |                    |
| ENERGIAS DE PORTUGAL                  |                  | 4,760   | 5,090   | 2,244     | 306,849     | 電力                 |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS           |                  | 810     | 960     | 1,104     | 150,916     | 石油・ガス・消耗燃料         |
| JERONIMO MARTINS                      |                  | 380     | 550     | 1,194     | 163,301     | 食品・生活必需品小売り        |
| EDP RENOVAVEIS SA                     |                  | —       | 580     | 1,336     | 182,674     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 5,950   | 7,180   | 5,879     | 803,742     |                    |
| ユーロ計                                  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 307,381 | 346,806 | 866,368   | 118,432,528 |                    |
| (香港)                                  |                  |         |         | 千香港ドル     |             |                    |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY                |                  | 480     | —       | —         | —           | 半導体・半導体製造装置        |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD              |                  | 3,600   | 3,600   | 5,724     | 89,523      | 不動産管理・開発           |
| BANK OF EAST ASIA                     |                  | 2,200   | —       | —         | —           | 銀行                 |
| CLP HLDGS                             |                  | 2,810   | 3,170   | 24,218    | 378,782     | 電力                 |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD    |                  | 1,983   | 2,280   | 85,773    | 1,341,499   | 資本市場               |
| MTR CORP                              |                  | 2,720   | 3,070   | 13,032    | 203,822     | 陸運・鉄道              |
| HANG SENG BANK                        |                  | 1,310   | 1,400   | 21,392    | 334,570     | 銀行                 |
| HENDERSON LAND                        |                  | 2,294   | 2,674   | 8,892     | 139,078     | 不動産管理・開発           |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD             |                  | 2,250   | 2,540   | 13,081    | 204,586     | 電力                 |
| HONG KONG & CHINA GAS                 |                  | 17,403  | 20,703  | 19,792    | 309,560     | ガス                 |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L          |                  | 3,560   | 4,090   | 19,427    | 303,846     | ホテル・レストラン・レジャー     |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD            |                  | 6,100   | 6,700   | 20,033    | 313,316     | 銀行                 |
| PCCW LTD                              |                  | 7,500   | —       | —         | —           | 各種電気通信サービス         |
| SINO LAND CO. LTD                     |                  | 4,800   | 6,200   | 6,472     | 101,234     | 不動産管理・開発           |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES               |                  | 2,220   | 2,500   | 23,812    | 372,427     | 不動産管理・開発           |
| SWIRE PACIFIC-A                       |                  | 750     | 1,040   | 4,997     | 78,156      | 不動産管理・開発           |
| TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED |                  | 2,330   | 2,620   | 33,929    | 530,649     | 機械                 |
| XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD           |                  | 2,800   | 3,300   | 6,481     | 101,365     | 建設関連製品             |
| SJM HOLDINGS LIMITED                  |                  | 2,700   | —       | —         | —           | ホテル・レストラン・レジャー     |
| WYNN MACAU LTD                        |                  | 2,280   | —       | —         | —           | ホテル・レストラン・レジャー     |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD     |                  | —       | 4,100   | 5,986     | 93,621      | 専門小売り              |
| AIA GROUP LTD                         |                  | 19,980  | 22,840  | 188,430   | 2,947,045   | 保険                 |
| HKT TRUST AND HKT LTD                 |                  | 5,996   | 7,196   | 7,800     | 121,999     | 各種電気通信サービス         |
| SANDS CHINA LTD                       |                  | 3,840   | 4,320   | 8,346     | 130,535     | ホテル・レストラン・レジャー     |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS           |                  | —       | 2,300   | 6,555     | 102,520     | 海運業                |
| SWIRE PROPERTIES LTD                  |                  | 1,730   | 2,300   | 4,586     | 71,728      | 不動産管理・開発           |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT          |                  | 2,790   | 3,110   | 12,502    | 195,534     | 不動産管理・開発           |
| ESR CAYMAN LTD                        |                  | 2,600   | 3,800   | 9,272     | 145,014     | 不動産管理・開発           |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT          |                  | 2,900   | 3,500   | 7,350     | 114,954     | 飲料                 |
| WH GROUP LIMITED                      |                  | 16,100  | 15,383  | 7,676     | 120,054     | 食品                 |
| NEW WORLD DEVELOPMENT                 |                  | 2,689   | 2,689   | 8,806     | 137,741     | 不動産管理・開発           |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD             |                  | 4,600   | 5,090   | 29,906    | 467,731     | コングロマリット           |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD        |                  | 1,070   | 1,340   | 7,142     | 111,704     | 電力                 |
| CK ASSET HOLDINGS LTD                 |                  | 4,450   | 3,830   | 20,875    | 326,495     | 不動産管理・開発           |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 140,837 | 147,687 | 632,295   | 9,889,098   |                    |
| (シンガポール)                              |                  |         |         | 千シンガポールドル |             |                    |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING            |                  | 2,490   | 3,100   | 1,283     | 116,134     | 航空宇宙・防衛            |
| DBS GROUP HLDGS                       |                  | 3,020   | 3,380   | 12,211    | 1,105,058   | 銀行                 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD                 |                  | 700     | 700     | 559       | 50,611      | 不動産管理・開発           |

| 銘柄                                   | 株数     | 当株数    | 期末        |           | 業種等                     |
|--------------------------------------|--------|--------|-----------|-----------|-------------------------|
|                                      |        |        | 評価額       | 価額        |                         |
|                                      |        |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |                         |
| (シンガポール)                             | 百株     | 百株     | 千シンガポールドル | 千円        |                         |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD               | 1,290  | 1,480  | 1,463     | 132,452   | 資本市場                    |
| CAPITALAND LIMITED                   | 4,300  | —      | —         | —         | 不動産管理・開発                |
| SINGAPORE AIRLINES LTD               | 2,400  | 2,400  | 1,320     | 119,446   | 旅客航空輸送業                 |
| UNITED OVERSEAS BANK                 | 1,900  | 2,200  | 7,108     | 643,221   | 銀行                      |
| UOL GROUP LIMITED                    | 870    | 870    | 620       | 56,131    | 不動産管理・開発                |
| VENTURE CORP LTD                     | 450    | 580    | 1,032     | 93,474    | 電子装置・機器・部品              |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | —      | 15,400 | 4,096     | 370,683   | 各種電気通信サービス              |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 14,000 | —      | —         | —         | 各種電気通信サービス              |
| OCBC-ORD                             | 5,590  | 6,490  | 8,080     | 731,163   | 銀行                      |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD             | 3,400  | 3,800  | 1,839     | 166,429   | 食品                      |
| KEPPEL CORP.                         | 2,320  | 2,800  | 1,817     | 164,438   | コングロマリット                |
| GENTING SINGAPORE LTD                | 11,300 | 11,300 | 932       | 84,359    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI         | —      | 4,800  | 1,958     | 177,215   | 不動産管理・開発                |
| 小計                                   | 株数・金額  | 株数     | 44,323    | 4,010,819 |                         |
| 銘柄数 < 比率 >                           | 14     | 14     | —         | < 0.3% >  |                         |
| (オーストラリア)                            |        |        | 千豪ドル      |           |                         |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD               | 295    | 330    | 2,136     | 196,550   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK         | 4,750  | 5,300  | 14,776    | 1,359,428 | 銀行                      |
| WESTPAC BANKING CORP                 | 5,940  | 6,950  | 17,034    | 1,567,169 | 銀行                      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD           | 2,760  | 3,130  | 6,197     | 570,160   | 金属・鉱業                   |
| TELSTRA CORP LTD                     | 7,300  | 7,900  | 3,081     | 283,452   | 各種電気通信サービス              |
| COCA-COLA AMATIL LTD                 | 770    | —      | —         | —         | 飲料                      |
| ASX LTD                              | 307    | 378    | 3,082     | 283,598   | 資本市場                    |
| BHP GROUP LIMITED                    | 4,860  | 9,530  | 48,202    | 4,434,652 | 金属・鉱業                   |
| COMPUTERSHARE LTD                    | 760    | 1,010  | 2,513     | 231,277   | 情報技術サービス                |
| COMPUTERSHARE LTD-RIGHTS             | 86     | —      | —         | —         | 情報技術サービス                |
| CSL LIMITED                          | 758    | 905    | 24,439    | 2,248,436 | バイオテクノロジー               |
| REA GROUP LTD                        | 88     | 104    | 1,420     | 130,660   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| TRANSURBAN GROUP                     | 4,620  | 5,860  | 7,799     | 717,568   | 運送インフラ                  |
| COCHLEAR LTD                         | 103    | 128    | 2,851     | 262,310   | ヘルスケア機器・用品              |
| ORIGIN ENERGY LTD                    | 2,650  | 3,300  | 2,088     | 192,178   | 電力                      |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA       | 2,951  | 3,211  | 34,380    | 3,162,976 | 銀行                      |
| RIO TINTO LTD                        | 607    | 702    | 8,207     | 755,051   | 金属・鉱業                   |
| APA GROUP                            | 2,050  | 2,290  | 2,457     | 226,059   | ガス                      |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD               | 990    | 1,100  | 4,121     | 379,196   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD        | 4,300  | 4,800  | 2,116     | 194,745   | 保険                      |
| ORICA LTD                            | 590    | 790    | 1,271     | 117,014   | 化学                      |
| BLUESCOPE STEEL LTD                  | 900    | 900    | 1,941     | 178,599   | 金属・鉱業                   |
| SUNCORP GROUP LTD                    | 2,220  | 2,450  | 2,746     | 252,673   | 保険                      |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK              | 5,410  | 6,190  | 20,037    | 1,843,406 | 銀行                      |
| NEWCREST MINING                      | 1,320  | 1,640  | 4,408     | 405,565   | 金属・鉱業                   |
| OIL SEARCH LTD                       | 3,500  | —      | —         | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| AMP LIMITED                          | 5,300  | —      | —         | —         | 各種金融サービス                |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED               | 1,700  | 1,700  | 894       | 82,266    | 旅客航空輸送業                 |
| QBE INSURANCE                        | 2,440  | 2,660  | 3,101     | 285,343   | 保険                      |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD          | 1,940  | 1,940  | 2,083     | 191,687   | 金属・鉱業                   |
| REECE LTD                            | —      | 490    | 980       | 90,205    | 商社・流通業                  |
| SANTOS LTD.                          | 3,100  | 6,100  | 4,800     | 441,664   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SONIC HEALTHCARE LTD                 | 780    | 840    | 3,006     | 276,585   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WASHINGTON H. SOUL PATTERSON         | 170    | 380    | 1,084     | 99,775    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TABCORP HOLDINGS                     | 3,709  | 4,200  | 2,188     | 201,314   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESFARMERS LIMITED                   | 1,902  | 2,120  | 10,848    | 998,019   | 複合小売り                   |
| WOODSIDE PETROLEUM                   | 1,630  | 1,850  | 6,019     | 553,830   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WOOLWORTHS GROUP LTD                 | 2,120  | 2,330  | 8,641     | 795,061   | 食品・生活必需品小売り             |

| 銘                                        | 柄             | 期首(前期末)   |           | 当 期 末       |               | 業 種 等                   |
|------------------------------------------|---------------|-----------|-----------|-------------|---------------|-------------------------|
|                                          |               | 株 数       | 株 数       | 評 価 額       |               |                         |
|                                          |               |           |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額        |                         |
| (オーストラリア)                                |               | 百株        | 百株        | 千豪ドル        | 千円            |                         |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD             |               | 192       | —         | —           | —             | 資本市場                    |
| SEEK LTD                                 |               | 600       | 600       | 1,807       | 166,262       | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L             |               | —         | 103       | 903         | 83,095        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MINERAL RESOURCES LTD                    |               | —         | 340       | 1,717       | 157,995       | 金属・鉱業                   |
| BRAMBLES LTD                             |               | 2,470     | 2,700     | 2,689       | 247,406       | 商業サービス・用品               |
| MACQUARIE GROUP LIMITED                  |               | 568       | 632       | 13,088      | 1,204,104     | 資本市場                    |
| CROWN RESORTS LTD                        |               | 550       | 770       | 980         | 90,250        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| EVOLUTION MINING LTD                     |               | 2,720     | 3,400     | 1,489       | 137,006       | 金属・鉱業                   |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC              |               | 730       | 850       | 3,578       | 329,222       | 建設資材                    |
| TREASURY WINE ESTATES LTD                |               | 1,110     | 1,350     | 1,597       | 146,928       | 飲料                      |
| SYDNEY AIRPORT                           |               | 2,006     | —         | —           | —             | 運送インフラ                  |
| AURIZON HOLDINGS LTD                     |               | 3,050     | 3,800     | 1,390       | 127,953       | 陸運・鉄道                   |
| XERO LIMITED                             |               | 198       | 255       | 2,745       | 252,570       | ソフトウェア                  |
| IDP EDUCATION LTD                        |               | —         | 370       | 1,168       | 107,532       | 各種消費者サービス               |
| AFTERPAY LTD                             |               | 348       | —         | —           | —             | 情報技術サービス                |
| AMPOL LTD                                |               | 400       | 400       | 1,229       | 113,086       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TPG TELECOM LTD                          |               | 520       | —         | —           | —             | 各種電気通信サービス              |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA            |               | —         | 2,530     | 1,857       | 170,845       | 食品・生活必需品小売り             |
| AUSNET SERVICES                          |               | 3,300     | —         | —           | —             | 電力                      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD                     |               | 4,500     | 5,200     | 1,617       | 148,782       | 保険                      |
| AGL ENERGY LTD                           |               | 1,050     | —         | —           | —             | 総合公益事業                  |
| SOUTH32 LTD                              |               | 7,800     | 8,700     | 4,332       | 398,599       | 金属・鉱業                   |
| CIMIC GROUP LTD                          |               | 180       | —         | —           | —             | 建設・土木                   |
| COLES GROUP LTD                          |               | 2,270     | 2,430     | 4,364       | 401,513       | 食品・生活必需品小売り             |
| WISETECH GLOBAL LTD                      |               | 210       | 280       | 1,449       | 133,308       | ソフトウェア                  |
| 小 計                                      | 株 数 ・ 金 額     | 120,448   | 128,218   | 308,966     | 28,424,950    |                         |
|                                          | 銘 柄 数 < 比 率 > | 58        | 52        | —           | < 2.2% >      |                         |
| (ニュージーランド)                               |               |           |           | 千ニュージーランドドル |               |                         |
| RYMAN HEALTHCARE LTD                     |               | 740       | 740       | 685         | 58,471        | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| A2 MILK CO LTD                           |               | 1,170     | —         | —           | —             | 食品                      |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L |               | 930       | 1,090     | 2,706       | 230,943       | ヘルスケア機器・用品              |
| SPARK NEW ZEALAND LTD                    |               | 3,070     | 3,800     | 1,751       | 149,481       | 各種電気通信サービス              |
| MERCURY NZ LTD                           |               | 1,000     | 1,370     | 817         | 69,790        | 電力                      |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD                |               | 2,230     | 2,230     | 1,717       | 146,520       | 運送インフラ                  |
| MERIDIAN ENERGY LTD                      |               | 2,010     | 2,500     | 1,237       | 105,595       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| 小 計                                      | 株 数 ・ 金 額     | 11,150    | 11,730    | 8,916       | 760,802       |                         |
|                                          | 銘 柄 数 < 比 率 > | 7         | 6         | —           | < 0.1% >      |                         |
| (イスラエル)                                  |               |           |           | 千新シェケル      |               |                         |
| BANK HAPOLIM BM                          |               | 1,830     | 2,240     | 7,221       | 278,130       | 銀行                      |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL                     |               | 2,380     | 2,670     | 9,414       | 362,576       | 銀行                      |
| ELBIT SYSTEMS LTD                        |               | 50        | 50        | 3,586       | 138,107       | 航空宇宙・防衛                 |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A                   |               | 1,720     | 2,130     | 4,247       | 163,572       | 銀行                      |
| ICL GROUP LTD                            |               | 1,250     | 1,390     | 5,309       | 204,495       | 化学                      |
| NICE LTD                                 |               | 106       | 116       | 8,267       | 318,398       | ソフトウェア                  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD                 |               | 230       | 280       | 3,575       | 137,706       | 銀行                      |
| AZRIELI GROUP                            |               | 65        | 86        | 2,463       | 94,891        | 不動産管理・開発                |
| 小 計                                      | 株 数 ・ 金 額     | 7,631     | 8,962     | 44,086      | 1,697,880     |                         |
|                                          | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8         | 8         | —           | < 0.1% >      |                         |
| 合 計                                      | 株 数 ・ 金 額     | 1,803,673 | 2,032,917 | —           | 1,260,556,072 |                         |
|                                          | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1,229     | 1,223     | —           | < 95.8% >     |                         |

\* 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。

\* 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。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 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         | 93,000                    | 93,000          | 1,231           | 150,701                | 0.0                       |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 22,400                    | 28,100          | 5,678           | 694,985                | 0.1                       |
| AMERICAN TOWER CORP          | 73,700                    | 86,000          | 21,574          | 2,640,542              | 0.2                       |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT    | 238,000                   | 267,000         | 1,893           | 231,687                | 0.0                       |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 22,700                    | 26,600          | 6,701           | 820,241                | 0.1                       |
| BOSTON PROPERTIES            | 25,000                    | 28,600          | 3,742           | 458,056                | 0.0                       |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 16,000                    | 18,800          | 3,188           | 390,261                | 0.0                       |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 72,100                    | 81,100          | 14,967          | 1,831,911              | 0.1                       |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 45,200                    | 54,000          | 7,784           | 952,762                | 0.1                       |
| DUKE REALTY CORP             | 62,200                    | 70,100          | 4,143           | 507,136                | 0.0                       |
| EQUINIX INC                  | 14,810                    | 16,910          | 12,746          | 1,560,096              | 0.1                       |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 29,400                    | 32,100          | 2,484           | 304,082                | 0.0                       |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 60,300                    | 67,400          | 6,167           | 754,791                | 0.1                       |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 10,700                    | 12,000          | 4,184           | 512,158                | 0.0                       |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 20,700                    | 24,900          | 5,202           | 636,777                | 0.0                       |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 88,000                    | 100,000         | 3,483           | 426,284                | 0.0                       |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 109,000                   | 135,000         | 2,690           | 329,296                | 0.0                       |
| INVITATION HOMES INC         | 92,000                    | 113,000         | 4,622           | 565,788                | 0.0                       |
| IRON MOUNTAIN INC            | 49,000                    | 54,000          | 2,994           | 366,538                | 0.0                       |
| KIMCO REALTY CORP            | —                         | 115,000         | 2,875           | 351,871                | 0.0                       |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 99,000                    | 108,000         | 2,307           | 282,471                | 0.0                       |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 19,300                    | 21,400          | 4,558           | 557,904                | 0.0                       |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 36,500                    | —               | —               | —                      | —                         |
| PROLOGIS INC                 | 122,700                   | 139,100         | 22,831          | 2,794,393              | 0.2                       |
| PUBLIC STORAGE               | 26,500                    | 29,700          | 11,765          | 1,440,034              | 0.1                       |
| REALTY INCOME CORP           | 55,600                    | 106,800         | 7,505           | 918,647                | 0.1                       |
| REGENCY CENTERS CORP         | 26,200                    | 28,800          | 2,084           | 255,162                | 0.0                       |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 18,100                    | 20,500          | 7,031           | 860,535                | 0.1                       |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 54,800                    | 61,300          | 8,262           | 1,011,262              | 0.1                       |
| SUN COMMUNITIES INC          | 17,800                    | 21,300          | 3,793           | 464,316                | 0.0                       |
| UDR INC                      | 46,100                    | 59,100          | 3,428           | 419,673                | 0.0                       |
| VENTAS INC                   | 63,900                    | 73,600          | 4,624           | 565,966                | 0.0                       |
| VEREIT INC                   | 37,000                    | —               | —               | —                      | —                         |
| VICI PROPERTIES INC          | 87,000                    | 120,000         | 3,472           | 425,035                | 0.0                       |
| VORNADO REALTY TRUST         | 27,000                    | 32,000          | 1,478           | 180,941                | 0.0                       |
| WP CAREY INC                 | 27,400                    | 34,000          | 2,796           | 342,222                | 0.0                       |
| WELLTOWER INC                | 68,000                    | 82,200          | 8,044           | 984,516                | 0.1                       |
| WEYERHAEUSER CO              | 121,000                   | 143,000         | 5,511           | 674,518                | 0.1                       |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 < 比 率 > | 2,098,110<br>37 | 2,504,410<br>36 | 217,857<br>—<br><2.0%> | 26,663,571<br>—<br><2.0%> |
| (カナダ)                        |                           |                 | 千カナダドル          |                        |                           |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 14,900                    | 14,900          | 812             | 79,587                 | 0.0                       |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 22,000                    | 28,000          | 715             | 70,065                 | 0.0                       |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 < 比 率 > | 36,900<br>2     | 42,900<br>2     | 1,528<br>—<br><0.0%>   | 149,652<br>—<br><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     |     |
| (イギリス)                                 |               | 口         | 口          | 千英ポンド     | 千円         | %   |
| BRITISH LAND                           |               | 128,000   | 159,000    | 857       | 137,986    | 0.0 |
| SEGRO PLC                              |               | 193,000   | 231,000    | 3,142     | 505,637    | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC              |               | 111,000   | 132,000    | 1,064     | 171,259    | 0.0 |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額     | 432,000   | 522,000    | 5,064     | 814,883    |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3         | 3          | —         | <0.1%>     |     |
| (ユーロ…フランス)                             |               |           |            | 千ユーロ      |            |     |
| KLEPIERRE                              |               | 32,300    | 40,000     | 995       | 136,098    | 0.0 |
| GECINA SA                              |               | 7,100     | 8,100      | 934       | 127,778    | 0.0 |
| COVIVIO                                |               | 8,500     | 10,900     | 796       | 108,891    | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              |               | 24,200    | 23,900     | 1,636     | 223,765    | 0.0 |
| ユ ー ロ 計                                | 口 数 ・ 金 額     | 72,100    | 82,900     | 4,363     | 596,534    |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4         | 4          | —         | <0.0%>     |     |
| (香港)                                   |               |           |            | 千香港ドル     |            |     |
| LINK REIT                              |               | 353,000   | 392,000    | 26,518    | 414,754    | 0.0 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS            |               | 470,000   | 470,000    | 3,628     | 56,748     | 0.0 |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額     | 823,000   | 862,000    | 30,147    | 471,502    |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2         | 2          | —         | <0.0%>     |     |
| (シンガポール)                               |               |           |            | 千シンガポールドル |            |     |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST |               | 706,779   | 904,221    | 2,061     | 186,556    | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT           |               | 539,240   | 620,040    | 1,829     | 165,516    | 0.0 |
| SUNTEC REIT                            |               | 300,000   | —          | —         | —          | —   |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST              |               | 427,980   | 570,329    | 1,066     | 96,508     | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST             |               | 370,000   | 370,000    | 710       | 64,284     | 0.0 |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額     | 2,343,999 | 2,464,590  | 5,667     | 512,866    |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5         | 4          | —         | <0.0%>     |     |
| (オーストラリア)                              |               |           |            | 千豪ドル      |            |     |
| MIRVAC GROUP                           |               | 660,000   | 750,000    | 1,897     | 174,570    | 0.0 |
| GPT GROUP                              |               | 330,000   | 380,000    | 1,960     | 180,393    | 0.0 |
| LENDLEASE GROUP                        |               | 111,000   | 135,000    | 1,494     | 137,489    | 0.0 |
| STOCKLAND TRUST GROUP                  |               | 400,000   | 460,000    | 1,978     | 181,976    | 0.0 |
| DEXUS/AU                               |               | 171,000   | 196,000    | 2,156     | 198,352    | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                          |               | 283,000   | 319,000    | 7,356     | 676,764    | 0.1 |
| SCENTRE GROUP                          |               | 820,000   | 1,010,000  | 3,141     | 288,981    | 0.0 |
| VICINITY CENTRES                       |               | 670,000   | 670,000    | 1,246     | 114,650    | 0.0 |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額     | 3,445,000 | 3,920,000  | 21,230    | 1,953,177  |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8         | 8          | —         | <0.1%>     |     |
| 合 計                                    | 口 数 ・ 金 額     | 9,251,109 | 10,398,800 | —         | 31,162,188 |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > | 61        | 59         | —         | <2.4%>     |     |

\* 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。

\* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 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     |     | 期末  |
|-----|--------|----------|--------|-----|-----|
|     |        |          | 買建額    | 売建額 | 額   |
| 外国  | 株式先物取引 | CAN60    | 百万円    |     | 百万円 |
|     |        | EUR050   | 754    |     | —   |
|     |        | FT100    | 1,795  |     | —   |
|     |        | SPI200   | 858    |     | —   |
|     |        | SPEMINI  | 481    |     | —   |
|     |        | SWISSMKT | 14,400 |     | —   |
|     |        |          | 592    |     | —   |

\* 単位未満は切り捨て。  
\* 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3月31日現在)

| 項目           | 当期            |    | 期末    |
|--------------|---------------|----|-------|
|              | 評価額           | 比率 |       |
| 株式           | 千円            |    | %     |
| 投資証券         | 1,260,556,072 |    | 95.8  |
| コール・ローン等、その他 | 31,162,188    |    | 2.4   |
| 投資信託財産総額     | 24,602,516    |    | 1.8   |
|              | 1,316,320,776 |    | 100.0 |

\* 金額の単位未満は切り捨て。  
\* 当期末における外貨建純資産（1,312,101,756千円）の投資信託財産総額（1,316,320,776千円）に対する比率は99.7%です。  
\* 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＝122.39円、1カナダドル＝97.90円、1英ポンド＝160.89円、1スイスフラン＝132.54円、1スウェーデンクローナ＝13.23円、1ノルウェークローネ＝14.27円、1デンマーククローネ＝18.38円、1ユーロ＝136.70円、1香港ドル＝15.64円、1シンガポールドル＝90.49円、1豪ドル＝92.00円、1ニュージーランドドル＝85.33円、1新シェケル＝38.5129円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年3月31日現在)

| 項 目             | 当 期 末             |
|-----------------|-------------------|
|                 | 円                 |
| (A) 資産          | 1,319,612,893,057 |
| コール・ローン等        | 16,164,492,581    |
| 株式(評価額)         | 1,260,556,072,948 |
| 投資証券(評価額)       | 31,162,188,398    |
| 未収入金            | 4,271,783,153     |
| 未収配当金           | 1,549,663,654     |
| 差入委託証拠金         | 5,908,692,323     |
| (B) 負債          | 4,268,796,686     |
| 未払金             | 3,316,782,017     |
| 未払解約金           | 948,473,555       |
| 未払利息            | 1,914             |
| その他未払費用         | 3,539,200         |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 1,315,344,096,371 |
| 元本              | 276,853,019,010   |
| 次期繰越損益金         | 1,038,491,077,361 |
| (D) 受益権総口数      | 276,853,019,010口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 47,511円           |

(注) 期首元本額は245,531,591,330円、期中追加設定元本額は57,234,513,893円、期中一部解約元本額は25,913,086,213円、1口当たり純資産額は4.7511円です。

## ○損益の状況 (2021年4月1日～2022年3月31日)

| 項 目                | 当 期               |
|--------------------|-------------------|
|                    | 円                 |
| (A) 配当等収益          | 18,637,884,256    |
| 受取配当金              | 18,622,438,805    |
| 受取利息               | 1,500             |
| その他収益金             | 25,263,686        |
| 支払利息               | △ 9,819,735       |
| (B) 有価証券売買損益       | 234,492,254,411   |
| 売買益                | 294,028,438,419   |
| 売買損                | △ 59,536,184,008  |
| (C) 先物取引等取引損益      | 1,828,564,586     |
| 取引益                | 4,615,035,393     |
| 取引損                | △ 2,786,470,807   |
| (D) 保管費用等          | △ 106,500,360     |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 254,852,202,893   |
| (F) 前期繰越損益金        | 682,116,659,771   |
| (G) 追加信託差損益金       | 185,312,463,668   |
| (H) 解約差損益金         | △ 83,790,248,971  |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 1,038,491,077,361 |
| 次期繰越損益金(I)         | 1,038,491,077,361 |

\* 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。

\* 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。

\* 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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                                          | 当期末<br>元本額     |
|------------------------------------------------|----------------|
|                                                | 円              |
| 野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)        | 85,751,817,026 |
| 野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)                   | 45,866,760,786 |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI                | 33,303,826,987 |
| 野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)  | 11,606,960,868 |
| 野村つみたて外国株投信                                    | 10,498,104,134 |
| のむらップ・ファンド(普通型)                                | 9,420,417,936  |
| のむらップ・ファンド(積極型)                                | 8,947,634,713  |
| マイバランス50(確定拠出年金向け)                             | 7,849,911,454  |
| マイバランス70(確定拠出年金向け)                             | 7,547,397,299  |
| 野村インデックスファンド・外国株式                              | 7,261,094,161  |
| NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 6,279,185,236  |
| ファンドラップ(ウェルネス・スクエア)外国株式                        | 4,975,961,363  |
| 野村外国株(含む新興国)インデックス B コース(野村投資一任口座向け)           | 4,785,556,933  |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース)                             | 4,050,440,777  |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース)                             | 3,779,433,195  |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース)                             | 3,160,425,882  |
| 野村外国株インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)                   | 2,253,930,795  |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)             | 2,232,642,047  |

| ファンド名                              | 当期末<br>元本額    |
|------------------------------------|---------------|
|                                    | 円             |
| マイバランス30(確定拠出年金向け)                 | 2,100,979,048 |
| マイバランスDC50                         | 1,797,228,535 |
| マイバランスDC70                         | 1,581,622,653 |
| 野村6資産均等バランス                        | 1,293,340,986 |
| マイ・ロード                             | 903,921,663   |
| マイバランスDC30                         | 791,203,682   |
| ノムラPOFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用) | 777,328,705   |
| のむらップ・ファンド(保守型)                    | 757,972,373   |
| のむらップ・ファンド(やや積極型)                  | 748,143,465   |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)   | 741,032,370   |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信                     | 700,597,962   |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)   | 599,612,608   |
| 野村外国株式インデックスファンド                   | 487,011,909   |
| 野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)        | 402,420,685   |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け)              | 397,018,872   |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)               | 372,867,953   |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け)              | 339,282,748   |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け)              | 328,915,465   |

| ファンド名                               | 当期末         |
|-------------------------------------|-------------|
|                                     | 元本額         |
|                                     | 円           |
| のむらッブ・ファンド (やや保守型)                  | 210,761,252 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け)              | 180,184,729 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス              | 148,946,058 |
| 野村DC運用戦略ファンド                        | 139,777,548 |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け)              | 138,949,046 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用)   | 131,647,823 |
| バランスセレクト70                          | 116,425,567 |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け)              | 113,029,588 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10) (確定拠出年金向け)      | 99,795,865  |
| バランスセレクト50                          | 95,935,920  |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用) | 87,764,083  |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け)              | 81,193,323  |
| グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)   | 65,295,175  |
| 野村資産設計ファンド2040                      | 43,237,015  |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース              | 42,469,309  |
| 世界6資産分散ファンド                         | 38,134,431  |
| インデックス・ブレンド (タイプV)                  | 33,019,086  |
| バランスセレクト30                          | 32,014,849  |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用) | 28,287,428  |
| インデックス・ブレンド (タイプIII)                | 27,292,797  |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け)              | 27,158,462  |
| 野村資産設計ファンド2030                      | 26,855,303  |
| 野村資産設計ファンド2035                      | 22,668,859  |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用)            | 21,492,638  |
| 野村資産設計ファンド2025                      | 18,132,350  |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース              | 17,320,011  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)  | 16,847,179  |
| 野村資産設計ファンド2050                      | 10,655,035  |
| 野村資産設計ファンド2020                      | 10,126,000  |

| ファンド名                                           | 当期末        |
|-------------------------------------------------|------------|
|                                                 | 元本額        |
|                                                 | 円          |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド)                             | 10,066,762 |
| 野村資産設計ファンド2015                                  | 9,939,235  |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)                           | 8,648,454  |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)                           | 8,396,231  |
| 野村資産設計ファンド2045                                  | 8,346,649  |
| 先物・国債・人形・プラス外国株式戦略・オープン (部分含準ヘッジあり) (適格機関投資家専用) | 8,274,561  |
| 野村資産設計ファンド2060                                  | 7,831,515  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030                   | 7,699,711  |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース                        | 7,696,230  |
| インデックス・ブレンド (タイプIV)                             | 7,308,377  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040                   | 6,905,610  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050                   | 5,549,486  |
| 野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)                 | 4,650,251  |
| ネクストコア                                          | 4,396,469  |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型 (適格機関投資家専用)             | 4,287,944  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060                   | 3,557,016  |
| みらいバランス・株式10 (富士通企業年金基金DC向け)                    | 3,323,878  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型                | 3,308,598  |
| インデックス・ブレンド (タイプI)                              | 2,595,644  |
| インデックス・ブレンド (タイプII)                             | 2,398,873  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型                | 1,837,951  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型 (適格機関投資家専用)               | 1,655,193  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型                | 1,430,643  |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)                           | 1,363,876  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型                | 1,214,397  |
| 野村PPIs用・ターゲット・リターン・資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用) | 1,175,495  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA (適格機関投資家専用)              | 1,040,026  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型 (適格機関投資家専用)               | 699,932    |

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 新興国株式マザーファンド

## 運用報告書

第14期（決算日2022年5月10日）

作成対象期間（2021年5月11日～2022年5月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                  |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主な投資対象 | 新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。                                                               |
| 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割合には制限を設けません。                                                        |

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期           | 基 準 価 額 |       | ベンチマーク  |       | 株 式 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|---------|-------|---------|-------|-------------|-----------|---------------------|---------|
|                 | 期 騰 落 率 | 中 率   | 期 騰 落 率 | 中 率   |             |           |                     |         |
|                 | 円       | %     |         | %     | %           | %         | %                   | 百万円     |
| 10期(2018年5月10日) | 13,270  | 14.0  | 134.93  | 14.4  | 97.5        | 2.1       | 0.4                 | 33,831  |
| 11期(2019年5月10日) | 12,185  | △ 8.2 | 124.66  | △ 7.6 | 95.5        | 3.3       | 1.1                 | 36,658  |
| 12期(2020年5月11日) | 10,763  | △11.7 | 110.86  | △11.1 | 90.8        | 4.9       | 4.3                 | 36,969  |
| 13期(2021年5月10日) | 16,542  | 53.7  | 170.78  | 54.1  | 92.4        | 3.7       | 3.8                 | 66,110  |
| 14期(2022年5月10日) | 15,191  | △ 8.2 | 157.63  | △ 7.7 | 90.8        | 5.1       | 4.0                 | 69,608  |

\* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*ベンチマーク（＝「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」）は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに当社が円換算したものです。なお指数算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。

\*MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行われますので、変動することがあります。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI、為替レート（対顧客電信売買相場仲値）

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日      | 基 準 価 額 |      | ベンチマーク |      | 株 式 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|------------|---------|------|--------|------|-------------|-----------|---------------------|
|            | 騰 落 率   | 中 率  | 騰 落 率  | 中 率  |             |           |                     |
| (期 首)      | 円       | %    |        | %    | %           | %         | %                   |
| 2021年5月10日 | 16,542  | －    | 170.78 | －    | 92.4        | 3.7       | 3.8                 |
| 5月末        | 16,843  | 1.8  | 174.17 | 2.0  | 91.1        | 4.7       | 4.1                 |
| 6月末        | 17,220  | 4.1  | 178.16 | 4.3  | 90.7        | 5.1       | 4.1                 |
| 7月末        | 16,097  | △2.7 | 166.62 | △2.4 | 92.0        | 3.6       | 4.3                 |
| 8月末        | 16,068  | △2.9 | 166.33 | △2.6 | 90.9        | 4.6       | 4.3                 |
| 9月末        | 15,963  | △3.5 | 165.44 | △3.1 | 91.0        | 4.4       | 4.5                 |
| 10月末       | 16,568  | 0.2  | 171.47 | 0.4  | 91.0        | 4.4       | 4.5                 |
| 11月末       | 15,858  | △4.1 | 164.07 | △3.9 | 90.7        | 4.5       | 4.7                 |
| 12月末       | 16,045  | △3.0 | 166.23 | △2.7 | 91.0        | 4.3       | 4.6                 |
| 2022年1月末   | 15,761  | △4.7 | 163.25 | △4.4 | 91.6        | 4.0       | 4.2                 |
| 2月末        | 15,538  | △6.1 | 160.89 | △5.8 | 90.1        | 5.5       | 4.3                 |
| 3月末        | 16,278  | △1.6 | 167.64 | △1.8 | 91.4        | 4.4       | 4.1                 |
| 4月末        | 15,540  | △6.1 | 160.59 | △6.0 | 90.9        | 5.0       | 4.0                 |
| (期 末)      |         |      |        |      |             |           |                     |
| 2022年5月10日 | 15,191  | △8.2 | 157.63 | △7.7 | 90.8        | 5.1       | 4.0                 |

\* 騰落率は期首比です。

\* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

ロシアによるウクライナへの軍事侵攻により、欧米諸国による制裁措置の影響が懸念されたことや、中国において新型コロナウイルスの感染拡大に伴う上海のロックダウン（都市封鎖）による中国景気の減速などが警戒されたことなどをを受けて、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

新興国株式市場は、期首よりパウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長が利上げを急がない姿勢を示したことにより、市場のリスク選好度合いが高まったことなどから上昇しました。2021年7月以降は、中国当局による企業への規制強化の動きが広がったことなどから下落しました。その後は、中国の大手不動産会社の債務問題の状況や新型コロナウイルスのオミクロン株の状況などを巡って一進一退の展開となりました。2022年2月下旬以降は、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻により、欧米諸国による制裁措置の影響が懸念されたことや、中国において新型コロナウイルスの感染拡大に伴う上海のロックダウン（都市封鎖）による中国景気の減速などが警戒されたことなどをを受けて下落しました。

為替市場は、一部の新興国や米国の金融政策当局が物価上昇に対応し金融引き締め姿勢を強める一方、日銀が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、各国通貨が概ね対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指すため、新興国の株式（ETF（上場投資信託証券）やDR（預託証券）を含む）に幅広く分散投資し、株式先物への投資も一部行ないました。期中の資金流入や「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行ない、実質株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は－8.2%となり、ベンチマークの－7.7%を0.5ポイント下回りました。

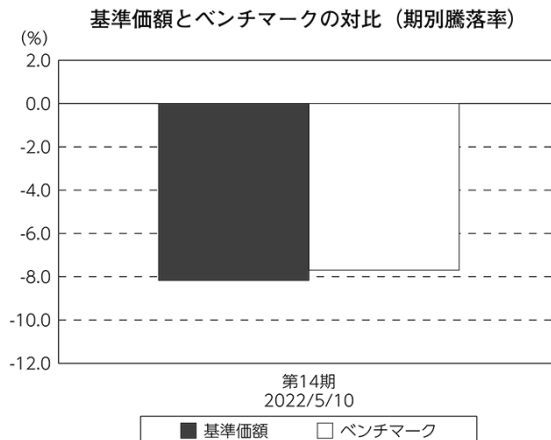
主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### （その他の要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）



（注）ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年 5 月11日～2022年 5 月10日)

| 項 目                   | 当 期   |         | 項 目 の 概 要                                                              |
|-----------------------|-------|---------|------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額   | 比 率     |                                                                        |
|                       | 円     | %       |                                                                        |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 5     | 0.029   | (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<br>※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)                 | ( 4 ) | (0.024) |                                                                        |
| (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)            | ( 1 ) | (0.006) |                                                                        |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 2     | 0.013   | (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<br>※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 ) | (0.013) |                                                                        |
| (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         | 10    | 0.063   | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                                          |
| (保 管 費 用)             | ( 9 ) | (0.054) |                                                                        |
| (そ の 他)               | ( 2 ) | (0.008) |                                                                        |
| 合 計                   | 17    | 0.105   |                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、16,148円です。 |       |         |                                                                        |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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5月11日～2022年5月10日)

## 株式

|     |        | 買 付                  |                                    | 売 付                |                                 |
|-----|--------|----------------------|------------------------------------|--------------------|---------------------------------|
|     |        | 株 数                  | 金 額                                | 株 数                | 金 額                             |
| 外 国 | カタール   | 百株<br>3,141          | 千カタールリヤル<br>1,873                  | 百株<br>—            | 千カタールリヤル<br>—                   |
|     | アメリカ   | 19,814<br>(△ 984)    | 千米ドル<br>11,605<br>( —)             | 1,753<br>( 2,272)  | 千米ドル<br>2,996<br>( 37,831)      |
|     | イギリス   | 84                   | 千英ポンド<br>144                       | 278                | 千英ポンド<br>49                     |
|     | トルコ    | 400                  | 千トルコリラ<br>641                      | 3,031              | 千トルコリラ<br>1,517                 |
|     | ユーロ    |                      | 千ユーロ                               |                    | 千ユーロ                            |
|     | ギリシャ   | 4,073                | 580                                | —                  | —                               |
|     | チェコ    | 30                   | 千チェココルナ<br>2,440                   | 41                 | 千チェココルナ<br>2,527                |
|     | ハンガリー  | 125                  | 千フォリント<br>29,672                   | —                  | 千フォリント<br>—                     |
|     | ポーランド  | 1,059                | 千ズロチ<br>2,343                      | 131                | 千ズロチ<br>462                     |
|     | 香港     | 103,740<br>( 12,515) | 千香港ドル<br>205,922<br>( 295,205)     | 52,237<br>( 422)   | 千香港ドル<br>25,768<br>( 1,604)     |
|     | マレーシア  | 8,000                | 千リンギ<br>4,851                      | 3,066              | 千リンギ<br>802                     |
|     | タイ     | 7,855<br>( 548)      | 千バーツ<br>44,359<br>( 861)           | 4,713<br>( 320)    | 千バーツ<br>33,014<br>( —)          |
|     | フィリピン  | 9,866                | 千フィリピンペソ<br>26,764                 | 10,517             | 千フィリピンペソ<br>6,542               |
|     | インドネシア | 47,010<br>( 52,952)  | 千ルピア<br>24,423,949<br>( 7,233,890) | 11,235<br>(10,016) | 千ルピア<br>2,398,332<br>( 486,358) |
|     | 韓国     | 2,065<br>( 351)      | 千ウォン<br>17,811,013<br>( 516,440)   | 430<br>( 138)      | 千ウォン<br>3,377,605<br>( 197,575) |
|     | 台湾     | 35,700<br>( 3,359)   | 千新台幣ドル<br>363,352<br>( 164)        | 12,830<br>( 697)   | 千新台幣ドル<br>69,203<br>( 165)      |
|     | インド    | 13,132<br>( 2,021)   | 千インドルピー<br>935,305<br>( 4,911)     | 3,375<br>( —)      | 千インドルピー<br>144,799<br>( 4,911)  |
|     | パキスタン  | 90                   | 千パキスタンルピー<br>8,219                 | 1,296              | 千パキスタンルピー<br>19,965             |
|     | メキシコ   | 6,344<br>( 1,110)    | 千メキシコペソ<br>26,786<br>( 1,739)      | 2,830<br>( 2,220)  | 千メキシコペソ<br>10,159<br>( 4,184)   |
|     | ブラジル   | 8,124<br>( 7,731)    | 千レアル<br>25,772<br>( 3,805)         | 3,481<br>( 1,134)  | 千レアル<br>5,569<br>( 4,020)       |

|     |          | 買 付             |                               | 売 付           |                           |
|-----|----------|-----------------|-------------------------------|---------------|---------------------------|
|     |          | 株 数             | 金 額                           | 株 数           | 金 額                       |
| 外 国 | チリ       | 百株<br>—<br>( 1) | 千チリペソ<br>—<br>( —)            | 百株<br>5,228   | 千チリペソ<br>94,586           |
|     | アラブ首長国連邦 | 6,967<br>( 41)  | 千UAEディルハム<br>9,812<br>( —)    | 2,110         | 千UAEディルハム<br>416          |
|     | エジプト     | 370<br>( 997)   | 千エジプトポンド<br>817<br>( 409)     | 415<br>( 346) | 千エジプトポンド<br>353<br>( 375) |
|     | 南アフリカ    | 3,886<br>( 324) | 千ランド<br>38,392<br>( —)        | 1,049         | 千ランド<br>43,981            |
|     | クウェート    | 1,533<br>( 778) | 千クウェートディナール<br>131<br>( —)    | 980           | 千クウェートディナール<br>21         |
|     | サウジアラビア  | 1,918<br>( 733) | 千サウジアラビアリヤル<br>10,113<br>( —) | 424           | 千サウジアラビアリヤル<br>1,905      |

\*金額は受け渡し代金。  
\*単位未満は切り捨て。  
\* ( ) 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<br>—<br>(351,012) | 千バーツ<br>—<br>( —) | 証券<br>184,412<br>(184,412) | 千バーツ<br>179<br>( —) |

\*金額は受け渡し代金。  
\*単位未満は切り捨て。  
\* ( ) 内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

投資信託証券

| 銘 柄 |                                | 買 付                 |                  | 売 付            |              |
|-----|--------------------------------|---------------------|------------------|----------------|--------------|
|     |                                | 口 数                 | 金 額              | 口 数            | 金 額          |
| 外 国 | アメリカ                           | 口                   | 千米ドル             | 口              | 千米ドル         |
|     | ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF | 811,000             | 5,202            | 104,000        | 676          |
|     | 小 計                            | 811,000             | 5,202            | 104,000        | 676          |
|     | メキシコ                           |                     | 千メキシコペソ          |                | 千メキシコペソ      |
|     | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA    | 25,900<br>( — )     | 560<br>( △ 161 ) | —              | —            |
|     | OPERADORA DE SITES MEX- A-1    | —<br>(222,000)      | —<br>( 4,184 )   | —<br>(111,000) | —<br>(2,092) |
|     | 小 計                            | 25,900<br>(222,000) | 560<br>( 4,022 ) | —<br>(111,000) | —<br>(2,092) |
|     | 南アフリカ                          |                     | 千ランド             |                | 千ランド         |
|     | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD     | 109,000             | 1,588            | —              | —            |
|     | 小 計                            | 109,000             | 1,588            | —              | —            |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、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<br>29,869 | 百万円<br>28,358 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

\*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5月11日～2022年5月10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       | 13,805,055千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 63,624,039千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.21         |

\* (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5月11日～2022年5月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A           |               |           | 売付額等<br>C           |               |           |
|--------|---------------------|---------------|-----------|---------------------|---------------|-----------|
|        | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ |           | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |           |
| 為替直物取引 | 百万円<br>23,712       | 百万円<br>4,550  | %<br>19.2 | 百万円<br>14,094       | 百万円<br>4,550  | %<br>32.3 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2022年5月10日現在)

## 外国株式

| 銘                              | 柄            | 期首(前期末)<br>株 数 | 当 期<br>株 数 | 期 末<br>評 価 額 |         | 業 種 等                |
|--------------------------------|--------------|----------------|------------|--------------|---------|----------------------|
|                                |              |                |            | 外貨建金額        | 邦貨換算金額  |                      |
|                                |              |                |            | 千カターリヤル      | 千円      |                      |
| (カタール)                         |              | 百株             | 百株         |              |         |                      |
| QATAR NATIONAL BANK            |              | 3,250          | 3,470      | 8,012        | 285,395 | 銀行                   |
| COMMERCIAL BANK OF QATAR       |              | 1,179          | 1,840      | 1,381        | 49,221  | 銀行                   |
| OOREDOO QSC                    |              | 431            | 431        | 318          | 11,360  | 各種電気通信サービス           |
| QATAR FUEL CO                  |              | 347            | 347        | 637          | 22,705  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO   |              | 344            | 344        | 595          | 21,198  | 総合公益事業               |
| QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC    |              | 470            | 470        | 542          | 19,336  | 銀行                   |
| INDUSTRIES QATAR               |              | 1,430          | 1,430      | 2,558        | 91,125  | コングロマリット             |
| QATAR ISLAMIC BANK             |              | 839            | 839        | 2,061        | 73,427  | 銀行                   |
| QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT |              | 2,200          | 2,200      | 758          | 27,027  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| MASRAF AL RAYAN                |              | 2,370          | 3,810      | 2,133        | 75,998  | 銀行                   |
| BARWA REAL ESTATE CO           |              | 1,130          | 1,950      | 656          | 23,372  | 不動産管理・開発             |
| MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING |              | 3,050          | 3,050      | 780          | 27,812  | 化学                   |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額    | 17,040         | 20,181     | 20,437       | 727,982 |                      |
|                                | 銘柄 数 < 比 率 > | 12             | 12         | —            | <1.0%>  |                      |
| (アメリカ)                         |              |                |            | 千米ドル         |         |                      |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR   |              | 1,352          | —          | —            | —       | インターネット販売・通信販売       |
| AUTOHOME INC-ADR               |              | 38             | 75         | 190          | 24,721  | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| BAIDU INC - SPON ADR           |              | 189            | 221        | 2,363        | 307,360 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| BANCO DE CHILE-ADR             |              | 181            | 181        | 349          | 45,446  | 銀行                   |
| BANCO SANTANDER CHILE-ADR      |              | 138            | 138        | 254          | 33,053  | 銀行                   |
| BANCOLOMBIA S. A.-SPONS ADR    |              | 73             | 100        | 364          | 47,433  | 銀行                   |
| BAOZUN INC-SPN ADR             |              | 49             | —          | —            | —       | インターネット販売・通信販売       |
| BEIGENE, LTD ADR               |              | 32             | 35         | 477          | 62,131  | バイオテクノロジー            |
| BILIBILI INC-SPONSORED ADR     |              | 120            | 120        | 225          | 29,383  | 娯楽                   |
| CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR    |              | —              | 60         | 34           | 4,478   | 情報技術サービス             |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR     |              | 40             | 71         | 91           | 11,890  | 飲料                   |
| CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR   |              | 96             | 216        | 165          | 21,514  | 金属・鉱業                |
| DIDI GLOBAL INC                |              | —              | 182        | 28           | 3,691   | 陸運・鉄道                |
| DADA NEXUS LTD-ADR             |              | —              | 41         | 24           | 3,193   | インターネット販売・通信販売       |
| DAQO NEW ENERGY CORP-ADR       |              | 41             | 41         | 155          | 20,279  | 半導体・半導体製造装置          |
| DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR   |              | 60             | —          | —            | —       | 娯楽                   |
| ECOPETROL SA-SPONSORED ADR     |              | 203            | 203        | 306          | 39,858  | 石油・ガス・消耗燃料           |
| ENEL AMERICAS S. A-ADR         |              | 479            | 299        | 160          | 20,916  | 電力                   |
| ENEL CHILE SA-ADR              |              | 429            | 429        | 56           | 7,307   | 電力                   |
| 51JOB INC-ADR                  |              | 22             | —          | —            | —       | 専門サービス               |
| GDS HOLDINGS LTD-ADR           |              | 65             | 65         | 168          | 21,848  | 情報技術サービス             |
| GAOTU TECHEDU INC-ADR          |              | 50             | —          | —            | —       | 各種消費者サービス            |
| HELLO GROUP INC-SPN ADR        |              | —              | 115        | 55           | 7,177   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR      |              | 112            | 143        | 362          | 47,155  | ホテル・レストラン・レジャー       |
| HUTCHMED CHINA-ADR             |              | 38             | 78         | 77           | 10,091  | 医薬品                  |
| HUYA INC-ADR                   |              | 59             | —          | —            | —       | 娯楽                   |
| I-MAB-SPONSORED ADR            |              | —              | 23         | 24           | 3,220   | バイオテクノロジー            |
| IQIYI INC-ADR                  |              | 214            | 214        | 61           | 7,958   | 娯楽                   |
| JOYY INC                       |              | 42             | 42         | 151          | 19,720  | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| JD.COM INC-ADR                 |              | 622            | —          | —            | —       | インターネット販売・通信販売       |
| KE HOLDINGS INC ADR            |              | 94             | 276        | 313          | 40,804  | 不動産管理・開発             |

| 銘<br>柄                            | 株<br>数 | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         | 業<br>種<br>等          |
|-----------------------------------|--------|---------|-------------|---------|----------------------|
|                                   |        | 株<br>数  | 評<br>価<br>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      |                      |
| KANZHUN LTD                       | —      | 84      | 147         | 19,147  | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR       | 40     | 40      | 12          | 1,575   | 情報技術サービス             |
| LI AUTO INC - ADR                 | 144    | 432     | 816         | 106,166 | 自動車                  |
| STATE BANK OF INDIA-GDR           | 138    | 138     | 839         | 109,100 | 銀行                   |
| PJSC GAZPROM-ADR                  | 4,160  | 4,563   | —           | —       | 石油・ガス・消耗燃料           |
| LEGEND BIOTECH CORP-ADR           | —      | 45      | 150         | 19,625  | バイオテクノロジー            |
| LUFAX HOLDING LTD                 | 113    | 468     | 220         | 28,723  | 消費者金融                |
| MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR         | 286    | 286     | —           | —       | 無線通信サービス             |
| MOMO INC-SPON ADR                 | 88     | —       | —           | —       | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| NIO INC ADR                       | 902    | 1,050   | 1,422       | 185,000 | 自動車                  |
| NETEASE INC-ADR                   | 300    | —       | —           | —       | 娯楽                   |
| NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR     | 1,094  | —       | —           | —       | 各種消費者サービス            |
| NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR     | —      | 109     | 111         | 14,509  | 各種消費者サービス            |
| NOAH HLDS LTD ADR                 | 30     | 30      | 49          | 6,424   | 資本市場                 |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B      | 876    | 876     | 78          | 10,257  | 不動産管理・開発             |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD | —      | 290     | 108         | 14,046  | ソフトウェア               |
| OZON HOLDINGS PLC - ADR           | —      | 53      | —           | —       | インターネット販売・通信販売       |
| PINDUODUO INC ADR                 | 276    | 355     | 1,243       | 161,695 | インターネット販売・通信販売       |
| RLX TECHNOLOGY INC-ADR            | 80     | 563     | 96          | 12,518  | タバコ                  |
| QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR      | 87     | 115     | 863         | 112,319 | 化学                   |
| SOUTHERN COPPER CORP              | 63     | 63      | 367         | 47,824  | 金属・鉱業                |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR           | 264    | 297     | 98          | 12,834  | 各種消費者サービス            |
| TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR       | 53     | —       | —           | —       | 各種電気通信サービス           |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR      | 274    | 594     | 225         | 29,350  | 娯楽                   |
| 360 DIGITECH INC-ADR              | —      | 60      | 73          | 9,533   | 消費者金融                |
| TRIP.COM GROUP LTD-ADR            | 352    | 392     | 772         | 100,465 | ホテル・レストラン・レジャー       |
| VNET GROUP INC                    | 72     | —       | —           | —       | 情報技術サービス             |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS        | 308    | 322     | 224         | 29,183  | インターネット販売・通信販売       |
| WEIBO CORP-SPON ADR               | 34     | 45      | 90          | 11,708  | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| XPENG INC ADR                     | 110    | 299     | 599         | 77,913  | 自動車                  |
| YPF S.A. -SPONSORED ADR           | 106    | —       | —           | —       | 石油・ガス・消耗燃料           |
| YUM CHINA HOLDINGS INC            | 293    | 347     | 1,325       | 172,405 | ホテル・レストラン・レジャー       |
| ZAI LAB LTD - ADR                 | 48     | 70      | 181         | 23,564  | バイオテクノロジー            |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC            | 277    | 346     | 823         | 107,122 | 航空貨物・物流サービス          |
| SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR             | 1,056  | 1,030   | —           | —       | 石油・ガス・消耗燃料           |
| X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR      | 85     | 115     | —           | —       | 食品・生活必需品小売り          |
| NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S      | 64     | 70      | —           | —       | 石油・ガス・消耗燃料           |
| NOVOLIPET STEEL - GDR REG S       | 103    | 103     | —           | —       | 金属・鉱業                |
| ROSNEFT OJSC - GDR                | 728    | 839     | —           | —       | 石油・ガス・消耗燃料           |
| PJSC ALROSA                       | 1,760  | 1,760   | —           | —       | 金属・鉱業                |
| SEVERSTAL-GDR REG S               | 158    | 158     | —           | —       | 金属・鉱業                |
| VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI        | 878    | 878     | —           | —       | 銀行                   |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS         | 259    | 313     | —           | —       | 食品・生活必需品小売り          |
| INTER RAO UES PJSC                | 22,800 | 36,600  | —           | —       | 電力                   |
| VK CO LTD GDR                     | 70     | 70      | —           | —       | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| PJSC SBERBANK OF RUSSIA           | 7,830  | 8,110   | —           | —       | 銀行                   |
| PJSC PHOSAGRO-GDR REG S           | 121    | 121     | —           | —       | 化学                   |
| MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC    | 851    | 1,330   | —           | —       | 資本市場                 |
| TCS GROUP HOLDING-REG S           | 93     | 93      | —           | —       | 銀行                   |
| PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR       | 450    | 486     | —           | —       | 金属・鉱業                |
| POLYUS PJSC-REG S-GDR             | 47     | 47      | —           | —       | 金属・鉱業                |
| TATNEFT-SPONSORED ADR             | 165    | 191     | —           | —       | 石油・ガス・消耗燃料           |

| 銘<br>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        |                      |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR                    |               | 302     | 320    | —       | —         | 石油・ガス・消耗燃料           |
| CREDICORP LTD                           |               | 49      | 49     | 625     | 81,343    | 銀行                   |
| GLOBANT SA                              |               | 25      | —      | —       | —         | 情報技術サービス             |
| YANDEX NV-A                             |               | 211     | 236    | —       | —         | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額     | 53,824  | 68,628 | 18,034  | 2,344,997 |                      |
|                                         | 銘 柄 数 < 比 率 > | 76      | 73     | —       | <3.4%>    |                      |
| (イギリス)                                  |               |         |        | 千英ポンド   |           |                      |
| POLYMETAL INTERNATIONAL PLC             |               | 194     | —      | —       | —         | 金属・鉱業                |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額     | 194     | —      | —       | —         |                      |
|                                         | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1       | —      | —       | <—%>      |                      |
| (トルコ)                                   |               |         |        | 千トルコリラ  |           |                      |
| AKBANK T. A. S                          |               | 2,050   | 2,050  | 1,775   | 15,280    | 銀行                   |
| ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI               |               | 414     | 414    | 984     | 8,471     | 航空宇宙・防衛              |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK            |               | 1,160   | 1,160  | 3,888   | 33,466    | 金属・鉱業                |
| FORD OTOMOTIVE SANAYI AS                |               | 62      | 62     | 1,834   | 15,790    | 自動車                  |
| KOC HLDGS                               |               | 530     | 530    | 2,127   | 18,310    | コングロマリット             |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS         |               | 880     | 880    | 1,694   | 14,587    | コングロマリット             |
| TURK HAVA YOLLARI AO                    |               | 321     | —      | —       | —         | 旅客航空輸送業              |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS             |               | 770     | 1,170  | 2,414   | 20,784    | 無線通信サービス             |
| TURKIYE GARANTI BANKASI                 |               | 1,421   | 1,421  | 2,130   | 18,341    | 銀行                   |
| TURKIYE IS BANKASI AS-C                 |               | 918     | 918    | 993     | 8,549     | 銀行                   |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE            |               | 83      | 83     | 2,035   | 17,523    | 石油・ガス・消耗燃料           |
| YAPI VE KREDI BANKASI A. S.             |               | 1,900   | —      | —       | —         | 銀行                   |
| HACI OMER SABANCI HOLDING               |               | 810     | —      | —       | —         | 銀行                   |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS               |               | 300     | 300    | 2,475   | 21,302    | 食品・生活必需品小売り          |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額     | 11,621  | 8,989  | 22,354  | 192,408   |                      |
|                                         | 銘 柄 数 < 比 率 > | 14      | 11     | —       | <0.3%>    |                      |
| (ユーロ…ギリシャ)                              |               |         |        | 千ユーロ    |           |                      |
| HELLENIC TELECOM                        |               | 180     | 180    | 321     | 44,080    | 各種電気通信サービス           |
| OPAP SA                                 |               | 131     | 131    | 174     | 23,990    | ホテル・レストラン・レジャー       |
| JUMBO SA                                |               | 67      | 67     | 94      | 12,928    | 専門小売り                |
| PUBLIC POWER CORP                       |               | —       | 200    | 133     | 18,284    | 電力                   |
| FF GROUP                                |               | 20      | 20     | —       | —         | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS |               | —       | 1,808  | 162     | 22,311    | 銀行                   |
| ALPHA SERVICES AND HOLDINGS             |               | —       | 2,065  | 202     | 27,779    | 銀行                   |
| ユ ー ロ 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 399     | 4,472  | 1,088   | 149,374   |                      |
|                                         | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 7      | —       | <0.2%>    |                      |
| (チェコ)                                   |               |         |        | 千チェココルナ |           |                      |
| KOMERCNI BANKA AS                       |               | 50      | 50     | 3,787   | 20,769    | 銀行                   |
| CEZ AS                                  |               | 136     | 125    | 12,625  | 69,232    | 電力                   |
| MONETA MONEY BANK AS                    |               | 420     | 420    | 3,553   | 19,485    | 銀行                   |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額     | 606     | 595    | 19,965  | 109,487   |                      |
|                                         | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 3      | —       | <0.2%>    |                      |
| (ハンガリー)                                 |               |         |        | 千フォリント  |           |                      |
| OTP BANK NYRT                           |               | 162     | 162    | 167,265 | 60,347    | 銀行                   |
| RICHTER GEDEON NYRT                     |               | 92      | 92     | 62,606  | 22,587    | 医薬品                  |
| MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC           |               | 250     | 375    | 107,925 | 38,938    | 石油・ガス・消耗燃料           |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額     | 504     | 629    | 337,796 | 121,874   |                      |
|                                         | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 3      | —       | <0.2%>    |                      |
| (ポーランド)                                 |               |         |        | 千ズロチ    |           |                      |
| MBANK                                   |               | —       | 11     | 286     | 8,371     | 銀行                   |
| KGHM POLSKA MIEDZ S. A.                 |               | 99      | 99     | 1,189   | 34,763    | 金属・鉱業                |

| 銘柄                                      |               | 期首(前期末) | 当 期 末  |        | 業 種 等   |                    |
|-----------------------------------------|---------------|---------|--------|--------|---------|--------------------|
|                                         |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額  |         |                    |
|                                         |               |         |        | 外貨建金額  |         | 邦貨換算金額             |
| (ポーランド)                                 |               | 百株      | 百株     | 千ズロチ   | 千円      |                    |
| BANK PEKAO SA                           |               | 157     | 157    | 1,368  | 39,983  | 銀行                 |
| ORANGE POLSKA SA                        |               | 391     | 391    | 242    | 7,089   | 各種電気通信サービス         |
| POLSKI KONCERN NAFTOWY S. A.            |               | 188     | 259    | 1,953  | 57,088  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| LPP SA                                  |               | 0.94    | 0.94   | 813    | 23,763  | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| SANTANDER BANK POLSKA SA                |               | 31      | 31     | 734    | 21,472  | 銀行                 |
| CD PROJEKT RED SA                       |               | 49      | 49     | 570    | 16,679  | 娯楽                 |
| PKO BANK POLSKI SA                      |               | 686     | 630    | 1,891  | 55,273  | 銀行                 |
| POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I             |               | 977     | 1,750  | 1,067  | 31,208  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CYFROWY POLSAT SA                       |               | 189     | 189    | 432    | 12,638  | メディア               |
| POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA            |               | 517     | 517    | 480    | 14,045  | 電力                 |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE            |               | 375     | 505    | 1,498  | 43,789  | 保険                 |
| DINO POLSKA SA                          |               | 38      | 38     | 1,021  | 29,841  | 食品・生活必需品小売り        |
| ALLEGRO. EU SA                          |               | 294     | 294    | 655    | 19,156  | インターネット販売・通信販売     |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額     | 3,994   | 4,922  | 14,205 | 415,165 |                    |
|                                         | 銘 柄 数 < 比 率 > | 14      | 15     | —      | <0.6%>  |                    |
| (香港)                                    |               |         |        | 千香港ドル  |         |                    |
| JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H            |               | 980     | 980    | 1,132  | 18,760  | 金属・鉱業              |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H                |               | 680     | 680    | 517    | 8,569   | 運送インフラ             |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES H               |               | 1,060   | 1,060  | 428    | 7,091   | 旅客航空輸送業            |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD          |               | 70      | 70     | 732    | 12,137  | 飲料                 |
| ANHUI CONCH CEMENT CO. LTD-H            |               | 910     | 1,070  | 4,494  | 74,420  | 建設資材               |
| BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD        |               | 360     | 360    | 941    | 15,589  | ガス                 |
| HUANENG POWER INTL INC-H                |               | 2,380   | 2,380  | 885    | 14,661  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO-H              |               | 960     | 1,380  | 2,960  | 49,019  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS             |               | 420     | —      | —      | —       | 不動産管理・開発           |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD                |               | 445     | 600    | 2,187  | 36,216  | パーソナル用品            |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE             |               | 2,180   | 2,180  | 597    | 9,891   | 自動車                |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED       |               | 6,835   | 7,075  | 5,454  | 90,334  | 医薬品                |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT        |               | 2,860   | 3,200  | 7,536  | 124,796 | 不動産管理・開発           |
| CHINA RESOURCES LAND LTD                |               | 2,284   | 2,484  | 8,496  | 140,706 | 不動産管理・開発           |
| CITIC LTD                               |               | 4,730   | 4,730  | 3,802  | 62,976  | コングロマリット           |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H |               | 980     | 980    | 401    | 6,653   | 運送インフラ             |
| LENOVO GROUP LTD                        |               | 4,980   | 6,040  | 4,735  | 78,417  | コンピュータ・周辺機器        |
| PETROCHINA CO LTD-H                     |               | 14,000  | 17,000 | 6,715  | 111,200 | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING         |               | 1,034   | 1,034  | 870    | 14,410  | 保険                 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H            |               | 17,409  | 19,309 | 7,549  | 125,025 | 石油・ガス・消耗燃料         |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H              |               | 660     | 660    | 755    | 12,503  | 情報技術サービス           |
| KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD      |               | 1,740   | 2,190  | 3,315  | 54,907  | ソフトウェア             |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD                 |               | 565     | 615    | 6,500  | 107,649 | ガス                 |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD               |               | 3,160   | 3,160  | 2,019  | 33,438  | ガス                 |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD                |               | 1,020   | 1,820  | 991    | 16,425  | 運送インフラ             |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD                  |               | 3,700   | —      | —      | —       | 不動産管理・開発           |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING            |               | 820     | 1,060  | 1,428  | 23,662  | 運送インフラ             |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H            |               | 2,100   | 2,800  | 890    | 14,745  | 金属・鉱業              |
| WHARF(HOLDING)                          |               | 940     | 1,170  | 2,574  | 42,625  | 不動産管理・開発           |
| CHINA EVERBRIGHT LTD                    |               | 480     | —      | —      | —       | 資本市場               |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD                  |               | 1,840   | 2,470  | 2,230  | 36,935  | ガス                 |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD                  |               | 430     | 600    | 2,103  | 34,825  | 電子装置・機器・部品         |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT            |               | 4,190   | 4,540  | 5,266  | 87,211  | 自動車                |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD                 |               | 1,760   | —      | —      | —       | 不動産管理・開発           |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT            |               | 640     | 680    | 1,961  | 32,487  | ガス                 |
| BYD CO LTD-H                            |               | 545     | 650    | 14,859 | 246,065 | 自動車                |

| 銘<br>柄                                   | 株<br>数 | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         | 業<br>種<br>等        |
|------------------------------------------|--------|---------|-------------|---------|--------------------|
|                                          |        | 株<br>数  | 評<br>価<br>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 OILFIELD SERVICES LTD-H            | 1,000  | 1,300   | 1,034       | 17,136  | エネルギー設備・サービス       |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT             | 2,810  | 2,810   | 1,301       | 21,545  | 商業サービス・用品          |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN             | 780    | 780     | 280         | 4,637   | 紙製品・林産品            |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H              | 5,504  | 5,504   | 4,265       | 70,640  | 保険                 |
| AVICHINA INDUSTRY&TECH-H                 | 2,020  | 2,020   | 814         | 13,480  | 航空宇宙・防衛            |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDING            | 1,500  | 1,500   | 2,025       | 33,534  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H               | 2,240  | 2,480   | 2,410       | 39,918  | 自動車                |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H                | 5,250  | 5,820   | 6,564       | 108,715 | 保険                 |
| ZIJIN MINING GROUP CO-H                  | 4,310  | 4,890   | 5,154       | 85,351  | 金属・鉱業              |
| MMG LTD                                  | —      | 1,680   | 504         | 8,346   | 金属・鉱業              |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H             | 1,600  | 1,800   | 1,411       | 23,369  | ヘルスケア機器・用品         |
| WEICHAI POWER CO LTD-H                   | 1,498  | 1,498   | 1,554       | 25,749  | 機械                 |
| TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO               | 1,680  | 1,680   | 2,429       | 40,228  | 食品                 |
| TSING TAO BREWERY CO-H                   | 300    | 420     | 2,465       | 40,827  | 飲料                 |
| GUANGDONG INVESTMENT                     | 2,400  | 2,400   | 2,352       | 38,949  | 水道                 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE       | 2,480  | 2,480   | 927         | 15,359  | 医薬品                |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN              | 1,033  | 1,113   | 4,553       | 75,406  | 飲料                 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY-H                    | 1,140  | 1,140   | 733         | 12,138  | 運送インフラ             |
| CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY       | 3,670  | 3,670   | —           | —       | 半導体・半導体製造装置        |
| HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS            | —      | 690     | 276         | 4,581   | 化学                 |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL                   | 7,125  | 8,685   | 3,265       | 54,077  | 医薬品                |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO                   | 1,970  | 2,440   | 9,418       | 155,968 | 食品                 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H             | 4,245  | 4,985   | 24,252      | 401,613 | 保険                 |
| LI NING CO LTD                           | 1,500  | 1,910   | 10,505      | 173,962 | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR             | 4,050  | 4,050   | 1,012       | 16,767  | 水道                 |
| GOME RETAIL HODINGS LTD                  | 11,003 | 11,003  | 407         | 6,742   | 専門小売り              |
| CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT    | 2,400  | 4,900   | 1,710       | 28,319  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AIR CHINA LIMITED-H                      | 1,020  | 1,020   | 502         | 8,327   | 旅客航空輸送業            |
| ZTE CORP-H                               | 472    | 760     | 1,159       | 19,193  | 通信機器               |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO - H              | 2,310  | 2,830   | 6,919       | 114,584 | 石油・ガス・消耗燃料         |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H       | 2,100  | 2,730   | 3,379       | 55,968  | 海運業                |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H              | 5,977  | 7,457   | 3,885       | 64,344  | 銀行                 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT             | 1,532  | 1,532   | 1,541       | 25,530  | 建設・土木              |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H                | 69,140 | 75,700  | 41,635      | 689,475 | 銀行                 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP             | 617    | 637     | 6,210       | 102,850 | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H              | 1,840  | 1,840   | 1,024       | 16,972  | 自動車                |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD              | 940    | —       | —           | —       | 不動産管理・開発           |
| MINTH GROUP LTD                          | 480    | 540     | 972         | 16,096  | 自動車部品              |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS              | 1,010  | 1,180   | 787         | 13,033  | 紙製品・林産品            |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H             | 3,090  | 3,090   | 3,145       | 52,091  | 建設資材               |
| BANK OF CHINA LTD-H                      | 56,800 | 62,400  | 18,969      | 314,136 | 銀行                 |
| SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD                | 1,030  | —       | —           | —       | 不動産管理・開発           |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS                 | 560    | 560     | 735         | 12,185  | 不動産管理・開発           |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H               | 1,432  | —       | —           | —       | 不動産管理・開発           |
| CHINA MERCHANTS BANK-H                   | 2,846  | 3,071   | 13,531      | 224,086 | 銀行                 |
| IND & COMM BK OF CHINA-H                 | 44,020 | 43,500  | 19,923      | 329,924 | 銀行                 |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H                | 570    | —       | —           | —       | 金属・鉱業              |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING              | 1,010  | 650     | 785         | 13,002  | 電子装置・機器・部品         |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H | 1,744  | 1,744   | 620         | 10,281  | 建設・土木              |
| CHINA COAL ENERGY CO-H                   | —      | 1,500   | 960         | 15,897  | 石油・ガス・消耗燃料         |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS              | 570    | 570     | 1,135       | 18,802  | 機械                 |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H            | 363    | 363     | 1,067       | 17,673  | 電気設備               |

| 銘                                     | 柄 | 期首(前期末) | 当 |        | 期 |       | 業 | 種       | 等                       |        |
|---------------------------------------|---|---------|---|--------|---|-------|---|---------|-------------------------|--------|
|                                       |   | 株       | 数 | 株      | 数 | 評     |   |         |                         | 価      |
|                                       |   |         |   |        |   | 外貨建金額 |   |         |                         | 邦貨換算金額 |
| (香港)                                  |   | 百株      |   | 百株     |   | 千香港ドル |   | 千円      |                         |        |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO            |   | 5,743   |   | 5,743  |   | 2,791 |   | 46,227  | 不動産管理・開発                |        |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H             |   | 1,800   |   | 2,400  |   | 909   |   | 15,062  | 金属・鉱業                   |        |
| CHINA CITIC BANK-H                    |   | 5,600   |   | 6,400  |   | 2,342 |   | 38,790  | 銀行                      |        |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD                |   | 685     |   | —      |   | —     |   | —       | 不動産管理・開発                |        |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD |   | 515     |   | 547    |   | 5,475 |   | 90,673  | 電子装置・機器・部品              |        |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD              |   | 770     |   | 872    |   | 7,281 |   | 120,576 | 繊維・アパレル・贅沢品             |        |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS          |   | 230     |   | 230    |   | 437   |   | 7,251   | 家庭用品                    |        |
| FOSUN INTERNATIONAL LIMITED           |   | 1,659   |   | 2,259  |   | 1,708 |   | 28,286  | コングロマリット                |        |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD       |   | 3,300   |   | 4,100  |   | 975   |   | 16,159  | 不動産管理・開発                |        |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD               |   | 2,040   |   | 2,040  |   | 783   |   | 12,972  | 繊維・アパレル・贅沢品             |        |
| KINGSOFT CORP LTD                     |   | 540     |   | 670    |   | 1,554 |   | 25,740  | 娯楽                      |        |
| SINOTRUK HONG KONG LTD                |   | 375     |   | 500    |   | 430   |   | 7,129   | 機械                      |        |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H             |   | 2,300   |   | 2,900  |   | 1,618 |   | 26,797  | 建設・土木                   |        |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD      |   | 700     |   | 1,250  |   | 828   |   | 13,724  | 食品                      |        |
| DONGYUE GROUP LTD                     |   | —       |   | 1,080  |   | 988   |   | 16,364  | 化学                      |        |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD   |   | 515     |   | 515    |   | 719   |   | 11,922  | 通信機器                    |        |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD          |   | 3,080   |   | 3,490  |   | 2,425 |   | 40,167  | 食品                      |        |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H          |   | 1,980   |   | 1,980  |   | 3,314 |   | 54,888  | 保険                      |        |
| CRRC CORP LTD-H                       |   | —       |   | 3,200  |   | 921   |   | 15,261  | 機械                      |        |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD              |   | 1,490   |   | 1,490  |   | 339   |   | 5,625   | 食品・生活必需品小売り             |        |
| SINOPHARM GROUP CO-H                  |   | 872     |   | 964    |   | 1,704 |   | 28,224  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H          |   | —       |   | 1,290  |   | 525   |   | 8,694   | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD   |   | 1,520   |   | 1,760  |   | 1,063 |   | 17,603  | 建設資材                    |        |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H          |   | 1,998   |   | 2,858  |   | 1,832 |   | 30,347  | 自動車                     |        |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD              |   | 1,040   |   | 1,600  |   | 1,436 |   | 23,793  | 金属・鉱業                   |        |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H          |   | 1,370   |   | —      |   | —     |   | —       | 銀行                      |        |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H          |   | 2,180   |   | 2,840  |   | 4,163 |   | 68,946  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |        |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H            |   | 509     |   | 509    |   | 599   |   | 9,929   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD              |   | 1,900   |   | —      |   | —     |   | —       | 不動産管理・開発                |        |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H             |   | 1,160   |   | 1,160  |   | 528   |   | 8,759   | 機械                      |        |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTL             |   | —       |   | 770    |   | 547   |   | 9,066   | 機械                      |        |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD            |   | 1,350   |   | 1,540  |   | 5,759 |   | 95,378  | 不動産管理・開発                |        |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H          |   | 591     |   | 591    |   | 1,118 |   | 18,516  | 保険                      |        |
| CHINA MINSHENG BANKING-H              |   | 3,748   |   | 3,748  |   | 1,075 |   | 17,813  | 銀行                      |        |
| KAISA GROUP HLDS LTD                  |   | 1,314   |   | —      |   | —     |   | —       | 不動産管理・開発                |        |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H           |   | 399     |   | 559    |   | 615   |   | 10,198  | 電気設備                    |        |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H          |   | 2,570   |   | 2,570  |   | 701   |   | 11,618  | 銀行                      |        |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H          |   | 19,100  |   | 21,600 |   | 6,328 |   | 104,804 | 銀行                      |        |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS             |   | 430     |   | 550    |   | 2,736 |   | 45,312  | 専門小売り                   |        |
| FAR EAST HORIZON LTD                  |   | 1,540   |   | 1,540  |   | 965   |   | 15,990  | 各種金融サービス                |        |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP             |   | 470     |   | 470    |   | 620   |   | 10,273  | ヘルスケア機器・用品              |        |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H             |   | 1,620   |   | 2,265  |   | 3,665 |   | 60,701  | 資本市場                    |        |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING          |   | 810     |   | 980    |   | 1,040 |   | 17,234  | 医薬品                     |        |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H           |   | 1,736   |   | 2,680  |   | 1,415 |   | 23,433  | 資本市場                    |        |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC         |   | 450     |   | 520    |   | 865   |   | 14,329  | 電子装置・機器・部品              |        |
| PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H          |   | 5,870   |   | 5,870  |   | 1,455 |   | 24,107  | 保険                      |        |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H          |   | 345     |   | 345    |   | 1,122 |   | 18,596  | 医薬品                     |        |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD            |   | 1,960   |   | 2,478  |   | 825   |   | 13,664  | 不動産管理・開発                |        |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H          |   | 2,660   |   | 2,660  |   | 1,085 |   | 17,972  | 資本市場                    |        |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED       |   | —       |   | 1,940  |   | 1,200 |   | 19,886  | 情報技術サービス                |        |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD        |   | 920     |   | 920    |   | 835   |   | 13,833  | 建設関連製品                  |        |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD   |   | 1,440   |   | 1,440  |   | —     |   | —       | 食品                      |        |

| 銘柄                                       | 期首(前期末) | 当 期 末  |         | 業 種 等     |                         |        |
|------------------------------------------|---------|--------|---------|-----------|-------------------------|--------|
|                                          |         | 株 数    | 株 数     |           | 評 価 額                   |        |
|                                          |         |        |         |           | 外貨建金額                   | 邦貨換算金額 |
| (香港)                                     | 百株      | 百株     | 千香港ドル   | 千円        |                         |        |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO.LTD.          | 1,280   | 1,280  | 904     | 14,986    | 不動産管理・開発                |        |
| CHINA EVERGRANDE GROUP                   | 1,260   | —      | —       | —         | 不動産管理・開発                |        |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H           | 7,750   | 6,810  | 4,113   | 68,115    | 銀行                      |        |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD          | 310     | 310    | 624     | 10,344    | 食品                      |        |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP                   | 560     | 980    | 1,828   | 30,282    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |        |
| KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING              | 150     | —      | —       | —         | 各種消費者サービス               |        |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD             | 1,040   | 1,470  | 4,196   | 69,499    | 不動産管理・開発                |        |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD              | 670     | —      | —       | —         | 不動産管理・開発                |        |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD | 366     | 366    | 625     | 10,352    | インターネット販売・通信販売          |        |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS           | 650     | 650    | 406     | 6,727     | 各種消費者サービス               |        |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD              | 360     | 360    | 487     | 8,072     | 金属・鉱業                   |        |
| AK MEDICAL HOLDINGS LTD                  | 240     | —      | —       | —         | ヘルスケア機器・用品              |        |
| A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD      | 330     | —      | —       | —         | 不動産管理・開発                |        |
| CHINA TOWER CORP LTD                     | 27,900  | 36,100 | 3,176   | 52,607    | 各種電気通信サービス              |        |
| XIAOMI CORPORATION                       | 10,360  | 11,020 | 12,232  | 202,565   | コンピュータ・周辺機器             |        |
| WUXI APPTec CO LTD                       | 200     | 305    | 2,929   | 48,512    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |        |
| WEIMOB INC                               | 1,250   | 1,250  | 537     | 8,901     | ソフトウェア                  |        |
| MEITUAN-CLASS B                          | 2,582   | 3,221  | 50,569  | 837,434   | インターネット販売・通信販売          |        |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD            | 548     | 708    | 947     | 15,687    | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.      | 510     | 1,110  | 1,507   | 24,962    | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD                 | 3,020   | 3,980  | 4,577   | 75,795    | 半導体・半導体製造装置             |        |
| INNOVENT BIOLOGICS INC                   | 665     | 1,040  | 2,042   | 33,824    | バイオテクノロジー               |        |
| EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES         | 460     | —      | —       | —         | 商業サービス・用品               |        |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMEN-H            | 6,200   | 6,200  | 787     | 13,039    | 資本市場                    |        |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED      | 360     | 420    | 997     | 16,518    | 専門小売り                   |        |
| LOGAN GROUP CO LTD                       | 1,280   | —      | —       | —         | 不動産管理・開発                |        |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS             | 1,135   | 1,340  | 2,720   | 45,046    | 建設・土木                   |        |
| POLY PROPERTY SERVICES CO LTD            | 74      | —      | —       | —         | 不動産管理・開発                |        |
| JINXIN FERTILITY GROUP LTD               | 860     | 860    | 387     | 6,422     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD          | 980     | —      | —       | —         | 不動産管理・開発                |        |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDING             | 460     | —      | —       | —         | 各種消費者サービス               |        |
| CANSINO BIOLOGICS INC                    | 50      | 58     | 424     | 7,030     | 医薬品                     |        |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD             | 770     | 1,120  | 621     | 10,293    | 専門小売り                   |        |
| SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED  | 790     | 790    | 670     | 11,106    | 運送インフラ                  |        |
| HANSON PHARMACEUTICAL GROUP              | 840     | 840    | 1,031   | 17,081    | 医薬品                     |        |
| CHINA FEIHE LTD                          | 940     | 2,920  | 2,052   | 33,993    | 食品                      |        |
| ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED            | —       | 11,949 | 107,966 | 1,787,924 | インターネット販売・通信販売          |        |
| PHARMARON BEIJING CO LTD                 | 80      | 96     | 814     | 13,481    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |        |
| JD.COM, INC.                             | —       | 1,579  | 35,795  | 592,770   | インターネット販売・通信販売          |        |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING             | 450     | 1,330  | 2,069   | 34,270    | タバコ                     |        |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC                | 2,330   | 2,880  | 14,515  | 240,371   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |        |
| VENUS MEDTECH HANGZHOU INC               | —       | 150    | 166     | 2,762     | ヘルスケア機器・用品              |        |
| JTUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS         | 570     | 570    | 880     | 14,574    | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| KUAISHOU TECHNOLOGY                      | 150     | 398    | 2,391   | 39,611    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |        |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H                | 1,392   | 1,920  | 5,164   | 85,529    | 家庭用耐久財                  |        |
| AKESO INC                                | —       | 200    | 243     | 4,034     | バイオテクノロジー               |        |
| SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD              | —       | 430    | 156     | 2,599     | 不動産管理・開発                |        |
| NETEASE, INC.                            | —       | 1,659  | 23,448  | 388,311   | 娯楽                      |        |
| MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS           | 270     | 570    | 557     | 9,231     | ソフトウェア                  |        |
| CHINA RUYI HOLDINGS LTD                  | —       | 1,920  | 370     | 6,136     | インターネット販売・通信販売          |        |
| NONGFU SPRING LTD                        | 274     | 1,394  | 5,569   | 92,223    | 飲料                      |        |
| TENCENT HOLDINGS LTD                     | 4,099   | 4,536  | 158,397 | 2,623,056 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |        |

| 銘柄                                       |               | 期首(前期末) | 当 期 末   |         | 業 種 等      |                         |
|------------------------------------------|---------------|---------|---------|---------|------------|-------------------------|
|                                          |               | 株 数     | 株 数     | 評 価 額   |            |                         |
|                                          |               |         |         | 外貨建金額   |            | 邦貨換算金額                  |
| (香港)                                     |               | 百株      | 百株      | 千香港ドル   | 千円         |                         |
| CHINA BOHAI BANK CO LTD                  |               | 1,600   | 1,600   | 195     | 3,232      | 銀行                      |
| CHINA YOUZAN LIMITED                     |               | 8,880   | —       | —       | —          | ソフトウェア                  |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC              |               | 224     | 337     | 1,383   | 22,908     | インターネット販売・通信販売          |
| SEAZEN GROUP LTD                         |               | 1,680   | 1,680   | 525     | 8,707      | 不動産管理・開発                |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO            |               | —       | 252     | 854     | 14,146     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS              |               | —       | 528     | 753     | 12,485     | 不動産管理・開発                |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY             |               | —       | 522     | 1,913   | 31,681     | 不動産管理・開発                |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD      |               | 80      | 80      | 566     | 9,372      | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| CHINA VANKE CO LTD-H                     |               | 1,280   | 1,280   | 2,265   | 37,518     | 不動産管理・開発                |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD                   |               | —       | 1,000   | 784     | 12,983     | 不動産管理・開発                |
| CIFI EVER SUNSHINE SERVICES              |               | —       | 800     | 723     | 11,976     | 不動産管理・開発                |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD               |               | 8,700   | 8,700   | 539     | 8,932      | 娯楽                      |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD               |               | 460     | 460     | 1,301   | 21,557     | 半導体・半導体製造装置             |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT |               | 2,780   | 2,900   | 1,099   | 18,201     | インターネット販売・通信販売          |
| CGN POWER CO LTD-H                       |               | 6,270   | 9,800   | 2,028   | 33,593     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| GF SECURITIES CO LTD-H                   |               | 826     | 826     | 782     | 12,953     | 資本市場                    |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD        |               | 392     | 436     | 1,371   | 22,707     | 自動車部品                   |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H               |               | 1,020   | 1,020   | 1,018   | 16,874     | 資本市場                    |
| 3SBIO, INC                               |               | 770     | 770     | 401     | 6,656      | バイオテクノロジー               |
| LEGEND HLDS CORP-RTS                     |               | 181     | 181     | —       | —          | コンピュータ・周辺機器             |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD |               | 930     | —       | —       | —          | 医薬品                     |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD    |               | 5,920   | —       | —       | —          | 資本市場                    |
| CHINA LITERATURE LTD                     |               | 208     | 284     | 864     | 14,320     | メディア                    |
| SSY GROUP LTD                            |               | 820     | —       | —       | —          | 医薬品                     |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD                  |               | —       | 280     | 786     | 13,029     | 半導体・半導体製造装置             |
| DALI FOODS GROUP CO LTD                  |               | 1,115   | 1,115   | 441     | 7,311      | 食品                      |
| CHINA YUHUA EDUCATION CO.LTD             |               | 760     | —       | —       | —          | 各種消費者サービス               |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD             |               | 850     | 850     | 753     | 12,485     | 不動産管理・開発                |
| BOC AVIATION LTD                         |               | 113     | 150     | 915     | 15,164     | 商社・流通業                  |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H           |               | 250     | 358     | 903     | 14,969     | 保険                      |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD                 |               | 680     | 860     | 1,002   | 16,605     | 自動車                     |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H     |               | 924     | 1,028   | 1,387   | 22,981     | 資本市場                    |
| GANFENG LITHIUM CO LTD                   |               | —       | 226     | 1,948   | 32,260     | 金属・鉱業                   |
| 小 計                                      | 株 数 ・ 金 額     | 594,859 | 658,454 | 894,961 | 14,820,556 |                         |
|                                          | 銘 柄 数 < 比 率 > | 203     | 198     | —       | <21.3%>    |                         |
| (マレーシア)                                  |               |         |         | 千リンギ    |            |                         |
| AMMB HOLDING                             |               | 1,250   | 1,250   | 455     | 13,496     | 銀行                      |
| GENTING PLANTATIONS BHD                  |               | 146     | —       | —       | —          | 食品                      |
| CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD               |               | 5,080   | 5,080   | 2,590   | 76,851     | 銀行                      |
| DIGI.COM BERHAD                          |               | 1,860   | 2,860   | 989     | 29,353     | 無線通信サービス                |
| MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD              |               | 564     | 1,214   | 797     | 23,671     | 運送インフラ                  |
| RHB BANK BHD                             |               | 1,250   | 1,250   | 755     | 22,399     | 銀行                      |
| HAP SENG CONSOLIDATED                    |               | 338     | 338     | 248     | 7,369      | コングロマリット                |
| GAMUDA BERHAD                            |               | 1,002   | —       | —       | —          | 建設・土木                   |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP               |               | 134     | 134     | 257     | 7,636      | 銀行                      |
| HONG LEONG BANK                          |               | 374     | 609     | 1,249   | 37,069     | 銀行                      |
| KUALA LUMPUR KEPONG                      |               | 264     | 424     | 1,157   | 34,335     | 食品                      |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD              |               | 77      | 77      | 168     | 5,002      | 飲料                      |
| MALAYAN BANKING                          |               | 2,910   | 3,790   | 3,411   | 101,181    | 銀行                      |
| MISC BHD                                 |               | 999     | 999     | 771     | 22,890     | 海運業                     |
| NESTLE (MALAYSIA) BERHAD                 |               | 44      | 44      | 578     | 17,150     | 食品                      |
| PPB GROUP BERHAD                         |               | 517     | 517     | 847     | 25,139     | 食品                      |

| 銘柄                              | 株数      | 期首(前期末) | 当 期 末  |         | 業 種 等                   |
|---------------------------------|---------|---------|--------|---------|-------------------------|
|                                 |         | 株 数     | 評 価 額  |         |                         |
|                                 |         |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |                         |
| (マレーシア)                         | 百株      | 百株      | 千リンギ   | 千円      |                         |
| PETRONAS DAGANGAN BHD           | 145     | 300     | 649    | 19,257  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PETRONAS GAS BERHAD             | 630     | 630     | 1,063  | 31,545  | ガス                      |
| TELEKOM MALAYSIA                | 620     | 620     | 298    | 8,864   | 各種電気通信サービス              |
| TENAGA NASIONAL                 | 1,820   | 1,820   | 1,630  | 48,372  | 電力                      |
| QL RESOURCES BHD                | 600     | 600     | 288    | 8,543   | 食品                      |
| DIALOG GROUP BHD                | 3,130   | 3,130   | 757    | 22,471  | エネルギー設備・サービス            |
| PUBLIC BANK BHD                 | 10,520  | 11,770  | 5,367  | 159,206 | 銀行                      |
| TOP GLOVE CORP BHD              | 3,320   | 4,280   | 676    | 20,059  | ヘルスケア機器・用品              |
| KOSSAN RUBBER INDUSTRIES BERHAD | 800     | —       | —      | —       | ヘルスケア機器・用品              |
| SUPERMAX CORP BHD               | 1,118   | —       | —      | —       | ヘルスケア機器・用品              |
| GENTING BHD                     | 1,870   | 1,870   | 854    | 25,349  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| GENTING MALAYSIA BHD            | 2,290   | 2,290   | 705    | 20,922  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| IOI CORP                        | 1,620   | 1,620   | 711    | 21,095  | 食品                      |
| SIME DARBY BERHAD               | 2,200   | 2,200   | 506    | 15,009  | コングロマリット                |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD          | 1,170   | 1,170   | 500    | 14,854  | ヘルスケア機器・用品              |
| AXIATA GROUP BERHAD             | 1,950   | 1,950   | 655    | 19,435  | 無線通信サービス                |
| MAXIS BHD                       | 1,462   | 1,462   | 539    | 16,002  | 無線通信サービス                |
| INARI AMERTRON BHD              | —       | 2,710   | 718    | 21,302  | 電子装置・機器・部品              |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD    | 1,900   | 1,900   | 1,900  | 56,360  | 化学                      |
| IHH HEALTHCARE BHD              | 1,560   | 1,560   | 992    | 29,430  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD          | 514     | 514     | 203    | 6,037   | 運送インフラ                  |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS  | 2,480   | 2,480   | 1,289  | 38,253  | 金属・鉱業                   |
| SIME DARBY PLANTATION BHD       | 1,443   | 1,443   | 709    | 21,059  | 食品                      |
| 小計                              | 株数・金額   | 59,974  | 64,908 | 35,295  | 1,046,984               |
|                                 | 銘柄数<比率> | 38      | 35     | —       | <1.5%>                  |
| (タイ)                            |         |         | 千バーツ   |         |                         |
| BANGKOK BANK (F)                | 480     | —       | —      | —       | 銀行                      |
| BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR     | 737     | 737     | 2,597  | 9,768   | 食品・生活必需品小売り             |
| KRUNG THAI BANK-NVDR            | 2,670   | 2,670   | 3,898  | 14,659  | 銀行                      |
| RATCH GROUP PCL-NVDR            | 430     | 430     | 1,752  | 6,588   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| RATCH GROUP PCL (R)-RTS         | —       | 228     | 68     | 257     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR     | 508     | —       | —      | —       | 銀行                      |
| TRUE CORP PCL-NVDR              | 9,200   | 9,200   | 3,937  | 14,805  | 各種電気通信サービス              |
| KASIKORNBANK PCL-NVDR           | 373     | —       | —      | —       | 銀行                      |
| ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR | 173     | 173     | 2,785  | 10,472  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR     | 1,400   | 1,400   | 9,870  | 37,111  | 無線通信サービス                |
| CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR     | 2,790   | 2,790   | 6,500  | 24,442  | 食品                      |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR      | 857     | 857     | 17,568 | 66,057  | 無線通信サービス                |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR    | 3,545   | 3,545   | 5,106  | 19,199  | 専門小売り                   |
| DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR     | 201     | 263     | 8,731  | 32,830  | 電子装置・機器・部品              |
| PTT PCL-NVDR                    | 8,260   | 7,640   | 28,268 | 106,287 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR       | 1,998   | 1,998   | 3,316  | 12,470  | 食品                      |
| KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR         | 680     | 680     | 3,893  | 14,637  | 消費者金融                   |
| LAND & HOUSES PUB - NVDR        | 6,200   | 6,200   | 5,394  | 20,281  | 不動産管理・開発                |
| SIAM CEMENT PCL-NVDR            | 587     | 587     | 21,249 | 79,897  | 建設資材                    |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR   | 2,940   | 3,610   | 23,916 | 89,925  | 運送インフラ                  |
| KASIKORNBANK PCL (F)            | 920     | —       | —      | —       | 銀行                      |
| CENTRAL PATTANA PCL-NVDR        | 1,880   | 1,850   | 11,238 | 42,257  | 不動産管理・開発                |
| BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR    | 6,550   | 7,820   | 19,315 | 72,625  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR     | 322     | 322     | 5,232  | 19,674  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR    | 2,709   | 2,709   | 9,145  | 34,387  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| THAI OIL PCL-NVDR               | 830     | 830     | 4,876  | 18,334  | 石油・ガス・消耗燃料              |

| 銘柄                                    |               | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等     |                    |
|---------------------------------------|---------------|---------|--------|-----------|-----------|--------------------|
|                                       |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額     |           |                    |
|                                       |               |         |        | 外貨建金額     |           | 邦貨換算金額             |
| (タイ)                                  |               | 百株      | 百株     | 千バーツ      | 千円        |                    |
| CP ALL PCL-NVDR                       |               | 4,210   | 4,820  | 30,848    | 115,988   | 食品・生活必需品小売り        |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR           |               | 4,760   | 4,760  | 4,117     | 15,481    | 陸運・鉄道              |
| PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR            |               | 1,130   | 1,130  | 17,458    | 65,643    | 石油・ガス・消耗燃料         |
| TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR           |               | 430     | —      | —         | —         | 無線通信サービス           |
| INDORAMA VENTURES PCL-NVDR            |               | 1,109   | 1,109  | 4,854     | 18,254    | 化学                 |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR          |               | 1,519   | 1,519  | 7,447     | 28,003    | 化学                 |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR              |               | 950     | 1,340  | 11,122    | 41,818    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR        |               | 4,471   | 4,471  | 3,554     | 13,364    | 運送インフラ             |
| B GRIMM POWER PCL-NVDR                |               | 340     | 340    | 1,011     | 3,803     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR          |               | 1,815   | 2,610  | 11,940    | 44,897    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| OSOTSPA PCL-NVDR                      |               | 330     | 1,120  | 3,696     | 13,896    | 飲料                 |
| BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR         |               | 1,540   | 1,540  | 2,787     | 10,480    | 資本市場               |
| ASSET WORLD CORP PCL-NVDR             |               | 7,000   | 7,000  | 3,388     | 12,738    | ホテル・レストラン・レジャー     |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR          |               | 1,550   | 1,550  | 5,968     | 22,441    | 複合小売り              |
| SCG PACKAGING PLC-NVDR                |               | —       | 897    | 4,664     | 17,538    | 容器・包装              |
| SRISAWAD CORP PCL-NVDR                |               | 630     | 630    | 3,102     | 11,666    | 消費者金融              |
| SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR          |               | 560     | 560    | 1,080     | 4,063     | ヘルスケア機器・用品         |
| PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR          |               | 2,580   | 2,580  | 6,514     | 24,494    | 専門小売り              |
| SCB X PCL-NVDR                        |               | —       | 810    | 8,950     | 33,653    | 銀行                 |
| CARABAO GROUP PCL-NVDR                |               | —       | 209    | 2,121     | 7,976     | 飲料                 |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR            |               | 490     | 490    | 2,082     | 7,830     | 消費者金融              |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR             |               | 590     | 590    | 3,525     | 13,254    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小 計                                   | 株 数 ・ 金 額     | 93,248  | 96,618 | 338,900   | 1,274,264 |                    |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 44      | 43     | —         | <1.8%>    |                    |
| (フィリピン)                               |               |         |        | 千フィリピンペソ  |           |                    |
| AYALA LAND LTD                        |               | 6,080   | 6,080  | 19,760    | 48,777    | 不動産管理・開発           |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC           |               | 1,460   | 1,460  | 7,373     | 18,200    | コングロマリット           |
| BANK OF PHILIPPINE ISLANDS            |               | 1,459   | 1,459  | 13,782    | 34,021    | 銀行                 |
| GLOBE TELECOM INC                     |               | 20      | 20     | 5,100     | 12,590    | 無線通信サービス           |
| INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS |               | 690     | 930    | 20,478    | 50,551    | 運送インフラ             |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC                |               | 2,550   | 2,550  | 13,719    | 33,866    | コングロマリット           |
| JOLLIBEE FOODS CORPORATION            |               | 244     | 430    | 9,348     | 23,076    | ホテル・レストラン・レジャー     |
| METROPOLITAN BANK & TRUST             |               | 1,276   | 1,276  | 6,748     | 16,659    | 銀行                 |
| MEGAWORLD CORP                        |               | 9,100   | —      | —         | —         | 不動産管理・開発           |
| SM PRIME HLDGS                        |               | 7,739   | 7,739  | 27,243    | 67,251    | 不動産管理・開発           |
| UNIVERSAL ROBINA CORP                 |               | 670     | 670    | 7,303     | 18,027    | 食品                 |
| SM INVESTMENTS CORP                   |               | 171     | 171    | 14,458    | 35,689    | コングロマリット           |
| AYALA CORPORATION                     |               | 211     | 211    | 15,404    | 38,025    | コングロマリット           |
| METRO PACIFIC INVESTMENTS CO          |               | 7,478   | 7,478  | 2,834     | 6,996     | 各種金融サービス           |
| ABOITIZ POWER CORP                    |               | 767     | —      | —         | —         | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| MANILA ELECTRIC COMPANY               |               | 169     | 169    | 5,813     | 14,350    | 電力                 |
| BDO UNIBANK INC                       |               | 1,249   | 1,689  | 21,631    | 53,397    | 銀行                 |
| PUREGOLD PRICE CLUB INC               |               | 650     | —      | —         | —         | 食品・生活必需品小売り        |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC               |               | 54      | 54     | 2,765     | 6,826     | コングロマリット           |
| PLDT INC                              |               | 49      | 49     | 9,393     | 23,187    | 無線通信サービス           |
| AC ENERGY CORP                        |               | —       | 5,700  | 4,332     | 10,693    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| MONDE NISSIN CORP                     |               | —       | 3,300  | 4,415     | 10,899    | 食品                 |
| 小 計                                   | 株 数 ・ 金 額     | 42,091  | 41,440 | 211,905   | 523,088   |                    |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 20      | 19     | —         | <0.8%>    |                    |
| (インドネシア)                              |               |         |        | 千ルピア      |           |                    |
| ANEKA TAMBANG TBK                     |               | 7,600   | 7,600  | 1,922,800 | 17,112    | 金属・鉱業              |
| BARITO PACIFIC TBK PT                 |               | 16,600  | 28,800 | 2,361,600 | 21,018    | 化学                 |

| 銘柄                              |               | 期首(前期末) | 当 期 末   |             | 業 種 等     |                      |
|---------------------------------|---------------|---------|---------|-------------|-----------|----------------------|
|                                 |               | 株 数     | 株 数     | 評 価 額       |           |                      |
|                                 |               |         |         | 外貨建金額       |           | 邦貨換算金額               |
| (インドネシア)                        |               | 百株      | 百株      | 千ルピア        | 千円        |                      |
| UNITED TRACTORS TBK PT          |               | 1,470   | 1,470   | 4,297,536   | 38,248    | 石油・ガス・消耗燃料           |
| INDOFOOD SUKSES MAK TBK         |               | 2,662   | 4,200   | 2,572,500   | 22,895    | 食品                   |
| PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA   |               | 4,990   | 7,000   | 3,451,000   | 30,713    | 食品                   |
| GUDANG GARAM TBK                |               | 292     | 292     | 884,760     | 7,874     | タバコ                  |
| INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA     |               | 1,270   | 1,270   | 1,270,000   | 11,303    | 建設資材                 |
| INDAH KIAT PULP&PAPER           |               | 2,400   | 2,400   | 1,758,000   | 15,646    | 紙製品・林産品              |
| BANK MANDIRI                    |               | 13,300  | 13,300  | 11,072,250  | 98,543    | 銀行                   |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT       |               | 5,235   | 5,235   | 2,099,235   | 18,683    | 家庭用品                 |
| BANK RAKYAT INDONESIA           |               | 41,100  | 55,300  | 25,051,026  | 222,954   | 銀行                   |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT    |               | 5,935   | —       | —           | —         | ガス                   |
| BANK NEGARA INDONESIA PT        |               | 4,990   | 4,990   | 4,403,675   | 39,192    | 銀行                   |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT  |               | 1,760   | 1,760   | 1,078,000   | 9,594     | 建設資材                 |
| BANK CENTRAL ASIA               |               | 6,870   | 43,800  | 33,288,000  | 296,263   | 銀行                   |
| ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT   |               | 8,392   | 8,392   | 2,651,872   | 23,601    | 石油・ガス・消耗燃料           |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T    |               | 1,780   | 1,780   | 1,317,200   | 11,723    | 食品                   |
| TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE    |               | —       | 5,530   | 1,664,530   | 14,814    | 各種電気通信サービス           |
| KALBE FARMA PT                  |               | 15,400  | 15,400  | 2,356,200   | 20,970    | 医薬品                  |
| PT ASTRA INTERNATIONAL TBK      |               | 13,350  | 16,600  | 11,703,000  | 104,156   | 自動車                  |
| SARANA MENARA NUSANTARA PT      |               | 14,790  | 14,790  | 1,434,630   | 12,768    | 各種電気通信サービス           |
| TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK   |               | 37,500  | 38,000  | 16,378,000  | 145,764   | 各種電気通信サービス           |
| BANK JAGO TBK PT                |               | —       | 3,680   | 3,992,800   | 35,535    | 銀行                   |
| MERDEKA COPPER GOLD TBK PT      |               | 6,350   | 11,158  | 5,523,274   | 49,157    | 金属・鉱業                |
| 小 計                             | 株 数 ・ 金 額     | 214,036 | 292,747 | 142,531,889 | 1,268,533 |                      |
|                                 | 銘 柄 数 < 比 率 > | 22      | 23      | —           | <1.8%>    |                      |
| (韓国)                            |               |         |         | 千ウォン        |           |                      |
| SKC CO LTD                      |               | —       | 14      | 213,150     | 21,719    | 化学                   |
| CHEIL WORLDWIDE INC             |               | 59      | 59      | 149,860     | 15,270    | メディア                 |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD    |               | 26      | 26      | 244,200     | 24,883    | 自動車                  |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE |               | 25      | 25      | 509,530     | 51,921    | 保険                   |
| DB INSURANCE CO LTD             |               | 28      | 28      | 184,965     | 18,847    | 保険                   |
| COWAY CO LTD                    |               | 33      | 49      | 349,888     | 35,653    | 家庭用耐久財               |
| KT & G CORP                     |               | 80      | 94      | 778,207     | 79,299    | タバコ                  |
| S-1 CORPORATION                 |               | 14      | 14      | 98,455      | 10,032    | 商業サービス・用品            |
| KOREA GAS CORPORATION           |               | 15      | —       | —           | —         | ガス                   |
| CJ CORP                         |               | 11      | 11      | 92,070      | 9,381     | コングロマリット             |
| KAKAO CORP                      |               | 210     | 252     | 2,122,684   | 216,301   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| CJ ENM CO LTD                   |               | 6       | 6       | 79,431      | 8,094     | 娯楽                   |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE    |               | 29      | —       | —           | —         | 機械                   |
| KMW CO.LTD.                     |               | 11      | —       | —           | —         | 通信機器                 |
| SK TELECOM CO LTD               |               | 27      | 25      | 146,412     | 14,919    | 無線通信サービス             |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD   |               | 247     | 247     | 192,206     | 19,585    | 資本市場                 |
| NCSOFT CORPORATION              |               | 11      | 12      | 532,656     | 54,277    | 娯楽                   |
| LG UPLUS CORP                   |               | 133     | 133     | 183,540     | 18,702    | 各種電気通信サービス           |
| DOOSAN ENERBILITY CO LTD        |               | 160     | 259     | 543,024     | 55,334    | 電気設備                 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE      |               | 6       | 8       | 644,800     | 65,705    | パーソナル用品              |
| LG CHEMICALS LTD                |               | 33      | 35      | 1,783,152   | 181,703   | 化学                   |
| LG CHEM LTD - PREFERRED         |               | 6       | 6       | 160,650     | 16,370    | 化学                   |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF      |               | 1       | 1       | 48,672      | 4,959     | パーソナル用品              |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP         |               | 324     | 356     | 1,509,440   | 153,811   | 銀行                   |
| HMM COMPANY LIMITED             |               | —       | 206     | 605,640     | 61,714    | 海運業                  |
| S-OIL CORPORATION               |               | 39      | 39      | 438,195     | 44,652    | 石油・ガス・消耗燃料           |
| HANWHA SOLUTIONS CORP           |               | 73      | 103     | 323,935     | 33,008    | 化学                   |

| 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    | 千ウォン       | 千円        |                      |
| MERITZ SECURITIES                        |         | 245   | 245   | 156,555    | 15,952    | 資本市場                 |
| SAMSUNG SECURITIES                       |         | 35    | 35    | 136,717    | 13,931    | 資本市場                 |
| POSCO CHEMICAL CO LTD                    |         | 22    | 22    | 284,607    | 29,001    | 建設資材                 |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION               |         | 10    | 16    | 309,120    | 31,499    | 化学                   |
| HOTEL SHILLA CO LTD                      |         | 19    | 19    | 150,136    | 15,298    | 専門小売り                |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN |         | 32    | 32    | 284,085    | 28,948    | 機械                   |
| HYUNDAI MOBIS                            |         | 49    | 55    | 1,107,510  | 112,855   | 自動車部品                |
| SK HYNIX INC                             |         | 393   | 429   | 4,620,350  | 470,813   | 半導体・半導体製造装置          |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR             |         | 69    | 69    | 299,460    | 30,514    | 建設・土木                |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD                 |         | 14    | 14    | 134,211    | 13,676    | 自動車                  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD                     |         | 106   | 107   | 1,943,865  | 198,079   | 自動車                  |
| HYUNDAI STEEL CO                         |         | 47    | 73    | 310,758    | 31,666    | 金属・鉱業                |
| INDUSTRIAL BK OF KOREA                   |         | 150   | 261   | 294,930    | 30,053    | 銀行                   |
| KIA CORP                                 |         | 181   | 202   | 1,673,476  | 170,527   | 自動車                  |
| KOREA ZINC CO LTD                        |         | 5     | 5     | 326,784    | 33,299    | 金属・鉱業                |
| KOREA ELECTRIC POWER                     |         | 196   | 196   | 442,960    | 45,137    | 電力                   |
| HANWHA CORPORATION                       |         | 24    | —     | —          | —         | コングロマリット             |
| KOREAN AIR LINES CO LTD                  |         | 126   | 126   | 372,960    | 38,004    | 旅客航空輸送業              |
| CJ LOGISTICS                             |         | 7     | 7     | 92,430     | 9,418     | 陸運・鉄道                |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO                  |         | 14    | 14    | 216,050    | 22,015    | 化学                   |
| DUZONBIZON CO., LTD.                     |         | 12    | —     | —          | —         | ソフトウェア               |
| HLB INC                                  |         | 74    | 74    | 218,300    | 22,244    | レジャー用品               |
| LG ELECTRONICS INC                       |         | 74    | 82    | 935,640    | 95,341    | 家庭用耐久財               |
| LOTTE CORP                               |         | 16    | —     | —          | —         | コングロマリット             |
| LG CORP                                  |         | 71    | 65    | 470,577    | 47,951    | コングロマリット             |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD        |         | 77    | 77    | 80,392     | 8,191     | 資本市場                 |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCT               |         | 42    | 42    | 170,066    | 17,329    | 建設・土木                |
| NAVER CORP                               |         | 87    | 99    | 2,725,250  | 277,702   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| L&F CO LTD                               |         | —     | 16    | 359,722    | 36,655    | 電子装置・機器・部品           |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO             |         | 31    | 31    | 219,486    | 22,365    | 資本市場                 |
| OTTOGI CORPORATION                       |         | 0.7   | —     | —          | —         | 食品                   |
| AMOREPACIFIC GROUP                       |         | 15    | 15    | 69,160     | 7,047     | パーソナル用品              |
| KANGWON LAND INC                         |         | 79    | 79    | 203,425    | 20,729    | ホテル・レストラン・レジャー       |
| POSCO HOLDINGS INC                       |         | 50    | 57    | 1,604,510  | 163,499   | 金属・鉱業                |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD               |         | 85    | 144   | 383,760    | 39,105    | 建設・土木                |
| SAMSUNG SDI CO,LTD                       |         | 40    | 42    | 2,506,431  | 255,405   | 電子装置・機器・部品           |
| SAMSUNG ELECTRO MECHANICS                |         | 40    | 48    | 770,400    | 78,503    | 電子装置・機器・部品           |
| GREEN CROSS CORP                         |         | —     | 4     | 71,545     | 7,290     | バイオテクノロジー            |
| SAMSUNG ELECTRONICS                      |         | 3,410 | 3,759 | 24,848,973 | 2,532,110 | コンピュータ・周辺機器          |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES                 |         | 307   | 630   | 360,360    | 36,720    | 機械                   |
| SAMSUNG ELECTRONICS PFD                  |         | 594   | 648   | 3,829,680  | 390,244   | コンピュータ・周辺機器          |
| SHINSEGAE CO LTD                         |         | 4     | —     | —          | —         | 複合小売り                |
| SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD         |         | 23    | —     | —          | —         | 医薬品                  |
| YUHAN CORPORATION                        |         | 38    | 39    | 233,074    | 23,750    | 医薬品                  |
| HANON SYSTEMS                            |         | 116   | 116   | 126,402    | 12,880    | 自動車部品                |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO             |         | 34    | —     | —          | —         | 保険                   |
| GS HOLDINGS CORP                         |         | 36    | 36    | 174,420    | 17,773    | 石油・ガス・消耗燃料           |
| LG.DISPLAY CO LTD                        |         | 162   | 162   | 274,590    | 27,980    | 電子装置・機器・部品           |
| CELLTRION INC                            |         | 70    | 79    | 1,310,100  | 133,499   | バイオテクノロジー            |
| HANA FINANCIAL HOLDINGS                  |         | 201   | 237   | 1,125,750  | 114,713   | 銀行                   |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD                    |         | 11    | 18    | 375,575    | 38,271    | 航空貨物・物流サービス          |
| CELLTRION PHARM INC                      |         | 10    | 10    | 91,020     | 9,274     | 医薬品                  |

| 銘柄                            |               | 期首(前期末) | 当 期 末  |            | 業 種 等     |                         |
|-------------------------------|---------------|---------|--------|------------|-----------|-------------------------|
|                               |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額      |           |                         |
|                               |               |         |        | 外貨建金額      |           | 邦貨換算金額                  |
| (韓国)                          |               | 百株      | 百株     | 千ウォン       | 千円        |                         |
| LOTTE SHOPPING CO             |               | 8       | 8      | 75,440     | 7,687     | 複合小売り                   |
| MERITZ FIRE & MARINE INSURAN  |               | —       | 42     | 179,775    | 18,319    | 保険                      |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO     |               | 46      | 46     | 296,032    | 30,165    | 保険                      |
| AMOREPACIFIC CORP             |               | 24      | 24     | 403,440    | 41,110    | パーソナル用品                 |
| SAMSUNG CARD CO               |               | 13      | —      | —          | —         | 消費者金融                   |
| SK INNOVATION CO LTD          |               | 39      | 39     | 806,139    | 82,145    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CJ CHEILJEDANG CORP           |               | 5       | 8      | 309,550    | 31,543    | 食品                      |
| PAN OCEAN CO LTD              |               | 148     | 148    | 104,676    | 10,666    | 海運業                     |
| LG INNOTEK CO LTD             |               | 8       | 12     | 418,320    | 42,626    | 電子装置・機器・部品              |
| SK INC                        |               | 27      | 33     | 837,445    | 85,335    | コングロマリット                |
| KB FINANCIAL GROUP INC        |               | 285     | 307    | 1,808,230  | 184,258   | 銀行                      |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES    |               | 45      | 45     | 220,576    | 22,476    | 航空宇宙・防衛                 |
| ILJIN MATERIALS CO LTD        |               | —       | 21     | 179,310    | 18,271    | 電子装置・機器・部品              |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC    |               | —       | 33     | 117,096    | 11,932    | 各種金融サービス                |
| HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD |               | 4       | 4      | 144,710    | 14,745    | 医薬品                     |
| FILA HOLDINGS CORP            |               | 29      | —      | —          | —         | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| SEEGENE, INC.                 |               | 27      | 27     | 106,488    | 10,851    | バイオテクノロジー               |
| E-MART CO                     |               | 11      | 11     | 148,806    | 15,163    | 食品・生活必需品小売り             |
| GS RETAIL CO LTD              |               | 11      | —      | —          | —         | 食品・生活必需品小売り             |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO  |               | 53      | 53     | 176,358    | 17,970    | 自動車部品                   |
| HD HYUNDAI CO LTD             |               | 29      | 29     | 176,712    | 18,006    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| BGF RETAIL CO LTD /NEW        |               | 4       | 4      | 90,695     | 9,241     | 食品・生活必需品小売り             |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA  |               | 18      | 18     | 160,020    | 16,306    | 食品                      |
| SK CHEMICALS CO LTD/NEW       |               | 6       | 9      | 110,250    | 11,234    | 化学                      |
| NETMARBLE CORP                |               | 14      | 14     | 130,389    | 13,286    | 娯楽                      |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC     |               | 423     | 423    | 647,190    | 65,948    | 銀行                      |
| ECOPRO BM CO LTD              |               | —       | 8      | 389,610    | 39,701    | 電気設備                    |
| ECOPRO BM CO LTD RTS          |               | —       | 0.45   | 4,203      | 428       | 電気設備                    |
| SD BIOSENSOR INC              |               | —       | 35     | 160,475    | 16,352    | ヘルスケア機器・用品              |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD  |               | 17      | 17     | 154,521    | 15,745    | 医薬品                     |
| KRAFTON INC                   |               | —       | 16     | 409,945    | 41,773    | 娯楽                      |
| SK IE TECHNOLOGY CO LTD       |               | —       | 24     | 287,595    | 29,305    | 化学                      |
| SK SQUARE CO LTD              |               | —       | 86     | 398,849    | 40,642    | 半導体・半導体製造装置             |
| SK BIOSCIENCE CO LTD          |               | —       | 19     | 239,850    | 24,440    | バイオテクノロジー               |
| KAKAO GAMES CORP              |               | —       | 28     | 159,889    | 16,292    | 娯楽                      |
| HYBE CO LTD                   |               | —       | 12     | 287,310    | 29,276    | 娯楽                      |
| LG ENERGY SOLUTION            |               | —       | 16     | 638,280    | 65,040    | 電気設備                    |
| KAKAOBANK CORP                |               | —       | 70     | 286,300    | 29,173    | 銀行                      |
| F&F CO LTD / NEW              |               | —       | 16     | 200,000    | 20,380    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| SAMSUNG SDS CO LTD            |               | 25      | 25     | 372,650    | 37,973    | 情報技術サービス                |
| ALTEOGEN INC                  |               | 21      | 21     | 109,269    | 11,134    | バイオテクノロジー               |
| SAMSUNG C&T CORP              |               | 57      | 67     | 759,360    | 77,378    | コングロマリット                |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD      |               | 11      | 15     | 1,244,082  | 126,771   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| PEARL ABYSS CORP              |               | 15      | 28     | 173,602    | 17,690    | 娯楽                      |
| DOOSAN BOBCAT INC             |               | 33      | 33     | 138,355    | 14,098    | 機械                      |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD   |               | 48      | 75     | 446,630    | 45,511    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額     | 10,703  | 12,552 | 83,138,759 | 8,471,839 |                         |
|                               | 銘 柄 数 < 比 率 > | 106     | 112    | —          | <12.2%>   |                         |
| (台湾)                          |               |         |        | 千新台幣ドル     |           |                         |
| ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION |               | 320     | 360    | 7,866      | 34,326    | 通信機器                    |
| ACER INC                      |               | 2,567   | 2,567  | 7,048      | 30,757    | コンピュータ・周辺機器             |
| ASUSTEK COMPUTER INC          |               | 498     | 538    | 19,181     | 83,706    | コンピュータ・周辺機器             |

| 銘<br>柄                              | 株<br>数 | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         | 業<br>種<br>等 |
|-------------------------------------|--------|---------|-------------|---------|-------------|
|                                     |        | 株<br>数  | 評<br>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      |             |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP          | 324    | 354     | 14,450      | 63,058  | 半導体・半導体製造装置 |
| ASIA CEMENT                         | 1,869  | 2,089   | 9,675       | 42,224  | 建設資材        |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP              | 180    | —       | —           | —       | 電子装置・機器・部品  |
| TAIWAN BUSINESS BANK                | 3,366  | —       | —           | —       | 銀行          |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMI         | 690    | 690     | 6,865       | 29,960  | 半導体・半導体製造装置 |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD     | 520    | 520     | 6,682       | 29,159  | コンピュータ・周辺機器 |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP           | 780    | 1,000   | 21,100      | 92,078  | 電子装置・機器・部品  |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD          | 486    | —       | —           | —       | コンピュータ・周辺機器 |
| QUANTA COMPUTER INC                 | 2,126  | 2,246   | 19,075      | 83,244  | コンピュータ・周辺機器 |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP        | 430    | —       | —           | —       | 不動産管理・開発    |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD           | 458    | 458     | 6,876       | 30,006  | コンピュータ・周辺機器 |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK           | 3,554  | 3,590   | 6,354       | 27,730  | 銀行          |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD        | 1,420  | 1,420   | 4,751       | 20,733  | 自動車部品       |
| CHINA STEEL                         | 8,725  | 9,145   | 32,009      | 139,684 | 金属・鉱業       |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD         | 1,873  | —       | —           | —       | 保険          |
| ADVANTECH CO.,LTD.                  | 267    | 267     | 9,121       | 39,806  | コンピュータ・周辺機器 |
| COMPAL ELECTRONICS                  | 3,545  | 3,545   | 8,031       | 35,048  | コンピュータ・周辺機器 |
| DELTA ELECTRONICS INC               | 1,386  | 1,496   | 34,426      | 150,234 | 電子装置・機器・部品  |
| NANYA TECHNOLOGY CO                 | 1,000  | 1,000   | 6,510       | 28,408  | 半導体・半導体製造装置 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD             | 2,630  | 3,120   | 39,008      | 170,227 | 各種電気通信サービス  |
| AU OPTRONICS CORP                   | 6,700  | 7,170   | 12,404      | 54,130  | 電子装置・機器・部品  |
| TAIWAN MOBILE CO LTD                | 1,282  | 1,282   | 13,525      | 59,022  | 無線通信サービス    |
| EVERGREEN MARINE                    | 2,023  | 2,023   | 29,749      | 129,822 | 海運業         |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION | 2,344  | 2,344   | 6,986       | 30,489  | コングロマリット    |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD          | 268    | 328     | 5,759       | 25,131  | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD           | 114    | 144     | 6,831       | 29,812  | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD        | 400    | 430     | 16,275      | 71,026  | 半導体・半導体製造装置 |
| FORMOSA PLASTIC                     | 2,734  | 3,094   | 32,025      | 139,755 | 化学          |
| FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO           | 2,479  | 2,899   | 22,793      | 99,470  | 化学          |
| GIANT MANUFACTURING                 | 187    | 187     | 4,444       | 19,394  | レジャー用品      |
| MEDIATEK INC                        | 1,075  | 1,195   | 97,184      | 424,102 | 半導体・半導体製造装置 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD      | 4,795  | 5,877   | 39,851      | 173,906 | 保険          |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C        | 6,687  | 6,863   | 15,237      | 66,494  | 銀行          |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD             | 200    | 230     | 12,719      | 55,504  | 専門小売り       |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD         | 1,050  | 1,050   | 8,337       | 36,381  | 無線通信サービス    |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO         | 6,441  | 7,591   | 18,978      | 82,821  | 各種金融サービス    |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD     | 5,520  | 6,470   | 37,980      | 165,745 | 保険          |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING | 8,387  | 12,697  | 21,395      | 93,369  | 保険          |
| E. SUN FINANCIAL HOLDINGS CO        | 8,208  | 9,790   | 30,057      | 131,166 | 銀行          |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY          | 9,006  | 9,976   | 103,755     | 452,778 | 電子装置・機器・部品  |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT        | 8,223  | 8,583   | 32,618      | 142,343 | 銀行          |
| LARGAN PRECISION CO LTD             | 70     | 80      | 12,582      | 54,909  | 電子装置・機器・部品  |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS          | 6,801  | 8,710   | 15,548      | 67,851  | 銀行          |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS        | 7,082  | 10,301  | 9,363       | 40,862  | 保険          |
| INVENTEC CO.,LTD                    | 1,369  | 2,519   | 6,511       | 28,417  | コンピュータ・周辺機器 |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP             | 1,458  | 1,458   | 9,308       | 40,620  | コンピュータ・周辺機器 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS          | 7,595  | 7,595   | 13,064      | 57,011  | 銀行          |
| CTBC FINANCIAL HOLDING              | 12,582 | 15,142  | 41,337      | 180,394 | 銀行          |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO          | 7,623  | 7,699   | 20,095      | 87,694  | 銀行          |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC            | 461    | —       | —           | —       | 半導体・半導体製造装置 |
| NAN YA PLASTICS CORP                | 3,807  | 3,997   | 33,856      | 147,747 | 化学          |
| WISTRON CORP                        | 2,124  | —       | —           | —       | コンピュータ・周辺機器 |

| 銘柄                                       |  | 期首(前期末)   | 当 期 末   |           | 業 種 等     |                |
|------------------------------------------|--|-----------|---------|-----------|-----------|----------------|
|                                          |  | 株 数       | 株 数     | 評 価 額     |           |                |
|                                          |  |           |         | 外貨建金額     |           | 邦貨換算金額         |
| (台湾)                                     |  | 百株        | 百株      | 千新台幣ドル    | 千円        |                |
| POU CHEN CORP                            |  | 1,354     | 1,754   | 5,264     | 22,971    | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO             |  | 3,648     | 3,788   | 25,192    | 109,937   | 食品             |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP               |  | 378       | 428     | 11,431    | 49,887    | 食品・生活必需品小売り    |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP               |  | 883       | 883     | 7,987     | 34,857    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| PHISON ELECTRONICS CORP                  |  | 93        | —       | —         | —         | 半導体・半導体製造装置    |
| E INK HOLDINGS INC                       |  | —         | 660     | 11,220    | 48,962    | 電子装置・機器・部品     |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD               |  | 465       | 1,131   | 8,370     | 36,527    | 不動産管理・開発       |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD                |  | 548       | 548     | 3,317     | 14,477    | 電子装置・機器・部品     |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP              |  | 775       | 1,225   | 9,204     | 40,168    | 電子装置・機器・部品     |
| TAIWAN CEMENT                            |  | 3,342     | 3,952   | 17,491    | 76,332    | 建設資材           |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR                     |  | 17,560    | 19,390  | 1,008,280 | 4,400,033 | 半導体・半導体製造装置    |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP             |  | 8,495     | 9,635   | 46,151    | 201,401   | 半導体・半導体製造装置    |
| WAN HAI LINES LIMITED                    |  | —         | 429     | 6,349     | 27,707    | 海運業            |
| WINBOND ELECTRONICS CORPORATION          |  | 2,420     | 2,420   | 6,582     | 28,724    | 半導体・半導体製造装置    |
| YAGEO CORPORATION                        |  | 253       | 343     | 13,699    | 59,782    | 電子装置・機器・部品     |
| YANG MING MARINE TRANSPORT               |  | —         | 1,430   | 18,018    | 78,628    | 海運業            |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP              |  | 1,430     | 1,430   | 3,896     | 17,005    | 運送インフラ         |
| INNOLUX CORP                             |  | 6,603     | 8,373   | 11,429    | 49,876    | 電子装置・機器・部品     |
| WPG HOLDINGS CO LTD                      |  | 1,203     | 1,203   | 6,380     | 27,843    | 電子装置・機器・部品     |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION |  | 160       | 160     | 6,320     | 27,579    | 電子装置・機器・部品     |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP                  |  | 180       | 185     | 4,350     | 18,984    | 機械             |
| EMEMORY TECHNOLOGY INC                   |  | —         | 50      | 5,975     | 26,074    | 半導体・半導体製造装置    |
| PEGATRON CORP                            |  | 1,596     | 1,596   | 11,082    | 48,363    | コンピュータ・周辺機器    |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP               |  | 80        | 104     | 8,528     | 37,216    | 機械             |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP                  |  | 240       | 240     | 4,644     | 20,265    | 半導体・半導体製造装置    |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD                 |  | 839       | 1,025   | 23,078    | 100,712   | 各種金融サービス       |
| ONENESS BIOTECH CO LTD                   |  | 130       | 220     | 4,180     | 18,241    | 医薬品            |
| PARADE TECHNOLOGIES LTD                  |  | —         | 60      | 8,220     | 35,871    | 半導体・半導体製造装置    |
| ASMEDIA TECHNOLOGY INC                   |  | 20        | 20      | 2,600     | 11,346    | 半導体・半導体製造装置    |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING             |  | 364       | 644     | 6,602     | 28,810    | 電子装置・機器・部品     |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL             |  | 7,284     | 7,430   | 19,615    | 85,601    | 銀行             |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK   |  | 2,205     | 2,915   | 13,703    | 59,802    | 銀行             |
| VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY               |  | —         | 50      | 6,425     | 28,038    | 電気設備           |
| WIWYNN CORP                              |  | 50        | 50      | 4,815     | 21,012    | コンピュータ・周辺機器    |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD            |  | 2,206     | 2,486   | 23,398    | 102,109   | 半導体・半導体製造装置    |
| SILERGY CORP                             |  | 50        | 60      | 14,610    | 63,756    | 半導体・半導体製造装置    |
| MOMO.COM INC                             |  | —         | 30      | 2,169     | 9,465     | インターネット販売・通信販売 |
| GLOBALWAFERS CO LTD                      |  | 150       | 170     | 8,976     | 39,170    | 半導体・半導体製造装置    |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD              |  | 100       | 100     | 3,060     | 13,353    | 家庭用耐久財         |
| 小 計                                      |  | 株 数 ・ 金 額 | 233,245 | 258,776   | 2,392,235 | 10,439,476     |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                            |  |           | 87      | 86        | —         | <15.0%>        |
| (インド)                                    |  |           |         | 千インドルピー   |           |                |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED              |  | 2,051     | 2,250   | 566,617   | 957,583   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD                |  | 447       | 700     | 24,738    | 41,807    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED                |  | 622       | 737     | 65,983    | 111,512   | 自動車            |
| SHREE CEMENT LIMITED                     |  | 8         | 8       | 21,171    | 35,779    | 建設資材           |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP                 |  | 343       | 643     | 17,279    | 29,202    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TATA STEEL LIMITED                       |  | 496       | 562     | 70,376    | 118,936   | 金属・鉱業          |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD               |  | 453       | 453     | 34,348    | 58,049    | 食品             |
| NESTLE INDIA LIMITED                     |  | 23        | 28      | 47,697    | 80,608    | 食品             |
| GAIL INDIA LTD                           |  | 946       | 946     | 14,767    | 24,956    | ガス             |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD                  |  | 370       | 435     | 76,886    | 129,937   | 銀行             |

| 銘<br>柄                       | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |                  | 業<br>種<br>等 |                         |
|------------------------------|---------|-------------|------------------|-------------|-------------------------|
|                              | 株<br>数  | 株<br>数      | 評 価 額            |             |                         |
|                              |         |             | 外貨建金額<br>千インドルピー |             | 邦貨換算金額<br>千円            |
| (インド)                        | 百株      | 百株          |                  |             |                         |
| VEDANTA LTD                  | 1,260   | 820         | 28,712           | 48,523      | 金属・鉱業                   |
| TITAN CO LTD                 | 269     | 269         | 58,728           | 99,250      | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| OIL&NATURAL GAS CORP LTD     | 1,570   | 2,190       | 36,080           | 60,975      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)     | 102     | 102         | 16,128           | 27,256      | パーソナル用品                 |
| LUPIN LTD                    | 149     | 149         | 10,922           | 18,458      | 医薬品                     |
| MPHASIS LTD                  | —       | 62          | 16,377           | 27,678      | 情報技術サービス                |
| ACC LIMITED                  | 60      | 60          | 13,397           | 22,641      | 建設資材                    |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 1,203   | 1,356       | 294,021          | 496,896     | 貯蓄・抵当・不動産金融             |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE | 700     | —           | —                | —           | メディア                    |
| INFOSYS LTD                  | 2,455   | 2,627       | 412,530          | 697,177     | 情報技術サービス                |
| WIPRO LTD                    | 804     | 1,060       | 51,213           | 86,551      | 情報技術サービス                |
| MRF LTD                      | 2       | 2           | 13,715           | 23,179      | 自動車部品                   |
| INDIAN OIL CORPORATION LTD   | 1,130   | 1,130       | 14,012           | 23,680      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HINDUSTAN UNILEVER LIMITED   | 582     | 651         | 137,793          | 232,871     | パーソナル用品                 |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE  | 70      | 87          | 33,030           | 55,822      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HCL TECHNOLOGIES LTD         | 769     | 849         | 91,360           | 154,399     | 情報技術サービス                |
| DABUR INDIA LTD              | 378     | 459         | 23,158           | 39,138      | パーソナル用品                 |
| HERO MOTOCORP LTD            | 93      | 93          | 23,182           | 39,178      | 自動車                     |
| SRF LTD                      | —       | 110         | 24,467           | 41,349      | 化学                      |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD    | 70      | 70          | 13,900           | 23,492      | 自動車部品                   |
| DR. REDDYS LABORATORIES      | 91      | 91          | 35,699           | 60,331      | 医薬品                     |
| IPCA LABORATORIES LTD        | 60      | —           | —                | —           | 医薬品                     |
| BHARTI AIRTEL LIMITED        | 1,775   | 1,915       | 136,252          | 230,266     | 無線通信サービス                |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD | 617     | 617         | 54,629           | 92,323      | 医薬品                     |
| DIVIS LABORATORIES LTD       | 97      | 97          | 41,041           | 69,360      | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD      | 96      | 109         | 80,816           | 136,579     | 自動車                     |
| AUROBINDO PHARMA LTD         | 187     | 187         | 11,487           | 19,413      | 医薬品                     |
| BIOCON LTD                   | 186     | 310         | 10,495           | 17,736      | バイオテクノロジー               |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD   | 1,060   | 1,060       | 12,545           | 21,201      | 自動車部品                   |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE    | 157     | 157         | 18,164           | 30,698      | 消費者金融                   |
| PETRONET LNG LTD             | 349     | 770         | 16,658           | 28,153      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CIPLA LIMITED                | 345     | 345         | 32,371           | 54,707      | 医薬品                     |
| LARSEN&TOUBRO LIMITED        | 471     | 537         | 86,787           | 146,670     | 建設・土木                   |
| ULTRATECH CEMENT LTD         | 81      | 81          | 50,605           | 85,524      | 建設資材                    |
| TATA CONSULTANCY SVS LTD     | 680     | 722         | 248,898          | 420,637     | 情報技術サービス                |
| ADANI ENTERPRISES LTD        | —       | 191         | 41,975           | 70,937      | 商社・流通業                  |
| NTPC LIMITED                 | 3,220   | 3,960       | 62,964           | 106,409     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD      | 79      | 79          | 15,580           | 26,330      | 各種金融サービス                |
| AMBUJA CEMENTS LTD           | 570     | 570         | 20,904           | 35,329      | 建設資材                    |
| BHARAT FORGE LIMITED         | 127     | 127         | 8,093            | 13,678      | 自動車部品                   |
| HINDALCO INDUSTRIES LIMITED  | 1,170   | 1,170       | 51,959           | 87,811      | 金属・鉱業                   |
| ITC LTD                      | 2,211   | 2,211       | 58,138           | 98,253      | タバコ                     |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD      | 124     | 124         | 27,273           | 46,091      | 化学                      |
| UPL LTD                      | 321     | 432         | 33,592           | 56,771      | 化学                      |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD  | 32      | 32          | 8,492            | 14,352      | 医薬品                     |
| SIEMENS LIMITED              | 31      | 70          | 15,389           | 26,007      | コングロマリット                |
| INFO EDGE INDIA LTD          | 48      | 66          | 25,484           | 43,068      | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 272     | 272         | 20,599           | 34,813      | パーソナル用品                 |
| MINDTREE LIMITED             | —       | 48          | 15,592           | 26,350      | 情報技術サービス                |
| MARICO LIMITED               | 263     | 460         | 22,514           | 38,049      | 食品                      |
| PAGE INDUSTRIES LTD          | 3       | 3           | 14,490           | 24,489      | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| DLF LIMITED                  | 260     | 580         | 18,977           | 32,072      | 不動産管理・開発                |

| 銘柄                                      |               | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等     |                    |
|-----------------------------------------|---------------|---------|--------|-----------|-----------|--------------------|
|                                         |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額     |           |                    |
|                                         |               |         |        | 外貨建金額     |           | 邦貨換算金額             |
| (インド)                                   |               | 百株      | 百株     | 千インドルピー   | 千円        |                    |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD            |               | 1,270   | 2,619  | 64,220    | 108,533   | 電力                 |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE   |               | 426     | 426    | 33,764    | 57,062    | 運送インフラ             |
| REC LTD                                 |               | 398     | —      | —         | —         | 各種金融サービス           |
| BAJAJ FINSERV LTD                       |               | 23      | 31     | 43,556    | 73,611    | 各種金融サービス           |
| BAJAJ AUTO LIMITED                      |               | 55      | 55     | 19,949    | 33,714    | 自動車                |
| JUBILANT FOODWORKS LIMITED              |               | 47      | —      | —         | —         | ホテル・レストラン・レジャー     |
| MUTHOOT FINANCE LTD                     |               | 100     | 100    | 12,016    | 20,307    | 消費者金融              |
| COAL INDIA LTD                          |               | 769     | 1,420  | 25,993    | 43,928    | 石油・ガス・消耗燃料         |
| TATA MOTORS LTD                         |               | 1,340   | 1,340  | 54,129    | 91,478    | 自動車                |
| TATA POWER COMPANY LIMITED              |               | —       | 1,060  | 24,380    | 41,202    | 電力                 |
| INDUS TOWERS LTD                        |               | 610     | 610    | 12,559    | 21,226    | 各種電気通信サービス         |
| PI INDUSTRIES LTD                       |               | 70      | 70     | 17,926    | 30,295    | 化学                 |
| ASIAN PAINTS LTD                        |               | 262     | 298    | 89,556    | 151,350   | 化学                 |
| BAJAJ FINANCE LTD                       |               | 200     | 209    | 126,413   | 213,639   | 消費者金融              |
| LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD            |               | 40      | 40     | 17,795    | 30,074    | 情報技術サービス           |
| ADANI GREEN ENERGY LTD                  |               | 280     | 330    | 89,311    | 150,935   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| INDRAPRASTHA GAS LTD                    |               | 135     | 135    | 4,783     | 8,084     | ガス                 |
| TRENT LTD                               |               | 150     | 150    | 16,557    | 27,982    | 複合小売り              |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD              |               | 617     | 763    | 43,021    | 72,706    | 保険                 |
| BHARAT ELECTRONICS LTD                  |               | —       | 848    | 19,122    | 32,316    | 航空宇宙・防衛            |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD            |               | 48      | 48     | 9,276     | 15,676    | 資本市場               |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD             |               | 123     | 123    | 7,732     | 13,068    | 陸運・鉄道              |
| BANDHAN BANK LTD                        |               | 560     | 560    | 17,536    | 29,636    | 銀行                 |
| ADANI TOTAL GAS LTD                     |               | —       | 190    | 45,129    | 76,269    | ガス                 |
| GODREJ PROPERTIES LTD                   |               | —       | 93     | 12,982    | 21,940    | 不動産管理・開発           |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD                |               | 80      | 76     | 24,715    | 41,769    | 食品                 |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND            |               | —       | 286    | 18,172    | 30,711    | 消費者金融              |
| SBI CARDS & PAYMENT SERVICES            |               | —       | 131    | 9,975     | 16,858    | 消費者金融              |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TO            |               | —       | 222    | 15,334    | 25,915    | 商業サービス・用品          |
| YES BANK LTD                            |               | 8,390   | 8,390  | 10,865    | 18,361    | 銀行                 |
| ZOMATO LTD                              |               | —       | 1,430  | 8,115     | 13,714    | インターネット販売・通信販売     |
| EICHER MOTORS LTD                       |               | 82      | 116    | 27,193    | 45,957    | 自動車                |
| JUBILANT FOODWORKS LIMITED              |               | —       | 360    | 17,623    | 29,784    | ホテル・レストラン・レジャー     |
| AXIS BANK LIMITED                       |               | 1,627   | 1,762  | 116,943   | 197,635   | 銀行                 |
| HAVELLS INDIA LTD                       |               | 177     | 177    | 21,514    | 36,359    | 電気設備               |
| ICICI BANK LTD                          |               | 3,566   | 4,049  | 287,620   | 486,079   | 銀行                 |
| BERGER PAINTS INDIA LTD                 |               | 190     | 190    | 12,621    | 21,330    | 化学                 |
| TECH MAHINDRA LTD                       |               | 442     | 497    | 62,679    | 105,927   | 情報技術サービス           |
| ADANI TRANSMISSION LTD                  |               | —       | 236    | 63,801    | 107,824   | 電力                 |
| GRASIM INDUSTRIES LIMITED               |               | 177     | 233    | 36,155    | 61,103    | 建設資材               |
| AVENUE SUPERMARTS LTD                   |               | 115     | 136    | 48,192    | 81,446    | 食品・生活必需品小売り        |
| UNITED SPIRITS LTD                      |               | 226     | 226    | 18,095    | 30,581    | 飲料                 |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY |               | 160     | 160    | 20,229    | 34,188    | 保険                 |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD  |               | 171     | 332    | 16,761    | 28,326    | 保険                 |
| INTERGLOBE AVIATION LTD                 |               | 50      | 94     | 16,142    | 27,281    | 旅客航空輸送業            |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD               |               | 258     | 365    | 38,852    | 65,660    | 保険                 |
| JSW STEEL LTD                           |               | 530     | 660    | 44,771    | 75,663    | 金属・鉱業              |
| 小 計                                     | 株 数 ・ 金 額     | 56,181  | 67,959 | 5,295,171 | 8,948,840 |                    |
|                                         | 銘 柄 数 < 比 率 > | 95      | 105    | —         | <12.9%>   |                    |
| (パキスタン)                                 |               |         |        | 千パキスタルピー  |           |                    |
| MCB BANK LIMITED                        |               | 340     | —      | —         | —         | 銀行                 |
| OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD            |               | 510     | —      | —         | —         | 石油・ガス・消耗燃料         |

| 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         |     |
| (パキスタン)                                |         | 百株     | 百株      | 千パキスタンルピー | 千円        |                |     |
| HABIB BANK LTD                         |         | 356    | —       | —         | —         | 銀行             |     |
| 小計                                     | 株数・金額   | 1,206  | —       | —         | —         |                |     |
|                                        | 銘柄数<比率> | 3      | —       | —         | <—%>      |                |     |
| (メキシコ)                                 |         |        |         | 千メキシコペソ   |           |                |     |
| ALFA S. A. B. -A                       |         | —      | 2,180   | 2,923     | 18,604    | コングロマリット       |     |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD           |         | 1,454  | 1,568   | 22,132    | 140,850   | 飲料             |     |
| GRUPO TELEvisa SAB - SER CPO           |         | 1,980  | 1,780   | 5,813     | 36,996    | メディア           |     |
| GRUPO BIMBO SAB-SERIES A               |         | 1,010  | 1,380   | 8,325     | 52,983    | 食品             |     |
| GRUMA S. A. B. -B                      |         | 134    | 156     | 3,842     | 24,453    | 食品             |     |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INF           |         | 129    | 164     | 2,351     | 14,965    | 運送インフラ         |     |
| GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1           |         | 349    | 349     | 2,276     | 14,485    | コングロマリット       |     |
| CEMEX SAB - CPO                        |         | 10,799 | 11,219  | 9,121     | 58,050    | 建設資材           |     |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-O             |         | 1,839  | 2,001   | 26,643    | 169,558   | 銀行             |     |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV           |         | 84     | 84      | 1,694     | 10,780    | 金属・鉱業          |     |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A             |         | 950    | 1,100   | 3,030     | 19,286    | 家庭用品           |     |
| GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B           |         | 143    | 189     | 7,843     | 49,916    | 運送インフラ         |     |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B          |         | 2,169  | 2,549   | 24,001    | 152,745   | 金属・鉱業          |     |
| AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L           |         | 24,740 | 24,260  | 45,875    | 291,952   | 無線通信サービス       |     |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-O             |         | 1,402  | 1,690   | 5,784     | 36,814    | 銀行             |     |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV             |         | 261    | 320     | 4,127     | 26,268    | 飲料             |     |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH           |         | 304    | 304     | 8,427     | 53,632    | 運送インフラ         |     |
| MEGACABLE HOLDINGS-CPO                 |         | 231    | 231     | 1,355     | 8,629     | メディア           |     |
| INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N           |         | 387    | —       | —         | —         | ガス             |     |
| TELESITES SAB DE CV                    |         | 1,110  | —       | —         | —         | 各種電気通信サービス     |     |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV           |         | 939    | 939     | 4,565     | 29,054    | 化学             |     |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV              |         | 324    | 380     | 4,178     | 26,594    | 飲料             |     |
| WALMART DE MEXICO-SER V                |         | 3,780  | 4,080   | 28,347    | 180,405   | 食品・生活必需品小売り    |     |
| BECLÉ SAB DE CV                        |         | 470    | 470     | 2,294     | 14,599    | 飲料             |     |
| 小計                                     | 株数・金額   | 54,991 | 57,395  | 224,957   | 1,431,628 |                |     |
|                                        | 銘柄数<比率> | 23     | 22      | —         | <2.1%>    |                |     |
| (ブラジル)                                 |         |        |         | 千リアル      |           |                |     |
| BRF SA                                 |         | 397    | 630     | 776       | 19,551    | 食品             |     |
| VALE SA                                |         | 2,667  | 3,236   | 24,756    | 623,592   | 金属・鉱業          |     |
| CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB           |         | 860    | —       | —         | —         | 電力             |     |
| CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B |         | 180    | 180     | 693       | 17,469    | 電力             |     |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER           |         | 165    | 300     | 1,168     | 29,433    | 電力             |     |
| BANCO DO BRASIL SA                     |         | 536    | 728     | 2,470     | 62,238    | 銀行             |     |
| ITAUSA SA                              |         | 3,360  | 3,528   | 3,097     | 78,030    | 銀行             |     |
| LOJAS AMERICANAS SA-PREF               |         | 729    | —       | —         | —         | インターネット販売・通信販売 |     |
| GERDAU SA PFD NPV                      |         | 745    | 950     | 2,616     | 65,903    | 金属・鉱業          |     |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS              |         | 2,780  | 2,870   | 9,832     | 247,677   | 石油・ガス・消耗燃料     |     |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA             |         | 436    | —       | —         | —         | 専門小売り          |     |
| PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR             |         | 3,320  | 3,830   | 12,317    | 310,264   | 石油・ガス・消耗燃料     |     |
| CCR SA                                 |         | 756    | 1,210   | 1,422     | 35,843    | 運送インフラ         |     |
| WEG SA                                 |         | 1,174  | 1,347   | 3,592     | 90,489    | 電気設備           |     |
| BANCO BRADESCO SA - PREF               |         | 3,476  | 4,103   | 7,537     | 189,877   | 銀行             |     |
| BANCO BRADESCO S. A.                   |         | 1,110  | 1,221   | 1,840     | 46,369    | 銀行             |     |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA            |         | 462    | 462     | 881       | 22,192    | 金属・鉱業          |     |
| BRADESPAR SA -PREF                     |         | 150    | —       | —         | —         | 金属・鉱業          |     |
| SUZANO SA                              |         | 529    | 629     | 3,171     | 79,883    | 紙製品・林産品        |     |
| CPFL ENERGIA SA                        |         | 193    | —       | —         | —         | 電力             |     |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF          |         | 3,559  | 3,739   | 8,770     | 220,913   | 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                  |
| (ブラジル)                                |               | 百株      | 百株     | 千レアル     | 千円        |                         |
| BRASKEM SA-PREF A                     |               | —       | 132    | 534      | 13,462    | 化学                      |
| ALPARGATAS SA-PREF                    |               | 120     | 120    | 251      | 6,329     | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| LOCALIZA RENT A CAR                   |               | 456     | 456    | 2,361    | 59,474    | 陸運・鉄道                   |
| LOJAS RENNER S. A.                    |               | 627     | 690    | 1,650    | 41,566    | 複合小売り                   |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES                |               | 480     | 480    | 575      | 14,497    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COSAN SA                              |               | 868     | 868    | 1,530    | 38,546    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TOTVS SA                              |               | 400     | 400    | 1,000    | 25,189    | ソフトウェア                  |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD           |               | 700     | 910    | 2,213    | 55,747    | 電力                      |
| B2W CIA DIGITAL                       |               | 135     | —      | —        | —         | インターネット販売・通信販売          |
| JBS SA                                |               | 746     | 746    | 2,693    | 67,855    | 食品                      |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF      |               | 696     | 905    | 935      | 23,571    | 電力                      |
| CIA SANEAMENTO BASICO DE SP           |               | 213     | 336    | 1,520    | 38,289    | 水道                      |
| SUL AMERICA SA - UNITS                |               | 196     | —      | —        | —         | 保険                      |
| HYPERA SA                             |               | 239     | 239    | 847      | 21,347    | 医薬品                     |
| MAGAZINE LUIZA SA                     |               | 2,030   | 2,300  | 899      | 22,652    | 複合小売り                   |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) SA           |               | 244     | 244    | 811      | 20,448    | 銀行                      |
| ENERGISA SA-UNITS                     |               | 102     | 102    | 474      | 11,942    | 電力                      |
| TELEFONICA BRASIL S. A.               |               | 416     | 416    | 2,118    | 53,353    | 各種電気通信サービス              |
| RAIA DROGASIL SA                      |               | 782     | 782    | 1,480    | 37,288    | 食品・生活必需品小売り             |
| VIA S/A                               |               | 920     | —      | —        | —         | 専門小売り                   |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES           |               | 441     | 670    | 1,700    | 42,833    | 保険                      |
| ENGIE BRASIL SA                       |               | 120     | 120    | 512      | 12,904    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| NOTRE DAME INTERMED PAR SA            |               | 373     | —      | —        | —         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS |               | 695     | 3,289  | 2,671    | 67,290    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC          |               | 296     | 296    | 564      | 14,218    | 食品・生活必需品小売り             |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO             |               | 1,436   | 4,757  | 5,585    | 140,704   | 資本市場                    |
| AMBEV SA                              |               | 3,239   | 3,899  | 5,338    | 134,473   | 飲料                      |
| KLABIN SA-UNIT                        |               | 610     | 610    | 1,315    | 33,143    | 容器・包装                   |
| NATURA &CO HOLDING SA                 |               | 625     | 625    | 952      | 23,992    | パーソナル用品                 |
| BANCO INTER SA-UNITS                  |               | 91      | 273    | 331      | 8,355     | 銀行                      |
| TIM SA                                |               | 465     | 829    | 1,094    | 27,581    | 無線通信サービス                |
| AMERICANAS SA                         |               | —       | 600    | 1,252    | 31,547    | インターネット販売・通信販売          |
| REDE D'OR SAO LUIZ SA                 |               | —       | 298    | 1,026    | 25,844    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VIBRA ENERGIA SA                      |               | —       | 836    | 1,622    | 40,874    | 専門小売り                   |
| RUMO SA                               |               | 960     | 960    | 1,483    | 37,360    | 陸運・鉄道                   |
| PETRO RIO SA                          |               | —       | 653    | 1,581    | 39,838    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT           |               | 161     | 900    | 2,042    | 51,439    | 資本市場                    |
| 小 計                                   | 株 数 ・ 金 額     | 47,474  | 58,713 | 135,918  | 3,423,698 |                         |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 53      | 49     | —        | <4.9%>    |                         |
| (チリ)                                  |               |         |        | 千チリペソ    |           |                         |
| BANCO DE CREDITO E INVERSION          |               | 32      | 33     | 88,296   | 13,215    | 銀行                      |
| EMPRESAS CMPC SA                      |               | 719     | 719    | 90,298   | 13,515    | 紙製品・林産品                 |
| EMPRESAS COPEC SA                     |               | 259     | 259    | 155,115  | 23,216    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COLBUN SA                             |               | 4,710   | —      | —        | —         | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B           |               | 288     | —      | —        | —         | 飲料                      |
| S. A. C. I. FALABELLA                 |               | 502     | 502    | 113,452  | 16,980    | 複合小売り                   |
| CENCOSUD SA                           |               | 1,260   | 1,260  | 166,194  | 24,874    | 食品・生活必需品小売り             |
| CENCOSUD SHOPPING SA                  |               | 230     | —      | —        | —         | 不動産管理・開発                |
| 小 計                                   | 株 数 ・ 金 額     | 8,000   | 2,774  | 613,355  | 91,802    |                         |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8       | 5      | —        | <0.1%>    |                         |
| (コロンビア)                               |               |         |        | 千コロンビアペソ |           |                         |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA            |               | 338     | 338    | 709,800  | 22,565    | 電力                      |

| 銘 柄                           |                            | 期首(前期末)     | 当 期 末       |                | 業 種 等               |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|-------------------------------|----------------------------|-------------|-------------|----------------|---------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                               |                            | 株 数         | 株 数         | 評 価 額          |                     |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|                               |                            |             |             | 外貨建金額          |                     | 邦貨換算金額                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| (コロンビア)                       |                            | 百株          | 百株          | 千コロンビアペソ       | 千円                  | 銀行<br>各種金融サービス                                                                                                                                                                                                                                                          |
| BANCOLOMBIA SA                |                            | 159         | 159         | 622,485        | 19,790              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| GRUPO DE INV SURAMERICANA     |                            | 130         | 130         | 535,600        | 17,027              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 627<br>3    | 627<br>3    | 1,867,885<br>— | 59,383<br><0.1%>    |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| (アラブ首長国連邦)                    |                            |             |             | 千UAEディルハム      |                     | 銀行<br>銀行<br>各種電気通信サービス<br>銀行<br>銀行<br>不動産管理・開発<br>不動産管理・開発<br>銀行<br>不動産管理・開発<br>専門小売り                                                                                                                                                                                   |
| ABU DHABI ISLAMIC BANK        |                            | 1,280       | 1,280       | 1,113          | 39,376              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| DUBAI ISLAMIC BANK            |                            | 1,020       | 2,140       | 1,363          | 48,208              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| EMIRATES TELECOM CORPORATION  |                            | 1,182       | 2,749       | 9,341          | 330,301             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| ABU DHABI COMMERCIAL BANK     |                            | 1,738       | 2,378       | 2,431          | 85,961              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC     |                            | 2,040       | 3,571       | 7,785          | 275,289             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| EMAAR PROPERTIES PJSC         |                            | 2,900       | 2,900       | 1,783          | 63,064              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| ALDAR PROPERTIES PJSC         |                            | 2,770       | 2,770       | 1,562          | 55,242              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| EMIRATES NBD PJSC             |                            | 1,610       | 1,970       | 2,895          | 102,399             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| EMAAR MALLS PJSC              |                            | 2,110       | —           | —              | —                   |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO  |                            | —           | 1,790       | 733            | 25,950              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 16,650<br>9 | 21,549<br>9 | 29,010<br>—    | 1,025,793<br><1.5%> |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| (エジプト)                        |                            |             |             | 千エジプトポンド       |                     | 銀行<br>タバコ<br>電気設備<br>情報技術サービス                                                                                                                                                                                                                                           |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK |                            | 913         | 1,217       | 5,249          | 36,899              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| EASTERN TOBACCO               |                            | 515         | 515         | 575            | 4,042               |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| ELSWEDY ELECTRIC CO           |                            | 415         | —           | —              | —                   |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| FAWRY FOR BANKING & PAYMENT   |                            | —           | 716         | 346            | 2,438               |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 1,843<br>3  | 2,449<br>3  | 6,171<br>—     | 43,379<br><0.1%>    |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| (南アフリカ)                       |                            |             |             | 千ランド           |                     | 金属・鉱業<br>コングロマリット<br>食品・生活必需品小売り<br>保険<br>金属・鉱業<br>各種金融サービス<br>金属・鉱業<br>金属・鉱業<br>石油・ガス・消耗燃料<br>銀行<br>無線通信サービス<br>金属・鉱業<br>各種金融サービス<br>インターネット販売・通信販売<br>銀行<br>金属・鉱業<br>化学<br>食品・生活必需品小売り<br>銀行<br>食品・生活必需品小売り<br>複合小売り<br>医薬品<br>食品<br>保険<br>金属・鉱業<br>金属・鉱業<br>無線通信サービス |
| AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD  |                            | 70          | 70          | 1,699          | 13,614              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| BIDVEST GROUP LTD             |                            | 172         | 255         | 5,206          | 41,704              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| CLICKS GROUP LTD              |                            | 183         | 183         | 5,128          | 41,081              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| DISCOVERY LTD                 |                            | 258         | 469         | 6,574          | 52,665              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| GOLD FIELDS LTD               |                            | 596         | 716         | 13,818         | 110,688             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| REMGRO LTD                    |                            | 332         | 473         | 6,385          | 51,147              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| NORTHAM PLATINUM LTD          |                            | 267         | —           | —              | —                   |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD    |                            | 408         | 408         | 2,408          | 19,288              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| EXXARO RESOURCES LTD          |                            | 150         | 150         | 2,907          | 23,287              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| CAPIPEC BANK HOLDINGS LTD     |                            | 54          | 64          | 12,866         | 103,063             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| MTN GROUP LTD                 |                            | 1,300       | 1,330       | 21,764         | 174,330             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD         |                            | 310         | 350         | 10,201         | 81,716              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| FIRSTRAND LTD                 |                            | 3,290       | 4,100       | 26,625         | 213,269             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| NASPERS LTD-N SHS             |                            | 312         | 167         | 23,962         | 191,939             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| NEDBANK GROUP LTD             |                            | 319         | 357         | 7,320          | 58,639              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD   |                            | 41          | 41          | 6,459          | 51,744              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| SASOL LTD                     |                            | 438         | 438         | 16,169         | 129,515             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD         |                            | 396         | 396         | 8,509          | 68,159              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| STANDARD BANK GROUP LTD       |                            | 911         | 1,058       | 16,692         | 133,703             |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| SPAR GROUP LIMITED/THE        |                            | 153         | 153         | 2,378          | 19,052              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD       |                            | 616         | 940         | 5,085          | 40,734              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT  |                            | 315         | 315         | 4,788          | 38,351              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| TIGER BRANDS LTD              |                            | 128         | 128         | 1,858          | 14,885              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| SANLAM LIMITED                |                            | 1,193       | 1,490       | 9,039          | 72,409              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD  |                            | 557         | 652         | 12,169         | 97,478              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| KUMBA IRON ORE LTD            |                            | 39          | 39          | 1,823          | 14,608              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| VODACOM GROUP                 |                            | 517         | 517         | 7,621          | 61,044              |                                                                                                                                                                                                                                                                         |

| 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     | 千ランド        | 千円        |             |
| NEPI ROCKCASTLE PLC                   |               | 262     | 419    | 3,789       | 30,350    | 不動産管理・開発    |
| OLD MUTUAL LTD                        |               | 2,940   | 2,940  | 3,422       | 27,411    | 保険          |
| REINET INVESTMENTS SCA                |               | 87      | 87     | 2,680       | 21,467    | 資本市場        |
| ABSA GROUP LTD                        |               | 552     | 552    | 8,721       | 69,855    | 銀行          |
| PEPKOR HOLDINGS LTD                   |               | —       | 960    | 1,872       | 14,994    | 専門小売り       |
| MULTICHOICE GROUP LTD                 |               | 266     | 266    | 3,375       | 27,037    | メディア        |
| MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS        |               | —       | 201    | 313         | 2,511     | 保険          |
| SIBANYE STILLWATER LTD                |               | 2,050   | 2,050  | 9,727       | 77,915    | 金属・鉱業       |
| NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT          |               | —       | 267    | 4,506       | 36,094    | 金属・鉱業       |
| RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD |               | 403     | —      | —           | —         | 保険          |
| MR PRICE GROUP LTD                    |               | 167     | 167    | 3,281       | 26,286    | 専門小売り       |
| BID CORP LTD                          |               | 228     | 273    | 8,127       | 65,098    | 食品・生活必需品小売り |
| 小 計                                   | 株 数 ・ 金 額     | 20,283  | 23,445 | 289,281     | 2,317,146 |             |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 36      | 37     | —           | <3.3%>    |             |
| (クウェート)                               |               |         |        | 千クウェートディナール |           |             |
| KUWAIT FINANCE HOUSE                  |               | 3,432   | 4,213  | 414         | 176,167   | 銀行          |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO          |               | 1,390   | 1,890  | 125         | 53,195    | 無線通信サービス    |
| GULF BANK                             |               | 980     | —      | —           | —         | 銀行          |
| NATIONAL BANK OF KUWAIT               |               | 4,983   | 5,554  | 593         | 251,834   | 銀行          |
| AGILITY                               |               | 720     | 1,120  | 139         | 59,195    | 航空貨物・物流サービス |
| MABANEE CO SAKC                       |               | 381     | 404    | 33          | 14,080    | 不動産管理・開発    |
| BOUBYAN BANK K.S.C                    |               | 714     | 749    | 74          | 31,603    | 銀行          |
| 小 計                                   | 株 数 ・ 金 額     | 12,600  | 13,931 | 1,380       | 586,075   |             |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 7       | 6      | —           | <0.8%>    |             |
| (サウジアラビア)                             |               |         |        | 千サウジアラビリアル  |           |             |
| YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL          |               | 199     | 199    | 1,174       | 40,764    | 化学          |
| JARIR MARKETING CO                    |               | 37      | 37     | 690         | 23,984    | 専門小売り       |
| CO FOR COOPERATIVE INSURANCE          |               | 27      | 27     | 185         | 6,449     | 保険          |
| ETIHAD ETISALAT CO                    |               | 239     | 239    | 1,034       | 35,930    | 無線通信サービス    |
| SAUDI BRITISH BANK                    |               | 611     | 611    | 2,828       | 98,220    | 銀行          |
| AL RAJHI BANK                         |               | 868     | 1,563  | 17,601      | 611,128   | 銀行          |
| ARAB NATIONAL BANK                    |               | 478     | 478    | 1,610       | 55,929    | 銀行          |
| BANK ALBILAD                          |               | 233     | 426    | 2,193       | 76,142    | 銀行          |
| BANK AL - JAZIRA                      |               | 341     | 341    | 1,058       | 36,761    | 銀行          |
| BANQUE SAUDI FRANSI                   |               | 374     | 492    | 2,725       | 94,635    | 銀行          |
| RIYAD BANK                            |               | 975     | 1,118  | 4,717       | 163,807   | 銀行          |
| SAUDI TELECOM CO                      |               | 436     | 481    | 5,733       | 199,067   | 各種電気通信サービス  |
| SABIC AGRI-NUTRIENTS CO               |               | 166     | 166    | 2,669       | 92,677    | 化学          |
| SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP           |               | 659     | 711    | 9,015       | 313,017   | 化学          |
| SAUDI CEMENT                          |               | 64      | —      | —           | —         | 建設資材        |
| SAUDI ELECTRICITY CO                  |               | 582     | 582    | 1,588       | 55,165    | 電力          |
| SAUDI IND INVESTMENT GROUP            |               | 187     | 293    | 970         | 33,699    | 化学          |
| SAVOLA                                |               | 166     | 166    | 586         | 20,374    | 食品          |
| NATIONAL INDUSTRIALIZATION C          |               | 280     | 280    | 568         | 19,734    | 化学          |
| ALMARAI CO                            |               | 180     | 180    | 963         | 33,435    | 食品          |
| SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP          |               | —       | 28     | 739         | 25,665    | メディア        |
| EMAAR ECONOMIC CITY                   |               | 350     | 350    | 387         | 13,440    | 不動産管理・開発    |
| SAHARA INTERNATIONAL PETROCH          |               | 293     | 293    | 1,626       | 56,459    | 化学          |
| ADVANCED PETROCHEMICALS CO            |               | 90      | 108    | 717         | 24,899    | 化学          |
| SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO          |               | 470     | 670    | 1,235       | 42,895    | 化学          |
| DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV          |               | 230     | 530    | 590         | 20,499    | 不動産管理・開発    |
| RABIGH REFINING AND PETROCHE          |               | 96      | 96     | 288         | 10,016    | 石油・ガス・消耗燃料  |

| 銘                                 |               | 柄 | 期首(前期末)   | 当 期 末     |            | 業 種 等      |                         |
|-----------------------------------|---------------|---|-----------|-----------|------------|------------|-------------------------|
|                                   |               |   | 株 数       | 株 数       | 評 価 額      |            | 外貨建金額                   |
| (サウジアラビア)                         |               |   | 百株        | 百株        | 千サウジアラビリアル | 千円         |                         |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY |               |   | 290       | 290       | 407        | 14,156     | 無線通信サービス                |
| BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE       |               |   | 39        | 39        | 651        | 22,613     | 保険                      |
| ALINMA BANK                       |               |   | 800       | 810       | 3,385      | 117,554    | 銀行                      |
| ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS        |               |   | 37        | 37        | 421        | 14,644     | 食品・生活必需品小売り             |
| SAUDI ARABIAN MINING CO           |               |   | 282       | 351       | 4,640      | 161,108    | 金属・鉱業                   |
| MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO      |               |   | —         | 34        | 836        | 29,039     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SAUDI AIRLINES CATERING CO        |               |   | 12        | —         | —          | —          | 商業サービス・用品               |
| SAUDI ARABIAN OIL CO              |               |   | 1,569     | 1,690     | 7,765      | 269,619    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL      |               |   | 30        | 51        | 1,028      | 35,697     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| THE SAUDI NATIONAL BANK           |               |   | 1,572     | 1,721     | 13,647     | 473,842    | 銀行                      |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額     |   | 13,263    | 15,490    | 96,286     | 3,343,079  |                         |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > |   | 35        | 35        | —          | < 4.8% >   |                         |
| 合 計                               | 株 数 ・ 金 額     |   | 1,569,465 | 1,798,251 | —          | 63,176,863 |                         |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > |   | 922       | 914       | —          | < 90.8% >  |                         |

\* 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。

\* 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。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 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。

外国新株予約権証券

2022年5月10日現在の組入れはございません。

| 銘柄                     |    | 期首(前期末) |        |
|------------------------|----|---------|--------|
|                        |    | 証       | 券数     |
| (タイ)                   |    |         | 証券     |
| MINOR INTL PCL(R)-CW23 |    |         | 9,344  |
| MINOR INTL PCL(R)-CW24 |    |         | 8,468  |
| 合計                     | 証  | 券       | 数      |
|                        | 銘柄 |         | 数      |
|                        |    |         | 17,812 |
|                        |    |         | 2      |

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        | %   |
| ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF |               | 3,674,400 | 4,381,400 | 20,577  | 2,675,659 | 3.8 |
| 小 計                            | 口 数 ・ 金 額     | 3,674,400 | 4,381,400 | 20,577  | 2,675,659 |     |
|                                | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1         | 1         | —       | <3.8%>    |     |
| (メキシコ)                         |               |           |           | 千メキシコペソ |           |     |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA    |               | 208,100   | 234,000   | 5,239   | 33,342    | 0.0 |
| OPERADORA DE SITES MEX- A-1    |               | —         | 111,000   | 2,761   | 17,575    | 0.0 |
| 小 計                            | 口 数 ・ 金 額     | 208,100   | 345,000   | 8,000   | 50,917    |     |
|                                | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1         | 2         | —       | <0.1%>    |     |
| (南アフリカ)                        |               |           |           | 千ランド    |           |     |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD     |               | 191,000   | 300,000   | 3,960   | 31,719    | 0.0 |
| 小 計                            | 口 数 ・ 金 額     | 191,000   | 300,000   | 3,960   | 31,719    |     |
|                                | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1         | 1         | —       | <0.0%>    |     |
| 合 計                            | 口 数 ・ 金 額     | 4,073,500 | 5,026,400 | —       | 2,758,296 |     |
|                                | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3         | 4         | —       | <4.0%>    |     |

\* 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。  
\* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。  
\* 金額の単位未満は切り捨て。  
\* 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 | MSCICHA | 百万円         |
|       |        | 536     | —           |
|       |        | MSCIN   | 3,042       |

\* 単位未満は切り捨て。  
\* 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5月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末            |
|--------------|------------------|
|              | 評 価 額 比 率        |
|              | 千円 %             |
| 株式           | 63,176,863 90.3  |
| 投資信託受益証券     | 2,675,659 3.8    |
| 投資証券         | 82,637 0.1       |
| コール・ローン等、その他 | 4,058,395 5.8    |
| 投資信託財産総額     | 69,993,554 100.0 |

\* 金額の単位未満は切り捨て。  
\* 当期末における外貨建純資産（69,517,377千円）の投資信託財産総額（69,993,554千円）に対する比率は99.3%です。  
\* 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 カタールリヤル=35.62円、1 米ドル=130.03円、1 トルコリラ=8.607円、1 ユーロ=137.27円、1 チェココルナ=5.4838円、1 フォリント=0.360792円、1 ズロチ=29.2257円、1 香港ドル=16.56円、1 リンギ=29.6633円、1 パーツ=3.76円、1 フィリピンペソ=2.4685円、1 ルピア=0.0089円、1 ウォン=0.1019円、1 新台湾ドル=4.3639円、1 インドルピー=1.69円、1 メキシコペソ=6.364円、1 レアル=25.1894円、1 チリペソ=0.149672円、1 コロンビアペソ=0.031792円、1 UAEディルハム=35.36円、1 エジプトポンド=7.0296円、1 ランド=8.01円、1 クウェートディナール=424.52円、1 サウジアラビアリヤル=34.72円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年5月10日現在）

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 70,058,567,710  |
| コール・ローン等        | 2,811,550,509   |
| 株式(評価額)         | 63,176,863,956  |
| 投資信託受益証券(評価額)   | 2,675,659,180   |
| 投資証券(評価額)       | 82,637,582      |
| 未収入金            | 83,913,058      |
| 未収配当金           | 113,348,568     |
| 差入委託証拠金         | 1,114,594,857   |
| (B) 負債          | 450,343,141     |
| 未払金             | 370,258,056     |
| 未払解約金           | 75,896,420      |
| 未払利息            | 65              |
| その他未払費用         | 4,188,600       |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 69,608,224,569  |
| 元本              | 45,820,572,205  |
| 次期繰越損益金         | 23,787,652,364  |
| (D) 受益権総口数      | 45,820,572,205口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 15,191円         |

(注) 期首元本額は39,964,682,518円、期中追加設定元本額は10,742,911,245円、期中一部解約元本額は4,887,021,558円、1口当たり純資産額は15191円です。

○損益の状況（2021年5月11日～2022年5月10日）

| 項 目                | 当 期             |
|--------------------|-----------------|
|                    | 円               |
| (A) 配当等収益          | 1,657,059,150   |
| 受取配当金              | 1,657,099,903   |
| 受取利息               | 3,209           |
| 支払利息               | △ 43,962        |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 6,737,230,119 |
| 売買益                | 15,275,287,661  |
| 売買損                | △22,012,517,780 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 1,028,766,673 |
| 取引益                | 275,634,603     |
| 取引損                | △ 1,304,401,276 |
| (D) 保管費用等          | △ 44,795,130    |
| (E) 当期損益金(A＋B＋C＋D) | △ 6,153,732,772 |
| (F) 前期繰越損益金        | 26,145,576,840  |
| (G) 追加信託差損益金       | 6,658,095,152   |
| (H) 解約差損益金         | △ 2,862,286,856 |
| (I) 計(E＋F＋G＋H)     | 23,787,652,364  |
| 次期繰越損益金(I)         | 23,787,652,364  |

\* 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。  
\* 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。  
\* 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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                                                       | 当期末<br>元本額     |
|-------------------------------------------------------------|----------------|
|                                                             | 円              |
| 野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)                                 | 31,097,020,629 |
| 野村つみたて外国株投信                                                 | 4,234,871,470  |
| 野村インデックスファンド・新興国株式                                          | 3,598,400,657  |
| 野村外国株(含む新興国)インデックスBコース(野村投資一任口座向け)                          | 1,820,628,714  |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式                                      | 1,258,487,455  |
| NST RINGS 新興国株式・NST Emerging Market インデックス(為替ヘッジなし) 連動型上場投信 | 1,255,327,673  |
| 野村外国株(含む新興国)インデックスAコース(野村投資一任口座向け)                          | 987,160,031    |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス                                      | 471,082,566    |
| ノムラPOF's用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用)                        | 422,808,645    |
| 世界6資産分散ファンド                                                 | 109,121,978    |
| 野村資産設計ファンド2040                                              | 90,860,075     |
| 野村DC運用戦略ファンド                                                | 76,113,848     |
| 野村資産設計ファンド2030                                              | 56,599,236     |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)                               | 53,641,944     |
| 野村資産設計ファンド2035                                              | 48,350,320     |
| 野村資産設計ファンド2025                                              | 38,080,775     |
| 野村資産設計ファンド2050                                              | 22,657,912     |
| 野村資産設計ファンド2020                                              | 21,512,338     |
| 野村資産設計ファンド2015                                              | 20,909,655     |

| ファンド名                                           | 当期末<br>元本額 |
|-------------------------------------------------|------------|
|                                                 | 円          |
| 野村資産設計ファンド2045                                  | 18,049,413 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030                     | 16,824,924 |
| 野村資産設計ファンド2060                                  | 16,121,739 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040                     | 15,129,737 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050                     | 11,913,204 |
| インデックス・ブレンド(タイプV)                               | 10,791,449 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060                     | 7,805,696  |
| インデックス・ブレンド(タイプIII)                             | 6,970,547  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型                | 6,706,380  |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)                              | 5,458,820  |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)                  | 4,330,328  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型                | 3,759,573  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型                | 2,950,039  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型                | 2,552,962  |
| ネクストコア                                          | 2,441,227  |
| インデックス・ブレンド(タイプIV)                              | 2,393,111  |
| インデックス・ブレンド(タイプI)                               | 1,052,011  |
| インデックス・ブレンド(タイプII)                              | 851,689    |
| 野村POF's用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 833,435    |

○お知らせ

該当事項はございません。

# 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2022年3月31日）

作成対象期間（2021年4月1日～2022年3月31日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                     |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主な投資対象 | わが国の公社債を主要投資対象とします。                                                                 |
| 主な投資制限 | 株式への投資は行いません。                                                                       |

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近５期の運用実績

| 決 算 期           | 基 準 価 額 |      | ベ ン チ マ ー ク    |       | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|---------|------|----------------|-------|-----------|-----------|---------|
|                 | 期 騰 落   | 中 率  | NOMURA-BPI 総 合 | 期 騰 落 |           |           |         |
|                 | 円       | %    |                | %     | %         | %         | 百万円     |
| 16期(2018年４月２日)  | 13,114  | 0.9  | 381.893        | 0.9   | 99.6      | —         | 672,515 |
| 17期(2019年４月１日)  | 13,342  | 1.7  | 388.518        | 1.7   | 99.3      | —         | 663,317 |
| 18期(2020年３月31日) | 13,340  | △0.0 | 388.450        | △0.0  | 98.1      | —         | 679,315 |
| 19期(2021年３月31日) | 13,248  | △0.7 | 385.724        | △0.7  | 99.5      | —         | 735,829 |
| 20期(2022年３月31日) | 13,090  | △1.2 | 381.037        | △1.2  | 99.8      | —         | 833,820 |

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、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うものではありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

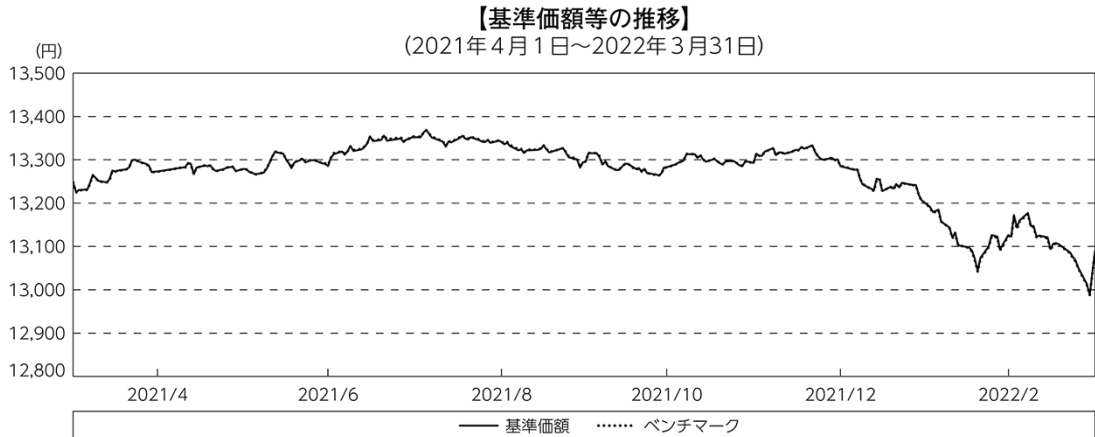
| 年 月 日               | 基 準 価 額 |      | ベ ン チ マ ー ク    |      | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|------|----------------|------|-----------|-----------|
|                     | 騰 落     | 率    | NOMURA-BPI 総 合 | 騰 落  |           |           |
|                     | 円       | %    |                | %    | %         | %         |
| (期 首)<br>2021年３月31日 | 13,248  | —    | 385.724        | —    | 99.5      | —         |
| ４月末                 | 13,273  | 0.2  | 386.440        | 0.2  | 99.2      | —         |
| ５月末                 | 13,279  | 0.2  | 386.621        | 0.2  | 99.2      | —         |
| ６月末                 | 13,286  | 0.3  | 386.903        | 0.3  | 99.6      | —         |
| ７月末                 | 13,352  | 0.8  | 388.809        | 0.8  | 98.6      | —         |
| ８月末                 | 13,341  | 0.7  | 388.461        | 0.7  | 99.3      | —         |
| ９月末                 | 13,296  | 0.4  | 387.116        | 0.4  | 99.1      | —         |
| 10月末                | 13,283  | 0.3  | 386.721        | 0.3  | 99.4      | —         |
| 11月末                | 13,314  | 0.5  | 387.655        | 0.5  | 99.1      | —         |
| 12月末                | 13,285  | 0.3  | 386.841        | 0.3  | 99.0      | —         |
| 2022年１月末            | 13,192  | △0.4 | 384.056        | △0.4 | 99.0      | —         |
| ２月末                 | 13,126  | △0.9 | 382.128        | △0.9 | 99.0      | —         |
| (期 末)<br>2022年３月31日 | 13,090  | △1.2 | 381.037        | △1.2 | 99.8      | —         |

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

当運用期間では、国内債券利回りが上昇（価格は下落）したことから基準価額は下落しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

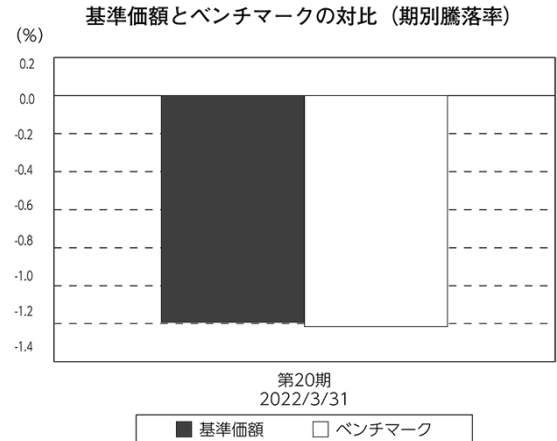
NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ない、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した債券銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間の基準価額の騰落率は－1.2％となり、ベンチマークの－1.2％と同程度となりました。

### (その他要因)

ベンチマークとファンドで評価時価に違いがあること。



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

## ◎今後の運用方針

当ファンドでは引き続き、債券組入比率を高位に保ち、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせることで、NOMURA-BPI総合との連動をできる限り高めるように運用を行なってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年 4 月 1 日～2022年 3 月31日)

該当事項はございません。

## ○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2021年 4 月 1 日～2022年 3 月31日)

## 公社債

|                |                | 買 付 額       | 売 付 額                    |
|----------------|----------------|-------------|--------------------------|
| 国<br><br><br>内 |                | 千円          | 千円                       |
|                | 国債証券           | 212,494,042 | 121,317,552              |
|                | 地方債証券          | 14,065,897  | 6,914,283<br>( 15,360)   |
|                | 特殊債券           | 16,137,272  | 11,490,114<br>( 980,037) |
|                | 社債券（投資法人債券を含む） | 15,233,423  | 1,720,414                |

\*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）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。

\*社債券（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 4 月 1 日～2022年 3 月31日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況 B |               | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況 D |               |
|-----|----------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|---------------|
|     |                |                     | $\frac{B}{A}$ |                |                     | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円<br>257,930 | 百万円<br>907          | %<br>0.4      | 百万円<br>141,442 | 百万円<br>1,459        | %<br>1.0      |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2022年3月31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B B格以下<br>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                | 642,295,000<br>( 2,960,000)  | 667,251,907<br>( 3,995,904)  | 80.0<br>( 0.5) | —<br>(—)            | 53.2<br>( 0.5) | 18.4<br>( 0.0) | 8.5<br>( —)    |
| 地方債証券               | 55,428,320<br>( 55,428,320)  | 57,337,944<br>( 57,337,944)  | 6.9<br>( 6.9)  | —<br>(—)            | 3.7<br>( 3.7)  | 2.5<br>( 2.5)  | 0.7<br>( 0.7)  |
| 特殊債券<br>(除く金融債)     | 60,880,889<br>( 60,880,889)  | 63,220,691<br>( 63,220,691)  | 7.6<br>( 7.6)  | —<br>(—)            | 4.0<br>( 4.0)  | 2.4<br>( 2.4)  | 1.2<br>( 1.2)  |
| 金融債券                | 3,100,000<br>( 3,100,000)    | 3,095,895<br>( 3,095,895)    | 0.4<br>( 0.4)  | —<br>(—)            | —<br>( —)      | 0.3<br>( 0.3)  | 0.0<br>( 0.0)  |
| 普通社債券<br>(含む投資法人債券) | 40,705,000<br>( 40,705,000)  | 40,993,825<br>( 40,993,825)  | 4.9<br>( 4.9)  | —<br>(—)            | 2.6<br>( 2.6)  | 1.8<br>( 1.8)  | 0.5<br>( 0.5)  |
| 合 計                 | 802,409,209<br>(163,074,209) | 831,900,264<br>(168,644,261) | 99.8<br>(20.2) | —<br>(—)            | 63.6<br>(10.8) | 25.4<br>( 7.0) | 10.8<br>( 2.4) |

\* ( ) 内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*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。

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄   | 柄              | 当期 末  |           |           |            |
|------|----------------|-------|-----------|-----------|------------|
|      |                | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券 |                | %     | 千円        | 千円        |            |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第424回  | 0.005 | 2,600,000 | 2,602,106 | 2023/5/1   |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第426回  | 0.005 | 1,500,000 | 1,501,395 | 2023/7/1   |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第427回  | 0.005 | 6,800,000 | 6,806,324 | 2023/8/1   |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第428回  | 0.005 | 2,400,000 | 2,402,208 | 2023/9/1   |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第429回  | 0.005 | 1,500,000 | 1,501,455 | 2023/10/1  |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第431回  | 0.005 | 3,000,000 | 3,003,000 | 2023/12/1  |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第433回  | 0.005 | 3,500,000 | 3,503,185 | 2024/2/1   |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第136回  | 0.1   | 4,300,000 | 4,308,901 | 2023/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第137回  | 0.1   | 6,600,000 | 6,615,510 | 2023/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第138回  | 0.1   | 7,100,000 | 7,118,318 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第139回  | 0.1   | 6,700,000 | 6,718,425 | 2024/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第140回  | 0.1   | 5,100,000 | 5,115,810 | 2024/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第141回  | 0.1   | 9,600,000 | 9,631,968 | 2024/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第142回  | 0.1   | 1,200,000 | 1,204,404 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第143回  | 0.1   | 6,070,000 | 6,094,280 | 2025/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第144回  | 0.1   | 4,400,000 | 4,418,392 | 2025/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第145回  | 0.1   | 3,900,000 | 3,916,224 | 2025/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第146回  | 0.1   | 2,100,000 | 2,108,988 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第147回  | 0.005 | 5,600,000 | 5,602,184 | 2026/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第148回  | 0.005 | 7,300,000 | 7,300,000 | 2026/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第149回  | 0.005 | 7,100,000 | 7,096,805 | 2026/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第150回  | 0.005 | 4,000,000 | 3,996,200 | 2026/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第1回   | 2.4   | 2,860,000 | 3,894,090 | 2048/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第2回   | 2.2   | 900,000   | 1,183,419 | 2049/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第3回   | 2.2   | 900,000   | 1,190,673 | 2050/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第4回   | 2.2   | 1,630,000 | 2,169,204 | 2051/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第5回   | 2.0   | 1,200,000 | 1,542,480 | 2052/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第6回   | 1.9   | 1,300,000 | 1,646,723 | 2053/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第7回   | 1.7   | 1,400,000 | 1,705,550 | 2054/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第8回   | 1.4   | 1,500,000 | 1,705,845 | 2055/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第9回   | 0.4   | 3,550,000 | 3,013,737 | 2056/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第10回  | 0.9   | 2,010,000 | 1,996,713 | 2057/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第11回  | 0.8   | 1,750,000 | 1,684,130 | 2058/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第12回  | 0.5   | 2,070,000 | 1,793,075 | 2059/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第13回  | 0.5   | 7,020,000 | 6,054,048 | 2060/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第14回  | 0.7   | 4,460,000 | 4,113,636 | 2061/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第329回 | 0.8   | 6,000,000 | 6,063,660 | 2023/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第330回 | 0.8   | 3,800,000 | 3,848,108 | 2023/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第331回 | 0.6   | 1,900,000 | 1,918,449 | 2023/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第332回 | 0.6   | 5,900,000 | 5,966,021 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第333回 | 0.6   | 3,600,000 | 3,645,324 | 2024/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第334回 | 0.6   | 6,600,000 | 6,693,786 | 2024/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第335回 | 0.5   | 4,600,000 | 4,660,858 | 2024/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第336回 | 0.5   | 2,750,000 | 2,790,040 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第337回 | 0.3   | 3,000,000 | 3,027,360 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第338回 | 0.4   | 9,000,000 | 9,116,280 | 2025/3/20  |

| 銘柄   |    |       |       | 当 期 末 |            |            |            |
|------|----|-------|-------|-------|------------|------------|------------|
|      |    |       |       | 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券 |    |       |       | %     | 千円         | 千円         |            |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第339回 | 0.4   | 5,000,000  | 5,069,250  | 2025/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第340回 | 0.4   | 2,700,000  | 2,739,366  | 2025/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第341回 | 0.3   | 5,800,000  | 5,867,976  | 2025/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第342回 | 0.1   | 6,550,000  | 6,577,248  | 2026/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第343回 | 0.1   | 9,500,000  | 9,538,000  | 2026/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第344回 | 0.1   | 6,400,000  | 6,424,256  | 2026/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第345回 | 0.1   | 7,000,000  | 7,024,710  | 2026/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第346回 | 0.1   | 5,100,000  | 5,117,697  | 2027/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第347回 | 0.1   | 5,400,000  | 5,416,848  | 2027/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第348回 | 0.1   | 5,800,000  | 5,817,400  | 2027/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第349回 | 0.1   | 2,800,000  | 2,807,168  | 2027/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第350回 | 0.1   | 10,150,000 | 10,171,112 | 2028/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第351回 | 0.1   | 6,000,000  | 6,009,240  | 2028/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第352回 | 0.1   | 6,400,000  | 6,406,144  | 2028/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第353回 | 0.1   | 1,200,000  | 1,200,396  | 2028/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第354回 | 0.1   | 1,850,000  | 1,850,000  | 2029/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第355回 | 0.1   | 2,600,000  | 2,597,192  | 2029/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第356回 | 0.1   | 4,800,000  | 4,791,072  | 2029/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第357回 | 0.1   | 1,900,000  | 1,894,908  | 2029/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第358回 | 0.1   | 5,470,000  | 5,450,581  | 2030/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第359回 | 0.1   | 10,600,000 | 10,552,618 | 2030/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第360回 | 0.1   | 10,900,000 | 10,840,704 | 2030/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第361回 | 0.1   | 7,400,000  | 7,352,270  | 2030/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第362回 | 0.1   | 8,500,000  | 8,436,250  | 2031/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第363回 | 0.1   | 10,450,000 | 10,360,025 | 2031/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第364回 | 0.1   | 8,650,000  | 8,565,576  | 2031/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (10年) | 第365回 | 0.1   | 7,500,000  | 7,421,400  | 2031/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第1回   | 2.8   | 500,000    | 599,445    | 2029/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第2回   | 2.4   | 500,000    | 588,645    | 2030/2/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第3回   | 2.3   | 160,000    | 187,795    | 2030/5/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第4回   | 2.9   | 1,400,000  | 1,727,572  | 2030/11/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第5回   | 2.2   | 150,000    | 177,307    | 2031/5/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第6回   | 2.4   | 600,000    | 725,502    | 2031/11/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第7回   | 2.3   | 600,000    | 724,794    | 2032/5/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第8回   | 1.8   | 100,000    | 116,311    | 2032/11/22 |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第9回   | 1.4   | 265,000    | 297,125    | 2032/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第10回  | 1.1   | 250,000    | 272,682    | 2033/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第11回  | 1.7   | 160,000    | 185,216    | 2033/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第12回  | 2.1   | 220,000    | 265,089    | 2033/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第13回  | 2.0   | 290,000    | 346,799    | 2033/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第14回  | 2.4   | 800,000    | 996,376    | 2034/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第15回  | 2.5   | 900,000    | 1,135,386  | 2034/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第16回  | 2.5   | 915,000    | 1,156,990  | 2034/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第17回  | 2.4   | 1,200,000  | 1,506,924  | 2034/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第18回  | 2.3   | 2,200,000  | 2,740,628  | 2035/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第19回  | 2.3   | 2,050,000  | 2,558,297  | 2035/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第20回  | 2.5   | 1,270,000  | 1,622,310  | 2035/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 | (30年) | 第21回  | 2.3   | 300,000    | 376,092    | 2035/12/20 |

| 銘柄   |               | 当 期 末 |           |           |             |
|------|---------------|-------|-----------|-----------|-------------|
|      |               | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日   |
| 国債証券 |               | %     | 千円        | 千円        |             |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第22回 | 2.5   | 600,000   | 770,238   | 2036/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第23回 | 2.5   | 840,000   | 1,080,231 | 2036/ 6 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第24回 | 2.5   | 700,000   | 902,321   | 2036/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第25回 | 2.3   | 500,000   | 631,625   | 2036/12/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第26回 | 2.4   | 850,000   | 1,088,527 | 2037/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第27回 | 2.5   | 3,550,000 | 4,612,621 | 2037/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第28回 | 2.5   | 1,200,000 | 1,565,292 | 2038/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第29回 | 2.4   | 1,500,000 | 1,939,605 | 2038/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第30回 | 2.3   | 1,700,000 | 2,175,184 | 2039/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第31回 | 2.2   | 1,200,000 | 1,519,224 | 2039/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第32回 | 2.3   | 1,200,000 | 1,542,108 | 2040/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第33回 | 2.0   | 2,400,000 | 2,963,640 | 2040/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第34回 | 2.2   | 3,300,000 | 4,199,118 | 2041/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第35回 | 2.0   | 2,300,000 | 2,851,425 | 2041/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第36回 | 2.0   | 2,000,000 | 2,485,960 | 2042/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第37回 | 1.9   | 2,300,000 | 2,821,962 | 2042/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第38回 | 1.8   | 1,600,000 | 1,935,936 | 2043/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第39回 | 1.9   | 1,400,000 | 1,723,106 | 2043/ 6 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第40回 | 1.8   | 1,300,000 | 1,575,743 | 2043/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第41回 | 1.7   | 1,500,000 | 1,789,545 | 2043/12/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第42回 | 1.7   | 1,600,000 | 1,910,080 | 2044/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第43回 | 1.7   | 1,300,000 | 1,552,954 | 2044/ 6 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第44回 | 1.7   | 1,400,000 | 1,673,462 | 2044/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第45回 | 1.5   | 1,700,000 | 1,960,831 | 2044/12/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第46回 | 1.5   | 1,800,000 | 2,076,696 | 2045/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第47回 | 1.6   | 1,700,000 | 1,997,602 | 2045/ 6 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第48回 | 1.4   | 1,900,000 | 2,150,762 | 2045/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第49回 | 1.4   | 2,900,000 | 3,282,887 | 2045/12/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第50回 | 0.8   | 1,900,000 | 1,901,900 | 2046/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第51回 | 0.3   | 2,650,000 | 2,357,254 | 2046/ 6 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第52回 | 0.5   | 1,900,000 | 1,770,667 | 2046/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第53回 | 0.6   | 1,700,000 | 1,619,794 | 2046/12/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第54回 | 0.8   | 1,700,000 | 1,692,945 | 2047/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第55回 | 0.8   | 1,500,000 | 1,492,170 | 2047/ 6 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第56回 | 0.8   | 1,900,000 | 1,886,016 | 2047/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第57回 | 0.8   | 1,600,000 | 1,584,784 | 2047/12/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第58回 | 0.8   | 2,100,000 | 2,077,656 | 2048/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第59回 | 0.7   | 1,600,000 | 1,541,920 | 2048/ 6 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第60回 | 0.9   | 1,150,000 | 1,159,913 | 2048/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第61回 | 0.7   | 1,500,000 | 1,438,470 | 2048/12/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第62回 | 0.5   | 1,500,000 | 1,362,405 | 2049/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第63回 | 0.4   | 1,400,000 | 1,233,470 | 2049/ 6 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第64回 | 0.4   | 1,500,000 | 1,318,830 | 2049/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第65回 | 0.4   | 2,200,000 | 1,932,370 | 2049/12/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第66回 | 0.4   | 2,600,000 | 2,283,996 | 2050/ 3 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第67回 | 0.6   | 1,800,000 | 1,665,360 | 2050/ 6 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第68回 | 0.6   | 1,950,000 | 1,803,106 | 2050/ 9 /20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第69回 | 0.7   | 2,200,000 | 2,090,044 | 2050/12/20  |

| 銘柄   |                | 当期末 |           |           |            |
|------|----------------|-----|-----------|-----------|------------|
|      |                | 利 率 | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券 |                | %   | 千円        | 千円        |            |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第70回  | 0.7 | 1,610,000 | 1,527,229 | 2051/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第71回  | 0.7 | 2,400,000 | 2,275,776 | 2051/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第72回  | 0.7 | 1,300,000 | 1,230,827 | 2051/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第73回  | 0.7 | 500,000   | 473,220   | 2051/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第62回  | 0.8 | 440,000   | 444,668   | 2023/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第63回  | 1.8 | 300,000   | 306,843   | 2023/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第64回  | 1.9 | 400,000   | 411,544   | 2023/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第65回  | 1.9 | 455,000   | 470,274   | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第66回  | 1.8 | 300,000   | 309,555   | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第67回  | 1.9 | 310,000   | 321,838   | 2024/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第68回  | 2.2 | 290,000   | 302,786   | 2024/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第69回  | 2.1 | 560,000   | 583,587   | 2024/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第70回  | 2.4 | 540,000   | 569,197   | 2024/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第71回  | 2.2 | 200,000   | 209,926   | 2024/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第72回  | 2.1 | 1,470,000 | 1,547,616 | 2024/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第73回  | 2.0 | 1,200,000 | 1,266,492 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第74回  | 2.1 | 800,000   | 846,504   | 2024/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第75回  | 2.1 | 600,000   | 638,046   | 2025/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第76回  | 1.9 | 910,000   | 962,297   | 2025/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第77回  | 2.0 | 700,000   | 742,308   | 2025/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第78回  | 1.9 | 800,000   | 849,752   | 2025/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第79回  | 2.0 | 860,000   | 916,252   | 2025/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第80回  | 2.1 | 1,400,000 | 1,496,082 | 2025/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第81回  | 2.0 | 360,000   | 385,257   | 2025/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第82回  | 2.1 | 820,000   | 880,384   | 2025/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第83回  | 2.1 | 1,370,000 | 1,477,860 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第84回  | 2.0 | 1,200,000 | 1,290,012 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第85回  | 2.1 | 400,000   | 433,408   | 2026/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第86回  | 2.3 | 1,700,000 | 1,855,482 | 2026/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第87回  | 2.2 | 500,000   | 543,745   | 2026/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第88回  | 2.3 | 1,100,000 | 1,206,480 | 2026/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第89回  | 2.2 | 470,000   | 513,517   | 2026/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第90回  | 2.2 | 1,500,000 | 1,646,445 | 2026/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第91回  | 2.3 | 250,000   | 275,522   | 2026/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第92回  | 2.1 | 650,000   | 713,589   | 2026/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第93回  | 2.0 | 300,000   | 329,310   | 2027/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第94回  | 2.1 | 200,000   | 220,532   | 2027/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第95回  | 2.3 | 100,000   | 111,770   | 2027/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第96回  | 2.1 | 400,000   | 442,916   | 2027/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第97回  | 2.2 | 300,000   | 335,283   | 2027/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第98回  | 2.1 | 300,000   | 333,645   | 2027/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第99回  | 2.1 | 1,100,000 | 1,228,623 | 2027/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第100回 | 2.2 | 820,000   | 924,336   | 2028/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第101回 | 2.4 | 250,000   | 284,782   | 2028/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第102回 | 2.4 | 1,500,000 | 1,716,405 | 2028/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第103回 | 2.3 | 600,000   | 682,848   | 2028/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第104回 | 2.1 | 400,000   | 450,280   | 2028/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第105回 | 2.1 | 1,900,000 | 2,147,076 | 2028/9/20  |

| 銘柄   |                | 当期末 |           |           |            |
|------|----------------|-----|-----------|-----------|------------|
|      |                | 利 率 | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券 |                | %   | 千円        | 千円        |            |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第106回 | 2.2 | 400,000   | 454,592   | 2028/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第107回 | 2.1 | 300,000   | 340,281   | 2028/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第108回 | 1.9 | 1,600,000 | 1,793,456 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第109回 | 1.9 | 900,000   | 1,012,428 | 2029/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第110回 | 2.1 | 1,100,000 | 1,252,647 | 2029/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第111回 | 2.2 | 800,000   | 919,752   | 2029/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第112回 | 2.1 | 1,800,000 | 2,056,536 | 2029/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第113回 | 2.1 | 2,000,000 | 2,294,080 | 2029/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第114回 | 2.1 | 1,700,000 | 1,956,734 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第115回 | 2.2 | 1,000,000 | 1,158,670 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第116回 | 2.2 | 1,100,000 | 1,279,047 | 2030/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第117回 | 2.1 | 1,400,000 | 1,616,832 | 2030/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第118回 | 2.0 | 500,000   | 575,335   | 2030/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第119回 | 1.8 | 800,000   | 907,536   | 2030/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第120回 | 1.6 | 800,000   | 894,544   | 2030/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第121回 | 1.9 | 1,200,000 | 1,375,080 | 2030/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第122回 | 1.8 | 900,000   | 1,023,786 | 2030/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第123回 | 2.1 | 500,000   | 583,170   | 2030/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第124回 | 2.0 | 1,000,000 | 1,157,750 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第125回 | 2.2 | 1,400,000 | 1,651,006 | 2031/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第126回 | 2.0 | 1,200,000 | 1,393,956 | 2031/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第127回 | 1.9 | 500,000   | 576,400   | 2031/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第128回 | 1.9 | 800,000   | 924,784   | 2031/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第129回 | 1.8 | 1,300,000 | 1,490,983 | 2031/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第130回 | 1.8 | 1,700,000 | 1,954,643 | 2031/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第131回 | 1.7 | 800,000   | 912,384   | 2031/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第132回 | 1.7 | 1,300,000 | 1,486,641 | 2031/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第133回 | 1.8 | 1,400,000 | 1,614,354 | 2031/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第134回 | 1.8 | 1,400,000 | 1,618,106 | 2032/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第135回 | 1.7 | 700,000   | 802,214   | 2032/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第136回 | 1.6 | 700,000   | 795,375   | 2032/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第137回 | 1.7 | 1,000,000 | 1,148,490 | 2032/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第138回 | 1.5 | 800,000   | 902,792   | 2032/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第139回 | 1.6 | 1,000,000 | 1,138,490 | 2032/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第140回 | 1.7 | 2,300,000 | 2,647,047 | 2032/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第141回 | 1.7 | 2,600,000 | 2,998,294 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第142回 | 1.8 | 950,000   | 1,105,467 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第143回 | 1.6 | 1,300,000 | 1,488,123 | 2033/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第144回 | 1.5 | 1,300,000 | 1,474,239 | 2033/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第145回 | 1.7 | 2,300,000 | 2,662,480 | 2033/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第146回 | 1.7 | 2,400,000 | 2,783,400 | 2033/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第147回 | 1.6 | 4,000,000 | 4,599,160 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第148回 | 1.5 | 2,100,000 | 2,393,874 | 2034/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第149回 | 1.5 | 3,850,000 | 4,394,544 | 2034/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第150回 | 1.4 | 3,330,000 | 3,763,532 | 2034/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第151回 | 1.2 | 2,500,000 | 2,765,525 | 2034/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第152回 | 1.2 | 2,650,000 | 2,931,218 | 2035/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第153回 | 1.3 | 1,600,000 | 1,790,912 | 2035/6/20  |

| 銘       |                 | 柄     | 期 末   |             |             |            |
|---------|-----------------|-------|-------|-------------|-------------|------------|
|         |                 |       | 利 率   | 額 面 金 額     | 評 価 額       | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券    |                 |       | %     | 千円          | 千円          |            |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第154回 | 1.2   | 2,120,000   | 2,345,780   | 2035/9/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第155回 | 1.0   | 5,350,000   | 5,778,749   | 2035/12/20 |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第156回 | 0.4   | 4,650,000   | 4,643,815   | 2036/3/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第157回 | 0.2   | 5,540,000   | 5,369,257   | 2036/6/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第158回 | 0.5   | 3,470,000   | 3,500,674   | 2036/9/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第159回 | 0.6   | 4,810,000   | 4,912,982   | 2036/12/20 |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第160回 | 0.7   | 3,000,000   | 3,105,150   | 2037/3/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第161回 | 0.6   | 2,100,000   | 2,138,766   | 2037/6/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第162回 | 0.6   | 1,700,000   | 1,728,135   | 2037/9/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第163回 | 0.6   | 2,600,000   | 2,639,806   | 2037/12/20 |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第164回 | 0.5   | 2,600,000   | 2,594,228   | 2038/3/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第165回 | 0.5   | 2,200,000   | 2,191,772   | 2038/6/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第166回 | 0.7   | 2,300,000   | 2,359,225   | 2038/9/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第167回 | 0.5   | 2,600,000   | 2,578,108   | 2038/12/20 |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第168回 | 0.4   | 2,700,000   | 2,626,938   | 2039/3/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第169回 | 0.3   | 3,030,000   | 2,890,377   | 2039/6/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第170回 | 0.3   | 2,800,000   | 2,662,940   | 2039/9/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第171回 | 0.3   | 2,500,000   | 2,370,375   | 2039/12/20 |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第172回 | 0.4   | 3,840,000   | 3,694,464   | 2040/3/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第173回 | 0.4   | 3,250,000   | 3,117,627   | 2040/6/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第174回 | 0.4   | 3,970,000   | 3,796,908   | 2040/9/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第175回 | 0.5   | 5,500,000   | 5,344,460   | 2040/12/20 |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第176回 | 0.5   | 6,020,000   | 5,837,895   | 2041/3/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第177回 | 0.4   | 5,070,000   | 4,820,505   | 2041/6/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第178回 | 0.5   | 3,750,000   | 3,624,562   | 2041/9/20  |
| 国庫債券    | 利付 (20年)        | 第179回 | 0.5   | 3,000,000   | 2,896,020   | 2041/12/20 |
| メキシコ合衆国 | 第19回円貨社債 (2014) |       | 1.44  | 100,000     | 101,814     | 2024/7/24  |
| 小 計     |                 |       |       | 642,295,000 | 667,251,907 |            |
| 地方債証券   |                 |       |       |             |             |            |
| 東京都     | 公募第731回         |       | 0.635 | 100,000     | 101,189     | 2024/3/19  |
| 東京都     | 公募第736回         |       | 0.505 | 100,000     | 101,136     | 2024/9/20  |
| 東京都     | 公募第745回         |       | 0.533 | 300,000     | 304,758     | 2025/6/20  |
| 東京都     | 公募第760回         |       | 0.045 | 100,000     | 99,799      | 2026/9/18  |
| 東京都     | 公募第761回         |       | 0.075 | 100,000     | 99,933      | 2026/9/18  |
| 東京都     | 公募第769回         |       | 0.21  | 500,000     | 502,335     | 2027/6/18  |
| 東京都     | 公募第778回         |       | 0.165 | 100,000     | 100,029     | 2028/3/17  |
| 東京都     | 公募第784回         |       | 0.254 | 200,000     | 201,012     | 2028/9/20  |
| 東京都     | 公募第813回         |       | 0.179 | 200,000     | 198,452     | 2030/12/20 |
| 東京都     | 公募第822回         |       | 0.095 | 130,000     | 127,722     | 2031/9/19  |
| 東京都     | 公募 (30年) 第7回    |       | 2.51  | 100,000     | 129,764     | 2038/9/17  |
| 東京都     | 公募第10回          |       | 2.31  | 200,000     | 254,348     | 2039/9/20  |
| 東京都     | 公募第1回           |       | 1.54  | 300,000     | 305,607     | 2023/6/20  |
| 東京都     | 公募 (20年) 第3回    |       | 2.26  | 200,000     | 208,768     | 2024/3/19  |
| 東京都     | 公募第7回           |       | 2.16  | 100,000     | 107,310     | 2025/9/19  |
| 東京都     | 公募 (20年) 第13回   |       | 2.15  | 100,000     | 111,376     | 2027/12/20 |
| 東京都     | 公募 (20年) 第16回   |       | 2.01  | 200,000     | 224,228     | 2028/12/20 |
| 東京都     | 公募 (20年) 第17回   |       | 2.09  | 200,000     | 225,290     | 2028/12/20 |
| 東京都     | 公募 (20年) 第20回   |       | 2.09  | 180,000     | 204,798     | 2029/9/20  |

| 銘柄    |              | 当 期 末 |         |         |            |
|-------|--------------|-------|---------|---------|------------|
|       |              | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券 |              | %     | 千円      | 千円      |            |
| 東京都   | 公募第23回       | 2.12  | 100,000 | 115,857 | 2030/12/20 |
| 東京都   | 公募（20年）第26回  | 1.74  | 100,000 | 114,440 | 2032/6/18  |
| 東京都   | 公募（20年）第29回  | 1.57  | 200,000 | 227,310 | 2033/9/20  |
| 東京都   | 公募（5年）第31回   | 0.005 | 300,000 | 299,760 | 2024/6/20  |
| 東京都   | 公募（5年）第32回   | 0.02  | 300,000 | 299,757 | 2025/6/20  |
| 北海道   | 公募平成26年度第13回 | 0.461 | 100,000 | 101,168 | 2024/12/26 |
| 北海道   | 公募平成27年度第7回  | 0.529 | 100,000 | 101,647 | 2025/8/28  |
| 北海道   | 公募平成29年度第5回  | 0.18  | 200,000 | 200,572 | 2027/6/30  |
| 北海道   | 公募平成29年度第7回  | 0.21  | 100,000 | 100,322 | 2027/8/31  |
| 北海道   | 公募平成29年度第9回  | 0.205 | 100,000 | 100,304 | 2027/10/27 |
| 北海道   | 公募平成30年度第15回 | 0.291 | 253,920 | 252,970 | 2038/9/24  |
| 北海道   | 公募平成30年度第18回 | 0.146 | 200,000 | 199,186 | 2029/2/28  |
| 北海道   | 公募令和2年度第4回   | 0.165 | 300,000 | 297,705 | 2030/6/26  |
| 宮城県   | 公募第31回1号     | 0.515 | 300,000 | 304,815 | 2025/9/29  |
| 宮城県   | 公募第32回2号     | 0.105 | 100,000 | 100,067 | 2026/9/28  |
| 神奈川県  | 公募第200回      | 0.825 | 100,000 | 101,184 | 2023/9/20  |
| 神奈川県  | 公募第205回      | 0.664 | 100,000 | 101,246 | 2024/3/19  |
| 神奈川県  | 公募第206回      | 0.654 | 100,000 | 101,360 | 2024/6/20  |
| 神奈川県  | 公募第208回      | 0.551 | 100,000 | 101,132 | 2024/6/20  |
| 神奈川県  | 公募第210回      | 0.451 | 200,000 | 202,238 | 2024/12/20 |
| 神奈川県  | 公募第212回      | 0.42  | 100,000 | 101,140 | 2025/3/19  |
| 神奈川県  | 公募第231回      | 0.22  | 200,000 | 200,736 | 2027/12/20 |
| 神奈川県  | 公募第243回      | 0.075 | 200,000 | 197,650 | 2029/12/20 |
| 神奈川県  | 公募第247回      | 0.12  | 200,000 | 197,908 | 2030/6/20  |
| 神奈川県  | 公募（30年）第3回   | 2.62  | 100,000 | 129,973 | 2037/3/19  |
| 神奈川県  | 公募第7回        | 2.22  | 300,000 | 331,584 | 2027/3/19  |
| 神奈川県  | 公募（20年）第14回  | 1.969 | 100,000 | 114,019 | 2030/7/19  |
| 神奈川県  | 公募（20年）第17回  | 1.975 | 200,000 | 231,072 | 2031/7/11  |
| 神奈川県  | 公募（20年）第26回  | 1.477 | 100,000 | 112,954 | 2034/6/20  |
| 大阪府   | 公募第378回      | 0.7   | 104,000 | 105,182 | 2023/11/28 |
| 大阪府   | 公募第381回      | 0.683 | 100,000 | 101,260 | 2024/2/27  |
| 大阪府   | 公募第382回      | 0.674 | 100,000 | 101,281 | 2024/3/28  |
| 大阪府   | 公募第383回      | 0.695 | 100,000 | 101,375 | 2024/4/26  |
| 大阪府   | 公募第384回      | 0.67  | 100,000 | 101,380 | 2024/5/29  |
| 大阪府   | 公募第387回      | 0.521 | 300,000 | 303,510 | 2024/8/28  |
| 大阪府   | 公募第389回      | 0.53  | 100,000 | 101,270 | 2024/10/30 |
| 大阪府   | 公募第396回      | 0.554 | 200,000 | 203,274 | 2025/5/28  |
| 大阪府   | 公募第417回      | 0.248 | 102,000 | 102,781 | 2027/2/26  |
| 大阪府   | 公募第423回      | 0.185 | 100,000 | 100,188 | 2027/8/30  |
| 大阪府   | 公募第429回      | 0.197 | 179,000 | 179,282 | 2028/2/25  |
| 大阪府   | 公募第452回      | 0.062 | 100,000 | 98,557  | 2030/1/30  |
| 大阪府   | 公募第467回      | 0.164 | 140,000 | 138,475 | 2031/4/28  |
| 大阪府   | 公募第469回      | 0.128 | 150,000 | 147,747 | 2031/6/27  |
| 大阪府   | 公募第5回        | 2.16  | 100,000 | 115,310 | 2030/5/28  |
| 大阪府   | 公募第8回        | 1.83  | 100,000 | 114,676 | 2031/12/22 |
| 大阪府   | 公募（5年）第173回  | 0.001 | 200,000 | 199,740 | 2025/7/30  |
| 大阪府   | 公募（5年）第174回  | 0.001 | 200,000 | 199,700 | 2025/8/28  |
| 大阪府   | 公募（5年）第178回  | 0.001 | 400,000 | 399,176 | 2025/12/25 |

| 銘柄    |                   | 当 期 末 |         |         |            |
|-------|-------------------|-------|---------|---------|------------|
|       |                   | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券 |                   | %     | 千円      | 千円      |            |
| 大阪府   | 公募（5年）第184回       | 0.001 | 400,000 | 398,744 | 2026/6/29  |
| 大阪府   | 公募（5年）第190回       | 0.001 | 200,000 | 199,116 | 2026/12/25 |
| 京都府   | 公募平成25年度第15回      | 0.66  | 200,000 | 202,476 | 2024/3/19  |
| 京都府   | 公募平成26年度第5回       | 1.455 | 100,000 | 112,696 | 2034/8/10  |
| 京都府   | 公募平成26年度第7回       | 0.564 | 200,000 | 202,586 | 2024/9/19  |
| 京都府   | 公募（20年）平成27年度第5回  | 1.23  | 200,000 | 220,254 | 2035/8/17  |
| 京都府   | 公募（15年）平成27年度第8回  | 0.78  | 100,000 | 104,295 | 2030/10/11 |
| 京都府   | 公募（15年）平成28年度第2回  | 0.21  | 200,000 | 198,820 | 2031/4/22  |
| 京都府   | 公募（20年）平成28年度第5回  | 0.327 | 100,000 | 97,623  | 2036/8/15  |
| 京都府   | 公募平成29年度第4回       | 0.19  | 100,000 | 100,337 | 2027/6/21  |
| 兵庫県   | 公募平成26年度第17回      | 0.46  | 100,000 | 101,231 | 2025/2/26  |
| 兵庫県   | 公募平成29年度第22回      | 0.19  | 100,000 | 100,201 | 2028/1/21  |
| 兵庫県   | 公募（30年）第2回        | 2.36  | 200,000 | 256,522 | 2040/3/19  |
| 兵庫県   | 公募（15年）第1回        | 1.66  | 300,000 | 320,442 | 2026/7/29  |
| 兵庫県   | 公募（15年）第3回        | 1.35  | 200,000 | 212,878 | 2027/7/16  |
| 兵庫県   | 公募（12年）第3回        | 0.56  | 300,000 | 304,740 | 2025/4/16  |
| 兵庫県   | 公募（15年）第8回        | 1.09  | 100,000 | 106,172 | 2029/4/16  |
| 兵庫県   | 公募（15年）第11回       | 0.718 | 100,000 | 103,801 | 2030/5/10  |
| 兵庫県   | 公募第2回             | 2.37  | 100,000 | 112,092 | 2027/9/17  |
| 兵庫県   | 公募第9回             | 2.25  | 100,000 | 115,239 | 2029/11/19 |
| 兵庫県   | 公募（20年）第11回       | 1.84  | 200,000 | 226,082 | 2030/8/16  |
| 兵庫県   | 公募（20年）第14回       | 1.72  | 100,000 | 114,135 | 2032/5/24  |
| 兵庫県   | 公募（20年）第22回       | 1.4   | 100,000 | 112,051 | 2034/9/8   |
| 静岡県   | 公募平成25年度第5回       | 0.926 | 101,000 | 102,214 | 2023/7/25  |
| 静岡県   | 公募平成26年度第3回       | 0.679 | 165,000 | 167,285 | 2024/5/27  |
| 静岡県   | 公募平成26年度第8回       | 0.564 | 100,000 | 101,290 | 2024/9/25  |
| 静岡県   | 公募平成26年度第9回       | 0.554 | 200,000 | 202,620 | 2024/10/24 |
| 静岡県   | 公募平成27年度第11回      | 0.11  | 115,400 | 115,600 | 2026/3/19  |
| 静岡県   | 公募平成28年度第2回       | 0.08  | 300,000 | 300,105 | 2026/3/19  |
| 静岡県   | 公募平成29年度第3回       | 0.17  | 100,000 | 100,370 | 2027/3/19  |
| 静岡県   | 公募（31年）第1回        | 0.095 | 174,000 | 172,792 | 2029/3/19  |
| 静岡県   | 公募（5年）令和3年度第2回    | 0.01  | 100,000 | 99,758  | 2026/3/19  |
| 静岡県   | 公募（5年）令和3年度第5回    | 0.005 | 300,000 | 299,052 | 2026/6/19  |
| 静岡県   | 公募（15年）第2回        | 1.406 | 200,000 | 213,322 | 2027/6/25  |
| 静岡県   | 公募（15年）第5回        | 1.087 | 200,000 | 211,830 | 2028/11/20 |
| 静岡県   | 公募（15年）第9回        | 0.739 | 100,000 | 103,970 | 2030/9/20  |
| 静岡県   | 公募（20年）第11回       | 1.841 | 100,000 | 113,265 | 2030/10/18 |
| 静岡県   | 公募（20年）第14回       | 1.736 | 200,000 | 228,688 | 2032/6/18  |
| 静岡県   | 公募（20年）第18回       | 1.473 | 100,000 | 112,894 | 2034/7/10  |
| 静岡県   | 公募（20年）第30回       | 0.449 | 200,000 | 191,326 | 2040/9/20  |
| 愛知県   | 公募平成20年度第8回       | 2.04  | 100,000 | 112,350 | 2028/12/20 |
| 愛知県   | 公募（20年）平成22年度第8回  | 1.891 | 200,000 | 227,160 | 2030/9/13  |
| 愛知県   | 公募（20年）平成24年度第4回  | 1.687 | 100,000 | 113,885 | 2032/6/11  |
| 愛知県   | 公募（15年）平成24年度第14回 | 1.314 | 400,000 | 426,444 | 2027/12/13 |
| 愛知県   | 公募平成24年度第17回      | 1.829 | 100,000 | 115,933 | 2033/2/8   |
| 愛知県   | 公募（30年）平成25年度第8回  | 2.024 | 120,000 | 148,669 | 2043/6/19  |
| 愛知県   | 公募平成26年度第8回       | 1.814 | 100,000 | 120,045 | 2044/6/20  |
| 愛知県   | 公募平成26年度第13回      | 1.363 | 100,000 | 111,640 | 2034/11/14 |

| 銘柄    |                       | 当 期 末 |         |         |            |
|-------|-----------------------|-------|---------|---------|------------|
|       |                       | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券 |                       | %     | 千円      | 千円      |            |
| 愛知県   | 公募平成26年度第17回          | 0.463 | 300,000 | 303,720 | 2025/2/26  |
| 愛知県   | 公募（15年）平成27年度第2回      | 0.74  | 300,000 | 311,994 | 2030/4/26  |
| 愛知県   | 公募平成27年度第15回          | 0.471 | 100,000 | 101,516 | 2025/11/27 |
| 愛知県   | 公募平成29年度第8回           | 0.2   | 100,000 | 100,322 | 2027/8/31  |
| 愛知県   | 公募平成29年度第9回           | 0.15  | 100,000 | 100,054 | 2027/9/15  |
| 愛知県   | 公募平成30年度第7回           | 0.18  | 200,000 | 200,126 | 2028/7/31  |
| 愛知県   | 公募令和3年度第10回           | 0.001 | 200,000 | 199,194 | 2026/10/15 |
| 広島県   | 公募平成25年度第3回           | 0.8   | 200,000 | 202,318 | 2023/9/25  |
| 広島県   | 公募平成26年度第5回           | 0.33  | 109,650 | 110,539 | 2025/1/27  |
| 広島県   | 公募平成26年度第7回           | 0.46  | 200,000 | 202,502 | 2025/3/25  |
| 広島県   | 公募平成29年度第3回           | 0.15  | 100,000 | 100,027 | 2027/9/27  |
| 広島県   | 公募平成29年度第4回           | 0.22  | 211,300 | 212,128 | 2027/11/24 |
| 広島県   | 公募平成30年度第6回           | 0.02  | 300,000 | 299,952 | 2024/2/20  |
| 広島県   | 公募令和2年度第2回            | 0.165 | 100,000 | 99,309  | 2030/7/22  |
| 広島県   | 公募令和2年度第7回            | 0.214 | 300,000 | 298,272 | 2031/3/19  |
| 埼玉県   | 公募平成25年度第4回           | 0.921 | 100,000 | 101,193 | 2023/7/24  |
| 埼玉県   | 公募平成25年度第6回           | 0.806 | 148,000 | 149,734 | 2023/9/27  |
| 埼玉県   | 公募平成25年度第10回          | 0.67  | 100,000 | 101,224 | 2024/2/26  |
| 埼玉県   | 公募平成25年度第11回          | 0.655 | 100,000 | 101,230 | 2024/3/26  |
| 埼玉県   | 公募平成26年度第3回           | 0.67  | 100,000 | 101,354 | 2024/5/20  |
| 埼玉県   | 公募平成26年度第6回           | 0.554 | 200,000 | 202,534 | 2024/9/26  |
| 埼玉県   | 公募平成26年度第7回           | 0.476 | 400,000 | 404,772 | 2024/12/25 |
| 埼玉県   | 公募平成26年度第9回           | 0.429 | 100,000 | 101,140 | 2025/2/25  |
| 埼玉県   | 公募平成27年度第9回           | 0.235 | 100,000 | 100,658 | 2026/2/25  |
| 埼玉県   | 公募平成28年度第5回           | 0.05  | 100,000 | 99,870  | 2026/7/28  |
| 埼玉県   | 公募平成30年度第4回           | 0.205 | 200,000 | 200,432 | 2028/6/26  |
| 埼玉県   | 公募平成30年度第7回           | 0.02  | 200,000 | 200,004 | 2023/10/26 |
| 埼玉県   | 公募令和元年度第4回            | 0.055 | 100,000 | 98,891  | 2029/6/20  |
| 埼玉県   | 公募令和2年度第4回            | 0.145 | 300,000 | 297,468 | 2030/6/17  |
| 埼玉県   | 公募（15年）第1回            | 0.941 | 100,000 | 105,310 | 2029/10/19 |
| 埼玉県   | 公募（15年）第2回            | 0.869 | 200,000 | 210,042 | 2030/5/22  |
| 埼玉県   | 公募（15年）第3回            | 0.43  | 100,000 | 101,415 | 2032/1/30  |
| 埼玉県   | 公募（25年）第2回            | 0.781 | 200,000 | 200,442 | 2042/9/19  |
| 埼玉県   | 公募（30年）第9回            | 0.845 | 200,000 | 196,056 | 2048/3/19  |
| 埼玉県   | 公募（20年）第6回            | 2.26  | 100,000 | 113,347 | 2028/9/21  |
| 埼玉県   | 公募（20年）第16回           | 1.216 | 100,000 | 109,944 | 2035/8/14  |
| 埼玉県   | 公募（20年）第20回           | 0.626 | 100,000 | 101,414 | 2037/5/15  |
| 福岡県   | 公募平成26年度第1回           | 0.654 | 100,000 | 101,371 | 2024/6/26  |
| 福岡県   | 公募平成27年度第1回           | 0.578 | 300,000 | 305,169 | 2025/6/26  |
| 福岡県   | 公募平成29年度第1回           | 0.2   | 100,000 | 100,389 | 2027/6/23  |
| 福岡県   | 公募平成23年度第1回           | 1.491 | 100,000 | 106,475 | 2026/11/27 |
| 福岡県   | 公募（15年）平成27年度第1回      | 0.784 | 200,000 | 208,690 | 2030/11/25 |
| 福岡県   | 公募（15年）令和元年度第1回       | 0.254 | 100,000 | 98,393  | 2034/6/14  |
| 福岡県   | 公募（30年）平成19年度第1回      | 2.62  | 100,000 | 130,347 | 2037/9/18  |
| 福岡県   | 公募（30年）平成26年度第1回      | 1.827 | 100,000 | 120,291 | 2044/6/20  |
| 福岡県   | 公募（30年・定時償還）平成29年度第2回 | 0.937 | 100,000 | 100,344 | 2047/12/20 |
| 福岡県   | 公募（20年）平成20年度第1回      | 2.26  | 300,000 | 339,471 | 2028/8/18  |
| 福岡県   | 公募（20年）平成20年度第2回      | 2.05  | 100,000 | 112,417 | 2028/12/20 |

| 銘柄        |                  | 当 期 末 |           |           |            |
|-----------|------------------|-------|-----------|-----------|------------|
|           |                  | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券     |                  | %     | 千円        | 千円        |            |
| 福岡県       | 公募（20年）平成22年度第1回 | 1.77  | 300,000   | 337,437   | 2030/8/19  |
| 福岡県       | 公募（20年）平成22年度第2回 | 2.116 | 300,000   | 348,285   | 2031/2/21  |
| 福岡県       | 公募（20年）平成24年度第2回 | 1.635 | 100,000   | 113,474   | 2032/8/16  |
| 千葉県       | 公募平成25年度第3回      | 0.89  | 100,000   | 101,082   | 2023/6/23  |
| 千葉県       | 公募平成25年度第4回      | 0.92  | 100,000   | 101,194   | 2023/7/25  |
| 千葉県       | 公募平成26年度第1回      | 0.679 | 100,000   | 101,330   | 2024/4/25  |
| 千葉県       | 公募平成26年度第3回      | 0.611 | 200,000   | 202,640   | 2024/7/25  |
| 千葉県       | 公募平成27年度第6回      | 0.469 | 200,000   | 203,040   | 2025/12/25 |
| 千葉県       | 公募平成28年度第4回      | 0.085 | 200,000   | 199,954   | 2026/9/25  |
| 千葉県       | 公募平成29年度第4回      | 0.15  | 100,000   | 100,027   | 2027/9/24  |
| 千葉県       | 公募平成29年度第8回      | 0.2   | 100,000   | 100,237   | 2028/3/24  |
| 千葉県       | 公募令和元年度第6回       | 0.135 | 300,000   | 297,813   | 2030/1/25  |
| 千葉県       | 公募（20年）第1回       | 2.06  | 400,000   | 429,756   | 2025/12/19 |
| 千葉県       | 公募（20年）第8回       | 2.18  | 100,000   | 115,363   | 2030/4/19  |
| 千葉県       | 公募（20年）第13回      | 1.701 | 200,000   | 228,558   | 2032/10/15 |
| 千葉県       | 公募（20年）第16回      | 1.555 | 200,000   | 227,574   | 2034/4/14  |
| 千葉県       | 公募（20年）第17回      | 1.403 | 100,000   | 112,107   | 2034/10/13 |
| 新潟県       | 公募平成30年度第2回      | 0.264 | 200,000   | 201,106   | 2028/11/30 |
| 新潟県       | 公募令和2年度第2回       | 0.135 | 120,000   | 118,680   | 2030/11/29 |
| 長野県       | 公募令和3年度第1回       | 0.19  | 300,000   | 297,714   | 2031/4/16  |
| 茨城県       | 公募令和3年度第3回       | 0.005 | 200,000   | 199,298   | 2026/8/25  |
| 群馬県       | 公募第12回           | 0.519 | 100,000   | 101,580   | 2025/8/15  |
| 群馬県       | 公募（5年）第13回       | 0.005 | 300,000   | 298,950   | 2026/8/18  |
| 群馬県       | 公募（20年）第3回       | 1.687 | 100,000   | 113,887   | 2032/6/25  |
| 岐阜県       | 公募平成26年度第1回      | 0.554 | 186,670   | 189,046   | 2024/9/30  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第122回          | 0.62  | 400,000   | 402,808   | 2023/5/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第124回          | 0.91  | 300,000   | 303,564   | 2023/7/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第126回          | 0.81  | 100,000   | 101,174   | 2023/9/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第128回          | 0.66  | 700,000   | 707,385   | 2023/11/24 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第129回          | 0.71  | 100,000   | 101,190   | 2023/12/25 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第130回          | 0.76  | 100,000   | 101,335   | 2024/1/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第132回          | 0.66  | 100,000   | 101,238   | 2024/3/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第136回          | 0.611 | 200,000   | 202,640   | 2024/7/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第137回          | 0.566 | 500,000   | 506,295   | 2024/8/23  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第139回          | 0.544 | 155,000   | 156,993   | 2024/10/25 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第143回          | 0.448 | 540,000   | 546,453   | 2025/2/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第145回          | 0.406 | 1,000,000 | 1,011,210 | 2025/4/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第152回          | 0.496 | 400,000   | 406,420   | 2025/11/25 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第154回          | 0.405 | 300,000   | 303,927   | 2026/1/23  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第156回          | 0.1   | 200,000   | 200,230   | 2026/3/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第157回          | 0.08  | 300,000   | 300,114   | 2026/4/24  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第161回          | 0.06  | 300,000   | 299,670   | 2026/8/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第172回          | 0.225 | 600,000   | 603,162   | 2027/7/23  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第184回          | 0.175 | 100,000   | 100,031   | 2028/7/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第186回          | 0.25  | 400,000   | 401,796   | 2028/9/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第188回          | 0.264 | 300,000   | 301,656   | 2028/11/24 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第190回          | 0.16  | 610,000   | 608,956   | 2029/1/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第191回          | 0.14  | 100,000   | 99,655    | 2029/2/22  |

| 銘柄        |                  | 当 期 末 |         |         |            |
|-----------|------------------|-------|---------|---------|------------|
|           |                  | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券     |                  | %     | 千円      | 千円      |            |
| 共同発行市場地方債 | 公募第194回          | 0.11  | 200,000 | 198,648 | 2029/5/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第196回          | 0.06  | 400,000 | 395,508 | 2029/7/25  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第197回          | 0.06  | 300,000 | 296,595 | 2029/8/24  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第200回          | 0.07  | 100,000 | 98,834  | 2029/11/22 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第206回          | 0.131 | 300,000 | 297,270 | 2030/5/24  |
| 共同発行市場地方債 | 公募第213回          | 0.125 | 300,000 | 296,286 | 2030/12/25 |
| 共同発行市場地方債 | 公募第215回          | 0.145 | 400,000 | 395,528 | 2031/2/25  |
| 堺市        | 公募平成22年度第1回      | 1.97  | 100,000 | 114,439 | 2030/11/19 |
| 堺市        | 公募平成26年度第1回      | 1.664 | 100,000 | 116,930 | 2044/9/20  |
| 長崎県       | 公募令和元年度第3回       | 0.05  | 100,000 | 98,855  | 2029/6/20  |
| 島根県       | 公募(30年)平成29年度第1回 | 0.919 | 100,000 | 100,195 | 2047/6/20  |
| 佐賀県       | 公募平成28年度第1回      | 0.08  | 100,000 | 99,930  | 2026/11/30 |
| 福島県       | 公募平成26年度第1回      | 0.495 | 200,000 | 202,416 | 2024/11/28 |
| 滋賀県       | 公募平成25年度第1回      | 0.65  | 100,000 | 101,048 | 2023/11/29 |
| 滋賀県       | 公募平成26年度第1回      | 0.495 | 142,000 | 143,715 | 2024/11/28 |
| 栃木県       | 公募平成25年度第1回      | 0.65  | 100,000 | 101,048 | 2023/11/29 |
| 熊本県       | 公募平成28年度第2回      | 0.06  | 132,000 | 131,819 | 2026/10/28 |
| 熊本市       | 公募平成29年度第1回      | 0.19  | 100,000 | 100,225 | 2027/11/30 |
| 新潟市       | 公募平成25年度第1回      | 0.72  | 233,200 | 236,019 | 2023/12/26 |
| 新潟市       | 公募平成29年度第1回      | 0.21  | 100,000 | 100,312 | 2027/12/24 |
| 浜松市       | 公募平成26年度第1回      | 0.335 | 100,000 | 100,821 | 2025/1/23  |
| 大阪市       | 公募平成25年度第6回      | 0.694 | 100,000 | 101,107 | 2023/11/22 |
| 大阪市       | 公募平成26年度第5回      | 0.593 | 100,000 | 101,365 | 2024/9/27  |
| 大阪市       | 公募平成27年度第6回      | 0.471 | 100,000 | 101,514 | 2025/11/25 |
| 大阪市       | 公募令和2年度第2回       | 0.131 | 300,000 | 297,273 | 2030/5/22  |
| 大阪市       | 公募令和3年度第2回       | 0.16  | 300,000 | 296,835 | 2031/5/21  |
| 大阪市       | 公募(15年)第1回       | 1.753 | 100,000 | 107,183 | 2026/7/17  |
| 大阪市       | 公募(20年)第1回       | 2.3   | 300,000 | 336,072 | 2027/11/15 |
| 大阪市       | 公募(20年)第5回       | 2.47  | 100,000 | 114,691 | 2028/9/21  |
| 大阪市       | 公募(20年)第6回       | 2.21  | 100,000 | 113,479 | 2028/12/20 |
| 大阪市       | 公募(20年)第17回      | 1.721 | 100,000 | 114,651 | 2032/12/21 |
| 大阪市       | 公募(20年)第26回      | 0.635 | 100,000 | 101,179 | 2037/10/23 |
| 名古屋市      | 公募第488回          | 0.598 | 300,000 | 304,137 | 2024/9/20  |
| 名古屋市      | 公募第489回          | 0.461 | 100,000 | 101,146 | 2024/12/20 |
| 名古屋市      | 公募第501回          | 0.175 | 200,000 | 200,326 | 2027/9/29  |
| 名古屋市      | 公募第503回          | 0.205 | 100,000 | 100,266 | 2028/3/24  |
| 名古屋市      | 公募第504回          | 0.205 | 200,000 | 200,430 | 2028/6/20  |
| 名古屋市      | 公募第511回          | 0.075 | 200,000 | 197,416 | 2030/3/27  |
| 名古屋市      | 公募第512回          | 0.15  | 300,000 | 297,585 | 2030/6/20  |
| 名古屋市      | 公募(12年)第1回       | 1.033 | 200,000 | 206,388 | 2025/6/20  |
| 名古屋市      | 公募(15年)第2回       | 0.905 | 100,000 | 105,056 | 2029/11/16 |
| 京都市       | 公募平成29年度第1回      | 0.21  | 100,000 | 100,402 | 2027/8/25  |
| 京都市       | 公募平成29年度第4回      | 0.235 | 101,280 | 101,748 | 2028/1/31  |
| 京都市       | 公募(20年)第2回       | 2.12  | 100,000 | 107,153 | 2025/9/19  |
| 京都市       | 公募(20年)第5回       | 2.36  | 200,000 | 221,270 | 2026/12/18 |
| 京都市       | 公募(20年)第6回       | 2.38  | 100,000 | 112,146 | 2027/9/17  |
| 京都市       | 公募(20年)第13回      | 1.359 | 100,000 | 111,616 | 2034/11/24 |
| 京都市       | 公募(20年)第15回      | 0.487 | 200,000 | 199,256 | 2036/11/28 |

| 銘柄          |                     | 当 期 末 |         |         |            |
|-------------|---------------------|-------|---------|---------|------------|
|             |                     | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券       |                     | %     | 千円      | 千円      |            |
| 神戸市         | 公募平成26年度第17回        | 0.28  | 300,000 | 302,010 | 2025/1/27  |
| 神戸市         | 公募平成28年度第1回         | 0.08  | 200,000 | 200,074 | 2026/4/17  |
| 神戸市         | 公募平成30年度第2回         | 0.845 | 200,000 | 196,056 | 2048/3/19  |
| 横浜市         | 公募公債平成25年度1回        | 0.664 | 200,000 | 201,482 | 2023/5/19  |
| 横浜市         | 公募公債平成25年度5回        | 0.655 | 200,000 | 202,068 | 2023/11/17 |
| 横浜市         | 公募公債平成26年度5回        | 0.471 | 200,000 | 202,328 | 2024/12/13 |
| 横浜市         | 公募平成28年度第5回         | 0.23  | 300,000 | 301,947 | 2027/2/19  |
| 横浜市         | 公募平成29年度第3回         | 0.22  | 100,000 | 100,453 | 2027/8/13  |
| 横浜市         | 公募2019年度第3回         | 0.05  | 200,000 | 197,468 | 2029/10/16 |
| 横浜市         | 公募（30年）第2回          | 2.49  | 200,000 | 251,640 | 2035/3/20  |
| 横浜市         | 公募（20年）第11回         | 2.2   | 100,000 | 109,883 | 2026/12/18 |
| 横浜市         | 公募（20年）第18回         | 2.21  | 100,000 | 114,156 | 2029/5/25  |
| 横浜市         | 公募（20年）第26回         | 1.776 | 100,000 | 115,328 | 2033/1/28  |
| 横浜市         | 公募（20年）第30回         | 1.376 | 100,000 | 111,802 | 2034/10/20 |
| 札幌市         | 公募（15年）平成23年度第9回    | 1.493 | 200,000 | 213,530 | 2027/2/12  |
| 札幌市         | 公募（20年）平成24年度第1回    | 1.79  | 100,000 | 114,800 | 2032/4/23  |
| 札幌市         | 公募（20年）平成24年度第11回   | 1.794 | 100,000 | 115,593 | 2033/2/28  |
| 札幌市         | 公募平成26年度第4回         | 0.54  | 100,000 | 101,107 | 2024/6/20  |
| 札幌市         | 公募平成26年度第9回         | 0.43  | 200,000 | 202,096 | 2024/12/20 |
| 川崎市         | 公募（20年）第14回         | 1.79  | 100,000 | 114,645 | 2032/3/19  |
| 川崎市         | 公募（20年）第17回         | 1.527 | 100,000 | 112,925 | 2033/5/9   |
| 川崎市         | 公募（20年）第19回         | 1.362 | 100,000 | 111,628 | 2034/9/20  |
| 川崎市         | 公募（30年）第11回         | 0.817 | 100,000 | 97,348  | 2048/3/19  |
| 北九州市        | 公募（10年）令和2年度第2回     | 0.125 | 200,000 | 197,356 | 2030/12/24 |
| 北九州市        | 公募（20年）第3回          | 2.33  | 200,000 | 223,736 | 2027/9/21  |
| 北九州市        | 公募（20年）第14回         | 1.732 | 100,000 | 114,598 | 2032/11/12 |
| 福岡市         | 公募（20年）平成21年度第3回    | 2.14  | 200,000 | 228,270 | 2029/9/18  |
| 福岡市         | 公募（20年）平成23年度第4回    | 1.89  | 100,000 | 114,827 | 2031/8/19  |
| 福岡市         | 公募平成26年度第2回         | 1.49  | 100,000 | 113,106 | 2034/6/20  |
| 福岡市         | 公募平成26年度第5回         | 0.539 | 100,000 | 101,278 | 2024/10/28 |
| 福岡市         | 公募平成26年度第8回         | 0.465 | 160,000 | 162,025 | 2025/3/25  |
| 福岡市         | 公募（5年）2020年度第9回     | 0.01  | 300,000 | 299,427 | 2025/12/25 |
| 広島市         | 公募平成26年度第2回         | 0.456 | 100,000 | 101,125 | 2024/12/25 |
| 広島市         | 公募平成27年度第2回         | 0.464 | 500,000 | 507,510 | 2025/12/25 |
| 広島市         | 公募（10年）平成30年度第6回    | 0.146 | 241,000 | 240,267 | 2029/2/22  |
| 千葉市         | 公募平成26年度第2回         | 0.505 | 200,000 | 202,466 | 2024/11/27 |
| 三重県         | 公募平成28年度第1回         | 0.165 | 155,000 | 155,475 | 2026/12/25 |
| 福井県         | 公募平成27年度第4回         | 0.085 | 200,000 | 200,116 | 2026/4/27  |
| 福井県         | 公募令和元年度第3回          | 0.05  | 200,000 | 197,384 | 2029/10/29 |
| 徳島県         | 公募平成29年度第2回         | 0.19  | 200,000 | 200,450 | 2027/11/30 |
| 徳島県         | 公募平成30年度第2回         | 0.264 | 300,000 | 301,659 | 2028/11/28 |
| 山梨県         | 公募令和元年度第1回          | 0.05  | 100,000 | 98,692  | 2029/10/30 |
| 岡山県         | 公募平成28年度第2回         | 0.205 | 168,900 | 169,776 | 2027/3/31  |
| 岡山県         | 公募令和2年度第3回          | 0.224 | 300,000 | 298,512 | 2031/3/31  |
| 愛知県・名古屋市中区  | 折半保証名古屋高速道路債券 第96回  | 2.34  | 100,000 | 112,992 | 2028/12/20 |
| 愛知県・名古屋市中区  | 折半保証名古屋高速道路債券 第102回 | 2.298 | 300,000 | 343,410 | 2029/12/20 |
| 福岡北九州高速道路債券 | 第117回               | 2.26  | 100,000 | 112,504 | 2028/12/20 |

| 銘柄                           |                       | 当 期 末 |            |            |            |
|------------------------------|-----------------------|-------|------------|------------|------------|
|                              |                       | 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券                        |                       | %     | 千円         | 千円         |            |
| 福岡北九州高速道路債券 第136回            |                       | 0.833 | 100,000    | 103,502    | 2030/3/19  |
| 小 計                          |                       |       | 55,428,320 | 57,337,944 |            |
| 特殊債券(除く金融債)                  |                       |       |            |            |            |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第48回     | 0.605 | 500,000    | 503,515    | 2023/5/16  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第49回     | 0.882 | 13,000     | 13,141     | 2023/6/16  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第50回     | 0.911 | 100,000    | 101,200    | 2023/7/14  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第56回     | 0.747 | 591,000    | 599,002    | 2024/1/19  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第59回     | 0.669 | 116,000    | 117,566    | 2024/4/12  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第64回     | 0.544 | 100,000    | 101,297    | 2024/9/13  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第65回     | 0.539 | 400,000    | 405,348    | 2024/10/16 |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第69回     | 0.414 | 420,000    | 424,935    | 2025/2/17  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第72回     | 0.509 | 189,000    | 191,963    | 2025/5/23  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第78回     | 0.381 | 509,000    | 515,566    | 2025/11/18 |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第80回     | 0.32  | 300,000    | 303,294    | 2026/1/19  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回 | 0.173 | 500,000    | 501,610    | 2024/1/29  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第83回     | 0.02  | 116,000    | 115,856    | 2026/4/17  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第91回     | 0.085 | 300,000    | 300,138    | 2026/12/14 |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第108回    | 0.145 | 157,000    | 157,095    | 2028/5/19  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第110回    | 0.13  | 100,000    | 99,937     | 2028/7/18  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第113回    | 0.219 | 110,000    | 110,491    | 2028/10/16 |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 第119回    | 0.04  | 116,000    | 114,983    | 2029/4/13  |
| 政保                           | 地方公共団体金融機構債券 11回      | 0.001 | 500,000    | 499,885    | 2024/8/28  |
| 日本政策金融公庫債券 政府保証第63回          |                       | 0.11  | 110,000    | 108,718    | 2031/2/25  |
| 新関西国際空港債券 政府保証第2回            |                       | 0.882 | 191,000    | 193,137    | 2023/6/27  |
| 新関西国際空港債券 政府保証第5回            |                       | 0.145 | 117,000    | 117,374    | 2027/3/30  |
| 原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 政府保証第16回   |                       | 0.001 | 700,000    | 700,175    | 2023/11/27 |
| 日本政策投資銀行債券 政府保証第22回          |                       | 2.2   | 100,000    | 102,706    | 2023/6/19  |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第37回          |                       | 0.085 | 400,000    | 400,184    | 2026/12/14 |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第42回          |                       | 0.155 | 300,000    | 300,594    | 2027/12/15 |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第52回          |                       | 0.001 | 300,000    | 299,898    | 2025/1/24  |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第55回          |                       | 0.105 | 300,000    | 298,740    | 2029/3/19  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第90回  |                       | 2.1   | 100,000    | 114,186    | 2029/9/28  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回  |                       | 2.1   | 200,000    | 228,630    | 2029/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回  |                       | 2.1   | 200,000    | 229,142    | 2029/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回  |                       | 2.2   | 200,000    | 230,942    | 2030/1/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回 |                       | 2.1   | 200,000    | 230,116    | 2030/4/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回 |                       | 1.9   | 200,000    | 227,578    | 2030/7/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回 |                       | 2.1   | 100,000    | 124,308    | 2040/11/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回 |                       | 1.83  | 100,000    | 119,931    | 2042/5/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回 |                       | 1.634 | 100,000    | 113,621    | 2032/7/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回 |                       | 1.56  | 100,000    | 112,893    | 2032/8/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回 |                       | 1.919 | 300,000    | 364,989    | 2042/8/29  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回 |                       | 1.726 | 100,000    | 114,998    | 2033/1/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第185回 |                       | 1.757 | 200,000    | 230,770    | 2033/2/28  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回 |                       | 0.605 | 400,000    | 402,916    | 2023/5/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回 |                       | 0.882 | 1,000,000  | 1,011,270  | 2023/6/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回 |                       | 0.835 | 272,000    | 275,291    | 2023/8/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回 |                       | 0.693 | 300,000    | 303,654    | 2023/12/28 |

| 銘柄                |            | 当 期 末 |         |         |            |
|-------------------|------------|-------|---------|---------|------------|
|                   |            | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 特殊債券(除く金融債)       |            | %     | 千円      | 千円      |            |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第211回 | 0.66  | 137,000 | 138,731 | 2024/2/29  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第213回 | 0.645 | 745,000 | 754,506 | 2024/3/29  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第216回 | 1.483 | 100,000 | 113,195 | 2034/4/28  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第217回 | 1.72  | 100,000 | 118,118 | 2044/5/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第219回 | 1.478 | 100,000 | 113,104 | 2034/5/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第220回 | 0.644 | 300,000 | 304,260 | 2024/6/28  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第224回 | 1.72  | 100,000 | 118,182 | 2044/8/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第225回 | 0.556 | 190,000 | 192,504 | 2024/8/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第229回 | 0.539 | 630,000 | 638,574 | 2024/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第234回 | 0.466 | 100,000 | 101,238 | 2024/12/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第239回 | 1.16  | 500,000 | 546,690 | 2035/2/28  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第241回 | 0.45  | 200,000 | 202,638 | 2025/3/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第245回 | 1.079 | 300,000 | 325,128 | 2035/4/27  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第258回 | 0.386 | 400,000 | 405,164 | 2025/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第261回 | 0.381 | 401,000 | 406,208 | 2025/11/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第271回 | 0.02  | 151,000 | 150,873 | 2026/3/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第296回 | 0.522 | 200,000 | 200,614 | 2036/11/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第297回 | 0.085 | 100,000 | 100,025 | 2026/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第306回 | 0.145 | 403,000 | 404,289 | 2027/3/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第315回 | 0.13  | 100,000 | 100,130 | 2027/6/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第321回 | 0.155 | 600,000 | 601,452 | 2027/8/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第324回 | 0.09  | 100,000 | 99,863  | 2027/9/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第335回 | 0.84  | 100,000 | 98,340  | 2047/12/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第339回 | 0.195 | 500,000 | 502,055 | 2028/2/29  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第342回 | 0.145 | 131,000 | 131,116 | 2028/3/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第351回 | 0.145 | 100,000 | 100,031 | 2028/6/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第354回 | 0.13  | 200,000 | 199,874 | 2028/7/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第357回 | 0.209 | 100,000 | 100,407 | 2028/8/31  |
| 民間都市開発推進機構        | 政府保証第16回   | 0.699 | 360,000 | 364,006 | 2023/10/20 |
| 民間都市開発推進機構        | 政府保証第17回   | 0.145 | 400,000 | 401,700 | 2026/2/26  |
| 関西国際空港債券          | 政府保証第54回   | 2.4   | 300,000 | 341,961 | 2028/6/23  |
| 中部国際空港債券          | 政府保証第22回   | 0.001 | 300,000 | 300,012 | 2024/3/1   |
| 預金保険機構債券          | 政府保証第230回  | 0.1   | 600,000 | 601,260 | 2024/8/6   |
| 預金保険機構債券          | 政府保証第231回  | 0.1   | 300,000 | 300,645 | 2024/10/4  |
| 新関西国際空港社債         | 財投機関債第6回   | 1.445 | 300,000 | 323,811 | 2028/9/15  |
| 新関西国際空港社債         | 財投機関債第9回   | 1.231 | 100,000 | 106,766 | 2028/12/20 |
| 新関西国際空港社債         | 財投機関債第12回  | 1.067 | 100,000 | 105,945 | 2029/9/20  |
| 新関西国際空港社債         | 財投機関債第22回  | 0.05  | 200,000 | 200,054 | 2023/12/20 |
| 日本政策投資銀行社債        | 財投機関債第47回  | 1.027 | 100,000 | 105,691 | 2029/9/20  |
| 日本政策投資銀行社債        | 財投機関債第66回  | 0.09  | 400,000 | 400,308 | 2026/4/17  |
| 日本政策投資銀行社債        | 財投機関債第78回  | 0.225 | 200,000 | 201,138 | 2027/4/13  |
| 日本政策投資銀行社債        | 財投機関債第82回  | 0.27  | 100,000 | 100,761 | 2027/7/13  |
| 日本政策投資銀行社債        | 財投機関債第86回  | 0.235 | 300,000 | 301,482 | 2027/10/13 |
| 日本政策投資銀行社債        | 財投機関債第96回  | 0.195 | 200,000 | 200,000 | 2028/7/12  |
| 日本政策投資銀行社債        | 財投機関債第101回 | 0.309 | 300,000 | 302,010 | 2028/10/12 |
| 日本政策投資銀行社債        | 財投機関債第137回 | 0.03  | 400,000 | 399,348 | 2026/3/19  |
| 日本政策投資銀行社債        | 財投機関債第138回 | 0.145 | 400,000 | 394,984 | 2031/1/15  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第1回   | 2.99  | 200,000 | 285,690 | 2045/9/20  |

| 銘                       | 柄          | 当 期 末 |           |           |            |
|-------------------------|------------|-------|-----------|-----------|------------|
|                         |            | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 特殊債券(除く金融債)             |            | %     | 千円        | 千円        |            |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第4回   | 2.59  | 100,000   | 127,526   | 2035/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第8回   | 2.45  | 200,000   | 218,860   | 2026/3/19  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第17回  | 2.35  | 100,000   | 110,080   | 2026/9/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第23回  | 2.39  | 300,000   | 335,703   | 2027/7/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第33回  | 2.91  | 200,000   | 287,268   | 2048/3/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第39回  | 2.37  | 300,000   | 341,697   | 2028/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第47回  | 2.41  | 100,000   | 115,199   | 2029/4/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第89回  | 1.711 | 100,000   | 113,701   | 2032/6/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第103回 | 1.69  | 350,000   | 399,311   | 2033/3/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第105回 | 1.853 | 100,000   | 115,808   | 2033/3/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第107回 | 0.935 | 100,000   | 101,131   | 2023/6/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第116回 | 0.722 | 400,000   | 404,132   | 2023/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第122回 | 0.704 | 100,000   | 101,315   | 2024/3/19  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第123回 | 0.69  | 100,000   | 101,287   | 2024/3/19  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第130回 | 0.56  | 200,000   | 202,326   | 2024/6/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第134回 | 0.529 | 200,000   | 202,188   | 2024/6/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第136回 | 0.583 | 200,000   | 202,682   | 2024/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第145回 | 1.523 | 300,000   | 338,166   | 2044/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第149回 | 1.604 | 100,000   | 114,185   | 2045/3/17  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第157回 | 0.857 | 100,000   | 104,678   | 2030/6/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第164回 | 1.149 | 100,000   | 108,476   | 2035/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第173回 | 0.652 | 100,000   | 87,957    | 2056/3/17  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第188回 | 0.614 | 100,000   | 100,426   | 2037/9/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 財投機関債第260回 | 0.651 | 200,000   | 182,546   | 2050/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継       | 財投機関債第28回  | 2.83  | 400,000   | 510,520   | 2033/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継       | 財投機関債第33回  | 2.91  | 100,000   | 129,379   | 2034/6/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継       | 財投機関債第38回  | 2.26  | 1,000,000 | 1,054,860 | 2024/9/20  |
| 公営企業債券 30年第4回           | 財投機関債      | 2.95  | 100,000   | 129,714   | 2034/3/24  |
| 地方公営企業等金融機構債券 (20年) 第1回 |            | 2.07  | 100,000   | 112,400   | 2028/12/20 |
| 地方公共団体金融機構債券 (20年) 第1回  |            | 2.266 | 300,000   | 343,353   | 2029/6/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第4回     |            | 2.12  | 100,000   | 114,202   | 2029/12/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 F16回       |            | 2.042 | 100,000   | 109,252   | 2027/1/7   |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第6回     |            | 2.242 | 300,000   | 346,530   | 2030/3/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第7回     |            | 2.202 | 300,000   | 346,170   | 2030/4/26  |
| 地方公共団体金融機構債券 (20年) 第10回 |            | 1.752 | 300,000   | 336,546   | 2030/8/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 F104回      |            | 1.314 | 100,000   | 103,746   | 2025/3/7   |
| 地方公共団体金融機構債券 F106回      |            | 1.259 | 100,000   | 102,416   | 2024/3/19  |
| 地方公共団体金融機構債券 F122回      |            | 1.412 | 100,000   | 106,696   | 2027/6/18  |
| 地方公共団体金融機構債券 F124回      |            | 1.418 | 100,000   | 106,682   | 2027/6/4   |
| 地方公共団体金融機構債券 F132回      |            | 1.09  | 500,000   | 517,375   | 2025/7/30  |
| 地方公共団体金融機構債券 F142回      |            | 1.016 | 100,000   | 102,593   | 2024/11/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 F145回      |            | 1.059 | 200,000   | 206,068   | 2025/3/19  |
| 地方公共団体金融機構債券 F147回      |            | 1.291 | 100,000   | 105,910   | 2027/3/19  |
| 地方公共団体金融機構債券 F160回      |            | 1.052 | 100,000   | 105,241   | 2028/5/26  |
| 地方公共団体金融機構債券 (20年) 第29回 |            | 1.725 | 100,000   | 114,890   | 2033/6/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 第51回       |            | 0.841 | 600,000   | 606,972   | 2023/8/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 第52回       |            | 0.801 | 300,000   | 303,567   | 2023/9/15  |
| 地方公共団体金融機構債券 (15年) 第2回  |            | 1.161 | 200,000   | 212,714   | 2028/12/28 |

| 銘            |            | 柄         | 期 末   |         |         |            |
|--------------|------------|-----------|-------|---------|---------|------------|
|              |            |           | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 特殊債券(除く金融債)  |            |           | %     | 千円      | 千円      |            |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年)      | 第38回      | 1.487 | 100,000 | 112,708 | 2034/7/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 | F 240回     |           | 1.069 | 300,000 | 318,813 | 2030/2/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第64回       |           | 0.574 | 100,000 | 101,318 | 2024/9/27  |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年)      | 第39回      | 1.425 | 100,000 | 111,998 | 2034/9/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年)      | 第43回      | 1.171 | 100,000 | 108,910 | 2035/4/27  |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第74回       |           | 0.519 | 300,000 | 304,719 | 2025/7/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第77回       |           | 0.491 | 100,000 | 101,555 | 2025/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第79回       |           | 0.484 | 400,000 | 406,312 | 2025/12/26 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第95回       |           | 0.2   | 200,000 | 200,886 | 2027/4/28  |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第101回      |           | 0.235 | 400,000 | 401,992 | 2027/10/28 |
| 公営企業債券       | (20年)      | 第5回財投機関債  | 2.11  | 200,000 | 206,156 | 2023/9/20  |
| 公営企業債券       | (20年)      | 第19回財投機関債 | 2.37  | 100,000 | 110,681 | 2026/12/18 |
| 公営企業債券       | (20年)      | 第20回財投機関債 | 2.25  | 100,000 | 110,677 | 2027/3/24  |
| 公営企業債券       | (20年)      | 第23回財投機関債 | 2.29  | 200,000 | 223,458 | 2027/9/24  |
| 公営企業債券       | (20年)      | 第24回財投機関債 | 2.29  | 100,000 | 112,661 | 2028/4/25  |
| 公営企業債券       | (20年)      | 第25回財投機関債 | 2.5   | 100,000 | 114,234 | 2028/6/20  |
| 首都高速道路       | 第28回       |           | 0.04  | 200,000 | 199,288 | 2026/9/18  |
| 阪神高速道路       | 第25回       |           | 0.03  | 100,000 | 99,719  | 2026/3/19  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第96回  |           | 0.599 | 200,000 | 202,762 | 2024/9/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第97回  |           | 1.017 | 100,000 | 105,617 | 2029/9/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第101回 |           | 0.935 | 100,000 | 105,092 | 2029/11/20 |
| 都市再生債券       | 財投機関債第109回 |           | 0.918 | 100,000 | 105,168 | 2030/6/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第113回 |           | 0.851 | 300,000 | 314,043 | 2030/9/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第121回 |           | 0.482 | 200,000 | 203,268 | 2031/2/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第127回 |           | 0.075 | 100,000 | 99,933  | 2026/9/18  |
| 本州四国連絡橋債券    | 財投機関債第7回   |           | 2.26  | 100,000 | 107,073 | 2025/6/20  |
| 東京交通債券       | 第347回      |           | 2.05  | 157,000 | 162,889 | 2024/3/8   |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第3回   |           | 2.26  | 400,000 | 442,684 | 2027/3/19  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第6回   |           | 2.46  | 200,000 | 224,196 | 2027/6/18  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第18回  |           | 2.15  | 100,000 | 103,137 | 2023/9/20  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第42回  |           | 1.94  | 100,000 | 105,645 | 2025/3/19  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第49回  |           | 2.11  | 100,000 | 114,783 | 2030/6/18  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第59回  |           | 1.95  | 100,000 | 114,051 | 2030/10/22 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第75回  |           | 2.066 | 100,000 | 115,920 | 2031/6/13  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第77回  |           | 1.751 | 300,000 | 321,141 | 2026/6/19  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第78回  |           | 2.056 | 100,000 | 115,902 | 2031/7/11  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第81回  |           | 1.926 | 100,000 | 114,942 | 2031/9/12  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第85回  |           | 1.841 | 200,000 | 228,496 | 2031/10/17 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第90回  |           | 1.595 | 200,000 | 214,086 | 2026/12/18 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第115回 |           | 1.811 | 100,000 | 114,914 | 2032/9/14  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第120回 |           | 1.836 | 100,000 | 115,312 | 2032/11/12 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第123回 |           | 1.801 | 200,000 | 229,652 | 2032/9/17  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第128回 |           | 2.273 | 100,000 | 126,792 | 2042/9/19  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第132回 |           | 1.092 | 200,000 | 210,692 | 2028/3/17  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第137回 |           | 1.31  | 100,000 | 106,884 | 2028/6/20  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第143回 |           | 1.192 | 100,000 | 106,382 | 2028/10/20 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第177回 |           | 0.484 | 450,000 | 457,146 | 2025/12/19 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第188回 |           | 0.09  | 300,000 | 300,180 | 2026/5/20  |

| 銘                      | 柄          | 当 期 末 |         |         |            |
|------------------------|------------|-------|---------|---------|------------|
|                        |            | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 特殊債券(除く金融債)            |            | %     | 千円      | 千円      |            |
| 住宅金融支援機構債券             | 財投機関債第198回 | 0.155 | 300,000 | 300,843 | 2026/12/18 |
| 住宅金融支援機構債券             | 財投機関債第208回 | 0.215 | 200,000 | 200,986 | 2027/5/20  |
| 住宅金融支援機構債券             | 財投機関債第223回 | 0.403 | 100,000 | 100,435 | 2032/11/19 |
| 住宅金融支援機構債券             | 財投機関債第244回 | 0.274 | 130,000 | 130,605 | 2028/8/18  |
| 住宅金融支援機構債券             | 財投機関債第301回 | 0.04  | 300,000 | 299,766 | 2025/12/19 |
| 成田国際空港                 | 第17回       | 0.489 | 400,000 | 404,996 | 2025/2/20  |
| 成田国際空港                 | 第19回       | 0.275 | 100,000 | 100,732 | 2026/2/18  |
| 沖縄振興開発金融公庫債券           | 財投機関債第6回   | 2.04  | 200,000 | 212,868 | 2025/6/20  |
| 国際協力機構債券               | 第6回財投機関債   | 2.098 | 200,000 | 230,976 | 2030/12/13 |
| 国際協力機構債券               | 第23回財投機関債  | 0.684 | 100,000 | 101,242 | 2024/2/21  |
| 東日本高速道路                | 第61回       | 0.14  | 200,000 | 198,332 | 2029/7/31  |
| 東日本高速道路                | 第83回       | 0.05  | 200,000 | 199,496 | 2026/6/19  |
| 東日本高速道路                | 第86回       | 0.04  | 400,000 | 398,312 | 2026/12/18 |
| 中日本高速道路                | 第63回       | 0.576 | 100,000 | 101,807 | 2025/11/13 |
| 中日本高速道路                | 第79回       | 0.04  | 300,000 | 299,853 | 2024/8/19  |
| 中日本高速道路                | 第86回       | 0.06  | 100,000 | 99,920  | 2026/1/22  |
| 中日本高速道路                | 第89回       | 0.05  | 100,000 | 99,770  | 2026/6/1   |
| 中日本高速道路                | 第90回       | 0.05  | 300,000 | 299,223 | 2026/7/27  |
| 中日本高速道路                | 第91回       | 0.04  | 200,000 | 199,288 | 2026/9/17  |
| 西日本高速道路                | 第20回       | 0.759 | 200,000 | 202,174 | 2023/9/20  |
| 西日本高速道路                | 第22回       | 0.744 | 400,000 | 405,572 | 2024/3/19  |
| 西日本高速道路                | 第23回       | 0.602 | 100,000 | 101,211 | 2024/6/20  |
| 西日本高速道路                | 第30回       | 0.17  | 300,000 | 300,798 | 2026/5/22  |
| 西日本高速道路                | 第50回       | 0.04  | 200,000 | 199,906 | 2024/6/20  |
| 西日本高速道路                | 第64回       | 0.04  | 200,000 | 199,288 | 2026/9/18  |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第57回  | 0.835 | 300,000 | 303,024 | 2023/6/20  |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第62回  | 0.714 | 100,000 | 101,188 | 2023/12/20 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第68回  | 0.586 | 200,000 | 202,558 | 2024/8/5   |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第69回  | 1.441 | 100,000 | 111,989 | 2034/8/4   |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第71回  | 0.525 | 500,000 | 506,430 | 2024/11/27 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第90回  | 0.2   | 300,000 | 297,222 | 2031/5/30  |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第135回 | 0.11  | 300,000 | 296,286 | 2030/2/27  |
| 貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券     |            | 1.8   | 47,955  | 47,964  | 2039/6/10  |
| 貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券     |            | 2.34  | 31,527  | 31,840  | 2041/5/10  |
| 貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券    |            | 2.25  | 9,812   | 9,814   | 2037/5/10  |
| 貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券     |            | 1.84  | 21,762  | 22,037  | 2041/2/10  |
| 貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券     |            | 1.93  | 24,848  | 25,499  | 2041/3/10  |
| 貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券     |            | 1.69  | 44,552  | 45,068  | 2040/7/10  |
| 貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券     |            | 2.12  | 48,220  | 48,231  | 2039/7/10  |
| 貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券     |            | 2.3   | 42,676  | 43,433  | 2041/7/10  |
| 貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券    |            | 1.99  | 68,136  | 69,297  | 2042/12/10 |
| 貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券    |            | 2.14  | 11,942  | 12,209  | 2042/11/10 |
| 貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券   |            | 2.28  | 18,253  | 19,340  | 2044/6/10  |
| 貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券   |            | 1.98  | 60,456  | 63,777  | 2044/9/10  |
| 貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券 |            | 1.64  | 8,461   | 8,462   | 2032/11/10 |
| 貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券   |            | 1.43  | 55,408  | 57,873  | 2045/11/10 |
| 貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券 |            | 1.71  | 16,994  | 16,997  | 2032/11/10 |
| 貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券   |            | 1.79  | 65,904  | 69,261  | 2046/2/10  |

| 銘柄                    | 利 率  | 当 期 末   |         |            |
|-----------------------|------|---------|---------|------------|
|                       |      | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 特殊債券(除く金融債)           | %    | 千円      | 千円      |            |
| 貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券  | 1.51 | 49,404  | 51,584  | 2046/9/10  |
| 貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券  | 2.34 | 32,882  | 34,639  | 2044/5/10  |
| 貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券  | 1.89 | 61,290  | 64,340  | 2046/5/10  |
| 貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券  | 1.36 | 70,320  | 73,032  | 2045/9/10  |
| 貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券  | 1.21 | 110,910 | 115,269 | 2047/7/10  |
| 貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券  | 1.34 | 104,337 | 108,795 | 2047/5/10  |
| 貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券  | 1.26 | 68,310  | 71,058  | 2047/6/10  |
| 貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券  | 1.64 | 22,919  | 23,961  | 2046/8/10  |
| 貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券  | 1.6  | 54,536  | 57,348  | 2045/12/10 |
| 貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券  | 1.07 | 36,254  | 37,496  | 2048/12/10 |
| 貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券  | 1.07 | 79,276  | 82,037  | 2049/2/10  |
| 貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券  | 1.08 | 35,126  | 36,332  | 2048/5/10  |
| 貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券    | 1.87 | 19,636  | 19,640  | 2039/9/10  |
| 貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券  | 1.25 | 107,292 | 111,774 | 2048/3/10  |
| 貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券  | 1.88 | 22,695  | 23,962  | 2045/2/10  |
| 貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券  | 1.86 | 23,817  | 25,165  | 2045/3/10  |
| 貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券  | 1.87 | 22,160  | 23,409  | 2045/4/10  |
| 貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券  | 1.85 | 21,588  | 22,722  | 2046/3/10  |
| 貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券  | 1.41 | 61,322  | 64,063  | 2046/12/10 |
| 貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券  | 1.42 | 88,764  | 92,673  | 2047/1/10  |
| 貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券  | 1.44 | 30,209  | 31,557  | 2047/2/10  |
| 貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券  | 1.21 | 69,196  | 71,954  | 2048/9/10  |
| 貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券  | 2.25 | 64,692  | 67,966  | 2044/4/10  |
| 貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券  | 1.82 | 65,358  | 68,801  | 2045/1/10  |
| 貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券  | 1.52 | 116,340 | 121,429 | 2045/8/10  |
| 貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券  | 1.4  | 68,702  | 71,803  | 2047/3/10  |
| 貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券  | 1.16 | 119,025 | 123,574 | 2047/9/10  |
| 貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券  | 1.07 | 102,831 | 106,303 | 2048/4/10  |
| 貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券  | 1.3  | 81,394  | 85,162  | 2048/6/10  |
| 貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券  | 1.26 | 67,616  | 70,459  | 2048/8/10  |
| 貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券  | 1.04 | 167,964 | 173,627 | 2049/4/10  |
| 貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券  | 1.01 | 289,590 | 298,929 | 2049/5/10  |
| 貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券  | 0.93 | 44,519  | 45,782  | 2049/9/10  |
| 貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券  | 0.95 | 45,806  | 47,153  | 2049/10/10 |
| 貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券  | 0.87 | 47,221  | 48,424  | 2049/11/10 |
| 貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券  | 0.74 | 98,986  | 100,819 | 2050/1/10  |
| 貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券  | 0.6  | 104,948 | 106,055 | 2050/2/10  |
| 貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券  | 0.8  | 55,060  | 56,248  | 2050/3/10  |
| 貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券  | 0.74 | 58,938  | 60,032  | 2050/5/10  |
| 貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券  | 0.83 | 175,536 | 179,647 | 2050/6/10  |
| 貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券  | 0.9  | 181,524 | 186,452 | 2050/7/10  |
| 貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券  | 0.88 | 122,374 | 125,528 | 2050/8/10  |
| 貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券 | 0.84 | 59,037  | 60,442  | 2050/9/10  |
| 貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券 | 0.89 | 60,253  | 61,856  | 2050/10/10 |
| 貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券 | 0.41 | 227,583 | 226,986 | 2051/12/10 |
| 貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券 | 0.48 | 152,614 | 152,861 | 2052/1/10  |
| 貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 153,860 | 153,830 | 2052/2/10  |
| 貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券 | 0.47 | 76,630  | 76,706  | 2052/3/10  |

| 銘                         | 柄 | 当 期 末 |            |            |            |
|---------------------------|---|-------|------------|------------|------------|
|                           |   | 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償 還 年 月 日  |
| 特殊債券(除く金融債)               |   | %     | 千円         | 千円         |            |
| 貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券     |   | 0.46  | 153,474    | 153,512    | 2052/4/10  |
| 貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券     |   | 0.4   | 77,284     | 77,038     | 2052/5/10  |
| 貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券     |   | 0.43  | 77,966     | 77,846     | 2052/6/10  |
| 貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券     |   | 0.46  | 79,113     | 79,112     | 2052/8/10  |
| 貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券     |   | 0.42  | 316,640    | 315,731    | 2052/10/10 |
| 貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券     |   | 0.43  | 239,586    | 238,996    | 2052/11/10 |
| 貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券     |   | 0.42  | 159,776    | 159,259    | 2053/1/10  |
| 貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券     |   | 0.46  | 163,342    | 163,155    | 2053/2/10  |
| 貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券     |   | 0.39  | 165,444    | 164,532    | 2053/7/10  |
| 貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券     |   | 0.39  | 83,201     | 82,723     | 2053/8/10  |
| 貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券     |   | 0.44  | 83,926     | 83,718     | 2053/9/10  |
| 貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券     |   | 0.38  | 84,144     | 83,543     | 2054/1/10  |
| 貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券     |   | 0.32  | 259,845    | 256,877    | 2054/3/10  |
| 貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券     |   | 0.33  | 258,975    | 256,102    | 2054/5/10  |
| 貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券     |   | 0.21  | 449,695    | 440,566    | 2054/11/10 |
| 貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券     |   | 0.33  | 181,820    | 179,687    | 2055/1/10  |
| 貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券     |   | 0.3   | 183,262    | 180,650    | 2055/3/10  |
| 貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券     |   | 0.33  | 287,067    | 283,182    | 2056/1/10  |
| 貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券     |   | 0.36  | 191,340    | 189,237    | 2056/2/10  |
| 貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券     |   | 0.41  | 287,844    | 285,820    | 2056/3/10  |
| 貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券     |   | 0.41  | 193,174    | 191,746    | 2056/4/10  |
| 貸付債権担保第168回住宅金融支援機構債券     |   | 0.4   | 193,346    | 191,733    | 2056/5/10  |
| 貸付債権担保第169回住宅金融支援機構債券     |   | 0.39  | 291,225    | 288,472    | 2056/6/10  |
| 貸付債権担保第170回住宅金融支援機構債券     |   | 0.36  | 487,895    | 482,054    | 2056/7/10  |
| 貸付債権担保第174回住宅金融支援機構債券     |   | 0.38  | 296,436    | 293,261    | 2056/11/10 |
| 貸付債権担保第175回住宅金融支援機構債券     |   | 0.36  | 297,600    | 293,841    | 2056/12/10 |
| 貸付債権担保第176回住宅金融支援機構債券     |   | 0.32  | 298,263    | 293,800    | 2057/1/10  |
| 貸付債権担保第177回住宅金融支援機構債券     |   | 0.4   | 199,656    | 198,014    | 2057/2/10  |
| 貸付債権担保第178回住宅金融支援機構債券     |   | 0.48  | 300,000    | 299,928    | 2057/3/10  |
| 貸付債権担保第179回住宅金融支援機構債券     |   | 0.46  | 300,000    | 299,727    | 2057/4/10  |
| フランス預金供託公庫 第4回円貨債券 (2014) |   | 0.725 | 100,000    | 101,115    | 2024/7/30  |
| 小                         | 計 |       | 60,880,889 | 63,220,691 |            |
| 金融債券                      |   |       |            |            |            |
| 商工債券 利付第818回い号            |   | 0.17  | 100,000    | 100,121    | 2023/7/27  |
| 商工債券 利付第819回い号            |   | 0.18  | 300,000    | 300,411    | 2023/8/25  |
| 商工債券 利付第829回い号            |   | 0.13  | 200,000    | 200,084    | 2024/6/27  |
| 商工債券 利付第831回い号            |   | 0.08  | 200,000    | 199,854    | 2024/8/27  |
| 商工債券 利付第833回い号            |   | 0.05  | 100,000    | 99,813     | 2024/10/25 |
| 商工債券 利付第845回い号            |   | 0.12  | 300,000    | 299,727    | 2025/10/27 |
| 商工債券 利付第852回い号            |   | 0.09  | 100,000    | 99,648     | 2026/5/27  |
| 商工債券 利付第854回い号            |   | 0.08  | 400,000    | 398,284    | 2026/7/27  |
| 商工債券 利付第856回い号            |   | 0.09  | 200,000    | 199,110    | 2026/9/25  |
| しんきん中金債券 利付第374回          |   | 0.05  | 300,000    | 299,187    | 2026/1/27  |
| しんきん中金債券 利付第377回          |   | 0.04  | 100,000    | 99,633     | 2026/4/27  |
| しんきん中金債券 利付第379回          |   | 0.04  | 400,000    | 398,312    | 2026/6/26  |
| しんきん中金債券 利付第380回          |   | 0.03  | 100,000    | 99,527     | 2026/7/27  |
| 商工債券 利付(3年)第258回          |   | 0.04  | 100,000    | 99,836     | 2024/7/26  |

| 銘柄               |  | 当 期 末 |           |           |            |
|------------------|--|-------|-----------|-----------|------------|
|                  |  | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 金融債券             |  | %     | 千円        | 千円        |            |
| 商工債券 利付（10年）第15回 |  | 0.48  | 200,000   | 202,348   | 2025/9/19  |
| 小 計              |  |       | 3,100,000 | 3,095,895 |            |
| 普通社債券(含む投資法人債券)  |  |       |           |           |            |
| 東京電力 第548回       |  | 2.347 | 100,000   | 110,509   | 2028/9/29  |
| 東京電力 第560回       |  | 2.114 | 100,000   | 109,961   | 2029/12/10 |
| 中部電力 第500回       |  | 0.875 | 200,000   | 203,036   | 2024/5/24  |
| 中部電力 第524回       |  | 0.39  | 100,000   | 100,362   | 2027/5/25  |
| 中部電力 第530回       |  | 0.274 | 200,000   | 197,660   | 2029/6/25  |
| 関西電力 第509回       |  | 0.47  | 100,000   | 100,614   | 2027/5/25  |
| 関西電力 第511回       |  | 0.41  | 300,000   | 300,804   | 2027/9/17  |
| 関西電力 第527回       |  | 0.28  | 200,000   | 200,388   | 2024/4/25  |
| 関西電力 第535回       |  | 0.18  | 200,000   | 199,586   | 2025/12/19 |
| 中国電力 第377回       |  | 1.121 | 100,000   | 101,363   | 2023/8/25  |
| 中国電力 第400回       |  | 0.34  | 100,000   | 99,973    | 2027/9/24  |
| 中国電力 第402回       |  | 0.25  | 100,000   | 100,184   | 2024/10/25 |
| 中国電力 第416回       |  | 0.355 | 100,000   | 99,577    | 2029/5/25  |
| 中国電力 第422回       |  | 0.35  | 600,000   | 595,110   | 2030/4/25  |
| 中国電力 第425回       |  | 0.37  | 100,000   | 99,327    | 2030/6/25  |
| 北陸電力 第307回       |  | 1.055 | 100,000   | 103,308   | 2026/6/25  |
| 北陸電力 第308回       |  | 0.769 | 100,000   | 101,459   | 2024/9/25  |
| 北陸電力 第326回       |  | 0.719 | 100,000   | 99,241    | 2038/4/23  |
| 東北電力 第475回       |  | 0.809 | 100,000   | 101,558   | 2024/9/25  |
| 東北電力 第481回       |  | 0.803 | 200,000   | 203,806   | 2025/7/25  |
| 東北電力 第484回       |  | 0.758 | 100,000   | 100,620   | 2036/5/23  |
| 東北電力 第491回       |  | 0.42  | 100,000   | 100,696   | 2027/2/25  |
| 東北電力 第508回       |  | 0.465 | 100,000   | 100,303   | 2029/4/25  |
| 東北電力 第521回       |  | 0.45  | 300,000   | 299,886   | 2030/5/24  |
| 東北電力 第529回       |  | 0.07  | 200,000   | 198,546   | 2026/4/24  |
| 四国電力 第281回       |  | 1.111 | 100,000   | 101,410   | 2023/9/25  |
| 九州電力 第424回       |  | 1.233 | 100,000   | 101,757   | 2023/11/24 |
| 九州電力 第428回       |  | 0.936 | 105,000   | 106,793   | 2024/7/25  |
| 九州電力 第449回       |  | 0.43  | 200,000   | 200,928   | 2027/4/23  |
| 九州電力 第451回       |  | 0.45  | 100,000   | 100,412   | 2027/5/25  |
| 九州電力 第476回       |  | 0.43  | 100,000   | 99,752    | 2029/5/25  |
| 九州電力 第481回       |  | 0.324 | 300,000   | 296,781   | 2029/7/25  |
| 九州電力 第484回       |  | 0.375 | 200,000   | 198,376   | 2029/11/22 |
| 九州電力 第493回       |  | 0.1   | 300,000   | 298,026   | 2026/5/25  |
| 北海道電力 第321回      |  | 0.886 | 100,000   | 101,827   | 2024/12/25 |
| 北海道電力 第323回      |  | 1.337 | 100,000   | 106,547   | 2030/3/25  |
| 北海道電力 第338回      |  | 0.84  | 100,000   | 101,268   | 2036/11/25 |
| 北海道電力 第345回      |  | 0.27  | 300,000   | 300,447   | 2024/9/25  |
| 東京電力パワーグリッド 第6回  |  | 0.85  | 100,000   | 101,468   | 2027/8/31  |
| 東京電力パワーグリッド 第11回 |  | 0.79  | 300,000   | 303,477   | 2028/1/25  |
| 東京電力パワーグリッド 第14回 |  | 0.43  | 100,000   | 100,221   | 2023/7/24  |
| 東京電力パワーグリッド 第15回 |  | 0.89  | 300,000   | 302,211   | 2030/7/24  |
| 東京電力パワーグリッド 第28回 |  | 1.01  | 100,000   | 101,764   | 2029/7/10  |
| 東京電力パワーグリッド 第35回 |  | 1.2   | 100,000   | 103,211   | 2030/4/23  |
| 東京電力パワーグリッド 第38回 |  | 0.58  | 400,000   | 402,360   | 2025/7/16  |

| 銘                              | 柄 | 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       |              |
| 東京電力パワーグリッド 第40回               |   | 1. 37  | 400, 000 | 416, 096 | 2035/ 7 / 13 |
| 東京電力パワーグリッド 第45回               |   | 0. 8   | 300, 000 | 299, 562 | 2031/ 4 / 22 |
| I N P E X 第1回社債間限定同順位特約付       |   | 0. 08  | 500, 000 | 498, 310 | 2026/ 3 / 16 |
| 長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付    |   | 0. 47  | 200, 000 | 198, 958 | 2030/ 7 / 12 |
| 五洋建設 第7回社債間限定同順位特約付            |   | 0. 14  | 100, 000 | 99, 494  | 2026/ 9 / 25 |
| 大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付         |   | 0. 69  | 100, 000 | 99, 178  | 2036/ 11/ 28 |
| 大和ハウス工業 第25回特定社債間限定同順位特約付      |   | 0. 28  | 300, 000 | 297, 015 | 2031/ 6 / 3  |
| 日揮ホールディングス 第6回特定社債間限定同順位特約付    |   | 0. 03  | 200, 000 | 199, 700 | 2023/ 7 / 14 |
| 明治ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付     |   | 0. 05  | 200, 000 | 198, 546 | 2026/ 4 / 23 |
| アサヒグループホールディングス 第16回特定社債間限定同順位 |   | 0. 08  | 300, 000 | 298, 341 | 2026/ 3 / 13 |
| コカ・コーラボトラーズジャパン 第3回社債間限定同順位特約付 |   | 0. 27  | 100, 000 | 98, 603  | 2029/ 9 / 19 |
| 味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付          |   | 0. 19  | 100, 000 | 100, 136 | 2024/ 3 / 8  |
| 日本たばこ産業 第13回                   |   | 0. 355 | 100, 000 | 99, 749  | 2028/ 9 / 8  |
| 三越伊勢丹ホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付   |   | 0. 41  | 100, 000 | 99, 338  | 2027/ 8 / 31 |
| トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付           |   | 0. 714 | 100, 000 | 100, 747 | 2023/ 9 / 20 |
| 森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特 |   | 0. 34  | 200, 000 | 199, 356 | 2026/ 8 / 28 |
| 森ビル 第23回社債間限定同順位特約付            |   | 0. 97  | 100, 000 | 98, 391  | 2038/ 5 / 17 |
| セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約 |   | 0. 06  | 100, 000 | 99, 864  | 2023/ 12/ 20 |
| セブン&アイ・ホールディングス 第14回社債間限定同順位特約 |   | 0. 19  | 600, 000 | 599, 514 | 2025/ 12/ 19 |
| セブン&アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約 |   | 0. 28  | 200, 000 | 199, 220 | 2027/ 12/ 20 |
| 東レ 第30回社債間限定同順位特約付             |   | 0. 375 | 100, 000 | 100, 000 | 2027/ 7 / 16 |
| 東レ 第33回社債間限定同順位特約付             |   | 0. 38  | 100, 000 | 99, 633  | 2028/ 7 / 18 |
| 日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付          |   | 0. 734 | 200, 000 | 197, 864 | 2028/ 10/ 25 |
| 王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付     |   | 0. 425 | 100, 000 | 100, 204 | 2028/ 1 / 26 |
| 王子ホールディングス 第42回社債間限定同順位特約付     |   | 0. 08  | 600, 000 | 596, 898 | 2026/ 3 / 24 |
| 日本製紙 第15回社債間限定同順位特約付           |   | 0. 35  | 100, 000 | 98, 591  | 2031/ 9 / 10 |
| 住友化学 第56回社債間限定同順位特約付           |   | 0. 38  | 100, 000 | 99, 917  | 2027/ 9 / 13 |
| イビデン 第11回社債間限定同順位特約付           |   | 0. 001 | 100, 000 | 99, 695  | 2024/ 9 / 9  |
| 三井化学 第48回社債間限定同順位特約付           |   | 0. 39  | 100, 000 | 100, 044 | 2028/ 6 / 19 |
| 三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付 |   | 0. 33  | 100, 000 | 99, 619  | 2029/ 5 / 30 |
| 三菱ケミカルホールディングス 第33回社債間限定同順位特約付 |   | 0. 28  | 200, 000 | 197, 898 | 2030/ 2 / 28 |
| 三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付 |   | 0. 83  | 100, 000 | 97, 884  | 2040/ 6 / 11 |
| ダイセル 第17回社債間限定同順位特約付           |   | 0. 5   | 100, 000 | 100, 258 | 2030/ 12/ 13 |
| 電通 第3回社債間限定同順位特約付              |   | 0. 424 | 100, 000 | 100, 015 | 2028/ 10/ 25 |
| 電通 第6回社債間限定同順位特約付              |   | 0. 49  | 300, 000 | 300, 336 | 2030/ 7 / 8  |
| 武田薬品工業 第16回社債間限定同順位特約付         |   | 0. 4   | 200, 000 | 196, 554 | 2031/ 10/ 14 |
| ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付             |   | 0. 23  | 100, 000 | 99, 866  | 2024/ 5 / 31 |
| オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付      |   | 0. 15  | 100, 000 | 99, 801  | 2025/ 9 / 17 |
| オリエンタルランド 第18回社債間限定同順位特約付      |   | 0. 29  | 200, 000 | 197, 956 | 2030/ 9 / 17 |
| ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付             |   | 0. 35  | 100, 000 | 99, 905  | 2024/ 12/ 6  |
| ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付            |   | 0. 37  | 200, 000 | 198, 522 | 2026/ 7 / 31 |
| 楽天 第13回社債間限定同順位特約付             |   | 0. 45  | 100, 000 | 96, 169  | 2029/ 6 / 25 |
| 楽天 第15回社債間限定同順位特約付             |   | 0. 5   | 100, 000 | 99, 617  | 2024/ 12/ 2  |
| 出光興産 第14回社債間限定同順位特約付           |   | 0. 34  | 100, 000 | 98, 739  | 2031/ 7 / 15 |
| ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付         |   | 0. 295 | 100, 000 | 99, 865  | 2027/ 4 / 21 |
| 新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付           |   | 0. 385 | 300, 000 | 298, 953 | 2028/ 6 / 20 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順 |   | 0. 26  | 100, 000 | 99, 691  | 2026/ 5 / 27 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順 |   | 0. 25  | 100, 000 | 99, 972  | 2025/ 7 / 14 |

| 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      |            |
| 三菱マテリアル               | 第36回社債間限定同順位特約付          | 0.28  | 100,000 | 99,199  | 2028/6/7   |
| 住友金属鉱山                | 第33回社債間限定同順位特約付          | 0.09  | 200,000 | 198,682 | 2026/9/15  |
| 住友電気工業                | 第26回社債間限定同順位特約付          | 0.3   | 200,000 | 198,914 | 2027/3/1   |
| L I X I Lグループ         | 第11回社債間限定同順位特約付          | 0.01  | 300,000 | 299,508 | 2023/7/18  |
| 日立建機                  | 第20回社債間限定同順位特約付          | 0.38  | 100,000 | 98,819  | 2031/3/18  |
| 荏原製作所                 | 第10回社債間限定同順位特約付          | 0.19  | 100,000 | 99,586  | 2025/10/22 |
| 日立製作所                 | 第17回社債間限定同順位特約付          | 1.371 | 200,000 | 213,232 | 2028/12/13 |
| パナソニック                | 第17回社債間限定同順位特約付          | 0.47  | 200,000 | 201,638 | 2026/9/18  |
| パナソニック                | 第20回社債間限定同順位特約付          | 0.08  | 100,000 | 99,829  | 2023/12/22 |
| パナソニック                | 第21回社債間限定同順位特約付          | 0.19  | 100,000 | 99,808  | 2025/12/24 |
| パナソニック                | 第22回社債間限定同順位特約付          | 0.29  | 200,000 | 198,662 | 2027/12/24 |
| パナソニック                | 第23回社債間限定同順位特約付          | 0.39  | 100,000 | 98,718  | 2030/12/24 |
| ソニー                   | 第32回                     | 0.28  | 100,000 | 100,189 | 2023/9/20  |
| 東海理化電機製作所             | 第1回社債間限定同順位特約付           | 0.34  | 100,000 | 99,034  | 2027/6/7   |
| 三菱重工業                 | 第35回社債間限定同順位特約付          | 0.33  | 100,000 | 99,735  | 2027/8/27  |
| 三菱重工業                 | 第38回社債間限定同順位特約付(第2回グリーンボ | 0.09  | 300,000 | 298,227 | 2026/9/1   |
| J A 三井リース             | 第8回社債間限定同順位特約付           | 0.31  | 100,000 | 100,204 | 2024/9/13  |
| 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス | 第9回社債間限定                 | 0.22  | 100,000 | 99,729  | 2025/10/10 |
| トヨタ自動車                | 第26回社債間限定同順位特約付          | 0.05  | 700,000 | 697,487 | 2026/3/18  |
| トヨタ自動車                | 第27回社債間限定同順位特約付          | 0.219 | 300,000 | 297,366 | 2031/3/18  |
| 楽天カード                 | 第3回社債間限定同順位特約付           | 0.42  | 100,000 | 98,265  | 2026/12/11 |
| ドンキホーテホールディングス        | 第12回社債間限定同順位特約付          | 0.39  | 100,000 | 100,358 | 2024/3/21  |
| ニコン                   | 第22回特定社債間限定同順位特約付        | 0.15  | 100,000 | 99,538  | 2025/12/2  |
| 丸紅                    | 第113回社債間限定同順位特約付         | 0.36  | 100,000 | 98,809  | 2031/4/18  |
| 豊田通商                  | 第18回社債間限定同順位特約付          | 1.014 | 100,000 | 102,779 | 2025/12/5  |
| 豊田通商                  | 第19回社債間限定同順位特約付          | 0.954 | 200,000 | 205,652 | 2026/7/10  |
| 三井物産                  | 第64回社債間限定同順位特約付          | 2.36  | 100,000 | 110,488 | 2027/5/21  |
| 三井物産                  | 第71回社債間限定同順位特約付          | 1.187 | 100,000 | 105,524 | 2029/7/13  |
| 住友商事                  | 第49回社債間限定同順位特約付          | 1.286 | 100,000 | 105,742 | 2029/1/29  |
| 住友商事                  | 第53回社債間限定同順位特約付          | 0.33  | 100,000 | 99,916  | 2027/7/26  |
| クレディセゾン               | 第50回社債間限定同順位特約付          | 0.904 | 100,000 | 101,495 | 2024/4/24  |
| クレディセゾン               | 第65回社債間限定同順位特約付          | 0.38  | 100,000 | 99,994  | 2027/7/30  |
| クレディセゾン               | 第76回社債間限定同順位特約付          | 0.3   | 100,000 | 98,523  | 2029/7/31  |
| イオン                   | 第20回社債間限定同順位特約付          | 0.82  | 100,000 | 101,313 | 2024/6/28  |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ     | 第1回劣後特約付                 | 0.94  | 100,000 | 101,261 | 2024/6/26  |
| りそなホールディングス           | 第20回社債間限定同順位特約付          | 0.27  | 100,000 | 100,070 | 2025/7/23  |
| 三井住友トラスト・ホールディングス     | 第2回劣後特約付                 | 0.915 | 200,000 | 202,446 | 2025/6/5   |
| みずほコーポレート銀行           | 第8回特定社債間限定同順位特約付         | 2.54  | 100,000 | 111,666 | 2027/7/27  |
| 三菱東京UFJ銀行             | 第23回劣後特約付                | 2.91  | 100,000 | 116,536 | 2029/10/16 |
| 三菱東京UFJ銀行             | 第24回劣後特約付                | 2.27  | 100,000 | 112,582 | 2030/9/27  |
| 三井住友フィナンシャルグループ       | 第1回劣後特約付                 | 0.849 | 300,000 | 303,225 | 2024/9/12  |
| 三井住友フィナンシャルグループ       | 第3回劣後特約付                 | 0.884 | 100,000 | 101,277 | 2025/5/29  |
| 三井住友フィナンシャルグループ       | 第4回劣後特約付                 | 1.328 | 100,000 | 104,794 | 2030/5/29  |
| 三井住友信託銀行              | 第18回社債間限定同順位特約付          | 0.16  | 200,000 | 199,608 | 2026/1/27  |
| セブン銀行                 | 第11回社債間限定同順位特約付          | 0.536 | 100,000 | 101,018 | 2024/12/20 |
| セブン銀行                 | 第12回社債間限定同順位特約付          | 0.39  | 300,000 | 302,010 | 2027/9/17  |
| みずほフィナンシャルグループ        | 第1回劣後特約付                 | 0.95  | 200,000 | 202,124 | 2024/7/16  |
| みずほ銀行                 | 第7回劣後特約付                 | 2.87  | 100,000 | 109,949 | 2026/11/6  |

| 銘                   | 柄                  | 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      |            |
| 芙蓉総合リース             | 第26回社債間限定同順位特約付    | 0.03  | 200,000 | 199,566 | 2023/10/20 |
| みずほリース              | 第3回社債間限定同順位特約付     | 0.24  | 300,000 | 299,769 | 2025/7/15  |
| みずほリース              | 第7回社債間限定同順位特約付     | 0.33  | 200,000 | 198,708 | 2028/1/20  |
| N T Tファイナンス         | 第2回社債間限定同順位特約付     | 0.26  | 100,000 | 100,054 | 2026/12/18 |
| N T Tファイナンス         | 第16回日本電信電話保証付      | 0.18  | 100,000 | 99,956  | 2025/12/19 |
| N T Tファイナンス         | 第17回日本電信電話保証付      | 0.28  | 200,000 | 199,612 | 2027/12/20 |
| N T Tファイナンス         | 第18回日本電信電話保証付      | 0.38  | 300,000 | 299,874 | 2030/9/20  |
| 東京センチュリー            | 第33回社債間限定同順位特約付    | 0.28  | 100,000 | 98,947  | 2028/4/27  |
| ホンダファイナンス           | 第69回社債間限定同順位特約付    | 0.09  | 200,000 | 198,912 | 2026/6/19  |
| トヨタファイナンス           | 第81回社債間限定同順位特約付    | 0.265 | 100,000 | 99,781  | 2027/10/22 |
| トヨタファイナンス           | 第96回社債間限定同順位特約付    | 0.06  | 800,000 | 797,080 | 2026/4/15  |
| リコーリース              | 第28回社債間限定同順位特約付    | 0.345 | 100,000 | 99,786  | 2027/7/20  |
| イオンフィナンシャルサービス      | 第6回社債間限定同順位特約付     | 0.35  | 100,000 | 100,006 | 2024/5/28  |
| アコム                 | 第77回特定社債間限定同順位特約付  | 0.274 | 100,000 | 100,082 | 2023/8/30  |
| アコム                 | 第78回特定社債間限定同順位特約付  | 0.38  | 100,000 | 100,024 | 2026/8/28  |
| ジャックス               | 第19回社債間限定同順位特約付    | 0.25  | 100,000 | 100,058 | 2023/6/15  |
| オリエントコーポレーション       | 第32回社債間限定同順位特約付    | 0.55  | 100,000 | 98,670  | 2032/1/20  |
| 日立キャピタル             | 第61回社債間限定同順位特約付    | 0.31  | 100,000 | 100,083 | 2026/6/19  |
| 日立キャピタル             | 第80回社債間限定同順位特約付    | 0.28  | 100,000 | 98,412  | 2029/10/19 |
| オリックス               | 第202回社債間限定同順位特約付   | 0.35  | 100,000 | 98,466  | 2031/4/21  |
| 三井住友ファイナンス&リース      | 第27回社債間限定同順位特約付    | 0.22  | 100,000 | 99,601  | 2026/10/16 |
| 三菱ＵＦＪリース            | 第52回社債間限定同順位特約付    | 0.375 | 300,000 | 300,291 | 2027/7/13  |
| 三菱ＵＦＪリース            | 第56回社債間限定同順位特約付    | 0.455 | 100,000 | 100,316 | 2028/1/18  |
| 三菱ＵＦＪリース            | 第76回社債間限定同順位特約付    | 0.37  | 300,000 | 296,901 | 2030/1/23  |
| 大和証券グループ本社          | 第23回社債間限定同順位特約付    | 0.909 | 100,000 | 101,798 | 2025/8/12  |
| 大和証券グループ本社          | 第36回社債間限定同順位特約付    | 0.23  | 100,000 | 99,567  | 2026/6/2   |
| 三井住友海上火災保険          | 第7回社債間限定同順位特約付     | 0.19  | 100,000 | 99,641  | 2026/11/13 |
| 三井不動産               | 第71回社債間限定同順位特約付    | 0.31  | 200,000 | 198,802 | 2030/4/16  |
| 三菱地所                | 第93回担保提供制限等財務上特約無  | 2.555 | 200,000 | 227,946 | 2028/7/28  |
| 三菱地所                | 第120回担保提供制限等財務上特約無 | 0.24  | 100,000 | 99,786  | 2027/6/18  |
| 東京建物                | 第25回社債間限定同順位特約付    | 0.52  | 100,000 | 100,109 | 2027/3/19  |
| ダイビル                | 第19回特定社債間限定同順位特約付  | 0.96  | 100,000 | 94,834  | 2039/7/19  |
| エス・ティ・ティ都市開発        | 第15回社債間限定同順位特約付    | 1.25  | 100,000 | 105,714 | 2028/9/20  |
| 日本ビルファンド投資法人        | 第13回特定投資法人債間限定同順位  | 1.168 | 100,000 | 101,163 | 2023/6/26  |
| 野村不動産オフィスファンド投資法人   | 第7回特定投資法人債間限       | 2.9   | 100,000 | 113,371 | 2028/3/17  |
| 積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投資法人 | 第5回特定投資法人債         | 0.871 | 100,000 | 101,281 | 2024/8/30  |
| 東武鉄道                | 第124回社債間限定同順位特約付   | 0.001 | 100,000 | 99,680  | 2023/11/27 |
| 相鉄ホールディングス          | 第32回相模鉄道株式会社保証付    | 0.58  | 200,000 | 201,626 | 2025/1/28  |
| 東京急行電鉄              | 第82回社債間限定同順位特約付    | 1.307 | 100,000 | 108,394 | 2033/6/3   |
| 東京急行電鉄              | 第83回社債間限定同順位特約付    | 0.459 | 200,000 | 200,456 | 2031/4/22  |
| 小田急電鉄               | 第68回社債間限定同順位特約付    | 1.098 | 200,000 | 210,634 | 2030/6/12  |
| 小田急電鉄               | 第74回社債間限定同順位特約付    | 0.756 | 100,000 | 99,861  | 2037/5/29  |
| 京成電鉄                | 第58回社債間限定同順位特約付    | 0.001 | 200,000 | 199,156 | 2024/8/30  |
| 東日本旅客鉄道             | 第57回社債間限定同順位特約付    | 2.376 | 200,000 | 227,488 | 2028/12/12 |
| 東日本旅客鉄道             | 第71回社債間限定同順位特約付    | 1.905 | 100,000 | 113,006 | 2030/9/27  |
| 東日本旅客鉄道             | 第106回社債間限定同順位特約付   | 0.981 | 100,000 | 105,624 | 2035/1/29  |
| 東日本旅客鉄道             | 第107回社債間限定同順位特約付   | 1.415 | 100,000 | 109,692 | 2045/1/27  |
| 東日本旅客鉄道             | 第119回社債間限定同順位特約付   | 0.2   | 100,000 | 99,867  | 2027/1/27  |

| 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      |            |
| 東日本旅客鉄道         | 第133回社債間限定同順位特約付 | 1.246 | 100,000 | 101,700 | 2058/9/27  |
| 東日本旅客鉄道         | 第145回社債間限定同順位特約付 | 0.771 | 200,000 | 173,784 | 2059/12/23 |
| 東日本旅客鉄道         | 第147回社債間限定同順位特約付 | 0.265 | 100,000 | 99,413  | 2030/4/22  |
| 東日本旅客鉄道         | 第153回社債間限定同順位特約付 | 0.23  | 100,000 | 99,074  | 2030/7/19  |
| 東日本旅客鉄道         | 第164回社債間限定同順位特約付 | 0.245 | 100,000 | 98,982  | 2031/4/15  |
| 東日本旅客鉄道         | 第165回社債間限定同順位特約付 | 0.596 | 100,000 | 96,081  | 2041/4/15  |
| 東日本旅客鉄道         | 第167回社債間限定同順位特約付 | 0.978 | 100,000 | 92,153  | 2061/4/15  |
| 西日本旅客鉄道         | 第13回社債間限定同順位特約付  | 2.34  | 100,000 | 110,271 | 2027/2/19  |
| 西日本旅客鉄道         | 第15回社債間限定同順位特約付  | 2.26  | 300,000 | 334,011 | 2027/12/20 |
| 西日本旅客鉄道         | 第60回社債間限定同順位特約付  | 0.255 | 200,000 | 198,578 | 2030/5/21  |
| 西日本旅客鉄道         | 第65回社債間限定同順位特約付  | 0.24  | 200,000 | 198,206 | 2030/8/27  |
| 西日本旅客鉄道         | 第66回社債間限定同順位特約付  | 0.629 | 200,000 | 194,052 | 2040/8/27  |
| 西日本旅客鉄道         | 第77回社債間限定同順位特約付  | 0.961 | 100,000 | 91,712  | 2061/4/22  |
| 東海旅客鉄道          | 第17回社債間限定同順位特約付  | 2.21  | 200,000 | 210,050 | 2024/9/20  |
| 東海旅客鉄道          | 第51回社債間限定同順位特約付  | 2.212 | 200,000 | 229,368 | 2030/4/23  |
| 東海旅客鉄道          | 第70回社債間限定同順位特約付  | 1.309 | 100,000 | 108,846 | 2032/9/30  |
| 東海旅客鉄道          | 第73回社債間限定同順位特約付  | 1.014 | 300,000 | 317,100 | 2035/1/26  |
| 東海旅客鉄道          | 第74回社債間限定同順位特約付  | 1.685 | 100,000 | 114,516 | 2045/3/6   |
| 東京地下鉄           | 第22回             | 0.215 | 100,000 | 99,845  | 2027/6/21  |
| 東京地下鉄           | 第23回             | 0.661 | 100,000 | 100,294 | 2037/6/19  |
| 東京地下鉄           | 第24回             | 1.035 | 100,000 | 100,923 | 2047/6/21  |
| 西武ホールディングス      | 第1回社債間限定同順位特約付   | 0.758 | 200,000 | 198,870 | 2032/3/17  |
| 西日本鉄道           | 第45回社債間限定同順位特約付  | 0.717 | 100,000 | 102,085 | 2031/3/4   |
| 阪急阪神ホールディングス    | 第47回             | 1.202 | 400,000 | 422,452 | 2029/7/18  |
| 阪急阪神ホールディングス    | 第49回             | 0.817 | 100,000 | 100,920 | 2036/12/15 |
| 名古屋鉄道           | 第50回社債間限定同順位特約付  | 0.857 | 100,000 | 102,597 | 2027/4/30  |
| 日本通運            | 第11回社債間限定同順位特約付  | 0.2   | 100,000 | 99,577  | 2026/7/14  |
| 日本通運            | 第12回社債間限定同順位特約付  | 0.7   | 100,000 | 97,994  | 2036/7/14  |
| 日本郵船            | 第32回社債間限定同順位特約付  | 2.13  | 100,000 | 109,447 | 2031/9/9   |
| 横浜高速鉄道          | 第2回社債間限定同順位特約付   | 0.455 | 100,000 | 100,299 | 2027/2/23  |
| 九州旅客鉄道          | 第2回社債間限定同順位特約付   | 0.929 | 200,000 | 189,370 | 2049/3/5   |
| 九州旅客鉄道          | 第4回社債間限定同順位特約付   | 0.51  | 100,000 | 94,444  | 2039/12/9  |
| ANAホールディングス     | 第32回社債間限定同順位特約付  | 0.99  | 100,000 | 93,594  | 2036/6/9   |
| 澁澤倉庫            | 第8回社債間限定同順位特約付   | 0.22  | 100,000 | 99,692  | 2023/6/14  |
| KDDI            | 第20回社債間限定同順位特約付  | 0.803 | 100,000 | 101,150 | 2023/12/20 |
| KDDI            | 第25回社債間限定同順位特約付  | 0.395 | 100,000 | 100,120 | 2028/11/22 |
| ソフトバンク          | 第11回社債間限定同順位特約付  | 0.3   | 100,000 | 99,385  | 2026/6/3   |
| ソフトバンク          | 第12回社債間限定同順位特約付  | 0.42  | 200,000 | 197,650 | 2028/6/2   |
| ソフトバンク          | 第14回社債間限定同順位特約付  | 0.24  | 100,000 | 98,963  | 2026/10/9  |
| ソフトバンク          | 第16回社債間限定同順位特約付  | 0.52  | 100,000 | 97,950  | 2031/10/10 |
| 電源開発            | 第40回社債間限定同順位特約付  | 0.889 | 100,000 | 101,621 | 2024/6/20  |
| 電源開発            | 第41回社債間限定同順位特約付  | 0.782 | 100,000 | 101,477 | 2024/8/20  |
| 電源開発            | 第50回社債間限定同順位特約付  | 0.415 | 100,000 | 100,489 | 2027/7/20  |
| 電源開発            | 第59回社債間限定同順位特約付  | 0.414 | 100,000 | 100,076 | 2028/9/20  |
| 電源開発            | 第73回社債間限定同順位特約付  | 0.31  | 200,000 | 197,158 | 2031/5/20  |
| 東京瓦斯            | 第38回社債間限定同順位特約付  | 1.984 | 100,000 | 121,129 | 2043/12/17 |
| 東京瓦斯            | 第55回社債間限定同順位特約付  | 0.28  | 100,000 | 92,195  | 2039/9/13  |
| 大阪瓦斯            | 第36回社債間限定同順位特約付  | 0.642 | 100,000 | 89,955  | 2049/6/4   |

| 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          |            |
| 大阪瓦斯                      | 第43回社債間限定同順位特約付  | 0.851 | 200,000     | 189,250     | 2051/6/2   |
| 北海道瓦斯                     | 第17回社債間限定同順位特約付  | 0.25  | 100,000     | 100,024     | 2024/3/14  |
| 北海道瓦斯                     | 第23回社債間限定同順位特約付  | 0.51  | 100,000     | 97,201      | 2034/12/12 |
| 広島ガス                      | 第13回社債間限定同順位特約付  | 0.405 | 100,000     | 99,643      | 2028/9/13  |
| 東京都競馬                     | 第3回社債間限定同順位特約付   | 0.18  | 100,000     | 99,916      | 2023/7/5   |
| ファーストリテイリング               | 第7回特定社債間限定同順位特約付 | 0.405 | 100,000     | 100,285     | 2028/6/6   |
| ソフトバンクグループ                | 第54回社債間限定同順位特約付  | 1.569 | 100,000     | 100,121     | 2024/6/12  |
| フランス相互信用連合銀行 (B F C M)    | 第29回円貨社債         | 0.25  | 200,000     | 199,214     | 2024/10/10 |
| フランス相互信用連合銀行 (B F C M)    | 第31回円貨社債         | 0.423 | 100,000     | 97,713      | 2029/10/10 |
| ビー・ピー・シー・イー・エス・エー         | 第14回円貨社債         | 0.45  | 100,000     | 99,322      | 2026/6/17  |
| ビー・ピー・シー・イー・エス・エー         | 第6回非上位円貨社債       | 1.258 | 200,000     | 202,802     | 2024/1/25  |
| ビー・ピー・シー・イー・エス・エー         | 第4回非上位円貨社債       | 1.258 | 200,000     | 202,822     | 2024/1/25  |
| ビー・ピー・シー・イー・エス・エー         | 第25回非上位円貨社債      | 0.302 | 200,000     | 196,942     | 2026/12/16 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー          | 第6回円貨社債 (2014)   | 0.865 | 100,000     | 100,657     | 2024/11/28 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー          | 第15回円貨社債 (2018)  | 0.204 | 100,000     | 99,690      | 2023/6/8   |
| クレディ・アグリコル・エス・エー          | 第16回円貨社債 (2018)  | 0.509 | 100,000     | 98,004      | 2028/6/8   |
| スタンダード・チャータード             | 第3回円貨社債 (2015)   | 1.043 | 100,000     | 100,338     | 2025/6/5   |
| エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー | 第2回円             | 0.842 | 100,000     | 100,542     | 2023/9/26  |
| エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー | 第3回円             | 1.207 | 100,000     | 101,495     | 2026/9/25  |
| ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー     | 第6回円貨社債          | 0.65  | 100,000     | 100,278     | 2023/5/30  |
| ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー     | 第7回円貨社債          | 0.968 | 100,000     | 98,970      | 2028/5/30  |
| サンタンデール銀行                 | 第1回円貨社債          | 0.463 | 100,000     | 99,718      | 2024/12/5  |
| フランス電力                    | 第4回円貨社債 (2017)   | 1.088 | 100,000     | 98,298      | 2027/1/26  |
| 現代キャピタル・サービス・インク          | 第15回円貨社債         | 0.65  | 200,000     | 198,894     | 2023/8/2   |
| ビー・エヌ・ビー・パリバ              | 第1回円貨社債 (2017)   | 0.967 | 100,000     | 100,514     | 2024/3/1   |
| ウエストバック・バンキング・コーポレーション    | 第12回円貨社          | 0.32  | 200,000     | 200,052     | 2023/7/6   |
| オーストラリア・ニュージーランド銀行        | 第10回円貨社債         | 0.293 | 200,000     | 200,026     | 2024/1/23  |
| 小 計                       |                  |       | 40,705,000  | 40,993,825  |            |
| 合 計                       |                  |       | 802,409,209 | 831,900,264 |            |

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年3月31日現在)

| 項 目          | 当期末         |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 公社債          | 831,900,264 | 98.4  |
| コール・ローン等、その他 | 13,335,246  | 1.6   |
| 投資信託財産総額     | 845,235,510 | 100.0 |

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年3月31日現在)

| 項 目             | 当 期 末            |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 845,235,510,832  |
| コール・ローン等        | 6,304,434,651    |
| 公社債(評価額)        | 831,900,264,861  |
| 未収入金            | 6,203,887,080    |
| 未収利息            | 813,644,338      |
| 前払費用            | 13,279,902       |
| (B) 負債          | 11,415,470,748   |
| 未払金             | 11,194,815,000   |
| 未払解約金           | 220,652,886      |
| 未払利息            | 2,862            |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 833,820,040,084  |
| 元本              | 637,009,354,599  |
| 次期繰越損益金         | 196,810,685,485  |
| (D) 受益権総口数      | 637,009,354,599口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,090円          |

(注) 期首元本額は555,429,500,070円、期中追加設定元本額は140,183,169,551円、期中一部解約元本額は58,603,315,022円、1口当たり純資産額は1.3090円です。

## ○損益の状況 (2021年4月1日～2022年3月31日)

| 項 目            | 当 期              |
|----------------|------------------|
|                | 円                |
| (A) 配当等収益      | 5,723,401,519    |
| 受取利息           | 5,724,911,537    |
| 支払利息           | △ 1,510,018      |
| (B) 有価証券売買損益   | △ 16,033,601,285 |
| 売買益            | 164,384,768      |
| 売買損            | △ 16,197,986,053 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 10,310,199,766 |
| (D) 前期繰越損益金    | 180,400,353,686  |
| (E) 追加信託差損益金   | 45,850,802,345   |
| (F) 解約差損益金     | △ 19,130,270,780 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 196,810,685,485  |
| 次期繰越損益金(G)     | 196,810,685,485  |

\*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。

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

\*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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                                   | 当期末<br>元本額      |
|-----------------------------------------|-----------------|
|                                         | 円               |
| 野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)                | 159,230,144,819 |
| 野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向け) | 51,968,969,660  |
| マイバランス50(確定拠出年金向け)                      | 51,621,522,264  |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース)                      | 41,349,667,432  |
| マイバランス30(確定拠出年金向け)                      | 38,128,200,110  |
| NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信     | 35,212,095,763  |
| マイ・ロード                                  | 35,186,303,460  |
| ファンドラップ(ウェルス・スクエア)債券・安定型                | 31,327,023,046  |
| 野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)                | 21,802,374,834  |
| のむらっぴ・ファンド(普通型)                         | 20,112,939,733  |
| マイバランス70(確定拠出年金向け)                      | 19,847,888,365  |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース)                      | 17,664,745,205  |
| のむらっぴ・ファンド(保守型)                         | 16,059,759,182  |
| マイバランスDC30                              | 14,414,168,995  |
| 野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合         | 13,487,903,593  |
| マイバランスDC50                              | 12,027,813,857  |
| 野村日本債券インデックス(野村SMA向け)                   | 10,171,692,307  |
| マイバランスDC70                              | 4,427,526,951   |
| 野村6資産均等バランス                             | 4,230,386,616   |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け)                   | 3,714,615,690   |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース)                      | 3,532,046,682   |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)            | 3,471,983,513   |

| ファンド名                              | 当期末<br>元本額    |
|------------------------------------|---------------|
|                                    | 円             |
| のむらっぴ・ファンド(積極型)                    | 2,709,532,435 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)               | 2,372,693,668 |
| 野村インデックスファンド・国内債券                  | 1,940,508,577 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け)              | 1,697,668,987 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)   | 1,632,524,914 |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型      | 1,515,267,300 |
| ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)     | 1,510,069,117 |
| のむらっぴ・ファンド(やや保守型)                  | 1,448,753,728 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け)              | 1,385,913,012 |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け)              | 1,175,772,283 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 912,844,711   |
| 野村日本債券インデックスファンド                   | 778,502,291   |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)   | 726,321,232   |
| 野村円債投資インデックスファンド                   | 722,131,079   |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け)              | 596,018,419   |
| のむらっぴ・ファンド(やや積極型)                  | 562,413,685   |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)      | 544,036,493   |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)   | 516,733,620   |
| 野村国内債券インデックスファンド                   | 399,203,288   |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 370,173,357   |
| 野村資産設計ファンド2025                     | 355,854,308   |
| 野村資産設計ファンド2020                     | 348,643,122   |

| ファンド名                              | 当期末         |
|------------------------------------|-------------|
|                                    | 元本額         |
|                                    | 円           |
| 野村資産設計ファンド2015                     | 342,212,517 |
| ノムラPOFs用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用) | 336,480,292 |
| 野村資産設計ファンド2030                     | 298,175,797 |
| マイターゲット2060(確定拠出年金向け)              | 295,767,409 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 287,067,599 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース               | 226,607,660 |
| マイターゲット2055(確定拠出年金向け)              | 223,811,681 |
| みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)        | 217,452,141 |
| 野村資産設計ファンド2040                     | 210,631,470 |
| 野村資産設計ファンド2035                     | 158,887,693 |
| インデックス・ブレンド(タイプⅢ)                  | 153,637,290 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)            | 140,635,123 |
| 世界6資産分散ファンド                        | 124,733,821 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030        | 85,490,300  |
| グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)   | 85,429,618  |
| インデックス・ブレンド(タイプⅠ)                  | 78,140,127  |
| マイターゲット2065(確定拠出年金向け)              | 71,066,278  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)  | 55,105,479  |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)     | 40,561,278  |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース               | 39,689,442  |

| ファンド名                                         | 当期末        |
|-----------------------------------------------|------------|
|                                               | 元本額        |
|                                               | 円          |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040                   | 33,641,062 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース                        | 33,564,866 |
| インデックス・ブレンド(タイプⅡ)                             | 32,762,632 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型              | 30,892,430 |
| 野村資産設計ファンド2045                                | 26,156,783 |
| 野村資産設計ファンド2050                                | 24,622,798 |
| インデックス・ブレンド(タイプⅣ)                             | 23,352,125 |
| インデックス・ブレンド(タイプⅤ)                             | 21,294,624 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)              | 19,853,584 |
| 野村POFs用・ターゲット・リターン・資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 15,379,521 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050                   | 12,824,664 |
| 野村資産設計ファンド2060                                | 12,744,346 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)            | 10,200,316 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型              | 8,769,023  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)             | 6,804,242  |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060                   | 5,788,384  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型              | 4,442,377  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型              | 2,909,847  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)              | 416,257    |

## 〇お知らせ

該当事項はございません。

# 外国債券マザーファンド

## 運用報告書

第21期（決算日2022年5月10日）

作成対象期間（2021年5月11日～2022年5月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                  |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。<br>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。 |
| 主な投資対象 | 外国の公社債を主要投資対象とします。                                                                               |
| 主な投資制限 | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。                                                                           |

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期             | 基 準 価 額 |       | ベ ン チ マ ー ク |       | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|---------|-------|-------------|-------|-----------|-----------|---------|
|                   |         | 騰 落 率 |             | 騰 落 率 |           |           |         |
|                   | 円       | %     |             | %     | %         | %         | 百万円     |
| 17期(2018年 5 月10日) | 22,325  | 1.4   | 226.02      | 1.0   | 99.0      | —         | 616,573 |
| 18期(2019年 5 月10日) | 22,598  | 1.2   | 228.62      | 1.1   | 99.0      | —         | 605,827 |
| 19期(2020年 5 月11日) | 23,625  | 4.5   | 238.73      | 4.4   | 98.9      | —         | 564,663 |
| 20期(2021年 5 月10日) | 25,182  | 6.6   | 254.51      | 6.6   | 99.0      | —         | 577,343 |
| 21期(2022年 5 月10日) | 25,485  | 1.2   | 259.16      | 1.8   | 98.9      | —         | 640,565 |

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*ベンチマーク（＝FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））は、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。  
\*FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行なっておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。  
(出所) FTSE Fixed Income LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

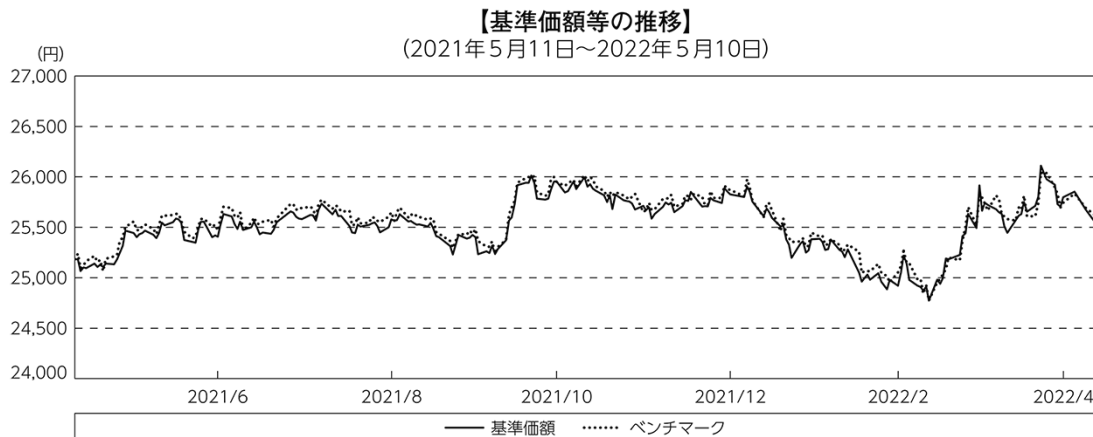
| 年 月 日        | 基 準 価 額 |       | ベ ン チ マ ー ク |       | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|--------------|---------|-------|-------------|-------|-----------|-----------|
|              |         | 騰 落 率 |             | 騰 落 率 |           |           |
| (期 首)        | 円       | %     |             | %     | %         | %         |
| 2021年 5 月10日 | 25,182  | —     | 254.51      | —     | 99.0      | —         |
| 5 月末         | 25,444  | 1.0   | 258.29      | 1.5   | 99.1      | —         |
| 6 月末         | 25,406  | 0.9   | 257.39      | 1.1   | 99.1      | —         |
| 7 月末         | 25,582  | 1.6   | 259.63      | 2.0   | 99.0      | —         |
| 8 月末         | 25,578  | 1.6   | 259.23      | 1.9   | 99.1      | —         |
| 9 月末         | 25,403  | 0.9   | 257.54      | 1.2   | 99.0      | —         |
| 10月末         | 25,956  | 3.1   | 262.28      | 3.1   | 98.9      | —         |
| 11月末         | 25,669  | 1.9   | 259.47      | 1.9   | 99.0      | —         |
| 12月末         | 25,827  | 2.6   | 261.47      | 2.7   | 99.0      | —         |
| 2022年 1 月末   | 25,385  | 0.8   | 256.78      | 0.9   | 98.7      | —         |
| 2 月末         | 24,921  | △1.0  | 253.19      | △0.5  | 99.0      | —         |
| 3 月末         | 25,743  | 2.2   | 260.10      | 2.2   | 99.0      | —         |
| 4 月末         | 25,799  | 2.5   | 260.18      | 2.2   | 98.5      | —         |
| (期 末)        |         |       |             |       |           |           |
| 2022年 5 月10日 | 25,485  | 1.2   | 259.16      | 1.8   | 98.9      | —         |

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことはマイナスに影響しましたが、主要通貨が対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

当運用期間では、FRB（米連邦準備制度理事会）による積極的な金融緩和縮小が意識されたことや、世界的なインフレ率の高まりを受けて欧州でも金融緩和縮小観測が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。

為替市場は、日銀が緩和的な金融政策を継続する姿勢を示す一方で、米欧中銀については金融引き締め姿勢への転換が市場で意識されたことなどから、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間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）は行なっておりません。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

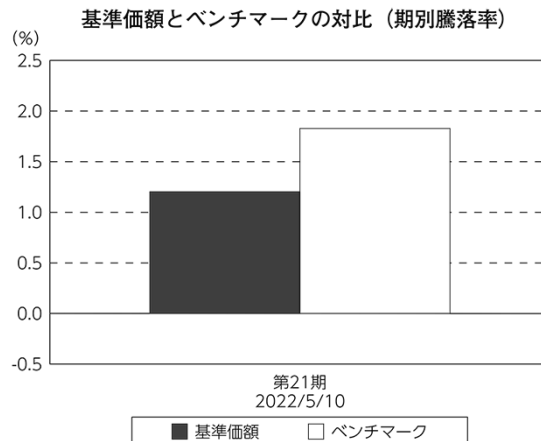
当運用期間の基準価額の騰落率は+1.2%となり、ベンチマークの+1.8%を0.6ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

### （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ること



（注）ベンチマークは、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

## ○今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることでFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行なってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月11日～2022年5月10日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                         |
|-----------------------|--------|------------|---------------------------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                                   |
| (a) そ の 他 費 用         | 円<br>4 | %<br>0.016 | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                      |
| ( 保 管 費 用 )           | (1)    | (0.004)    | 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 )             | (3)    | (0.012)    | 信託事務の処理に要するその他の諸費用                                |
| 合 計                   | 4      | 0.016      |                                                   |
| 期中の平均基準価額は、25,559円です。 |        |            |                                                   |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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5月11日～2022年5月10日)

公社債

|     |        |      | 買 付 額                 | 売 付 額                 |
|-----|--------|------|-----------------------|-----------------------|
| 外 国 | アメリカ   | 国債証券 | 千米ドル<br>1,086,259     | 千米ドル<br>684,377       |
|     | カナダ    | 国債証券 | 千カナダドル<br>61,634      | 千カナダドル<br>49,255      |
|     | イギリス   | 国債証券 | 千英ポンド<br>62,896       | 千英ポンド<br>67,223       |
|     | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデンクローナ<br>19,910 | 千スウェーデンクローナ<br>33,160 |
|     | ノルウェー  | 国債証券 | 千ノルウェークローネ<br>16,034  | 千ノルウェークローネ<br>—       |
|     | デンマーク  | 国債証券 | 千デンマーククローネ<br>25,725  | 千デンマーククローネ<br>29,726  |
|     | ユーロ    |      | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |
|     | ドイツ    | 国債証券 | 63,488                | 55,464                |
|     | イタリア   | 国債証券 | 134,152               | 73,478                |
|     | フランス   | 国債証券 | 80,128                | 73,769                |
|     | オランダ   | 国債証券 | 10,114                | 11,866                |
|     | スペイン   | 国債証券 | 84,691                | 33,795                |

|    |         |      | 買付額                | 売付額                |
|----|---------|------|--------------------|--------------------|
| 外国 | ユーロ     |      | 千ユーロ               | 千ユーロ               |
|    | ベルギー    | 国債証券 | 13,034             | 5,193              |
|    | オーストリア  | 国債証券 | 7,111              | 308                |
|    | フィンランド  | 国債証券 | 1,329              | 730                |
|    | アイルランド  | 国債証券 | 19,571             | 16,052             |
|    | ポーランド   | 国債証券 | 千ズロチ<br>126,035    | 千ズロチ<br>137,966    |
|    | シンガポール  | 国債証券 | 千シンガポールドル<br>6,622 | 千シンガポールドル<br>5,113 |
|    | マレーシア   | 国債証券 | 千リンギ<br>30,458     | 千リンギ<br>18,627     |
|    | 中国      | 国債証券 | 千人民元<br>573,703    | 千人民元<br>－          |
|    | オーストラリア | 国債証券 | 千豪ドル<br>21,943     | 千豪ドル<br>47,988     |
|    | イスラエル   | 国債証券 | 千新シェケル<br>16,792   | 千新シェケル<br>20,066   |
|    | メキシコ    | 国債証券 | 千メキシコペソ<br>180,290 | 千メキシコペソ<br>174,757 |

\*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年5月11日~2022年5月10日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A           |               | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況   |               |          |
|--------|---------------------|---------------|-----------|---------------------|---------------|----------|
|        | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ |           | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |          |
| 為替直物取引 | 百万円<br>114,259      | 百万円<br>311    | %<br>0.3  | 百万円<br>57,874       | 百万円<br>137    | %<br>0.2 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2022年5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<br>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<br>2,460,310      | 千米ドル<br>2,425,740      | 千円<br>315,419,082 | %<br>49.2 | %<br>—             | %<br>23.0 | %<br>17.9 | %<br>8.3 |
| カナダ     | 千カナダドル<br>126,380      | 千カナダドル<br>128,927      | 12,877,281        | 2.0       | —                  | 1.0       | 0.9       | 0.2      |
| イギリス    | 千英ポンド<br>177,430       | 千英ポンド<br>209,594       | 33,612,730        | 5.2       | —                  | 4.4       | 0.7       | 0.2      |
| スウェーデン  | 千スウェーデンクローナ<br>130,850 | 千スウェーデンクローナ<br>130,884 | 1,684,479         | 0.3       | —                  | 0.1       | 0.1       | 0.0      |
| ノルウェー   | 千ノルウェークローネ<br>124,700  | 千ノルウェークローネ<br>120,058  | 1,608,778         | 0.3       | —                  | 0.1       | 0.1       | 0.1      |
| デンマーク   | 千デンマーククローネ<br>125,020  | 千デンマーククローネ<br>140,277  | 2,588,124         | 0.4       | —                  | 0.3       | 0.1       | 0.0      |
| ユーロ     | 千ユーロ                   | 千ユーロ                   |                   |           |                    |           |           |          |
| ドイツ     | 224,830                | 275,070                | 37,758,889        | 5.9       | —                  | 4.7       | 1.1       | 0.1      |
| イタリア    | 371,550                | 417,824                | 57,354,782        | 9.0       | —                  | 5.2       | 2.7       | 1.1      |
| フランス    | 333,810                | 387,717                | 53,221,990        | 8.3       | —                  | 5.8       | 2.3       | 0.2      |
| オランダ    | 53,950                 | 63,830                 | 8,762,023         | 1.4       | —                  | 1.2       | 0.1       | 0.0      |
| スペイン    | 254,250                | 294,838                | 40,472,527        | 6.3       | —                  | 3.5       | 1.7       | 1.1      |
| ベルギー    | 87,400                 | 97,044                 | 13,321,246        | 2.1       | —                  | 1.6       | 0.4       | 0.1      |
| オーストリア  | 55,100                 | 59,292                 | 8,139,057         | 1.3       | —                  | 1.0       | 0.2       | 0.0      |
| フィンランド  | 18,900                 | 18,659                 | 2,561,372         | 0.4       | —                  | 0.2       | 0.1       | 0.0      |
| アイルランド  | 55,130                 | 56,301                 | 7,728,558         | 1.2       | —                  | 0.7       | 0.3       | 0.3      |
| ポーランド   | 千ズロチ<br>106,600        | 千ズロチ<br>89,690         | 2,621,274         | 0.4       | —                  | 0.2       | 0.2       | —        |
| シンガポール  | 千シンガポールドル<br>29,300    | 千シンガポールドル<br>28,960    | 2,705,811         | 0.4       | —                  | 0.2       | 0.2       | 0.1      |
| マレーシア   | 千リンギ<br>108,680        | 千リンギ<br>105,600        | 3,132,456         | 0.5       | —                  | 0.3       | 0.1       | 0.0      |
| 中国      | 千人民元<br>570,500        | 千人民元<br>573,547        | 11,078,938        | 1.7       | —                  | 0.7       | 1.0       | —        |
| オーストラリア | 千豪ドル<br>110,680        | 千豪ドル<br>106,333        | 9,577,495         | 1.5       | —                  | 1.0       | 0.4       | 0.0      |
| イスラエル   | 千新シェケル<br>65,700       | 千新シェケル<br>67,606       | 2,557,583         | 0.4       | —                  | 0.2       | 0.1       | 0.1      |
| メキシコ    | 千メキシコペソ<br>779,200     | 千メキシコペソ<br>738,149     | 4,697,582         | 0.7       | —                  | 0.4       | 0.3       | 0.1      |
| 合 計     | —                      | —                      | 633,482,065       | 98.9      | —                  | 56.0      | 31.1      | 11.8     |

\* 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。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

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

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄   |                  |        | 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      |       |
| アメリカ |                  |        | %        | 千米ドル     | 千米ドル         | 千円          |       |
| 国債証券 | US TREASURY BOND | 6. 25  | 36, 400  | 38, 188  | 4, 965, 678  | 2023/ 8 /15 |       |
|      | US TREASURY BOND | 2. 375 | 46, 700  | 46, 326  | 6, 023, 773  | 2024/ 8 /15 |       |
|      | US TREASURY BOND | 6. 0   | 66, 600  | 73, 926  | 9, 612, 597  | 2026/ 2 /15 |       |
|      | US TREASURY BOND | 6. 125 | 15, 000  | 17, 333  | 2, 253, 836  | 2027/11/15  |       |
|      | US TREASURY BOND | 5. 25  | 129, 400 | 146, 029 | 18, 988, 270 | 2028/11/15  |       |
|      | US TREASURY BOND | 4. 375 | 100      | 115      | 14, 961      | 2038/ 2 /15 |       |
|      | US TREASURY BOND | 2. 875 | 2, 300   | 2, 096   | 272, 549     | 2043/ 5 /15 |       |
|      | US TREASURY BOND | 3. 75  | 1, 200   | 1, 253   | 162, 972     | 2043/11/15  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 1. 625 | 900      | 896      | 116, 528     | 2023/ 4 /30 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 75  | 400      | 402      | 52, 349      | 2023/ 4 /30 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 1. 75  | 35, 500  | 35, 358  | 4, 597, 672  | 2023/ 5 /15 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 1. 625 | 21, 200  | 21, 080  | 2, 741, 129  | 2023/ 5 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 75  | 9, 900   | 9, 958   | 1, 294, 940  | 2023/ 5 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 25  | 200      | 195      | 25, 453      | 2023/ 6 /15 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 1. 375 | 800      | 792      | 103, 065     | 2023/ 6 /30 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 625 | 100      | 100      | 13, 072      | 2023/ 6 /30 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 125 | 100      | 97       | 12, 699      | 2023/ 6 /30 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 125 | 100      | 97       | 12, 681      | 2023/ 7 /15 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 1. 25  | 4, 300   | 4, 246   | 552, 183     | 2023/ 7 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 75  | 37, 100  | 37, 326  | 4, 853, 509  | 2023/ 7 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 125 | 100      | 97       | 12, 662      | 2023/ 7 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 5   | 6, 500   | 6, 517   | 847, 506     | 2023/ 8 /15 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 125 | 100      | 97       | 12, 642      | 2023/ 8 /15 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 1. 375 | 10, 900  | 10, 762  | 1, 399, 388  | 2023/ 8 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 75  | 1, 000   | 1, 006   | 130, 822     | 2023/ 8 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 125 | 1, 500   | 1, 456   | 189, 437     | 2023/ 8 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 125 | 200      | 194      | 25, 233      | 2023/ 9 /15 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 1. 375 | 35, 200  | 34, 716  | 4, 514, 121  | 2023/ 9 /30 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 875 | 1, 000   | 1, 006   | 130, 923     | 2023/ 9 /30 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 25  | 300      | 291      | 37, 872      | 2023/ 9 /30 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 125 | 200      | 193      | 25, 162      | 2023/10/15  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 1. 625 | 10, 600  | 10, 474  | 1, 361, 950  | 2023/10/31  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 875 | 1, 000   | 1, 005   | 130, 781     | 2023/10/31  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 375 | 300      | 291      | 37, 841      | 2023/10/31  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 75  | 42, 600  | 42, 759  | 5, 560, 050  | 2023/11/15  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 25  | 300      | 290      | 37, 732      | 2023/11/15  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 125 | 9, 200   | 9, 144   | 1, 189, 079  | 2023/11/30  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 875 | 29, 300  | 29, 469  | 3, 831, 904  | 2023/11/30  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 5   | 200      | 193      | 25, 221      | 2023/11/30  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 125 | 100      | 96       | 12, 520      | 2023/12/15  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 25  | 45, 900  | 45, 670  | 5, 938, 535  | 2023/12/31  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 625 | 800      | 801      | 104, 235     | 2023/12/31  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 75  | 200      | 194      | 25, 258      | 2023/12/31  |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 125 | 1, 500   | 1, 440   | 187, 365     | 2024/ 1 /15 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 25  | 8, 000   | 7, 956   | 1, 034, 632  | 2024/ 1 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 2. 5   | 11, 600  | 11, 587  | 1, 506, 698  | 2024/ 1 /31 |       |
|      | US TREASURY N/B  | 0. 875 | 200      | 194      | 25, 262      | 2024/ 1 /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    |            |
| アメリカ | 国債証券 | %     | 千米ドル   | 千米ドル   | 千円        |            |
|      |      | 2.75  | 800    | 802    | 104,320   | 2024/2/15  |
|      |      | 0.125 | 1,700  | 1,628  | 211,794   | 2024/2/15  |
|      |      | 2.125 | 500    | 496    | 64,507    | 2024/2/29  |
|      |      | 2.375 | 400    | 398    | 51,831    | 2024/2/29  |
|      |      | 1.5   | 100    | 98     | 12,754    | 2024/2/29  |
|      |      | 0.25  | 100    | 95     | 12,455    | 2024/3/15  |
|      |      | 2.125 | 38,100 | 37,772 | 4,911,568 | 2024/3/31  |
|      |      | 2.25  | 100    | 99     | 12,916    | 2024/3/31  |
|      |      | 0.375 | 100    | 95     | 12,455    | 2024/4/15  |
|      |      | 2.0   | 500    | 494    | 64,242    | 2024/4/30  |
|      |      | 2.25  | 700    | 695    | 90,373    | 2024/4/30  |
|      |      | 2.5   | 72,000 | 71,811 | 9,337,657 | 2024/5/15  |
|      |      | 0.25  | 13,900 | 13,251 | 1,723,047 | 2024/5/15  |
|      |      | 2.0   | 2,200  | 2,171  | 282,367   | 2024/5/31  |
|      |      | 0.25  | 100    | 95     | 12,362    | 2024/6/15  |
|      |      | 2.0   | 17,700 | 17,449 | 2,268,985 | 2024/6/30  |
|      |      | 1.75  | 500    | 490    | 63,757    | 2024/6/30  |
|      |      | 0.375 | 300    | 285    | 37,096    | 2024/7/15  |
|      |      | 2.125 | 3,800  | 3,752  | 487,898   | 2024/7/31  |
|      |      | 1.75  | 500    | 489    | 63,668    | 2024/7/31  |
|      |      | 0.375 | 200    | 189    | 24,663    | 2024/8/15  |
|      |      | 1.875 | 300    | 294    | 38,247    | 2024/8/31  |
|      |      | 1.25  | 1,100  | 1,063  | 138,250   | 2024/8/31  |
|      |      | 0.375 | 100    | 94     | 12,299    | 2024/9/15  |
|      |      | 2.125 | 43,600 | 42,971 | 5,587,590 | 2024/9/30  |
|      |      | 1.5   | 1,100  | 1,067  | 138,775   | 2024/9/30  |
|      |      | 0.625 | 100    | 94     | 12,347    | 2024/10/15 |
|      |      | 2.25  | 2,400  | 2,369  | 308,134   | 2024/10/31 |
|      |      | 1.5   | 500    | 484    | 63,028    | 2024/10/31 |
|      |      | 2.25  | 57,850 | 57,063 | 7,419,979 | 2024/11/15 |
|      |      | 0.75  | 200    | 190    | 24,717    | 2024/11/15 |
|      |      | 2.125 | 2,300  | 2,261  | 294,092   | 2024/11/30 |
|      |      | 1.5   | 500    | 484    | 62,952    | 2024/11/30 |
|      |      | 1.0   | 200    | 191    | 24,837    | 2024/12/15 |
|      |      | 2.25  | 1,900  | 1,871  | 243,409   | 2024/12/31 |
|      |      | 1.75  | 100    | 97     | 12,651    | 2024/12/31 |
|      |      | 1.125 | 200    | 191    | 24,872    | 2025/1/15  |
|      |      | 2.5   | 1,000  | 991    | 128,922   | 2025/1/31  |
|      |      | 1.375 | 300    | 288    | 37,529    | 2025/1/31  |
|      |      | 2.0   | 23,800 | 23,274 | 3,026,412 | 2025/2/15  |
|      |      | 1.5   | 200    | 192    | 25,076    | 2025/2/15  |
|      |      | 2.75  | 1,900  | 1,895  | 246,458   | 2025/2/28  |
|      |      | 1.125 | 17,300 | 16,510 | 2,146,796 | 2025/2/28  |
|      |      | 1.75  | 100    | 97     | 12,617    | 2025/3/15  |
|      |      | 2.625 | 27,700 | 27,522 | 3,578,756 | 2025/3/31  |
|      |      | 0.5   | 100    | 93     | 12,162    | 2025/3/31  |
|      |      | 2.625 | 100    | 99     | 12,925    | 2025/4/15  |
|      |      | 2.875 | 43,600 | 43,606 | 5,670,193 | 2025/4/30  |

| 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    |            |
| アメリカ | 国債証券 | %     | 千米ドル   | 千米ドル   | 千円        |            |
|      |      | 0.375 | 100    | 92     | 12,087    | 2025/4/30  |
|      |      | 2.125 | 8,050  | 7,876  | 1,024,211 | 2025/5/15  |
|      |      | 2.875 | 1,000  | 1,000  | 130,070   | 2025/5/31  |
|      |      | 0.25  | 200    | 184    | 24,023    | 2025/5/31  |
|      |      | 2.75  | 4,100  | 4,085  | 531,269   | 2025/6/30  |
|      |      | 0.25  | 200    | 184    | 23,961    | 2025/6/30  |
|      |      | 2.875 | 5,200  | 5,201  | 676,314   | 2025/7/31  |
|      |      | 0.25  | 200    | 183    | 23,889    | 2025/7/31  |
|      |      | 2.0   | 23,000 | 22,360 | 2,907,511 | 2025/8/15  |
|      |      | 2.75  | 700    | 696    | 90,629    | 2025/8/31  |
|      |      | 0.25  | 200    | 183    | 23,846    | 2025/8/31  |
|      |      | 3.0   | 32,700 | 32,807 | 4,265,932 | 2025/9/30  |
|      |      | 0.25  | 200    | 183    | 23,805    | 2025/9/30  |
|      |      | 3.0   | 100    | 100    | 13,052    | 2025/10/31 |
|      |      | 0.25  | 200    | 182    | 23,730    | 2025/10/31 |
|      |      | 2.25  | 50,100 | 49,000 | 6,371,488 | 2025/11/15 |
|      |      | 2.875 | 10,000 | 9,993  | 1,299,487 | 2025/11/30 |
|      |      | 0.375 | 200    | 182    | 23,779    | 2025/11/30 |
|      |      | 2.625 | 10,000 | 9,906  | 1,288,109 | 2025/12/31 |
|      |      | 0.375 | 200    | 182    | 23,734    | 2025/12/31 |
|      |      | 2.625 | 16,600 | 16,426 | 2,135,901 | 2026/1/31  |
|      |      | 0.375 | 100    | 91     | 11,835    | 2026/1/31  |
|      |      | 1.625 | 2,000  | 1,907  | 247,971   | 2026/2/15  |
|      |      | 2.5   | 1,000  | 984    | 128,018   | 2026/2/28  |
|      |      | 0.5   | 100    | 91     | 11,864    | 2026/2/28  |
|      |      | 2.25  | 5,000  | 4,872  | 633,591   | 2026/3/31  |
|      |      | 0.75  | 200    | 183    | 23,921    | 2026/3/31  |
|      |      | 2.375 | 42,300 | 41,407 | 5,384,247 | 2026/4/30  |
|      |      | 0.75  | 300    | 275    | 35,812    | 2026/4/30  |
|      |      | 1.625 | 1,800  | 1,711  | 222,497   | 2026/5/15  |
|      |      | 2.125 | 300    | 290    | 37,796    | 2026/5/31  |
|      |      | 0.75  | 300    | 274    | 35,732    | 2026/5/31  |
|      |      | 1.875 | 800    | 766    | 99,692    | 2026/6/30  |
|      |      | 0.875 | 300    | 275    | 35,873    | 2026/6/30  |
|      |      | 1.875 | 7,200  | 6,899  | 897,085   | 2026/7/31  |
|      |      | 0.625 | 100    | 90     | 11,807    | 2026/7/31  |
|      |      | 1.5   | 41,900 | 39,425 | 5,126,469 | 2026/8/15  |
|      |      | 1.375 | 12,000 | 11,231 | 1,460,399 | 2026/8/31  |
|      |      | 0.75  | 100    | 91     | 11,840    | 2026/8/31  |
|      |      | 1.625 | 14,500 | 13,704 | 1,782,030 | 2026/9/30  |
|      |      | 0.875 | 300    | 274    | 35,653    | 2026/9/30  |
|      |      | 1.625 | 5,600  | 5,288  | 687,663   | 2026/10/31 |
|      |      | 1.125 | 300    | 276    | 35,997    | 2026/10/31 |
|      |      | 2.0   | 14,300 | 13,696 | 1,780,984 | 2026/11/15 |
|      |      | 1.625 | 81,000 | 76,380 | 9,931,751 | 2026/11/30 |
|      |      | 1.25  | 500    | 463    | 60,250    | 2026/11/30 |
|      |      | 1.75  | 100    | 94     | 12,304    | 2026/12/31 |
|      |      | 1.25  | 200    | 185    | 24,055    | 2026/12/31 |

| 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 | 1. 5   | 200      | 186      | 24, 309      | 2027/ 1 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 25  | 29, 000  | 28, 041  | 3, 646, 254  | 2027/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 125 | 1, 400   | 1, 284   | 167, 037     | 2027/ 2 /28 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 875 | 100      | 95       | 12, 357      | 2027/ 2 /28 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 625 | 300      | 268      | 34, 849      | 2027/ 3 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 5   | 100      | 97       | 12, 717      | 2027/ 3 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 5   | 17, 000  | 15, 056  | 1, 957, 855  | 2027/ 4 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 375 | 67, 500  | 65, 538  | 8, 521, 942  | 2027/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 5   | 700      | 617      | 80, 354      | 2027/ 5 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 5   | 300      | 264      | 34, 367      | 2027/ 6 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 375 | 100      | 87       | 11, 353      | 2027/ 7 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 25  | 8, 700   | 8, 373   | 1, 088, 750  | 2027/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 5   | 100      | 87       | 11, 402      | 2027/ 8 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 375 | 100      | 86       | 11, 298      | 2027/ 9 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 5   | 300      | 261      | 34, 029      | 2027/10/31  |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 25  | 1, 000   | 960      | 124, 889     | 2027/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 625 | 300      | 263      | 34, 199      | 2027/11/30  |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 625 | 500      | 437      | 56, 888      | 2027/12/31  |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 75  | 500      | 439      | 57, 142      | 2028/ 1 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 75  | 27, 700  | 27, 245  | 3, 542, 738  | 2028/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 125 | 100      | 89       | 11, 670      | 2028/ 2 /29 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 25  | 500      | 451      | 58, 752      | 2028/ 3 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 25  | 100      | 90       | 11, 733      | 2028/ 4 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 875 | 53, 600  | 53, 040  | 6, 896, 917  | 2028/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 25  | 500      | 449      | 58, 508      | 2028/ 5 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 25  | 500      | 449      | 58, 399      | 2028/ 6 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 0   | 100      | 88       | 11, 478      | 2028/ 7 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 875 | 12, 200  | 12, 059  | 1, 568, 147  | 2028/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 125 | 100      | 88       | 11, 535      | 2028/ 8 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 25  | 100      | 89       | 11, 625      | 2028/ 9 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 375 | 300      | 269      | 35, 106      | 2028/10/31  |
|      |      | US TREASURY N/B | 3. 125 | 1, 200   | 1, 202   | 156, 407     | 2028/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 5   | 100      | 90       | 11, 783      | 2028/11/30  |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 375 | 100      | 89       | 11, 683      | 2028/12/31  |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 75  | 200      | 183      | 23, 917      | 2029/ 1 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 625 | 1, 100   | 1, 069   | 139, 116     | 2029/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 875 | 10, 000  | 9, 269   | 1, 205, 266  | 2029/ 2 /28 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 375 | 100      | 95       | 12, 437      | 2029/ 3 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 375 | 21, 700  | 20, 742  | 2, 697, 101  | 2029/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 625 | 300      | 272      | 35, 412      | 2029/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 75  | 2, 100   | 1, 918   | 249, 489     | 2029/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 5   | 11, 700  | 10, 452  | 1, 359, 113  | 2030/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 6. 25  | 48, 100  | 58, 986  | 7, 669, 999  | 2030/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 625 | 16, 600  | 13, 739  | 1, 786, 578  | 2030/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 625 | 100      | 82       | 10, 703      | 2030/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 875 | 600      | 502      | 65, 333      | 2030/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B | 5. 375 | 151, 700 | 178, 460 | 23, 205, 260 | 2031/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 125 | 1, 000   | 852      | 110, 835     | 2031/ 2 /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    |            |
| アメリカ | 国債証券 | %     | 千米ドル   | 千米ドル   | 千円        |            |
|      |      | 1.625 | 100    | 88     | 11,538    | 2031/5/15  |
|      |      | 1.25  | 20,100 | 17,169 | 2,232,486 | 2031/8/15  |
|      |      | 1.375 | 28,900 | 24,867 | 3,233,526 | 2031/11/15 |
|      |      | 1.875 | 1,000  | 898    | 116,894   | 2032/2/15  |
|      |      | 4.5   | 21,100 | 24,629 | 3,202,548 | 2036/2/15  |
|      |      | 5.0   | 8,200  | 10,032 | 1,304,568 | 2037/5/15  |
|      |      | 4.5   | 100    | 116    | 15,164    | 2038/5/15  |
|      |      | 3.5   | 100    | 103    | 13,445    | 2039/2/15  |
|      |      | 4.25  | 100    | 113    | 14,717    | 2039/5/15  |
|      |      | 4.5   | 100    | 116    | 15,156    | 2039/8/15  |
|      |      | 4.375 | 100    | 114    | 14,900    | 2039/11/15 |
|      |      | 4.625 | 100    | 118    | 15,360    | 2040/2/15  |
|      |      | 4.375 | 100    | 114    | 14,895    | 2040/5/15  |
|      |      | 1.125 | 100    | 69     | 9,016     | 2040/5/15  |
|      |      | 3.875 | 100    | 107    | 13,943    | 2040/8/15  |
|      |      | 1.125 | 100    | 68     | 8,954     | 2040/8/15  |
|      |      | 4.25  | 100    | 112    | 14,578    | 2040/11/15 |
|      |      | 1.375 | 100    | 71     | 9,340     | 2040/11/15 |
|      |      | 4.75  | 300    | 358    | 46,618    | 2041/2/15  |
|      |      | 1.875 | 200    | 156    | 20,408    | 2041/2/15  |
|      |      | 4.375 | 100    | 113    | 14,787    | 2041/5/15  |
|      |      | 2.25  | 200    | 166    | 21,678    | 2041/5/15  |
|      |      | 3.75  | 100    | 104    | 13,616    | 2041/8/15  |
|      |      | 1.75  | 200    | 152    | 19,784    | 2041/8/15  |
|      |      | 3.125 | 100    | 95     | 12,441    | 2041/11/15 |
|      |      | 2.0   | 200    | 159    | 20,674    | 2041/11/15 |
|      |      | 3.125 | 100    | 95     | 12,449    | 2042/2/15  |
|      |      | 2.375 | 200    | 169    | 22,086    | 2042/2/15  |
|      |      | 3.0   | 100    | 93     | 12,195    | 2042/5/15  |
|      |      | 2.75  | 200    | 179    | 23,324    | 2042/8/15  |
|      |      | 2.75  | 100    | 89     | 11,643    | 2042/11/15 |
|      |      | 3.125 | 290    | 275    | 35,837    | 2043/2/15  |
|      |      | 3.625 | 100    | 102    | 13,334    | 2043/8/15  |
|      |      | 3.625 | 100    | 102    | 13,321    | 2044/2/15  |
|      |      | 3.375 | 16,500 | 16,260 | 2,114,318 | 2044/5/15  |
|      |      | 3.125 | 39,950 | 37,773 | 4,911,627 | 2044/8/15  |
|      |      | 3.0   | 36,700 | 33,923 | 4,411,024 | 2044/11/15 |
|      |      | 2.5   | 43,700 | 36,960 | 4,805,991 | 2045/2/15  |
|      |      | 3.0   | 23,400 | 21,634 | 2,813,072 | 2045/5/15  |
|      |      | 2.875 | 17,500 | 15,862 | 2,062,549 | 2045/8/15  |
|      |      | 3.0   | 3,200  | 2,966  | 385,766   | 2045/11/15 |
|      |      | 2.5   | 49,700 | 42,000 | 5,461,309 | 2046/2/15  |
|      |      | 2.5   | 28,200 | 23,857 | 3,102,208 | 2046/5/15  |
|      |      | 2.25  | 34,500 | 27,767 | 3,610,557 | 2046/8/15  |
|      |      | 2.875 | 14,200 | 12,904 | 1,677,939 | 2046/11/15 |
|      |      | 3.0   | 2,000  | 1,857  | 241,530   | 2047/2/15  |
|      |      | 3.0   | 1,700  | 1,581  | 205,577   | 2047/5/15  |
|      |      | 2.75  | 11,400 | 10,146 | 1,319,284 | 2047/8/15  |

| 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     | 2.75  | 9,300  | 8,277      | 1,076,258   | 2047/11/15 |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 3.0   | 9,500  | 8,897      | 1,156,921   | 2048/2/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 3.125 | 5,100  | 4,899      | 637,041     | 2048/5/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 3.0   | 10,500 | 9,841      | 1,279,662   | 2048/8/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 3.375 | 6,100  | 6,151      | 799,937     | 2048/11/15 |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 3.0   | 2,470  | 2,333      | 303,409     | 2049/2/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 2.875 | 100    | 92         | 11,999      | 2049/5/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 2.25  | 11,250 | 9,129      | 1,187,069   | 2049/8/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 2.375 | 300    | 250        | 32,624      | 2049/11/15 |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 2.0   | 1,000  | 765        | 99,554      | 2050/2/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 1.25  | 10,200 | 6,417      | 834,432     | 2050/5/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 1.375 | 9,100  | 5,927      | 770,698     | 2050/8/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 1.625 | 7,900  | 5,506      | 716,016     | 2050/11/15 |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 1.875 | 13,900 | 10,348     | 1,345,678   | 2051/2/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 2.375 | 60,050 | 50,273     | 6,537,012   | 2051/5/15  |
|                 |       | US TREASURY N/B     | 2.0   | 1,000  | 768        | 99,864      | 2051/8/15  |
| US TREASURY N/B | 1.875 | 100                 | 74    | 9,694  | 2051/11/15 |             |            |
| US TREASURY N/B | 2.25  | 100                 | 81    | 10,628 | 2052/2/15  |             |            |
| 小 計             |       |                     |       |        |            | 315,419,082 |            |
| カナダ             | 国債証券  | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5   | 6,680  | 6,612      | 660,417     | 2023/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0   | 3,070  | 3,049      | 304,590     | 2023/9/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25  | 500    | 496        | 49,633      | 2024/3/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5   | 8,200  | 8,175      | 816,549     | 2024/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25  | 34,400 | 33,058     | 3,301,869   | 2025/3/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25  | 3,700  | 3,650      | 364,645     | 2025/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 0.25  | 350    | 318        | 31,804      | 2026/3/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5   | 300    | 285        | 28,540      | 2026/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0   | 11,600 | 10,764     | 1,075,178   | 2026/9/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0   | 200    | 183        | 18,303      | 2027/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0   | 800    | 762        | 76,158      | 2028/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75  | 14,730 | 17,367     | 1,734,638   | 2029/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25  | 1,000  | 957        | 95,641      | 2029/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5   | 1,300  | 1,142      | 114,155     | 2031/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75  | 13,800 | 17,217     | 1,719,688   | 2033/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0   | 1,900  | 2,325      | 232,254     | 2037/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0   | 1,100  | 1,242      | 124,122     | 2041/6/1   |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5   | 9,950  | 10,699     | 1,068,679   | 2045/12/1  |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75  | 1,300  | 1,236      | 123,505     | 2048/12/1  |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0   | 10,600 | 8,542      | 853,220     | 2051/12/1  |
|                 |       | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75  | 900    | 837        | 83,685      | 2064/12/1  |
| 小 計             |       |                     |       |        |            | 12,877,281  |            |
| イギリス            | 国債証券  | UK TREASURY         | 0.75  | 1,350  | 1,341      | 215,093     | 2023/7/22  |
|                 |       | UK TREASURY         | 2.25  | 2,800  | 2,832      | 454,216     | 2023/9/7   |
|                 |       | UK TREASURY         | 0.125 | 300    | 293        | 47,054      | 2024/1/31  |
|                 |       | UK TREASURY         | 1.0   | 2,000  | 1,985      | 318,340     | 2024/4/22  |
|                 |       | UK TREASURY         | 2.75  | 4,550  | 4,686      | 751,499     | 2024/9/7   |

| 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               | 5.0   | 15,070      | 16,514      | 2,648,422  | 2025/3/7   |
|        |      | UK TREASURY               | 0.625 | 200         | 195         | 31,303     | 2025/6/7   |
|        |      | UK TREASURY               | 2.0   | 200         | 203         | 32,634     | 2025/9/7   |
|        |      | UK TREASURY               | 1.5   | 4,310       | 4,309       | 691,055    | 2026/7/22  |
|        |      | UK TREASURY               | 0.375 | 500         | 473         | 75,991     | 2026/10/22 |
|        |      | UK TREASURY               | 1.25  | 400         | 393         | 63,132     | 2027/7/22  |
|        |      | UK TREASURY               | 4.25  | 13,700      | 15,605      | 2,502,636  | 2027/12/7  |
|        |      | UK TREASURY               | 1.625 | 200         | 199         | 32,025     | 2028/10/22 |
|        |      | UK TREASURY               | 6.0   | 6,650       | 8,430       | 1,352,005  | 2028/12/7  |
|        |      | UK TREASURY               | 4.75  | 6,650       | 8,200       | 1,315,168  | 2030/12/7  |
|        |      | UK TREASURY               | 4.25  | 9,610       | 11,627      | 1,864,628  | 2032/6/7   |
|        |      | UK TREASURY               | 4.5   | 17,150      | 21,655      | 3,472,877  | 2034/9/7   |
|        |      | UK TREASURY               | 0.625 | 750         | 619         | 99,272     | 2035/7/31  |
|        |      | UK TREASURY               | 4.25  | 4,330       | 5,415       | 868,515    | 2036/3/7   |
|        |      | UK TREASURY               | 4.75  | 100         | 135         | 21,800     | 2038/12/7  |
|        |      | UK TREASURY               | 4.25  | 350         | 454         | 72,809     | 2039/9/7   |
|        |      | UK TREASURY               | 4.25  | 500         | 655         | 105,173    | 2040/12/7  |
|        |      | UK TREASURY               | 4.5   | 320         | 441         | 70,773     | 2042/12/7  |
|        |      | UK TREASURY               | 3.5   | 18,440      | 22,663      | 3,634,545  | 2045/1/22  |
|        |      | UK TREASURY               | 4.25  | 5,900       | 8,182       | 1,312,223  | 2046/12/7  |
|        |      | UK TREASURY               | 1.5   | 8,200       | 7,111       | 1,140,528  | 2047/7/22  |
|        |      | UK TREASURY               | 1.75  | 16,100      | 14,750      | 2,365,485  | 2049/1/22  |
|        |      | UK TREASURY               | 4.25  | 5,350       | 7,642       | 1,225,672  | 2049/12/7  |
|        |      | UK TREASURY               | 1.25  | 1,100       | 886         | 142,138    | 2051/7/31  |
|        |      | UK TREASURY               | 3.75  | 6,750       | 9,163       | 1,469,598  | 2052/7/22  |
|        |      | UK TREASURY               | 1.625 | 1,300       | 1,155       | 185,345    | 2054/10/22 |
|        |      | UK TREASURY               | 1.75  | 700         | 646         | 103,610    | 2057/7/22  |
|        |      | UK TREASURY               | 4.0   | 8,950       | 13,574      | 2,176,936  | 2060/1/22  |
|        |      | UK TREASURY               | 2.5   | 100         | 115         | 18,453     | 2065/7/22  |
|        |      | UK TREASURY               | 3.5   | 200         | 291         | 46,802     | 2068/7/22  |
|        |      | UK TSY 3 1/4% 2044        | 3.25  | 5,950       | 7,014       | 1,124,898  | 2044/1/22  |
|        |      | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT | 4.25  | 6,400       | 9,727       | 1,560,058  | 2055/12/7  |
| 小計     |      |                           |       |             |             | 33,612,730 |            |
| 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 | SWEDISH GOVERNMENT        | 1.5   | 7,900       | 7,919       | 101,926    | 2023/11/13 |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT        | 2.5   | 36,350      | 37,175      | 478,444    | 2025/5/12  |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT        | 1.0   | 16,000      | 15,445      | 198,783    | 2026/11/12 |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT        | 0.75  | 17,300      | 16,197      | 208,461    | 2028/5/12  |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT        | 0.75  | 18,900      | 17,356      | 223,383    | 2029/11/12 |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT        | 0.125 | 13,100      | 11,142      | 143,397    | 2031/5/12  |
|        |      | SWEDISH GOVERNMENT        | 3.5   | 21,300      | 25,647      | 330,081    | 2039/3/30  |
| 小計     |      |                           |       |             |             | 1,684,479  |            |
| ノルウェー  |      |                           |       | 千ノルウェークローネ  | 千ノルウェークローネ  |            |            |
|        | 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 2.0   | 5,300       | 5,309       | 71,144     | 2023/5/24  |
|        |      | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 3.0   | 37,800      | 38,220      | 512,152    | 2024/3/14  |
|        |      | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 1.75  | 12,500      | 12,188      | 163,328    | 2025/3/13  |
|        |      | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 1.5   | 7,100       | 6,783       | 90,903     | 2026/2/19  |
|        |      | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 1.75  | 10,200      | 9,695       | 129,914    | 2027/2/17  |

| 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 | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 2.0   | 9,400     | 8,938     | 119,781   | 2028/4/26  |
|       |      | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 1.75  | 28,000    | 25,873    | 346,710   | 2029/9/6   |
|       |      | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 1.375 | 7,400     | 6,561     | 87,918    | 2030/8/19  |
|       |      | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 2.125 | 7,000     | 6,486     | 86,924    | 2032/5/18  |
| 小計    |      |                          |       |           |           | 1,608,778 |            |
| 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 | KINGDOM OF DENMARK       | 1.5   | 870       | 887       | 16,372    | 2023/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 1.75  | 24,800    | 25,551    | 471,424   | 2025/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 0.5   | 18,400    | 17,814    | 328,673   | 2027/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 0.5   | 37,250    | 35,149    | 648,500   | 2029/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 4.5   | 40,200    | 58,439    | 1,078,203 | 2039/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 0.25  | 3,500     | 2,436     | 44,950    | 2052/11/15 |
| 小計    |      |                          |       |           |           | 2,588,124 |            |
| ユーロ   |      |                          |       | 千ユーロ      | 千ユーロ      |           |            |
| ドイツ   | 国債証券 | BUNDESOBLIGATION         | —     | 2,000     | 1,981     | 271,981   | 2024/10/18 |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25  | 1,500     | 1,652     | 226,845   | 2024/1/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75  | 1,700     | 1,747     | 239,816   | 2024/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5   | 10,100    | 10,347    | 1,420,408 | 2024/5/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0   | 7,700     | 7,814     | 1,072,685 | 2024/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 2,700     | 2,704     | 371,292   | 2025/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0   | 8,200     | 8,324     | 1,142,644 | 2025/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 20,400    | 20,318    | 2,789,078 | 2026/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 1,000     | 972       | 133,438   | 2026/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.25  | 700       | 684       | 93,996    | 2027/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5   | 20,200    | 26,015    | 3,571,158 | 2027/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 200       | 197       | 27,055    | 2027/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.625 | 19,300    | 24,438    | 3,354,637 | 2028/1/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 600       | 589       | 80,858    | 2028/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75  | 10,700    | 13,204    | 1,812,529 | 2028/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25  | 18,600    | 25,873    | 3,551,659 | 2030/1/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5   | 21,950    | 30,128    | 4,135,718 | 2031/1/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75  | 17,800    | 25,158    | 3,453,524 | 2034/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0   | 12,250    | 16,893    | 2,319,003 | 2037/1/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25  | 3,700     | 5,446     | 747,655   | 2039/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75  | 2,800     | 4,416     | 606,200   | 2040/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25  | 1,130     | 1,548     | 212,524   | 2042/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5   | 5,200     | 6,556     | 900,029   | 2044/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5   | 11,700    | 15,032    | 2,063,464 | 2046/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.25  | 22,700    | 23,025    | 3,160,681 | 2048/8/15  |
| イタリア  | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5   | 1,500     | 1,562     | 214,486   | 2023/5/1   |
|       |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75  | 500       | 526       | 72,209    | 2023/8/1   |
|       |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45  | 1,000     | 1,022     | 140,386   | 2023/10/1  |
|       |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0   | 19,700    | 22,069    | 3,029,455 | 2023/11/1  |
|       |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5   | 23,500    | 24,938    | 3,423,298 | 2024/3/1   |
|       |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.85  | 300       | 303       | 41,683    | 2024/5/15  |
|       |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.75  | 2,200     | 2,216     | 304,258   | 2024/7/1   |
|       |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75  | 6,600     | 6,957     | 954,995   | 2024/9/1   |
|       |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45  | 4,700     | 4,682     | 642,717   | 2024/11/15 |

| 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        |            |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5   | 1,000  | 1,024  | 140,605   | 2024/12/1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 31,600 | 34,560 | 4,744,177 | 2025/3/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45  | 800    | 790    | 108,465   | 2025/5/15  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5   | 5,500  | 5,465  | 750,267   | 2025/6/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.85  | 400    | 400    | 54,973    | 2025/7/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5   | 15,750 | 16,069 | 2,205,891 | 2025/11/15 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0   | 3,000  | 3,010  | 413,251   | 2025/12/1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5   | 17,500 | 19,183 | 2,633,319 | 2026/3/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1   | 2,000  | 2,003  | 275,061   | 2026/7/15  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.25  | 24,500 | 29,992 | 4,117,125 | 2026/11/1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.2   | 200    | 199    | 27,404    | 2027/6/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.05  | 200    | 197    | 27,108    | 2027/8/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5   | 32,800 | 39,966 | 5,486,242 | 2027/11/1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0   | 200    | 196    | 26,904    | 2028/2/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75  | 14,300 | 16,166 | 2,219,127 | 2028/9/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25  | 35,000 | 41,244 | 5,661,563 | 2029/11/1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65  | 1,000  | 902    | 123,947   | 2030/12/1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0   | 19,600 | 24,421 | 3,352,353 | 2031/5/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65  | 900    | 795    | 109,261   | 2032/3/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75  | 11,400 | 14,161 | 1,943,891 | 2033/2/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45  | 1,400  | 1,313  | 180,262   | 2033/9/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 22,300 | 26,565 | 3,646,713 | 2034/8/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.35  | 14,000 | 14,201 | 1,949,453 | 2035/3/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0   | 2,700  | 2,944  | 404,207   | 2037/2/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.95  | 500    | 478    | 65,615    | 2038/9/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 4,500  | 5,507  | 755,959   | 2039/8/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1   | 200    | 194    | 26,726    | 2040/3/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 11,400 | 14,043 | 1,927,773 | 2040/9/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75  | 8,800  | 10,763 | 1,477,475 | 2044/9/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25  | 5,500  | 5,443  | 747,208   | 2046/9/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.45  | 2,800  | 2,840  | 389,967   | 2048/3/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85  | 7,800  | 8,412  | 1,154,756 | 2049/9/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45  | 7,900  | 6,564  | 901,163   | 2050/9/1   |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8   | 4,100  | 3,519  | 483,063   | 2067/3/1   |
| フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | 1.75  | 970    | 988    | 135,749   | 2023/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 2,000  | 1,991  | 273,380   | 2024/2/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 100    | 99     | 13,643    | 2024/3/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 2.25  | 15,200 | 15,779 | 2,166,072 | 2024/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 1,800  | 1,767  | 242,660   | 2025/3/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 13,000 | 12,938 | 1,776,076 | 2025/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 1,800  | 1,773  | 243,508   | 2026/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.25  | 13,300 | 12,888 | 1,769,242 | 2026/11/25 |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.0   | 8,000  | 7,996  | 1,097,720 | 2027/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.75  | 6,900  | 6,748  | 926,300   | 2028/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.75  | 15,100 | 14,690 | 2,016,625 | 2028/11/25 |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 3,300  | 3,133  | 430,144   | 2029/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 2.5   | 9,400  | 10,230 | 1,404,367 | 2030/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.25  | 10,100 | 9,540  | 1,309,657 | 2034/5/25  |

| 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 | FRANCE (GOVT OF)         | 1.25  | 100    | 92     | 12,670    | 2036/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.75  | 100    | 98     | 13,569    | 2039/6/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 2.0   | 10,600 | 10,645 | 1,461,253 | 2048/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.5   | 2,000  | 1,787  | 245,389   | 2050/5/25  |
|      |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.75  | 500    | 356    | 48,983    | 2052/5/25  |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 4.25  | 6,400  | 6,789  | 931,942   | 2023/10/25 |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 1.75  | 5,700  | 5,873  | 806,224   | 2024/11/25 |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 6.0   | 9,500  | 11,210 | 1,538,876 | 2025/10/25 |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 1.0   | 6,000  | 6,048  | 830,208   | 2025/11/25 |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | —     | 300    | 290    | 39,921    | 2026/2/25  |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 3.5   | 33,100 | 36,461 | 5,005,043 | 2026/4/25  |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 2.75  | 5,700  | 6,207  | 852,154   | 2027/10/25 |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 5.5   | 29,700 | 38,201 | 5,243,889 | 2029/4/25  |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 1.5   | 14,600 | 14,639 | 2,009,517 | 2031/5/25  |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 5.75  | 24,650 | 34,480 | 4,733,073 | 2032/10/25 |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 4.75  | 30,100 | 40,553 | 5,566,736 | 2035/4/25  |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 4.0   | 300    | 391    | 53,751    | 2038/10/25 |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 4.5   | 8,150  | 11,437 | 1,570,014 | 2041/4/25  |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 3.25  | 24,450 | 30,263 | 4,154,267 | 2045/5/25  |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 4.0   | 6,850  | 10,073 | 1,382,815 | 2055/4/25  |
|      |      | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 4.0   | 14,040 | 21,246 | 2,916,538 | 2060/4/25  |
| オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 1.75  | 400    | 408    | 56,094    | 2023/7/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | —     | 100    | 99     | 13,694    | 2024/1/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 2.0   | 3,300  | 3,418  | 469,204   | 2024/7/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 0.25  | 1,500  | 1,481  | 203,372   | 2025/7/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 0.5   | 1,900  | 1,875  | 257,448   | 2026/7/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 0.75  | 2,500  | 2,473  | 339,537   | 2027/7/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 5.5   | 12,300 | 15,325 | 2,103,772 | 2028/1/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 0.75  | 1,000  | 983    | 134,998   | 2028/7/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 0.25  | 800    | 748    | 102,732   | 2029/7/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 2.5   | 11,750 | 12,972 | 1,780,666 | 2033/1/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 4.0   | 4,700  | 6,244  | 857,231   | 2037/1/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 0.5   | 500    | 424    | 58,230    | 2040/1/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 3.75  | 3,600  | 4,987  | 684,690   | 2042/1/15  |
|      |      | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 2.75  | 9,600  | 12,386 | 1,700,349 | 2047/1/15  |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.35  | 5,000  | 5,015  | 688,490   | 2023/7/30  |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4   | 7,300  | 7,747  | 1,063,463 | 2023/10/31 |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.8   | 20,700 | 22,258 | 3,055,387 | 2024/1/31  |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8   | 13,600 | 14,421 | 1,979,668 | 2024/4/30  |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.75  | 5,700  | 5,976  | 820,417   | 2024/10/31 |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.6   | 2,100  | 2,137  | 293,403   | 2025/4/30  |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.65  | 17,900 | 19,925 | 2,735,219 | 2025/7/30  |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.15  | 6,600  | 6,835  | 938,266   | 2025/10/31 |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95  | 3,000  | 3,081  | 423,061   | 2026/4/30  |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9   | 34,650 | 41,277 | 5,666,215 | 2026/7/30  |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.3   | 800    | 800    | 109,863   | 2026/10/31 |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.45  | 9,800  | 9,730  | 1,335,762 | 2027/10/31 |
|      |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4   | 2,800  | 2,771  | 380,504   | 2028/4/30  |

| 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    |            |
| ユーロ    |      |                          | %     | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |            |
| スペイン   | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4   | 5,000  | 4,920  | 675,402   | 2028/7/30  |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15  | 14,500 | 17,556 | 2,409,994 | 2028/10/31 |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95  | 3,000  | 3,012  | 413,492   | 2030/7/30  |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.35  | 5,400  | 5,421  | 744,223   | 2033/7/30  |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.85  | 1,000  | 938    | 128,794   | 2035/7/30  |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9   | 1,900  | 2,581  | 354,378   | 2040/7/30  |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7   | 4,200  | 5,609  | 769,983   | 2041/7/30  |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15  | 11,000 | 15,892 | 2,181,583 | 2044/10/31 |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.9   | 3,200  | 3,375  | 463,314   | 2046/10/31 |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7   | 10,500 | 10,625 | 1,458,602 | 2048/10/31 |
|        |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.45  | 5,200  | 5,784  | 793,979   | 2066/7/30  |
|        |      | SPANISH GOVERNMENT       | 6.0   | 25,200 | 32,208 | 4,421,194 | 2029/1/31  |
|        |      | SPANISH GOVERNMENT       | 5.75  | 27,900 | 37,213 | 5,108,231 | 2032/7/30  |
|        |      | SPANISH GOVERNMENT       | 4.2   | 6,300  | 7,719  | 1,059,628 | 2037/1/31  |
| ベルギー   | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM          | 2.25  | 1,800  | 1,848  | 253,717   | 2023/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.2   | 1,900  | 1,904  | 261,491   | 2023/10/22 |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 2.6   | 4,000  | 4,188  | 574,996   | 2024/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.5   | 1,000  | 1,000  | 137,363   | 2024/10/22 |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.8   | 1,700  | 1,708  | 234,550   | 2025/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 4.5   | 6,700  | 7,671  | 1,053,120 | 2026/3/28  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.0   | 3,300  | 3,324  | 456,373   | 2026/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.8   | 2,000  | 1,979  | 271,671   | 2027/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.8   | 1,000  | 980    | 134,655   | 2028/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.9   | 6,500  | 6,337  | 869,993   | 2029/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.0   | 11,400 | 10,907 | 1,497,265 | 2031/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 4.0   | 2,700  | 3,291  | 451,858   | 2032/3/28  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.25  | 100    | 96     | 13,217    | 2033/4/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.45  | 500    | 467    | 64,213    | 2037/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.9   | 100    | 99     | 13,640    | 2038/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 4.25  | 3,500  | 4,693  | 644,323   | 2041/3/28  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 3.75  | 4,000  | 5,227  | 717,544   | 2045/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.6   | 5,200  | 4,710  | 646,625   | 2047/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.7   | 2,700  | 2,472  | 339,341   | 2050/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 2.25  | 3,100  | 3,204  | 439,850   | 2057/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM          | 2.15  | 2,200  | 2,206  | 302,827   | 2066/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM GOVT     | 5.5   | 11,500 | 14,440 | 1,982,208 | 2028/3/28  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM GOVT     | 5.0   | 10,500 | 14,281 | 1,960,397 | 2035/3/28  |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA      | —     | 900    | 900    | 123,661   | 2023/7/15  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 1.75  | 150    | 153    | 21,117    | 2023/10/20 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | —     | 1,300  | 1,290  | 177,103   | 2024/7/15  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 1.65  | 700    | 721    | 98,996    | 2024/10/21 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 1.2   | 1,300  | 1,318  | 181,017   | 2025/10/20 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 4.85  | 5,400  | 6,237  | 856,227   | 2026/3/15  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 0.75  | 2,000  | 1,980  | 271,873   | 2026/10/20 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 6.25  | 7,600  | 9,627  | 1,321,555 | 2027/7/15  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 0.5   | 11,600 | 11,007 | 1,510,963 | 2029/2/20  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 2.4   | 8,600  | 9,354  | 1,284,138 | 2034/5/23  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 4.15  | 400    | 532    | 73,083    | 2037/3/15  |

| 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            |             |
| オーストリア                 | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 3. 15   | 4, 400    | 5, 625      | 772, 163      | 2044/ 6 /20 |
|                        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1. 5    | 7, 000    | 6, 710      | 921, 109      | 2047/ 2 /20 |
|                        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0. 75   | 2, 000    | 1, 553      | 213, 223      | 2051/ 3 /20 |
|                        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 3. 8    | 950       | 1, 477      | 202, 866      | 2062/ 1 /26 |
|                        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 2. 1    | 800       | 801         | 109, 956      | 2117/ 9 /20 |
| フィンランド                 | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT     | —       | 400       | 400         | 54, 909       | 2023/ 9 /15 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 2. 0    | 700       | 723         | 99, 246       | 2024/ 4 /15 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 4. 0    | 3, 600    | 3, 976      | 545, 911      | 2025/ 7 / 4 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 0. 875  | 100       | 100         | 13, 801       | 2025/ 9 /15 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 0. 5    | 2, 000    | 1, 973      | 270, 959      | 2026/ 4 /15 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 2. 75   | 3, 300    | 3, 627      | 497, 897      | 2028/ 7 / 4 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 0. 5    | 2, 400    | 2, 270      | 311, 702      | 2029/ 9 /15 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 0. 75   | 1, 300    | 1, 226      | 168, 342      | 2031/ 4 /15 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 1. 125  | 200       | 189         | 25, 957       | 2034/ 4 /15 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 0. 125  | 4, 000    | 3, 231      | 443, 593      | 2036/ 4 /15 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 2. 625  | 400       | 462         | 63, 551       | 2042/ 7 / 4 |
|                        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 1. 375  | 500       | 477         | 65, 496       | 2047/ 4 /15 |
| アイルランド                 | 国債証券 | IRISH GOVERNMENT       | 5. 4    | 6, 130    | 6, 948      | 953, 873      | 2025/ 3 /13 |
|                        |      | IRISH GOVERNMENT       | 0. 9    | 6, 900    | 6, 765      | 928, 644      | 2028/ 5 /15 |
|                        |      | IRISH TSY 1% 2026      | 1. 0    | 7, 100    | 7, 146      | 980, 998      | 2026/ 5 /15 |
|                        |      | IRISH TSY 1. 10% 2029  | 1. 1    | 600       | 590         | 81, 032       | 2029/ 5 /15 |
|                        |      | IRISH TSY 1. 3% 2033   | 1. 3    | 5, 100    | 4, 829      | 663, 004      | 2033/ 5 /15 |
|                        |      | IRISH TSY 1. 35% 2031  | 1. 35   | 3, 300    | 3, 253      | 446, 630      | 2031/ 3 /18 |
|                        |      | IRISH TSY 1. 5% 2050   | 1. 5    | 2, 600    | 2, 273      | 312, 015      | 2050/ 5 /15 |
|                        |      | IRISH TSY 1. 7% 2037   | 1. 7    | 3, 100    | 3, 012      | 413, 553      | 2037/ 5 /15 |
|                        |      | IRISH TSY 2% 2045      | 2. 0    | 1, 600    | 1, 594      | 218, 828      | 2045/ 2 /18 |
|                        |      | IRISH TSY 2. 4% 2030   | 2. 4    | 7, 500    | 8, 049      | 1, 105, 021   | 2030/ 5 /15 |
|                        |      | IRISH TSY 3. 4% 2024   | 3. 4    | 11, 200   | 11, 837     | 1, 624, 955   | 2024/ 3 /18 |
| 小 計                    |      |                        |         |           |             | 229, 320, 446 |             |
| ポーランド                  |      |                        |         | 千ズロチ      | 千ズロチ        |               |             |
|                        | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 2. 25   | 38, 800   | 34, 766     | 1, 016, 082   | 2024/10/25  |
| POLAND GOVERNMENT BOND |      | 3. 25                  | 3, 000  | 2, 700    | 78, 909     | 2025/ 7 /25   |             |
| POLAND GOVERNMENT BOND |      | 2. 5                   | 59, 100 | 48, 160   | 1, 407, 526 | 2027/ 7 /25   |             |
| POLAND GOVERNMENT BOND |      | 2. 75                  | 2, 600  | 2, 033    | 59, 421     | 2029/10/25    |             |
| POLAND GOVERNMENT BOND |      | 1. 25                  | 3, 100  | 2, 030    | 59, 333     | 2030/10/25    |             |
| 小 計                    |      |                        |         |           |             | 2, 621, 274   |             |
| 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 | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2. 75   | 2, 300    | 2, 318      | 216, 585      | 2023/ 7 / 1 |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 2. 0                   | 1, 450  | 1, 444    | 135, 003    | 2024/ 2 / 1   |             |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 3. 0                   | 2, 300  | 2, 335    | 218, 189    | 2024/ 9 / 1   |             |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 2. 375                 | 1, 100  | 1, 099    | 102, 759    | 2025/ 6 / 1   |             |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 2. 125                 | 1, 400  | 1, 378    | 128, 829    | 2026/ 6 / 1   |             |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 3. 5                   | 5, 350  | 5, 539    | 517, 530    | 2027/ 3 / 1   |             |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 2. 625                 | 500     | 499       | 46, 638     | 2028/ 5 / 1   |             |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 2. 875                 | 300     | 303       | 28, 322     | 2029/ 7 / 1   |             |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 2. 875                 | 3, 850  | 3, 879    | 362, 479    | 2030/ 9 / 1   |             |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 3. 375                 | 2, 080  | 2, 189    | 204, 539    | 2033/ 9 / 1   |             |
| SINGAPORE GOVERNMENT   |      | 2. 25                  | 1, 920  | 1, 753    | 163, 844    | 2036/ 8 / 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     |            |
| シンガポール               |       |                       | %     | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | 千円         |            |
|                      | 国債証券  | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2.75  | 2,750     | 2,636     | 246,334    | 2042/4/1   |
|                      |       | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2.75  | 1,900     | 1,854     | 173,236    | 2046/3/1   |
|                      |       | SINGAPORE GOVERNMENT  | 1.875 | 2,100     | 1,728     | 161,518    | 2050/3/1   |
| 小 計                  |       |                       |       |           |           | 2,705,811  |            |
| マレーシア                |       |                       |       | 千リンギ      | 千リンギ      |            |            |
|                      | 国債証券  | MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.059 | 400       | 402       | 11,939     | 2024/9/30  |
|                      |       | MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.642 | 2,600     | 2,576     | 76,416     | 2033/11/7  |
|                      |       | MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.828 | 2,700     | 2,441     | 72,431     | 2034/7/5   |
|                      |       | MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.762 | 400       | 396       | 11,748     | 2037/4/7   |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 3.8   | 2,200     | 2,225     | 66,009     | 2023/8/17  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 4.181 | 5,800     | 5,848     | 173,486    | 2024/7/15  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 3.955 | 1,700     | 1,700     | 50,455     | 2025/9/15  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 4.392 | 16,600    | 16,783    | 497,865    | 2026/4/15  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 3.892 | 4,600     | 4,518     | 134,018    | 2027/3/15  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 3.502 | 7,000     | 6,732     | 199,711    | 2027/5/31  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 3.733 | 2,200     | 2,119     | 62,882     | 2028/6/15  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 3.885 | 280       | 267       | 7,941      | 2029/8/15  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 4.498 | 15,400    | 15,235    | 451,941    | 2030/4/15  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 4.232 | 5,400     | 5,217     | 154,772    | 2031/6/30  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 3.844 | 9,800     | 8,986     | 266,573    | 2033/4/15  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 4.254 | 11,100    | 10,431    | 309,431    | 2035/5/31  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 4.935 | 9,700     | 9,523     | 282,496    | 2043/9/30  |
|                      |       | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 4.736 | 10,500    | 9,905     | 293,815    | 2046/3/15  |
| MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.921 | 300                   | 287   | 8,519     | 2048/7/6  |            |            |
| 小 計                  |       |                       |       |           |           | 3,132,456  |            |
| 中国                   |       |                       |       | 千人民元      | 千人民元      |            |            |
|                      | 国債証券  | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.47  | 141,900   | 142,237   | 2,747,528  | 2024/9/2   |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.26  | 62,100    | 61,852    | 1,194,774  | 2025/2/24  |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.69  | 89,500    | 89,904    | 1,736,641  | 2026/8/12  |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.37  | 33,000    | 32,691    | 631,484    | 2027/1/20  |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.48  | 20,000    | 19,892    | 384,245    | 2027/4/15  |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.91  | 70,000    | 70,384    | 1,359,582  | 2028/10/14 |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8   | 30,000    | 29,950    | 578,541    | 2029/3/24  |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.02  | 33,000    | 33,387    | 644,921    | 2031/5/27  |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.89  | 20,000    | 20,078    | 387,855    | 2031/11/18 |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.75  | 20,000    | 19,892    | 384,257    | 2032/2/17  |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.72  | 15,000    | 15,975    | 308,582    | 2051/4/12  |
|                      |       | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.53  | 36,000    | 37,300    | 720,522    | 2051/10/18 |
| 小 計                  |       |                       |       |           |           | 11,078,938 |            |
| オーストラリア              |       |                       |       | 千豪ドル      | 千豪ドル      |            |            |
|                      | 国債証券  | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75  | 2,500     | 2,500     | 225,258    | 2024/4/21  |
|                      |       | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25  | 7,700     | 7,746     | 697,760    | 2025/4/21  |
|                      |       | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25  | 17,080    | 17,761    | 1,599,765  | 2026/4/21  |
|                      |       | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75  | 5,300     | 5,660     | 509,836    | 2027/4/21  |
|                      |       | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75  | 1,200     | 1,166     | 105,025    | 2027/11/21 |
|                      |       | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75  | 300       | 288       | 26,001     | 2028/11/21 |
|                      |       | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25  | 2,800     | 2,770     | 249,522    | 2029/4/21  |
|                      |       | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75  | 10,100    | 9,649     | 869,134    | 2029/11/21 |

| 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 |      |                          | %     | 千豪ドル     | 千豪ドル     | 千円            |             |
|         | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 2. 5  | 22, 200  | 20, 678  | 1, 862, 521   | 2030/ 5 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 1. 0  | 5, 700   | 4, 638   | 417, 807      | 2030/12/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 1. 5  | 3, 300   | 2, 778   | 250, 301      | 2031/ 6 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 1. 75 | 1, 900   | 1, 596   | 143, 817      | 2032/11/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 4. 5  | 9, 800   | 10, 610  | 955, 657      | 2033/ 4 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 2. 75 | 2, 450   | 2, 214   | 199, 494      | 2035/ 6 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 3. 75 | 8, 250   | 8, 257   | 743, 732      | 2037/ 4 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 3. 25 | 700      | 651      | 58, 717       | 2039/ 6 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 2. 75 | 1, 500   | 1, 273   | 114, 697      | 2041/ 5 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 3. 0  | 4, 900   | 4, 200   | 378, 319      | 2047/ 3 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 1. 75 | 3, 000   | 1, 888   | 170, 124      | 2051/ 6 /21 |
| 小 計     |      |                          |       |          |          | 9, 577, 495   |             |
| イスラエル   |      |                          |       | 千新シエケル   | 千新シエケル   |               |             |
|         | 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND        | 1. 5  | 5, 000   | 5, 016   | 189, 791      | 2023/11/30  |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND        | 3. 75 | 6, 200   | 6, 452   | 244, 115      | 2024/ 3 /31 |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND        | 1. 75 | 11, 900  | 11, 822  | 447, 262      | 2025/ 8 /31 |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND        | 6. 25 | 6, 500   | 7, 647   | 289, 296      | 2026/10/30  |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND        | 2. 0  | 5, 000   | 4, 964   | 187, 791      | 2027/ 3 /31 |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND        | 2. 25 | 5, 000   | 4, 978   | 188, 322      | 2028/ 9 /28 |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND        | 1. 0  | 8, 500   | 7, 611   | 287, 956      | 2030/ 3 /31 |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND        | 1. 5  | 5, 900   | 4, 842   | 183, 193      | 2037/ 5 /31 |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND        | 5. 5  | 6, 000   | 8, 107   | 306, 693      | 2042/ 1 /31 |
|         |      | ISRAEL FIXED BOND        | 3. 75 | 5, 700   | 6, 163   | 233, 161      | 2047/ 3 /31 |
| 小 計     |      |                          |       |          |          | 2, 557, 583   |             |
| メキシコ    |      |                          |       | 千メキシコペソ  | 千メキシコペソ  |               |             |
|         | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8. 0  | 114, 500 | 112, 172 | 713, 863      | 2024/ 9 / 5 |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10. 0 | 65, 000  | 66, 482  | 423, 092      | 2024/12/ 5  |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 5. 75 | 110, 000 | 98, 612  | 627, 572      | 2026/ 3 / 5 |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7. 5  | 80, 300  | 75, 496  | 480, 458      | 2027/ 6 / 3 |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8. 5  | 77, 300  | 75, 067  | 477, 728      | 2029/ 5 /31 |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7. 75 | 76, 600  | 70, 031  | 445, 683      | 2031/ 5 /29 |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7. 75 | 400      | 356      | 2, 265        | 2034/11/23  |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10. 0 | 53, 300  | 56, 479  | 359, 432      | 2036/11/20  |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8. 5  | 25, 800  | 24, 122  | 153, 514      | 2038/11/18  |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7. 75 | 68, 200  | 58, 111  | 369, 823      | 2042/11/13  |
|         |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8. 0  | 43, 000  | 37, 269  | 237, 181      | 2047/11/ 7  |
|         |      | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8. 0  | 64, 800  | 63, 947  | 406, 964      | 2023/12/ 7  |
|         |      | 小 計                      |       |          |          |               |             |
| 合 計     |      |                          |       |          |          | 633, 482, 065 |             |

\* 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。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2022年5月10日現在)

| 区 分            | 当 期 末                |
|----------------|----------------------|
|                | 数 量                  |
| 貸付有価証券＜債券＞券面総額 | 米ドル<br>1,506,879,000 |
| 貸付有価証券＜債券＞券面総額 | ユーロ<br>237,942,000   |
| 貸付有価証券＜債券＞券面総額 | 豪ドル<br>26,000,000    |
| 貸付有価証券＜債券＞券面総額 | 新シュケル<br>9,300,000   |
| 貸付有価証券＜債券＞券面総額 | メキシコペソ<br>6,564,000  |

○投資信託財産の構成

(2022年5月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>633,482,065 | %<br>70.2 |
| コール・ローン等、その他 | 268,671,041       | 29.8      |
| 投資信託財産総額     | 902,153,106       | 100.0     |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建純資産（641,874,305千円）の投資信託財産総額（902,153,106千円）に対する比率は71.1%です。

\*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＝130.03円、1カナダドル＝99.88円、1英ポンド＝160.37円、1スウェーデンクローナ＝12.87円、1ノルウェークローネ＝13.40円、1デンマーククローネ＝18.45円、1ユーロ＝137.27円、1ズロチ＝29.2257円、1シンガポールドル＝93.43円、1リンギ＝29.6633円、1人民元＝19.3165円、1豪ドル＝90.07円、1新シュケル＝37.8303円、1メキシコペソ＝6.364円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月10日現在)

| 項 目             | 当 期 末            |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 903,512,746,683  |
| コール・ローン等        | 3,392,278,116    |
| 公社債(評価額)        | 633,482,065,266  |
| 未収入金            | 2,442,178,497    |
| 未収利息            | 6,384,022,110    |
| 前払費用            | 464,377,973      |
| その他未収収益         | 31,497,859       |
| 受入担保代用有価証券      | 257,316,326,862  |
| (B) 負債          | 262,947,306,556  |
| 未払金             | 3,722,762,093    |
| 未払解約金           | 1,895,799,065    |
| 未払利息            | 225              |
| 受入担保金           | 257,316,326,862  |
| その他未払費用         | 12,418,311       |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 640,565,440,127  |
| 元本              | 251,351,016,828  |
| 次期繰越損益金         | 389,214,423,299  |
| (D) 受益権総口数      | 251,351,016,828口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 25,485円          |

(注) 期首元本額は229,270,699,136円、期中追加設定元本額は45,249,115,005円、期中一部解約元本額は23,168,797,313円、1口当たり純資産額は2.5485円です。

(注) 2022年5月10日現在、有価証券の貸付などに係る受入担保代用有価証券として担保に受け入れている資産は以下の通りです。  
・有価証券 257,316,326,862円

○損益の状況 (2021年5月11日～2022年5月10日)

| 項 目              | 当 期              |
|------------------|------------------|
|                  | 円                |
| (A) 配当等収益        | 18,908,605,352   |
| 受取利息             | 18,640,733,757   |
| その他収益金           | 270,081,710      |
| 支払利息             | △ 2,210,115      |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 11,982,153,029 |
| 売買益              | 72,489,163,355   |
| 売買損              | △ 84,471,316,384 |
| (C) 保管費用等        | △ 106,183,344    |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | 6,820,268,979    |
| (E) 前期繰越損益金      | 348,072,525,004  |
| (F) 追加信託差損益金     | 70,345,026,831   |
| (G) 解約差損益金       | △ 36,023,397,515 |
| (H) 計(D＋E＋F＋G)   | 389,214,423,299  |
| 次期繰越損益金(H)       | 389,214,423,299  |

\* 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。

\* 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。

\* 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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                                               | 当期末<br>元本額     |
|-----------------------------------------------------|----------------|
|                                                     | 円              |
| 野村外国債券インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)                       | 73,257,696,615 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース)                                  | 23,188,750,740 |
| のむらップ・ファンド(普通型)                                     | 21,235,457,674 |
| 野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)                          | 20,730,136,901 |
| NEXT FUND 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし) 連動型上場投信 | 9,661,709,782  |
| マイ・ロード                                              | 8,756,944,831  |
| 野村外国債券インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)                       | 8,661,587,773  |
| 野村DC外国債券インデックスファンド                                  | 8,363,907,663  |
| マイバランス50(確定拠出年金向け)                                  | 6,736,883,818  |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)                | 6,628,014,121  |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券                              | 6,614,449,673  |
| のむらップ・ファンド(保守型)                                     | 6,443,747,171  |
| のむらップ・ファンド(積極型)                                     | 5,675,664,129  |
| マイバランス30(確定拠出年金向け)                                  | 5,340,957,191  |
| マイバランス70(確定拠出年金向け)                                  | 5,124,408,264  |
| 野村DC運用戦略ファンド                                        | 3,811,926,740  |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース)                                  | 3,569,553,345  |

| ファンド名                              | 当期末<br>元本額    |
|------------------------------------|---------------|
|                                    | 円             |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)       | 2,876,148,066 |
| 野村6資産均等バランス                        | 2,355,899,222 |
| マイバランスDC30                         | 2,028,527,683 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 1,901,593,567 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース)                 | 1,887,417,781 |
| マイバランスDC50                         | 1,538,399,924 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)               | 1,180,177,357 |
| ノムラPOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用) | 1,147,385,291 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)   | 1,138,845,144 |
| マイバランスDC70                         | 1,107,641,509 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)   | 1,080,898,866 |
| ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)     | 967,461,300   |
| 野村インデックスファンド・外国債券                  | 913,252,382   |
| のむらップ・ファンド(やや積極型)                  | 901,778,414   |
| のむらップ・ファンド(やや保守型)                  | 827,410,083   |
| 野村外国債券バッシブファンド(確定拠出年金向け)           | 591,185,049   |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)   | 590,181,608   |

| ファンド名                              | 当期末         |
|------------------------------------|-------------|
|                                    | 元本額         |
|                                    | 円           |
| 野村外国債券インデックス（野村SMA向け）              | 517,411,404 |
| マイターゲット2030（確定拠出年金向け）              | 516,164,387 |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）                 | 453,289,889 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス             | 283,375,933 |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け）              | 280,375,646 |
| 野村外国債券インデックスファンド                   | 267,862,695 |
| マイターゲット2040（確定拠出年金向け）              | 252,575,189 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）   | 177,073,767 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用） | 167,487,665 |
| マイターゲット2035（確定拠出年金向け）              | 158,040,030 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 151,098,257 |
| ネクストコア                             | 122,618,726 |
| マイターゲット2045（確定拠出年金向け）              | 103,546,969 |
| バランスセレクト50                         | 81,588,482  |
| バランスセレクト30                         | 80,479,591  |
| バランスセレクト70                         | 79,848,643  |
| マイターゲット2060（確定拠出年金向け）              | 78,526,376  |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）            | 71,250,985  |
| 世界6資産分散ファンド                        | 65,647,992  |
| マイターゲット2055（確定拠出年金向け）              | 56,992,507  |
| 多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）      | 53,779,195  |
| 野村資産設計ファンド2040                     | 50,985,722  |
| 野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース             | 45,832,317  |
| 野村資産設計ファンド2030                     | 40,845,984  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）  | 37,998,069  |
| 野村資産設計ファンド2025                     | 34,361,697  |
| 野村資産設計ファンド2035                     | 30,016,151  |
| 野村世界6資産分散投信（DC）成長コース               | 21,303,043  |
| みらいバランス・株式10（富士通企業年金基金DC向け）        | 20,764,315  |
| 野村世界6資産分散投信（DC）安定コース               | 20,043,176  |

| ファンド名                                         | 当期末        |
|-----------------------------------------------|------------|
|                                               | 元本額        |
|                                               | 円          |
| マイターゲット2065（確定拠出年金向け）                         | 19,688,153 |
| 野村資産設計ファンド2020                                | 19,271,101 |
| 野村資産設計ファンド2015                                | 18,725,131 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030                   | 12,120,415 |
| インデックス・ブレンド（タイプⅢ）                             | 8,698,234  |
| 野村資産設計ファンド2045                                | 8,563,864  |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040                   | 8,490,413  |
| 野村資産設計ファンド2050                                | 8,418,371  |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）            | 8,354,055  |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）                | 7,817,581  |
| インデックス・ブレンド（タイプⅤ）                             | 7,574,560  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）             | 7,448,079  |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け）                          | 7,300,257  |
| 野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）                 | 6,255,673  |
| 野村PQR運用・ターゲット・リターン・資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用） | 6,032,213  |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け）                          | 6,001,300  |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050                   | 4,426,481  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型              | 4,208,610  |
| 野村資産設計ファンド2060                                | 4,165,653  |
| インデックス・ブレンド（タイプⅠ）                             | 3,611,059  |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け）                          | 3,523,699  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）              | 2,409,833  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型              | 2,239,053  |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060                   | 2,016,841  |
| インデックス・ブレンド（タイプⅡ）                             | 1,949,204  |
| インデックス・ブレンド（タイプⅣ）                             | 1,493,195  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型              | 1,483,901  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型              | 1,173,121  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）              | 372,299    |

## 〇お知らせ

該当事項はございません。

# 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書

第9期（決算日2022年9月6日）

作成対象期間（2021年9月7日～2022年9月6日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                      |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | 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せん。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主な投資対象 | 外国の公社債を主要投資対象とします。                                                                   |
| 主な投資制限 | 株式への投資は行いません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。                           |

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期              | 基 準     | 価 額    |     | ベンチマーク                              |           | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|--------------------|---------|--------|-----|-------------------------------------|-----------|-----------|-----------|---------|
|                    |         | 期 騰 落  | 中 率 | FTSE 世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) | 期 騰 落 中 率 |           |           |         |
|                    | 円       |        | %   |                                     | %         | %         | %         | 百万円     |
| 5 期(2018年 9 月 6 日) | 11, 174 | △ 2.1  |     | 112. 61                             | △ 1. 9    | 98. 8     | —         | 50, 125 |
| 6 期(2019年 9 月 6 日) | 12, 118 | 8. 4   |     | 122. 22                             | 8. 5      | 99. 7     | —         | 59, 275 |
| 7 期(2020年 9 月 7 日) | 12, 502 | 3. 2   |     | 126. 25                             | 3. 3      | 99. 2     | —         | 69, 653 |
| 8 期(2021年 9 月 6 日) | 12, 332 | △ 1. 4 |     | 124. 58                             | △ 1. 3    | 99. 3     | —         | 85, 718 |
| 9 期(2022年 9 月 6 日) | 10, 625 | △13. 8 |     | 107. 48                             | △13. 7    | 99. 7     | —         | 80, 566 |

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\* 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により運営されている日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（為替ヘッジを行なう円ベースの指数）です。なお、設定時を100として再指数化しています。

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

(出所) FTSE Fixed Income LLC

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日         | 基 準     | 価 額    |   | ベンチマーク                              |        | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------|---------|--------|---|-------------------------------------|--------|-----------|-----------|
|               |         | 騰 落    | 率 | FTSE 世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) | 騰 落 率  |           |           |
| (期 首)         | 円       |        | % |                                     | %      | %         | %         |
| 2021年 9 月 6 日 | 12, 332 | —      |   | 124. 58                             | —      | 99. 3     | —         |
| 9 月末          | 12, 186 | △ 1. 2 |   | 123. 09                             | △ 1. 2 | 99. 5     | —         |
| 10 月末         | 12, 183 | △ 1. 2 |   | 123. 02                             | △ 1. 3 | 100. 8    | —         |
| 11 月末         | 12, 258 | △ 0. 6 |   | 123. 80                             | △ 0. 6 | 97. 2     | —         |
| 12 月末         | 12, 145 | △ 1. 5 |   | 122. 69                             | △ 1. 5 | 100. 1    | —         |
| 2022年 1 月末    | 11, 994 | △ 2. 7 |   | 121. 17                             | △ 2. 7 | 98. 4     | —         |
| 2 月末          | 11, 741 | △ 4. 8 |   | 118. 62                             | △ 4. 8 | 99. 0     | —         |
| 3 月末          | 11, 420 | △ 7. 4 |   | 115. 47                             | △ 7. 3 | 105. 1    | —         |
| 4 月末          | 11, 168 | △ 9. 4 |   | 112. 95                             | △ 9. 3 | 101. 1    | —         |
| 5 月末          | 11, 055 | △10. 4 |   | 111. 76                             | △10. 3 | 98. 7     | —         |
| 6 月末          | 10, 749 | △12. 8 |   | 108. 74                             | △12. 7 | 101. 4    | —         |
| 7 月末          | 11, 063 | △10. 3 |   | 111. 99                             | △10. 1 | 96. 3     | —         |
| 8 月末          | 10, 683 | △13. 4 |   | 108. 05                             | △13. 3 | 101. 2    | —         |
| (期 末)         |         |        |   |                                     |        |           |           |
| 2022年 9 月 6 日 | 10, 625 | △13. 8 |   | 107. 48                             | △13. 7 | 99. 7     | —         |

\* 騰落率は期首比です。

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが上昇（価格は下落）したため、基準価額は下落しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

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すため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、外貨建資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行ないました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

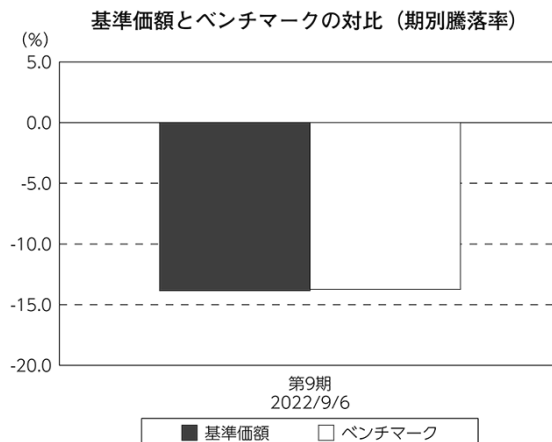
今期の基準価額の騰落率は－13.8%となり、ベンチマークの－13.7%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

### （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ること



（注）ベンチマークは、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、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なってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年9月7日～2022年9月6日)

| 項 目                                       | 当 期             |                             | 項 目 の 概 要                                                                                                |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                           | 金 額             | 比 率                         |                                                                                                          |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )  | 円<br>0<br>(0)   | %<br>0.000<br>(0.000)       | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※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<br>( 保 管 費 用 )<br>( そ の 他 ) | 1<br>(1)<br>(0) | 0.009<br>(0.009)<br>(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<br>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<br>信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計                                       | 1               | 0.009                       |                                                                                                          |
| 期中の平均基準価額は、11,553円です。                     |                 |                             |                                                                                                          |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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。



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   | 債券先物取引 | 百万円<br>1,057 | 百万円<br>1,056 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

\*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9月7日～2022年9月6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。

## ○組入資産の明細

(2022年9月6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<br>組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 |      |      |
|         |                       | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額     |      |                    | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満 |
|         | 千米ドル                  | 千米ドル                  | 千円         | %    | %                  | %         | %    | %    |
| アメリカ    | 321,300               | 298,106               | 41,815,432 | 51.9 | —                  | 22.8      | 19.3 | 9.8  |
| カナダ     | 千カナダドル<br>16,550      | 千カナダドル<br>15,808      | 1,692,928  | 2.1  | —                  | 1.1       | 0.5  | 0.5  |
| イギリス    | 千英ポンド<br>24,080       | 千英ポンド<br>22,662       | 3,683,633  | 4.6  | —                  | 3.4       | 0.9  | 0.3  |
| スウェーデン  | 千スウェーデンクローナ<br>16,050 | 千スウェーデンクローナ<br>15,330 | 199,757    | 0.2  | —                  | 0.2       | 0.0  | 0.0  |
| ノルウェー   | 千ノルウェークローネ<br>14,700  | 千ノルウェークローネ<br>13,552  | 191,768    | 0.2  | —                  | 0.1       | 0.1  | 0.0  |
| デンマーク   | 千デンマーククローネ<br>14,650  | 千デンマーククローネ<br>15,144  | 284,558    | 0.4  | —                  | 0.3       | 0.0  | 0.0  |
| ユーロ     | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |            |      |                    |           |      |      |
| ドイツ     | 33,000                | 33,604                | 4,695,267  | 5.8  | —                  | 3.5       | 1.6  | 0.8  |
| イタリア    | 47,410                | 45,297                | 6,328,948  | 7.9  | —                  | 4.4       | 2.4  | 1.0  |
| フランス    | 48,960                | 48,034                | 6,711,412  | 8.3  | —                  | 5.3       | 2.3  | 0.7  |
| オランダ    | 9,810                 | 9,493                 | 1,326,463  | 1.6  | —                  | 0.9       | 0.5  | 0.2  |
| スペイン    | 31,320                | 30,768                | 4,298,962  | 5.3  | —                  | 3.0       | 1.9  | 0.5  |
| ベルギー    | 10,640                | 10,284                | 1,436,887  | 1.8  | —                  | 1.3       | 0.3  | 0.1  |
| オーストリア  | 7,420                 | 6,915                 | 966,186    | 1.2  | —                  | 0.8       | 0.4  | 0.1  |
| フィンランド  | 3,310                 | 3,099                 | 433,021    | 0.5  | —                  | 0.4       | 0.1  | 0.0  |
| アイルランド  | 4,250                 | 3,886                 | 542,961    | 0.7  | —                  | 0.4       | 0.1  | 0.1  |
| ポーランド   | 千ズロチ<br>13,900        | 千ズロチ<br>12,005        | 355,971    | 0.4  | —                  | 0.2       | 0.2  | —    |
| シンガポール  | 千シンガポールドル<br>7,040    | 千シンガポールドル<br>6,575    | 658,562    | 0.8  | —                  | 0.5       | 0.2  | 0.0  |
| 中国      | 千人民元<br>113,000       | 千人民元<br>114,652       | 2,319,482  | 2.9  | —                  | 1.2       | 1.2  | 0.5  |
| オーストラリア | 千豪ドル<br>14,060        | 千豪ドル<br>13,125        | 1,257,257  | 1.6  | —                  | 1.2       | 0.4  | 0.0  |
| イスラエル   | 千新シェケル<br>8,300       | 千新シェケル<br>8,460       | 348,838    | 0.4  | —                  | 0.2       | 0.1  | 0.2  |
| メキシコ    | 千メキシコペソ<br>115,600    | 千メキシコペソ<br>108,684    | 764,791    | 0.9  | —                  | 0.4       | 0.5  | 0.1  |
| 合 計     | —                     | —                     | 80,313,097 | 99.7 | —                  | 51.5      | 33.1 | 15.1 |

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

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

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

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄   |      |                  | 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 BOND | 2.375 | 1,500 | 1,471 | 206,381 | 2024/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY BOND | 6.0   | 610   | 660   | 92,643  | 2026/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY BOND | 6.125 | 1,800 | 2,034 | 285,427 | 2027/11/15  |
|      |      | US TREASURY BOND | 5.25  | 20    | 22    | 3,102   | 2028/11/15  |
|      |      | US TREASURY BOND | 2.875 | 510   | 450   | 63,148  | 2043/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY BOND | 3.75  | 250   | 253   | 35,563  | 2043/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.375 | 3,000 | 2,940 | 412,533 | 2023/ 8 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.75  | 3,500 | 3,476 | 487,646 | 2023/ 8 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 0.125 | 2,500 | 2,417 | 339,052 | 2023/ 9 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.375 | 1,000 | 978   | 137,256 | 2023/ 9 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 0.125 | 500   | 482   | 67,643  | 2023/10/15  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.625 | 1,700 | 1,666 | 233,736 | 2023/10/31  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.75  | 2,500 | 2,481 | 348,086 | 2023/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.125 | 500   | 492   | 69,074  | 2023/11/30  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.875 | 1,500 | 1,490 | 209,098 | 2023/11/30  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.25  | 2,000 | 1,970 | 276,408 | 2023/12/31  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.625 | 700   | 693   | 97,239  | 2023/12/31  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 0.125 | 1,000 | 956   | 134,209 | 2024/ 1 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.25  | 500   | 492   | 69,030  | 2024/ 1 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.75  | 400   | 396   | 55,585  | 2024/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.125 | 1,500 | 1,472 | 206,529 | 2024/ 2 /29 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.375 | 300   | 295   | 41,458  | 2024/ 2 /29 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.5   | 1,000 | 972   | 136,431 | 2024/ 2 /29 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 0.25  | 2,500 | 2,383 | 334,285 | 2024/ 3 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.125 | 2,000 | 1,961 | 275,126 | 2024/ 3 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.25  | 2,000 | 1,964 | 275,553 | 2024/ 3 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 0.375 | 1,000 | 952   | 133,637 | 2024/ 4 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.0   | 2,000 | 1,955 | 274,337 | 2024/ 4 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.5   | 2,500 | 2,463 | 345,599 | 2024/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.0   | 2,000 | 1,953 | 274,041 | 2024/ 5 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.0   | 800   | 780   | 109,493 | 2024/ 6 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.75  | 2,000 | 1,942 | 272,490 | 2024/ 6 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 3.0   | 1,500 | 1,489 | 208,884 | 2024/ 6 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 0.375 | 3,000 | 2,838 | 398,175 | 2024/ 7 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.125 | 3,000 | 2,930 | 411,111 | 2024/ 7 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.75  | 3,000 | 2,910 | 408,226 | 2024/ 7 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 0.375 | 2,000 | 1,887 | 264,732 | 2024/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.875 | 2,000 | 1,942 | 272,458 | 2024/ 8 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.25  | 1,000 | 959   | 134,563 | 2024/ 8 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.125 | 2,000 | 1,950 | 273,581 | 2024/ 9 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.5   | 1,500 | 1,443 | 202,531 | 2024/ 9 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B  | 0.625 | 1,500 | 1,416 | 198,660 | 2024/10/15  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.25  | 2,000 | 1,953 | 273,997 | 2024/10/31  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 1.5   | 1,000 | 961   | 134,840 | 2024/10/31  |
|      |      | US TREASURY N/B  | 2.25  | 1,500 | 1,464 | 205,416 | 2024/11/15  |

| 銘<br>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  |             |
| アメリカ   |      |                 | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円      |             |
|        | 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.125 | 2,400 | 2,334 | 327,455 | 2024/11/30  |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.5   | 3,000 | 2,878 | 403,829 | 2024/11/30  |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.25  | 800   | 779   | 109,358 | 2024/12/31  |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.75  | 2,000 | 1,927 | 270,337 | 2024/12/31  |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.0   | 2,000 | 1,934 | 271,334 | 2025/ 2 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.75  | 1,500 | 1,476 | 207,092 | 2025/ 2 /28 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.125 | 1,000 | 945   | 132,692 | 2025/ 2 /28 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.75  | 2,000 | 1,920 | 269,329 | 2025/ 3 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.625 | 2,500 | 2,451 | 343,935 | 2025/ 3 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 0.375 | 500   | 461   | 64,748  | 2025/ 4 /30 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.125 | 2,300 | 2,223 | 311,883 | 2025/ 5 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.75  | 2,000 | 1,964 | 275,597 | 2025/ 5 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.875 | 3,100 | 3,054 | 428,501 | 2025/ 5 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 0.25  | 2,000 | 1,834 | 257,373 | 2025/ 5 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.875 | 1,500 | 1,477 | 207,281 | 2025/ 6 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.75  | 1,500 | 1,473 | 206,624 | 2025/ 6 /30 |
|        |      | US TREASURY N/B | 0.25  | 700   | 640   | 89,892  | 2025/ 6 /30 |
|        |      | US TREASURY N/B | 3.0   | 2,000 | 1,976 | 277,219 | 2025/ 7 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.875 | 2,000 | 1,969 | 276,299 | 2025/ 7 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 0.25  | 2,000 | 1,825 | 256,014 | 2025/ 7 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.0   | 2,780 | 2,669 | 374,413 | 2025/ 8 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.75  | 600   | 588   | 82,541  | 2025/ 8 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 3.0   | 3,000 | 2,962 | 415,566 | 2025/ 9 /30 |
|        |      | US TREASURY N/B | 0.25  | 1,500 | 1,362 | 191,082 | 2025/ 9 /30 |
|        |      | US TREASURY N/B | 0.25  | 1,000 | 905   | 127,010 | 2025/10/31  |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.25  | 1,640 | 1,580 | 221,766 | 2025/11/15  |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.625 | 2,500 | 2,436 | 341,798 | 2026/ 1 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 0.375 | 500   | 451   | 63,269  | 2026/ 1 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.625 | 2,200 | 2,071 | 290,500 | 2026/ 2 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.5   | 2,500 | 2,424 | 340,099 | 2026/ 2 /28 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.25  | 500   | 480   | 67,444  | 2026/ 3 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.625 | 700   | 657   | 92,171  | 2026/ 5 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.125 | 2,500 | 2,388 | 335,100 | 2026/ 5 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,000 | 946   | 132,818 | 2026/ 6 /30 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.875 | 2,500 | 2,363 | 331,579 | 2026/ 7 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.5   | 2,700 | 2,512 | 352,365 | 2026/ 8 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.375 | 500   | 462   | 64,932  | 2026/ 8 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.625 | 4,000 | 3,738 | 524,368 | 2026/ 9 /30 |
|        |      | US TREASURY N/B | 0.875 | 3,500 | 3,168 | 444,458 | 2026/ 9 /30 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.0   | 2,600 | 2,459 | 345,042 | 2026/11/15  |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.625 | 3,000 | 2,797 | 392,405 | 2026/11/30  |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.75  | 1,200 | 1,123 | 157,652 | 2026/12/31  |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.25  | 2,500 | 2,288 | 321,073 | 2026/12/31  |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.5   | 2,000 | 1,848 | 259,357 | 2027/ 1 /31 |
|        |      | US TREASURY N/B | 2.25  | 1,000 | 954   | 133,831 | 2027/ 2 /15 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.125 | 2,000 | 1,817 | 254,962 | 2027/ 2 /28 |
|        |      | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,100 | 1,033 | 144,966 | 2027/ 2 /28 |

| 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   |             |
| アメリカ |      |                 | %      | 千米ドル   | 千米ドル   | 千円       |             |
|      | 国債証券 | US TREASURY N/B | 2. 5   | 2, 000 | 1, 929 | 270, 611 | 2027/ 3 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 5   | 2, 000 | 1, 757 | 246, 535 | 2027/ 4 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 75  | 2, 000 | 1, 949 | 273, 482 | 2027/ 4 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 375 | 3, 800 | 3, 638 | 510, 414 | 2027/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 5   | 2, 000 | 1, 753 | 246, 009 | 2027/ 5 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 625 | 1, 500 | 1, 454 | 204, 084 | 2027/ 5 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 5   | 1, 500 | 1, 312 | 184, 120 | 2027/ 6 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 3. 25  | 200    | 199    | 27, 957  | 2027/ 6 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 25  | 3, 200 | 3, 044 | 426, 981 | 2027/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 5   | 1, 500 | 1, 300 | 182, 452 | 2027/10/31  |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 25  | 1, 600 | 1, 517 | 212, 921 | 2027/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 75  | 1, 500 | 1, 309 | 183, 709 | 2028/ 1 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 75  | 2, 700 | 2, 620 | 367, 544 | 2028/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 125 | 2, 000 | 1, 781 | 249, 844 | 2028/ 2 /29 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 25  | 4, 000 | 3, 571 | 501, 004 | 2028/ 4 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 875 | 3, 500 | 3, 414 | 478, 997 | 2028/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 0   | 1, 000 | 875    | 122, 834 | 2028/ 7 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 875 | 3, 100 | 3, 021 | 423, 779 | 2028/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 25  | 2, 000 | 1, 771 | 248, 540 | 2028/ 9 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 375 | 1, 500 | 1, 337 | 187, 605 | 2028/10/31  |
|      |      | US TREASURY N/B | 3. 125 | 5, 000 | 4, 942 | 693, 240 | 2028/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 5   | 1, 000 | 897    | 125, 848 | 2028/11/30  |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 375 | 2, 500 | 2, 226 | 312, 251 | 2028/12/31  |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 75  | 1, 000 | 909    | 127, 640 | 2029/ 1 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 625 | 3, 400 | 3, 262 | 457, 692 | 2029/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 875 | 2, 500 | 2, 432 | 341, 223 | 2029/ 4 /30 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 375 | 2, 500 | 2, 359 | 330, 976 | 2029/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 75  | 1, 500 | 1, 448 | 203, 188 | 2029/ 5 /31 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 625 | 2, 700 | 2, 429 | 340, 826 | 2029/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 75  | 200    | 181    | 25, 469  | 2029/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 5   | 2, 000 | 1, 774 | 248, 847 | 2030/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 6. 25  | 500    | 601    | 84, 408  | 2030/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 625 | 1, 700 | 1, 401 | 196, 598 | 2030/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 625 | 4, 300 | 3, 526 | 494, 639 | 2030/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 0. 875 | 3, 500 | 2, 922 | 409, 977 | 2030/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B | 5. 375 | 500    | 578    | 81, 197  | 2031/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 125 | 3, 100 | 2, 633 | 369, 373 | 2031/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 625 | 2, 600 | 2, 293 | 321, 764 | 2031/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 25  | 3, 700 | 3, 144 | 441, 068 | 2031/ 8 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 375 | 2, 400 | 2, 052 | 287, 965 | 2031/11/15  |
|      |      | US TREASURY N/B | 1. 875 | 3, 200 | 2, 857 | 400, 751 | 2032/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 2. 875 | 2, 900 | 2, 821 | 395, 787 | 2032/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 5. 0   | 340    | 410    | 57, 558  | 2037/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 4. 5   | 1, 760 | 2, 023 | 283, 829 | 2038/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 3. 5   | 400    | 407    | 57, 155  | 2039/ 2 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 4. 25  | 800    | 892    | 125, 190 | 2039/ 5 /15 |
|      |      | US TREASURY N/B | 4. 5   | 400    | 459    | 64, 418  | 2039/ 8 /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  |            |
| アメリカ | 国債証券 | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円      |            |
|      |      | 4.375 | 500   | 565   | 79,252  | 2039/11/15 |
|      |      | 4.625 | 1,150 | 1,337 | 187,649 | 2040/2/15  |
|      |      | 1.125 | 1,000 | 675   | 94,715  | 2040/5/15  |
|      |      | 3.875 | 340   | 357   | 50,117  | 2040/8/15  |
|      |      | 1.125 | 1,200 | 802   | 112,592 | 2040/8/15  |
|      |      | 4.25  | 1,600 | 1,764 | 247,471 | 2040/11/15 |
|      |      | 1.375 | 1,200 | 836   | 117,392 | 2040/11/15 |
|      |      | 4.75  | 300   | 352   | 49,471  | 2041/2/15  |
|      |      | 3.75  | 400   | 409   | 57,427  | 2041/8/15  |
|      |      | 3.125 | 500   | 466   | 65,428  | 2041/11/15 |
|      |      | 3.125 | 1,200 | 1,117 | 156,778 | 2042/2/15  |
|      |      | 3.0   | 400   | 364   | 51,093  | 2042/5/15  |
|      |      | 3.25  | 500   | 473   | 66,420  | 2042/5/15  |
|      |      | 2.75  | 500   | 435   | 61,039  | 2042/8/15  |
|      |      | 2.75  | 500   | 434   | 60,918  | 2042/11/15 |
|      |      | 3.125 | 800   | 736   | 103,317 | 2043/2/15  |
|      |      | 3.625 | 300   | 298   | 41,890  | 2043/8/15  |
|      |      | 3.625 | 700   | 695   | 97,536  | 2044/2/15  |
|      |      | 3.125 | 1,700 | 1,556 | 218,301 | 2044/8/15  |
|      |      | 3.0   | 1,600 | 1,432 | 200,936 | 2044/11/15 |
|      |      | 2.5   | 300   | 245   | 34,434  | 2045/2/15  |
|      |      | 3.0   | 2,540 | 2,271 | 318,597 | 2045/5/15  |
|      |      | 2.875 | 2,760 | 2,414 | 338,661 | 2045/8/15  |
|      |      | 3.0   | 920   | 823   | 115,488 | 2045/11/15 |
|      |      | 2.5   | 2,530 | 2,061 | 289,229 | 2046/2/15  |
|      |      | 2.5   | 3,400 | 2,770 | 388,613 | 2046/5/15  |
|      |      | 2.25  | 4,030 | 3,120 | 437,656 | 2046/8/15  |
|      |      | 2.875 | 2,300 | 2,015 | 282,671 | 2046/11/15 |
|      |      | 3.0   | 500   | 448   | 62,891  | 2047/2/15  |
|      |      | 3.0   | 1,000 | 898   | 125,969 | 2047/5/15  |
|      |      | 2.75  | 1,520 | 1,305 | 183,061 | 2047/8/15  |
|      |      | 2.75  | 1,300 | 1,117 | 156,807 | 2047/11/15 |
|      |      | 3.0   | 1,400 | 1,266 | 177,645 | 2048/2/15  |
|      |      | 3.125 | 1,400 | 1,301 | 182,539 | 2048/5/15  |
|      |      | 3.0   | 900   | 818   | 114,841 | 2048/8/15  |
|      |      | 3.375 | 300   | 293   | 41,170  | 2048/11/15 |
|      |      | 3.0   | 2,500 | 2,296 | 322,073 | 2049/2/15  |
|      |      | 2.875 | 500   | 449   | 62,989  | 2049/5/15  |
|      |      | 2.25  | 1,300 | 1,027 | 144,157 | 2049/8/15  |
|      |      | 2.375 | 1,000 | 813   | 114,057 | 2049/11/15 |
|      |      | 2.0   | 600   | 447   | 62,805  | 2050/2/15  |
|      |      | 1.25  | 2,500 | 1,522 | 213,582 | 2050/5/15  |
|      |      | 1.375 | 1,600 | 1,008 | 141,392 | 2050/8/15  |
|      |      | 1.625 | 1,600 | 1,078 | 151,333 | 2050/11/15 |
|      |      | 1.875 | 1,000 | 719   | 100,884 | 2051/2/15  |
|      |      | 2.375 | 2,200 | 1,786 | 250,563 | 2051/5/15  |
|      |      | 2.0   | 300   | 222   | 31,172  | 2051/8/15  |

| 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     |             |
| アメリカ |                     |                     | %     | 千米ドル   | 千米ドル   | 千円         |             |
|      | 国債証券                | US TREASURY N/B     | 1.875 | 1,600  | 1,148  | 161,100    | 2051/11/15  |
|      |                     | US TREASURY N/B     | 2.25  | 1,500  | 1,181  | 165,792    | 2052/ 2 /15 |
|      |                     | US TREASURY N/B     | 2.875 | 1,700  | 1,545  | 216,755    | 2052/ 5 /15 |
| 小 計  |                     |                     |       |        |        | 41,815,432 |             |
| カナダ  |                     |                     |       | 千カナダドル | 千カナダドル |            |             |
|      | 国債証券                | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0   | 150    | 147    | 15,798     | 2023/ 9 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25  | 600    | 588    | 63,016     | 2024/ 3 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5   | 260    | 255    | 27,353     | 2024/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5   | 3,000  | 2,883  | 308,827    | 2024/ 9 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25  | 1,000  | 946    | 101,351    | 2025/ 3 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5   | 200    | 190    | 20,361     | 2025/ 4 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 0.25  | 600    | 539    | 57,755     | 2026/ 3 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5   | 1,000  | 937    | 100,437    | 2026/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0   | 1,000  | 906    | 97,061     | 2027/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0   | 400    | 376    | 40,331     | 2028/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75  | 1,020  | 1,184  | 126,894    | 2029/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25  | 700    | 665    | 71,223     | 2029/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25  | 800    | 698    | 74,843     | 2030/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5   | 600    | 526    | 56,419     | 2031/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5   | 500    | 436    | 46,719     | 2031/12/ 1  |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0   | 900    | 818    | 87,622     | 2032/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75  | 600    | 742    | 79,482     | 2033/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0   | 400    | 487    | 52,169     | 2037/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0   | 180    | 202    | 21,676     | 2041/ 6 / 1 |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75  | 1,040  | 984    | 105,440    | 2048/12/ 1  |
|      |                     | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0   | 800    | 639    | 68,499     | 2051/12/ 1  |
|      | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75                | 500   | 371    | 39,733 | 2053/12/ 1 |             |
|      | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75                | 300   | 279    | 29,908 | 2064/12/ 1 |             |
| 小 計  |                     |                     |       |        |        | 1,692,928  |             |
| イギリス |                     |                     |       | 千英ポンド  | 千英ポンド  |            |             |
|      | 国債証券                | UK TREASURY         | 2.25  | 950    | 941    | 152,982    | 2023/ 9 / 7 |
|      |                     | UK TREASURY         | 1.0   | 500    | 482    | 78,484     | 2024/ 4 /22 |
|      |                     | UK TREASURY         | 2.75  | 400    | 396    | 64,494     | 2024/ 9 / 7 |
|      |                     | UK TREASURY         | 0.25  | 600    | 559    | 90,887     | 2025/ 1 /31 |
|      |                     | UK TREASURY         | 0.625 | 300    | 281    | 45,780     | 2025/ 6 / 7 |
|      |                     | UK TREASURY         | 2.0   | 1,000  | 972    | 158,062    | 2025/ 9 / 7 |
|      |                     | UK TREASURY         | 1.5   | 670    | 635    | 103,246    | 2026/ 7 /22 |
|      |                     | UK TREASURY         | 0.375 | 800    | 719    | 116,997    | 2026/10/22  |
|      |                     | UK TREASURY         | 1.25  | 1,000  | 925    | 150,430    | 2027/ 7 /22 |
|      |                     | UK TREASURY         | 4.25  | 300    | 318    | 51,811     | 2027/12/ 7  |
|      |                     | UK TREASURY         | 1.625 | 400    | 373    | 60,653     | 2028/10/22  |
|      |                     | UK TREASURY         | 6.0   | 90     | 105    | 17,220     | 2028/12/ 7  |
|      |                     | UK TREASURY         | 0.875 | 800    | 699    | 113,702    | 2029/10/22  |
|      |                     | UK TREASURY         | 0.375 | 700    | 575    | 93,566     | 2030/10/22  |
|      |                     | UK TREASURY         | 4.75  | 600    | 684    | 111,253    | 2030/12/ 7  |
|      |                     | UK TREASURY         | 0.25  | 600    | 475    | 77,217     | 2031/ 7 /31 |
|      |                     | UK TREASURY         | 1.0   | 100    | 83     | 13,618     | 2032/ 1 /31 |

| 銘<br>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          | 4. 25  | 600         | 667         | 108,414   | 2032/ 6 / 7  |
|                            |       | UK TREASURY          | 0. 875 | 300         | 239         | 38, 874   | 2033/ 7 / 31 |
|                            |       | UK TREASURY          | 4. 5   | 500         | 567         | 92,320    | 2034/ 9 / 7  |
|                            |       | UK TREASURY          | 0. 625 | 800         | 578         | 94,006    | 2035/ 7 / 31 |
|                            |       | UK TREASURY          | 4. 25  | 460         | 511         | 83,217    | 2036/ 3 / 7  |
|                            |       | UK TREASURY          | 1. 75  | 770         | 631         | 102,591   | 2037/ 9 / 7  |
|                            |       | UK TREASURY          | 4. 75  | 500         | 594         | 96,691    | 2038/12/ 7   |
|                            |       | UK TREASURY          | 1. 125 | 300         | 217         | 35,417    | 2039/ 1 / 31 |
|                            |       | UK TREASURY          | 4. 25  | 100         | 112         | 18,293    | 2039/ 9 / 7  |
|                            |       | UK TREASURY          | 1. 25  | 200         | 142         | 23,164    | 2041/10/22   |
|                            |       | UK TREASURY          | 4. 5   | 350         | 412         | 66,992    | 2042/12/ 7   |
|                            |       | UK TREASURY          | 3. 5   | 600         | 616         | 100,283   | 2045/ 1 / 22 |
|                            |       | UK TREASURY          | 4. 25  | 1, 580      | 1, 827      | 297,009   | 2046/12/ 7   |
|                            |       | UK TREASURY          | 1. 5   | 700         | 490         | 79,791    | 2047/ 7 / 22 |
|                            |       | UK TREASURY          | 1. 75  | 350         | 258         | 42,042    | 2049/ 1 / 22 |
|                            |       | UK TREASURY          | 4. 25  | 1, 240      | 1, 463      | 237,920   | 2049/12/ 7   |
|                            |       | UK TREASURY          | 1. 25  | 500         | 317         | 51,609    | 2051/ 7 / 31 |
|                            |       | UK TREASURY          | 3. 75  | 110         | 121         | 19,804    | 2052/ 7 / 22 |
|                            |       | UK TREASURY          | 1. 5   | 300         | 201         | 32,775    | 2053/ 7 / 31 |
|                            |       | UK TREASURY          | 1. 625 | 300         | 208         | 33,838    | 2054/10/22   |
|                            |       | UK TREASURY          | 1. 75  | 500         | 357         | 58,181    | 2057/ 7 / 22 |
|                            |       | UK TREASURY          | 4. 0   | 200         | 241         | 39,261    | 2060/ 1 / 22 |
|                            |       | UK TREASURY          | 2. 5   | 200         | 177         | 28,790    | 2065/ 7 / 22 |
|                            |       | UK TREASURY          | 3. 5   | 530         | 598         | 97,305    | 2068/ 7 / 22 |
|                            |       | UK TSY 0 1/2% 2061   | 0. 5   | 400         | 172         | 27,986    | 2061/10/22   |
|                            |       | UK TSY 0 5/8% 2050   | 0. 625 | 500         | 263         | 42,890    | 2050/10/22   |
|                            |       | UK TSY 3 1/4% 2044   | 3. 25  | 300         | 296         | 48,255    | 2044/ 1 / 22 |
|                            |       | UNITED KINGDOM GILT  | 0. 875 | 300         | 182         | 29,739    | 2046/ 1 / 31 |
| UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 4. 25 | 780                  | 958    | 155,753     | 2055/12/ 7  |           |              |
| 小 計                        |       |                      |        |             |             | 3,683,633 |              |
| 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  | SWEDISH GOVERNMENT   | 1. 5   | 3,000       | 2,976       | 38,783    | 2023/11/13   |
|                            |       | SWEDISH GOVERNMENT   | 2. 5   | 250         | 250         | 3,266     | 2025/ 5 / 12 |
|                            |       | SWEDISH GOVERNMENT   | 1. 0   | 2,700       | 2,572       | 33,514    | 2026/11/12   |
|                            |       | SWEDISH GOVERNMENT   | 0. 75  | 1,000       | 929         | 12,110    | 2028/ 5 / 12 |
|                            |       | SWEDISH GOVERNMENT   | 0. 75  | 3,500       | 3,203       | 41,743    | 2029/11/12   |
|                            |       | SWEDISH GOVERNMENT   | 0. 125 | 4,000       | 3,422       | 44,594    | 2031/ 5 / 12 |
|                            |       | SWEDISH GOVERNMENT   | 3. 5   | 1,600       | 1,975       | 25,743    | 2039/ 3 / 30 |
| 小 計                        |       |                      |        |             |             | 199,757   |              |
| ノルウェー                      |       |                      |        | 千ノルウェークローネ  | 千ノルウェークローネ  |           |              |
|                            | 国債証券  | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3. 0   | 2,750       | 2,738       | 38,748    | 2024/ 3 / 14 |
|                            |       | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1. 75  | 2,000       | 1,923       | 27,220    | 2025/ 3 / 13 |
|                            |       | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1. 5   | 1,700       | 1,596       | 22,596    | 2026/ 2 / 19 |
|                            |       | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1. 75  | 1,750       | 1,636       | 23,157    | 2027/ 2 / 17 |
|                            |       | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2. 0   | 1,500       | 1,399       | 19,805    | 2028/ 4 / 26 |
|                            |       | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1. 375 | 2,000       | 1,734       | 24,536    | 2030/ 8 / 19 |

| 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 |      |                          | %     | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | 千円      |            |
|       | 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 1.25  | 3,000      | 2,523      | 35,704  | 2031/9/17  |
| 小 計   |      |                          |       |            |            | 191,768 |            |
| デンマーク |      |                          |       | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ |         |            |
|       | 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK       | 1.5   | 1,650      | 1,661      | 31,220  | 2023/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 1.75  | 1,400      | 1,412      | 26,534  | 2025/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 0.5   | 2,300      | 2,167      | 40,719  | 2027/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 0.5   | 2,100      | 1,918      | 36,041  | 2029/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | —     | 2,000      | 1,681      | 31,591  | 2031/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 4.5   | 4,200      | 5,695      | 107,017 | 2039/11/15 |
|       |      | KINGDOM OF DENMARK       | 0.25  | 1,000      | 608        | 11,432  | 2052/11/15 |
| 小 計   |      |                          |       |            |            | 284,558 |            |
| ユーロ   |      |                          |       | 千ユーロ       | 千ユーロ       |         |            |
| ドイツ   | 国債証券 | BUNDESOBLIGATION         | —     | 100        | 99         | 13,887  | 2023/10/13 |
|       |      | BUNDESOBLIGATION         | —     | 1,000      | 987        | 137,997 | 2024/4/5   |
|       |      | BUNDESOBLIGATION         | —     | 1,500      | 1,459      | 203,955 | 2025/4/11  |
|       |      | BUNDESOBLIGATION         | —     | 1,000      | 959        | 134,093 | 2026/4/10  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25  | 400        | 428        | 59,937  | 2024/1/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75  | 610        | 618        | 86,482  | 2024/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5   | 700        | 707        | 98,837  | 2024/5/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0   | 440        | 440        | 61,540  | 2024/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 200        | 197        | 27,569  | 2025/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0   | 500        | 498        | 69,671  | 2025/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 900        | 880        | 123,041 | 2026/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 300        | 286        | 40,016  | 2026/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.25  | 2,270      | 2,175      | 303,922 | 2027/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5   | 1,400      | 1,734      | 242,332 | 2027/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 850        | 818        | 114,353 | 2027/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5   | 1,000      | 956        | 133,572 | 2028/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75  | 1,000      | 1,186      | 165,781 | 2028/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.25  | 1,000      | 931        | 130,193 | 2029/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 400        | 363        | 50,842  | 2029/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25  | 500        | 668        | 93,397  | 2030/1/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 200        | 180        | 25,225  | 2030/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 1,000      | 894        | 124,919 | 2030/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 1,000      | 894        | 124,939 | 2030/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5   | 1,100      | 1,449      | 202,492 | 2031/1/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 1,000      | 877        | 122,635 | 2031/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 1,000      | 878        | 122,720 | 2031/8/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 500        | 434        | 60,646  | 2032/2/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75  | 1,400      | 1,881      | 262,827 | 2034/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 100        | 81         | 11,323  | 2035/5/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 900        | 714        | 99,884  | 2036/5/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0   | 1,000      | 1,292      | 180,538 | 2037/1/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0   | 500        | 449        | 62,807  | 2038/5/15  |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25  | 710        | 971        | 135,791 | 2039/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75  | 60         | 87         | 12,264  | 2040/7/4   |
|       |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25  | 650        | 821        | 114,765 | 2042/7/4   |

| 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 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2. 5  | 800    | 916    | 128,071  | 2044/ 7 / 4 |
|      |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2. 5  | 910    | 1, 055 | 147, 473 | 2046/ 8 /15 |
|      |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1. 25 | 1, 200 | 1, 091 | 152, 435 | 2048/ 8 /15 |
|      |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 1, 100 | 687    | 95, 989  | 2050/ 8 /15 |
|      |      | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | —     | 600    | 361    | 50, 444  | 2052/ 8 /15 |
|      |      | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | —     | 1, 200 | 1, 185 | 165, 643 | 2024/ 3 /15 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0. 65 | 1, 000 | 988    | 138, 120 | 2023/10/15  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9. 0  | 180    | 194    | 27, 174  | 2023/11/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4. 5  | 2, 200 | 2, 280 | 318, 578 | 2024/ 3 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | —     | 1, 000 | 959    | 134, 068 | 2024/ 8 /15 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3. 75 | 1, 500 | 1, 545 | 215, 988 | 2024/ 9 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 45 | 1, 200 | 1, 181 | 165, 014 | 2024/11/15  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2. 5  | 500    | 503    | 70, 279  | 2024/12/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | —     | 1, 500 | 1, 423 | 198, 828 | 2024/12/15  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0. 35 | 500    | 476    | 66, 611  | 2025/ 2 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5. 0  | 1, 350 | 1, 436 | 200, 693 | 2025/ 3 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 45 | 500    | 485    | 67, 792  | 2025/ 5 /15 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 5  | 800    | 779    | 108, 963 | 2025/ 6 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 85 | 1, 000 | 981    | 137, 135 | 2025/ 7 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2. 5  | 200    | 199    | 27, 835  | 2025/11/15  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2. 0  | 330    | 323    | 45, 222  | 2025/12/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0. 5  | 1, 200 | 1, 115 | 155, 819 | 2026/ 2 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4. 5  | 1, 000 | 1, 062 | 148, 382 | 2026/ 3 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | —     | 1, 500 | 1, 359 | 189, 879 | 2026/ 4 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 6  | 550    | 528    | 73, 779  | 2026/ 6 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 25 | 1, 100 | 1, 032 | 144, 255 | 2026/12/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 1  | 600    | 551    | 77, 049  | 2027/ 4 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2. 2  | 500    | 482    | 67, 456  | 2027/ 6 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0. 95 | 1, 500 | 1, 355 | 189, 355 | 2027/ 9 /15 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6. 5  | 400    | 467    | 65, 372  | 2027/11/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2. 0  | 1, 800 | 1, 702 | 237, 890 | 2028/ 2 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0. 25 | 1, 000 | 852    | 119, 153 | 2028/ 3 /15 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0. 5  | 600    | 513    | 71, 693  | 2028/ 7 /15 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4. 75 | 240    | 259    | 36, 248  | 2028/ 9 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2. 8  | 500    | 487    | 68, 113  | 2028/12/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2. 8  | 1, 000 | 962    | 134, 452 | 2029/ 6 /15 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3. 0  | 1, 000 | 977    | 136, 576 | 2029/ 8 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5. 25 | 1, 000 | 1, 122 | 156, 835 | 2029/11/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3. 5  | 800    | 804    | 112, 413 | 2030/ 3 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 35 | 700    | 600    | 83, 935  | 2030/ 4 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0. 95 | 200    | 164    | 22, 950  | 2030/ 8 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 65 | 200    | 172    | 24, 061  | 2030/12/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6. 0  | 700    | 824    | 115, 144 | 2031/ 5 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0. 95 | 600    | 469    | 65, 560  | 2031/12/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1. 65 | 500    | 417    | 58, 368  | 2032/ 3 / 1 |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2. 5  | 600    | 529    | 73, 981  | 2032/12/ 1  |
|      |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5. 75 | 1, 500 | 1, 740 | 243, 238 | 2033/ 2 / 1 |

| 銘<br>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 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45  | 1,070 | 928   | 129,736 | 2033/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 1,610 | 1,770 | 247,421 | 2034/8/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.35  | 800   | 749   | 104,711 | 2035/3/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45  | 300   | 222   | 31,139  | 2036/3/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.25  | 100   | 82    | 11,457  | 2036/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0   | 780   | 785   | 109,755 | 2037/2/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25  | 400   | 361   | 50,561  | 2038/3/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.95  | 700   | 611   | 85,422  | 2038/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 350   | 393   | 54,970  | 2039/8/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1   | 500   | 442   | 61,819  | 2040/3/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0   | 300   | 335   | 46,933  | 2040/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.8   | 800   | 569   | 79,528  | 2041/3/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75  | 580   | 638   | 89,181  | 2044/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5   | 500   | 312   | 43,641  | 2045/4/30  |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25  | 460   | 408   | 57,034  | 2046/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.7   | 500   | 398   | 55,608  | 2047/3/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.45  | 400   | 363   | 50,740  | 2048/3/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85  | 300   | 287   | 40,201  | 2049/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45  | 500   | 368   | 51,493  | 2050/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.7   | 400   | 248   | 34,650  | 2051/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.15  | 700   | 471   | 65,861  | 2052/9/1   |
|        |      | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8   | 310   | 234   | 32,801  | 2067/3/1   |
| フランス   | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 2,500 | 2,467 | 344,820 | 2024/2/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 500   | 492   | 68,784  | 2024/3/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 2.25  | 510   | 519   | 72,646  | 2024/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 1,000 | 966   | 135,097 | 2025/2/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 1,400 | 1,352 | 189,000 | 2025/3/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 600   | 586   | 81,899  | 2025/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 1,100 | 1,061 | 148,294 | 2026/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.25  | 1,050 | 994   | 139,003 | 2026/11/25 |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 2,200 | 2,050 | 286,481 | 2027/2/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.0   | 1,000 | 972   | 135,863 | 2027/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.75  | 1,300 | 1,233 | 172,373 | 2028/2/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.75  | 1,300 | 1,232 | 172,238 | 2028/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.75  | 2,000 | 1,884 | 263,343 | 2028/11/25 |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 1,500 | 1,380 | 192,910 | 2029/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 1,800 | 1,581 | 221,024 | 2029/11/25 |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 2.5   | 1,220 | 1,281 | 179,105 | 2030/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 1,500 | 1,283 | 179,292 | 2030/11/25 |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 500   | 415   | 58,070  | 2031/11/25 |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | —     | 800   | 653   | 91,253  | 2032/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 2.0   | 1,000 | 983   | 137,371 | 2032/11/25 |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.25  | 800   | 710   | 99,263  | 2034/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.25  | 1,550 | 1,334 | 186,506 | 2036/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.25  | 500   | 416   | 58,137  | 2038/5/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 1.75  | 560   | 506   | 70,832  | 2039/6/25  |
|        |      | FRANCE (GOVT OF)         | 0.5   | 300   | 213   | 29,786  | 2040/5/25  |

| 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 | FRANCE (GOVT OF)          | 0.5   | 600     | 397         | 55,547  | 2044/ 6 /25 |
|                           |      | FRANCE (GOVT OF)          | 2.0   | 610     | 542         | 75,836  | 2048/ 5 /25 |
|                           |      | FRANCE (GOVT OF)          | 1.5   | 1,100   | 875         | 122,354 | 2050/ 5 /25 |
|                           |      | FRANCE (GOVT OF)          | 0.75  | 500     | 310         | 43,313  | 2052/ 5 /25 |
|                           |      | FRANCE (GOVT OF)          | 0.75  | 900     | 545         | 76,248  | 2053/ 5 /25 |
|                           |      | FRANCE (GOVT OF)          | 1.75  | 300     | 235         | 32,837  | 2066/ 5 /25 |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.25  | 300     | 311         | 43,544  | 2023/10/25  |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1.75  | 1,100   | 1,111       | 155,340 | 2024/11/25  |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 6.0   | 1,100   | 1,264       | 176,715 | 2025/10/25  |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1.0   | 600     | 592         | 82,717  | 2025/11/25  |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | —     | 1,000   | 951         | 132,984 | 2026/ 2 /25 |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.5   | 1,410   | 1,509       | 210,903 | 2026/ 4 /25 |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 2.75  | 900     | 949         | 132,626 | 2027/10/25  |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 5.5   | 1,200   | 1,478       | 206,608 | 2029/ 4 /25 |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1.5   | 2,340   | 2,265       | 316,570 | 2031/ 5 /25 |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 5.75  | 300     | 398         | 55,645  | 2032/10/25  |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.75  | 2,290   | 2,879       | 402,369 | 2035/ 4 /25 |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0   | 400     | 479         | 67,001  | 2038/10/25  |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.5   | 720     | 927         | 129,588 | 2041/ 4 /25 |
|                           |      | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 3.25  | 1,200   | 1,335       | 186,654 | 2045/ 5 /25 |
| FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0  | 700                       | 905   | 126,458 | 2055/ 4 /25 |         |             |
| FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.0  | 900                       | 1,189 | 166,141 | 2060/ 4 /25 |         |             |
| オランダ                      | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 2.0   | 1,000   | 1,018       | 142,249 | 2024/ 7 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 0.25  | 700     | 680         | 95,053  | 2025/ 7 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | —     | 1,000   | 955         | 133,523 | 2026/ 1 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 0.5   | 400     | 386         | 53,982  | 2026/ 7 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 0.75  | 1,100   | 1,047       | 146,406 | 2027/ 7 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 0.75  | 1,000   | 953         | 133,160 | 2028/ 7 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | —     | 1,100   | 964         | 134,712 | 2030/ 7 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 0.5   | 200     | 174         | 24,423  | 2032/ 7 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 2.5   | 550     | 580         | 81,065  | 2033/ 1 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 4.0   | 400     | 495         | 69,171  | 2037/ 1 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | —     | 300     | 218         | 30,579  | 2038/ 1 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 0.5   | 300     | 232         | 32,494  | 2040/ 1 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 3.75  | 610     | 772         | 107,912 | 2042/ 1 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | 2.75  | 650     | 738         | 103,233 | 2047/ 1 /15 |
|                           |      | NETHERLANDS GOVERNMENT    | —     | 500     | 275         | 38,495  | 2052/ 1 /15 |
| スペイン                      | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | 3.8   | 1,920   | 1,998       | 279,202 | 2024/ 4 /30 |
|                           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | —     | 400     | 391         | 54,671  | 2024/ 5 /31 |
|                           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | 0.25  | 600     | 587         | 82,070  | 2024/ 7 /30 |
|                           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | 2.75  | 1,400   | 1,440       | 201,275 | 2024/10/31  |
|                           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | —     | 1,000   | 964         | 134,711 | 2025/ 1 /31 |
|                           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | 1.6   | 800     | 801         | 111,921 | 2025/ 4 /30 |
|                           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | —     | 700     | 668         | 93,454  | 2025/ 5 /31 |
|                           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | 4.65  | 1,000   | 1,088       | 152,016 | 2025/ 7 /30 |
|                           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | 2.15  | 700     | 711         | 99,466  | 2025/10/31  |
|                           |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO  | —     | 1,000   | 940         | 131,462 | 2026/ 1 /31 |

| 銘<br>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 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95  | 20      | 20          | 2,811   | 2026/ 4 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9   | 400     | 462         | 64,642  | 2026/ 7 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.3   | 1,000   | 980         | 136,989 | 2026/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | －     | 1,500   | 1,376       | 192,383 | 2027/ 1 /31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.5   | 500     | 490         | 68,501  | 2027/ 4 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8   | 800     | 755         | 105,555 | 2027/ 7 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.45  | 500     | 485         | 67,879  | 2027/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | －     | 1,400   | 1,254       | 175,313 | 2028/ 1 /31 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4   | 1,000   | 964         | 134,697 | 2028/ 4 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4   | 900     | 865         | 120,963 | 2028/ 7 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15  | 330     | 385         | 53,911  | 2028/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.45  | 1,000   | 953         | 133,264 | 2029/ 4 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.6   | 800     | 712         | 99,535  | 2029/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5   | 500     | 436         | 60,924  | 2030/ 4 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95  | 300     | 290         | 40,605  | 2030/ 7 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.25  | 600     | 549         | 76,781  | 2030/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.7   | 800     | 668         | 93,377  | 2032/ 4 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.55  | 200     | 196         | 27,426  | 2032/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.35  | 1,300   | 1,244       | 173,825 | 2033/ 7 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.85  | 1,100   | 976         | 136,469 | 2035/ 7 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9   | 400     | 500         | 69,994  | 2040/ 7 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.2   | 500     | 365         | 51,061  | 2040/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7   | 700     | 861         | 120,344 | 2041/ 7 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0   | 100     | 68          | 9,618   | 2042/ 7 /30 |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15  | 500     | 660         | 92,353  | 2044/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.9   | 950     | 909         | 127,052 | 2046/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7   | 700     | 639         | 89,394  | 2048/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0   | 600     | 356         | 49,796  | 2050/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.9   | 300     | 218         | 30,573  | 2052/10/31  |
|                    |      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.45  | 200     | 198         | 27,690  | 2066/ 7 /30 |
|                    |      | SPANISH GOVERNMENT       | 6.0   | 90      | 110         | 15,461  | 2029/ 1 /31 |
|                    |      | SPANISH GOVERNMENT       | 5.75  | 1,100   | 1,401       | 195,818 | 2032/ 7 /30 |
| SPANISH GOVERNMENT | 4.2  | 710                      | 813   | 113,690 | 2037/ 1 /31 |         |             |
| ベルギー               | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM          | 0.2   | 600     | 595         | 83,165  | 2023/10/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 2.6   | 230     | 236         | 32,974  | 2024/ 6 /22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.5   | 300     | 295         | 41,291  | 2024/10/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.8   | 1,200   | 1,182       | 165,284 | 2025/ 6 /22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.0   | 100     | 98          | 13,733  | 2026/ 6 /22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.8   | 150     | 144         | 20,185  | 2027/ 6 /22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | －     | 1,000   | 918         | 128,268 | 2027/10/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.8   | 300     | 285         | 39,864  | 2028/ 6 /22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.9   | 400     | 376         | 52,662  | 2029/ 6 /22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 0.1   | 300     | 261         | 36,508  | 2030/ 6 /22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.0   | 700     | 644         | 90,000  | 2031/ 6 /22 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | －     | 1,000   | 827         | 115,618 | 2031/10/22  |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 4.0   | 550     | 639         | 89,378  | 2032/ 3 /28 |
|                    |      | BELGIUM KINGDOM          | 1.45  | 500     | 431         | 60,279  | 2037/ 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 | BELGIUM KINGDOM        | 1.9   | 120   | 109   | 15,278     | 2038/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM        | 4.25  | 300   | 366   | 51,186     | 2041/3/28  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM        | 3.75  | 650   | 762   | 106,558    | 2045/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM        | 1.6   | 500   | 400   | 55,993     | 2047/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM        | 1.7   | 400   | 320   | 44,804     | 2050/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM        | 1.4   | 300   | 215   | 30,109     | 2053/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM        | 2.15  | 370   | 319   | 44,627     | 2066/6/22  |
|        |      | BELGIUM KINGDOM GOVT   | 5.0   | 670   | 852   | 119,112    | 2035/3/28  |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1.75  | 120   | 121   | 16,922     | 2023/10/20 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | —     | 200   | 195   | 27,356     | 2024/7/15  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1.65  | 500   | 504   | 70,491     | 2024/10/21 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1.2   | 1,100 | 1,096 | 153,149    | 2025/10/20 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.75  | 300   | 291   | 40,680     | 2026/10/20 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.5   | 400   | 380   | 53,194     | 2027/4/20  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.75  | 700   | 662   | 92,600     | 2028/2/20  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.5   | 1,000 | 915   | 127,920    | 2029/2/20  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | —     | 500   | 420   | 58,788     | 2031/2/20  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 2.4   | 530   | 534   | 74,691     | 2034/5/23  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.25  | 100   | 74    | 10,405     | 2036/10/20 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 4.15  | 230   | 279   | 39,039     | 2037/3/15  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | —     | 300   | 190   | 26,679     | 2040/10/20 |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 3.15  | 200   | 225   | 31,510     | 2044/6/20  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1.5   | 200   | 165   | 23,179     | 2047/2/20  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.75  | 200   | 131   | 18,303     | 2051/3/20  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 3.8   | 330   | 432   | 60,443     | 2062/1/26  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 0.7   | 300   | 150   | 21,044     | 2071/4/20  |
|        |      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1.5   | 210   | 141   | 19,784     | 2086/11/2  |
| フィンランド | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT     | 2.0   | 200   | 203   | 28,408     | 2024/4/15  |
|        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 0.5   | 810   | 783   | 109,486    | 2026/4/15  |
|        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 2.75  | 740   | 782   | 109,383    | 2028/7/4   |
|        |      | FINNISH GOVERNMENT     | —     | 300   | 257   | 35,955     | 2030/9/15  |
|        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 1.125 | 500   | 443   | 61,952     | 2034/4/15  |
|        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 0.125 | 400   | 299   | 41,789     | 2036/4/15  |
|        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 2.625 | 160   | 164   | 22,971     | 2042/7/4   |
|        |      | FINNISH GOVERNMENT     | 1.375 | 200   | 165   | 23,074     | 2047/4/15  |
| アイルランド | 国債証券 | IRISH GOVERNMENT       | 0.9   | 200   | 190   | 26,662     | 2028/5/15  |
|        |      | IRISH GOVERNMENT       | 0.35  | 400   | 333   | 46,598     | 2032/10/18 |
|        |      | IRISH TSY 0.2%         | 0.2   | 200   | 187   | 26,141     | 2027/5/15  |
|        |      | IRISH TSY 0.2% 2030    | 0.2   | 1,100 | 956   | 133,606    | 2030/10/18 |
|        |      | IRISH TSY 1% 2026      | 1.0   | 650   | 639   | 89,332     | 2026/5/15  |
|        |      | IRISH TSY 1.5% 2050    | 1.5   | 200   | 155   | 21,725     | 2050/5/15  |
|        |      | IRISH TSY 1.7% 2037    | 1.7   | 550   | 500   | 69,934     | 2037/5/15  |
|        |      | IRISH TSY 2% 2045      | 2.0   | 450   | 405   | 56,629     | 2045/2/18  |
|        |      | IRISH TSY 3.4% 2024    | 3.4   | 500   | 517   | 72,330     | 2024/3/18  |
| 小 計    |      |                        |       |       |       | 26,740,112 |            |
| ポーランド  |      |                        |       | 千ズロチ  | 千ズロチ  |            |            |
|        | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.25  | 6,200 | 5,676 | 168,316    | 2024/10/25 |

| 銘<br>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      |             |
| ポーランド   |      |                        | %      | 千ズロチ      | 千ズロチ      | 千円          |             |
|         | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 2. 75  | 3, 800    | 3, 170    | 93, 997     | 2028/ 4 /25 |
|         |      | POLAND GOVERNMENT BOND | 2. 75  | 3, 900    | 3, 158    | 93, 656     | 2029/10/25  |
| 小 計     |      |                        |        |           |           | 355, 971    |             |
| 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 | SINGAPORE GOVERNMENT   | 3. 0   | 400       | 401       | 40, 215     | 2024/ 9 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2. 375 | 400       | 395       | 39, 611     | 2025/ 6 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2. 125 | 700       | 681       | 68, 289     | 2026/ 6 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 3. 5   | 730       | 746       | 74, 776     | 2027/ 3 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2. 625 | 300       | 294       | 29, 507     | 2028/ 5 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2. 875 | 400       | 397       | 39, 763     | 2029/ 7 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2. 875 | 310       | 306       | 30, 739     | 2030/ 9 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1. 625 | 900       | 800       | 80, 165     | 2031/ 7 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2. 25  | 900       | 819       | 82, 069     | 2036/ 8 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2. 375 | 700       | 635       | 63, 675     | 2039/ 7 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2. 75  | 500       | 472       | 47, 275     | 2046/ 3 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1. 875 | 400       | 312       | 31, 310     | 2050/ 3 / 1 |
|         |      | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1. 875 | 400       | 311       | 31, 164     | 2051/10/ 1  |
| 小 計     |      |                        |        |           |           | 658, 562    |             |
| 中国      |      |                        |        | 千人民元      | 千人民元      |             |             |
|         | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND  | 2. 47  | 20, 000   | 20, 171   | 408, 085    | 2024/ 9 / 2 |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 2. 26  | 18, 000   | 18, 059   | 365, 361    | 2025/ 2 /24 |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 2. 24  | 9, 000    | 9, 024    | 182, 576    | 2025/ 5 /25 |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 2. 69  | 6, 000    | 6, 081    | 123, 038    | 2026/ 8 /12 |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 2. 37  | 13, 000   | 12, 994   | 262, 885    | 2027/ 1 /20 |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 2. 91  | 9, 000    | 9, 174    | 185, 602    | 2028/10/14  |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 2. 75  | 14, 000   | 14, 131   | 285, 896    | 2029/ 6 /15 |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 3. 02  | 4, 000    | 4, 104    | 83, 039     | 2031/ 5 /27 |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 2. 89  | 4, 000    | 4, 063    | 82, 204     | 2031/11/18  |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 2. 75  | 4, 000    | 4, 022    | 81, 382     | 2032/ 2 /17 |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 3. 72  | 3, 000    | 3, 339    | 67, 555     | 2051/ 4 /12 |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 3. 53  | 2, 000    | 2, 162    | 43, 752     | 2051/10/18  |
|         |      | CHINA GOVERNMENT BOND  | 3. 32  | 7, 000    | 7, 320    | 148, 101    | 2052/ 4 /15 |
| 小 計     |      |                        |        |           |           | 2, 319, 482 |             |
| オーストラリア |      |                        |        | 千豪ドル      | 千豪ドル      |             |             |
|         | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2. 75  | 400       | 397       | 38, 122     | 2024/ 4 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 0. 25  | 300       | 281       | 26, 976     | 2024/11/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3. 25  | 1, 340    | 1, 340    | 128, 384    | 2025/ 4 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 4. 25  | 520       | 536       | 51, 377     | 2026/ 4 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 4. 75  | 820       | 868       | 83, 183     | 2027/ 4 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2. 75  | 300       | 290       | 27, 844     | 2027/11/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2. 25  | 820       | 768       | 73, 662     | 2028/ 5 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2. 75  | 900       | 864       | 82, 814     | 2028/11/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3. 25  | 500       | 492       | 47, 211     | 2029/ 4 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2. 75  | 800       | 758       | 72, 693     | 2029/11/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2. 5   | 800       | 743       | 71, 180     | 2030/ 5 /21 |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1. 0   | 200       | 162       | 15, 608     | 2030/12/21  |
|         |      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1. 5   | 500       | 420       | 40, 298     | 2031/ 6 /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 |                          |      | %       | 千豪ドル    | 千豪ドル       | 千円         |       |
| 国債証券    | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 1.0  | 150     | 119     | 11,402     | 2031/11/21 |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 1.25 | 500     | 402     | 38,582     | 2032/5/21  |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 1.75 | 800     | 670     | 64,257     | 2032/11/21 |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 4.5  | 1,170   | 1,255   | 120,258    | 2033/4/21  |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 3.0  | 500     | 468     | 44,855     | 2033/11/21 |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 2.75 | 800     | 715     | 68,568     | 2035/6/21  |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 3.75 | 150     | 148     | 14,182     | 2037/4/21  |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 3.25 | 320     | 291     | 27,936     | 2039/6/21  |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 2.75 | 700     | 587     | 56,275     | 2041/5/21  |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 3.0  | 270     | 227     | 21,813     | 2047/3/21  |       |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 1.75 | 500     | 310     | 29,766     | 2051/6/21  |       |
| 小 計     |                          |      |         |         | 1,257,257  |            |       |
| イスラエル   |                          |      | 千新シェケル  | 千新シェケル  |            |            |       |
| 国債証券    | ISRAEL FIXED BOND        | 1.5  | 1,500   | 1,481   | 61,104     | 2023/11/30 |       |
|         | ISRAEL FIXED BOND        | 3.75 | 1,500   | 1,525   | 62,902     | 2024/3/31  |       |
|         | ISRAEL FIXED BOND        | 0.5  | 400     | 377     | 15,549     | 2025/4/30  |       |
|         | ISRAEL FIXED BOND        | 2.0  | 2,000   | 1,922   | 79,270     | 2027/3/31  |       |
|         | ISRAEL FIXED BOND        | 1.0  | 1,000   | 869     | 35,840     | 2030/3/31  |       |
|         | ISRAEL FIXED BOND        | 5.5  | 1,100   | 1,445   | 59,580     | 2042/1/31  |       |
|         | ISRAEL FIXED BOND        | 3.75 | 800     | 838     | 34,590     | 2047/3/31  |       |
| 小 計     |                          |      |         |         | 348,838    |            |       |
| メキシコ    |                          |      | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ |            |            |       |
| 国債証券    | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8.0  | 13,100  | 12,699  | 89,363     | 2024/9/5   |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10.0 | 11,000  | 11,086  | 78,014     | 2024/12/5  |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 5.0  | 3,200   | 2,882   | 20,284     | 2025/3/6   |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 5.75 | 14,000  | 12,532  | 88,187     | 2026/3/5   |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 5.5  | 15,000  | 13,033  | 91,716     | 2027/3/4   |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.5  | 4,700   | 4,426   | 31,150     | 2027/6/3   |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.75 | 16,700  | 15,469  | 108,852    | 2031/5/29  |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.75 | 3,100   | 2,820   | 19,849     | 2034/11/23 |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10.0 | 6,000   | 6,530   | 45,956     | 2036/11/20 |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8.5  | 10,200  | 9,780   | 68,824     | 2038/11/18 |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.75 | 5,000   | 4,429   | 31,171     | 2042/11/13 |       |
|         | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8.0  | 4,300   | 3,914   | 27,542     | 2047/11/7  |       |
|         | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0  | 9,300   | 9,077   | 63,879     | 2023/12/7  |       |
| 小 計     |                          |      |         |         | 764,791    |            |       |
| 合 計     |                          |      |         |         | 80,313,097 |            |       |

\* 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。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年9月6日現在)

| 項 目          | 当 期 末      |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 公社債          | 80,313,097 | 96.0  |
| コール・ローン等、その他 | 3,302,958  | 4.0   |
| 投資信託財産総額     | 83,616,055 | 100.0 |

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 当期末における外貨建純資産（82,377,094千円）の投資信託財産総額（83,616,055千円）に対する比率は98.5%です。

\* 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＝140.27円、1カナダドル＝107.09円、1英ポンド＝162.54円、1スウェーデンクローナ＝13.03円、1ノルウェークローネ＝14.15円、1デンマーククローネ＝18.79円、1ユーロ＝139.72円、1ズロチ＝29.6513円、1シンガポールドル＝100.16円、1人民元＝20.2305円、1豪ドル＝95.79円、1新シェケル＝41.2315円、1メキシコペソ＝7.0368円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年9月6日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 165,759,520,120 |
| コール・ローン等        | 1,171,587,374   |
| 公社債(評価額)        | 80,313,097,403  |
| 未収入金            | 83,804,726,447  |
| 未収利息            | 422,400,674     |
| 前払費用            | 47,448,816      |
| 差入委託証拠金         | 259,406         |
| (B) 負債          | 85,193,479,056  |
| 未払金             | 85,178,402,522  |
| 未払解約金           | 14,255,625      |
| 未払利息            | 1,009           |
| その他未払費用         | 819,900         |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 80,566,041,064  |
| 元本              | 75,825,824,813  |
| 次期繰越損益金         | 4,740,216,251   |
| (D) 受益権総口数      | 75,825,824,813口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 10,625円         |

(注) 期首元本額は69,507,998,280円、期中追加設定元本額は29,919,073,643円、期中一部解約元本額は23,601,247,110円、1口当たり純資産額は1.0625円です。

## ○損益の状況 (2021年9月7日～2022年9月6日)

| 項 目                | 当 期             |
|--------------------|-----------------|
|                    | 円               |
| (A) 配当等収益          | 1,860,926,034   |
| 受取利息               | 1,861,197,920   |
| その他収益金             | 995             |
| 支払利息               | △ 272,881       |
| (B) 有価証券売買損益       | △14,409,354,485 |
| 売買益                | 19,825,324,282  |
| 売買損                | △34,234,678,767 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 615,708       |
| 取引益                | 160,957         |
| 取引損                | △ 776,665       |
| (D) 保管費用等          | △ 7,700,551     |
| (E) 当期損益金(A＋B＋C＋D) | △12,556,744,710 |
| (F) 前期繰越損益金        | 16,210,603,242  |
| (G) 追加信託差損益金       | 4,459,054,029   |
| (H) 解約差損益金         | △ 3,372,696,310 |
| (I) 計(E＋F＋G＋H)     | 4,740,216,251   |
| 次期繰越損益金(I)         | 4,740,216,251   |

\* 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。

\* 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。

\* 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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                                 | 当期末<br>元本額     |
|---------------------------------------|----------------|
|                                       | 円              |
| 野村外国債券インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)         | 45,565,102,638 |
| 野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)         | 10,432,731,724 |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)  | 9,123,988,347  |
| オールウェザー・ファクターアロケーションオープン投信(適格機関投資家専用) | 6,047,758,615  |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型         | 1,950,369,029  |
| 野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型              | 889,032,550    |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)         | 727,714,628    |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型              | 599,858,365    |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)               | 168,747,669    |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)    | 164,404,240    |

| ファンド名                            | 当期末<br>元本額 |
|----------------------------------|------------|
|                                  | 円          |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用) | 87,617,457 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 39,905,389 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 12,091,048 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 5,867,127  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 3,945,914  |
| インデックス・ブレンド(タイプⅢ)                | 2,677,783  |
| インデックス・ブレンド(タイプⅤ)                | 2,173,236  |
| インデックス・ブレンド(タイプⅠ)                | 729,960    |
| インデックス・ブレンド(タイプⅣ)                | 657,286    |
| インデックス・ブレンド(タイプⅡ)                | 451,808    |

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド

## 運用報告書

第12期（決算日2022年2月18日）

作成対象期間（2021年2月19日～2022年2月18日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|         |                                                                                                                                                                                                  |
|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運 用 方 針 | 現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。 |
| 主な投資対象  | 現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。                                                                                                                                                                       |
| 主な投資制限  | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。                                                                                                                                                |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近５期の運用実績

| 決 算 期           | 基 準 価 額 |      | ベンチマーク<br>JPモルガン・ガバメント・ボンド・<br>インデックス・エマージング・<br>マーケット・グローバル・ディバーシファイド<br>(円換算ベース) |      | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|---------|------|------------------------------------------------------------------------------------|------|-----------|-----------|---------|
|                 | 騰 落 率   | 中 率  | 騰 落 率                                                                              | 中 率  |           |           |         |
|                 | 円       | %    |                                                                                    | %    | %         | %         | 百万円     |
| 8期(2018年2月19日)  | 13,772  | 8.9  | 144.15                                                                             | 9.6  | 97.8      | —         | 7,008   |
| 9期(2019年2月18日)  | 13,261  | △3.7 | 139.01                                                                             | △3.6 | 97.4      | —         | 7,946   |
| 10期(2020年2月18日) | 14,226  | 7.3  | 150.17                                                                             | 8.0  | 97.7      | —         | 8,023   |
| 11期(2021年2月18日) | 14,036  | △1.3 | 147.86                                                                             | △1.5 | 97.7      | —         | 9,139   |
| 12期(2022年2月18日) | 14,265  | 1.6  | 151.46                                                                             | 2.4  | 97.3      | —         | 8,981   |

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*ベンチマーク（＝JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース））は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、当社が円換算したものです。なお指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。（設定時を100として指数化しています。）

\*JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified）は、J. P. Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数です（ただし、国別の組入比率には上限が設定されています）。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日      | 基 準 価 額 |      | ベンチマーク<br>JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・<br>エマージング・マーケット・グローバル・<br>ディバーシファイド(円換算ベース) |      | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|------------|---------|------|--------------------------------------------------------------------------------|------|-----------|-----------|
|            | 騰 落 率   | 中 率  | 騰 落 率                                                                          | 中 率  |           |           |
| (期 首)      | 円       | %    |                                                                                | %    | %         | %         |
| 2021年2月18日 | 14,036  | —    | 147.86                                                                         | —    | 97.7      | —         |
| 2月末        | 13,787  | △1.8 | 146.27                                                                         | △1.1 | 98.2      | —         |
| 3月末        | 13,738  | △2.1 | 145.26                                                                         | △1.8 | 97.8      | —         |
| 4月末        | 14,004  | △0.2 | 148.09                                                                         | 0.2  | 97.5      | —         |
| 5月末        | 14,328  | 2.1  | 151.79                                                                         | 2.7  | 97.6      | —         |
| 6月末        | 14,326  | 2.1  | 151.59                                                                         | 2.5  | 97.5      | —         |
| 7月末        | 14,113  | 0.5  | 149.60                                                                         | 1.2  | 97.4      | —         |
| 8月末        | 14,175  | 1.0  | 150.11                                                                         | 1.5  | 97.4      | —         |
| 9月末        | 14,003  | △0.2 | 148.42                                                                         | 0.4  | 96.4      | —         |
| 10月末       | 14,089  | 0.4  | 149.44                                                                         | 1.1  | 97.9      | —         |
| 11月末       | 13,598  | △3.1 | 144.06                                                                         | △2.6 | 94.4      | —         |
| 12月末       | 13,976  | △0.4 | 148.33                                                                         | 0.3  | 97.7      | —         |
| 2022年1月末   | 13,962  | △0.5 | 148.00                                                                         | 0.1  | 97.5      | —         |
| (期 末)      |         |      |                                                                                |      |           |           |
| 2022年2月18日 | 14,265  | 1.6  | 151.46                                                                         | 2.4  | 97.3      | —         |

\* 騰落率は期首比です。

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新興国債券利回りが上昇（価格は下落）したことはマイナスに影響しましたが、新興国通貨が概ね対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債などに分散投資しました。毎月の指数構成銘柄の変更に対応し、ポートフォリオの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行なっておりません。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

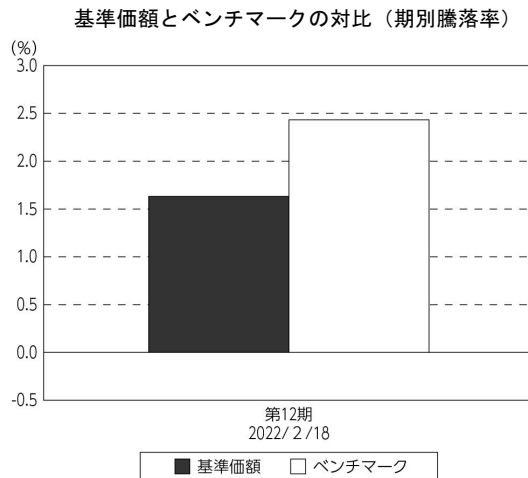
今期の基準価額の騰落率は+1.6%となり、ベンチマークの+2.4%を0.8ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用や利金に対する課税などのコスト）が生じること。

（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ること。



（注）ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）です。

## ◎今後の運用方針

当ファンドでは引き続き、新興国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行なってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

\*本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行なうものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できるとされるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行ない、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

ジェー・ビー・モルガン・セキュリティーズ・エル・エル・シー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できるとされる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。

JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ビー・モルガン・チェース・バンク・エス・エー、JPMSL、ジェー・ビー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、[index\\_research@jpmorgan.com](mailto:index_research@jpmorgan.com)宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、[www.morganmarkets.com](http://www.morganmarkets.com)もご覧ください。

当情報の著作権は、ジェー・ビー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021 年 2 月 19 日～2022 年 2 月 18 日)

| 項 目                   | 当 期   |         | 項 目 の 概 要                                         |
|-----------------------|-------|---------|---------------------------------------------------|
|                       | 金 額   | 比 率     |                                                   |
|                       | 円     | %       |                                                   |
| (a) そ の 他 費 用         | 14    | 0.101   | (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 ）           | (11)  | (0.079) | 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 ）             | ( 3 ) | (0.022) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用                                |
| 合 計                   | 14    | 0.101   |                                                   |
| 期中の平均基準価額は、14,008円です。 |       |         |                                                   |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。  
\*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。

公社債

\* 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年2月19日～2022年2月18日)

利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A    | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C    | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|--------------|---------------------|---------------|--------------|---------------------|---------------|
|        |              |                     |               |              |                     |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>8,579 | 百万円<br>1,360        | %<br>15.9     | 百万円<br>8,849 | 百万円<br>1,360        | %<br>15.4     |

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野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2022年2月18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<br>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     |
| トルコ     | 千トルコリラ<br>13,910       | 千トルコリラ<br>10,684       | 千円<br>90,740 | %<br>1.0 | %<br>1.0           | %<br>0.4  | %<br>0.4 | %<br>0.3 |
| チェコ     | 千チェココルナ<br>84,800      | 千チェココルナ<br>76,782      | 411,108      | 4.6      | —                  | 2.3       | 1.5      | 0.8      |
| ハンガリー   | 千フォリント<br>912,000      | 千フォリント<br>847,208      | 310,361      | 3.5      | —                  | 1.5       | 1.6      | 0.4      |
| ポーランド   | 千ズロチ<br>22,700         | 千ズロチ<br>21,475         | 619,781      | 6.9      | —                  | 3.3       | 2.5      | 1.1      |
| ロシア     | 千ルーブル<br>427,400       | 千ルーブル<br>387,024       | 588,277      | 6.5      | —                  | 3.0       | 2.8      | 0.7      |
| ドミニカ共和国 | 千ドミニカペソ<br>8,000       | 千ドミニカペソ<br>8,448       | 17,124       | 0.2      | 0.2                | —         | 0.2      | —        |
| ルーマニア   | 千レイ<br>10,530          | 千レイ<br>10,188          | 269,188      | 3.0      | —                  | 0.8       | 1.8      | 0.4      |
| マレーシア   | 千リンギ<br>26,900         | 千リンギ<br>27,089         | 743,982      | 8.3      | —                  | 4.3       | 3.3      | 0.7      |
| タイ      | 千バーツ<br>221,000        | 千バーツ<br>228,877        | 817,091      | 9.1      | —                  | 5.1       | 2.8      | 1.2      |
| インドネシア  | 千ルピア<br>100,080,000    | 千ルピア<br>106,919,594    | 866,048      | 9.6      | —                  | 6.9       | 2.3      | 0.4      |
| 中国      | 千人民元<br>47,200         | 千人民元<br>47,805         | 866,844      | 9.7      | —                  | 3.8       | 5.8      | —        |
| メキシコ    | 千メキシコペソ<br>143,550     | 千メキシコペソ<br>143,910     | 814,691      | 9.1      | —                  | 5.2       | 2.7      | 1.1      |
| ブラジル    | 千レアル<br>20,861         | 千レアル<br>33,665         | 748,015      | 8.3      | 8.3                | 1.0       | 3.0      | 4.4      |
| チリ      | 千チリペソ<br>1,310,000     | 千チリペソ<br>1,255,753     | 181,363      | 2.0      | —                  | 1.2       | 0.7      | 0.2      |
| コロンビア   | 千コロンビアペソ<br>12,440,000 | 千コロンビアペソ<br>11,401,951 | 332,708      | 3.7      | 0.6                | 2.8       | 0.9      | —        |
| ペルー     | 千ソル<br>6,520           | 千ソル<br>6,566           | 202,424      | 2.3      | —                  | 1.9       | 0.3      | —        |
| ウルグアイ   | 千ウルグアイペソ<br>4,000      | 千ウルグアイペソ<br>4,082      | 10,903       | 0.1      | —                  | 0.1       | —        | —        |
| セルビア    | 千セルビアディナール<br>22,000   | 千セルビアディナール<br>23,567   | 26,162       | 0.3      | 0.3                | 0.3       | —        | —        |
| エジプト    | 千エジプトポンド<br>9,200      | 千エジプトポンド<br>9,437      | 68,869       | 0.8      | 0.8                | 0.3       | 0.5      | —        |
| 南アフリカ   | 千ランド<br>108,010        | 千ランド<br>98,739         | 756,343      | 8.4      | 8.4                | 6.7       | 1.4      | 0.3      |
| 合 計     | —                      | —                      | 8,742,032    | 97.3     | 19.6               | 51.0      | 34.4     | 12.0     |

\* 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。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 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。

\* S&amp;Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

## (B) 外国（外貨建）公社債 銘柄別開示

| 銘<br>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  |            |
| トルコ    |      |                         | %     | 千トルコリラ  | 千トルコリラ  | 千円      |            |
|        | 国債証券 | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 8.5   | 790     | 759     | 6,454   | 2022/9/14  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 12.2  | 200     | 191     | 1,622   | 2023/1/18  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 7.1   | 770     | 689     | 5,859   | 2023/3/8   |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 16.2  | 1,200   | 1,160   | 9,855   | 2023/6/14  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 10.4  | 520     | 437     | 3,718   | 2024/3/20  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 9.0   | 1,110   | 873     | 7,419   | 2024/7/24  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 8.0   | 1,020   | 731     | 6,211   | 2025/3/12  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 12.6  | 1,800   | 1,417   | 12,038  | 2025/10/1  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 10.6  | 400     | 289     | 2,462   | 2026/2/11  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 11.0  | 2,100   | 1,430   | 12,145  | 2027/2/24  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 10.5  | 700     | 463     | 3,935   | 2027/8/11  |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 12.4  | 1,800   | 1,284   | 10,911  | 2028/3/8   |
|        |      | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 11.7  | 1,500   | 954     | 8,108   | 2030/11/13 |
| 小 計    |      |                         |       |         |         | 90,740  |            |
| チェコ    |      |                         |       | 千チェココルナ | 千チェココルナ |         |            |
|        | 国債証券 | CZECH REPUBLIC          | 0.45  | 14,000  | 13,242  | 70,903  | 2023/10/25 |
|        |      | CZECH REPUBLIC          | 1.0   | 16,600  | 15,131  | 81,018  | 2026/6/26  |
|        |      | CZECH REPUBLIC          | 0.25  | 11,500  | 10,021  | 53,655  | 2027/2/10  |
|        |      | CZECH REPUBLIC          | 0.95  | 13,200  | 11,255  | 60,261  | 2030/5/15  |
|        |      | CZECH REPUBLIC          | 1.2   | 17,800  | 15,333  | 82,099  | 2031/3/13  |
|        |      | CZECH REPUBLIC          | 2.0   | 6,500   | 5,879   | 31,480  | 2033/10/13 |
|        |      | CZECH REPUBLIC          | 4.2   | 5,200   | 5,918   | 31,689  | 2036/12/4  |
| 小 計    |      |                         |       |         |         | 411,108 |            |
| ハンガリー  |      |                         |       | 千フォリント  | 千フォリント  |         |            |
|        | 国債証券 | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 1.5   | 62,000  | 59,454  | 21,780  | 2023/8/23  |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 6.0   | 27,000  | 27,742  | 10,163  | 2023/11/24 |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.0   | 68,000  | 65,715  | 24,073  | 2024/6/26  |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 2.5   | 75,000  | 71,196  | 26,081  | 2024/10/24 |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 5.5   | 63,000  | 64,633  | 23,677  | 2025/6/24  |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 1.0   | 38,000  | 33,308  | 12,202  | 2025/11/26 |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 1.5   | 82,000  | 72,082  | 26,406  | 2026/4/22  |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 2.75  | 86,000  | 78,672  | 28,820  | 2026/12/22 |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.0   | 82,000  | 74,812  | 27,406  | 2027/10/27 |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 6.75  | 57,000  | 63,369  | 23,214  | 2028/10/22 |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.0   | 102,000 | 89,999  | 32,969  | 2030/8/21  |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.25  | 130,000 | 114,924 | 42,100  | 2031/10/22 |
|        |      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.0   | 40,000  | 31,296  | 11,464  | 2038/10/27 |
| 小 計    |      |                         |       |         |         | 310,361 |            |
| ポーランド  |      |                         |       | 千ズロチ    | 千ズロチ    |         |            |
|        | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND  | 4.0   | 3,500   | 3,524   | 101,713 | 2023/10/25 |
|        |      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 2.5   | 700     | 684     | 19,763  | 2024/4/25  |
|        |      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 2.25  | 600     | 580     | 16,747  | 2024/10/25 |
|        |      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 0.75  | 4,800   | 4,390   | 126,723 | 2025/4/25  |
|        |      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 2.5   | 2,100   | 1,984   | 57,285  | 2026/7/25  |
|        |      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 2.5   | 2,400   | 2,231   | 64,388  | 2027/7/25  |

| 銘<br>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    |            |
| ポーランド   |                        |                        | %      | 千ズロチ    | 千ズロチ    | 千円        |            |
|         | 国債証券                   | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75   | 8,600   | 8,078   | 233,159   | 2028/4/25  |
| 小 計     |                        |                        |        |         |         | 619,781   |            |
| ロシア     |                        |                        |        | 千ルーブル   | 千ルーブル   |           |            |
|         | 国債証券                   | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.4    | 12,000  | 11,774  | 17,897    | 2022/12/7  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.0    | 21,000  | 20,409  | 31,022    | 2023/1/25  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.0    | 12,000  | 11,515  | 17,503    | 2023/8/16  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 6.5    | 21,000  | 19,706  | 29,954    | 2024/2/28  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.4    | 28,300  | 26,784  | 40,712    | 2024/7/17  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.15   | 32,500  | 29,754  | 45,226    | 2025/11/12 |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.75   | 27,000  | 25,040  | 38,060    | 2026/9/16  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.95   | 38,700  | 36,025  | 54,758    | 2026/10/7  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 8.15   | 29,000  | 27,108  | 41,205    | 2027/2/3   |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 6.0    | 12,000  | 10,078  | 15,320    | 2027/10/6  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.05   | 18,700  | 16,408  | 24,940    | 2028/1/19  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 5.7    | 16,000  | 13,036  | 19,815    | 2028/5/17  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 6.9    | 24,000  | 20,666  | 31,412    | 2029/5/23  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.65   | 20,200  | 17,939  | 27,267    | 2030/4/10  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 8.5    | 26,500  | 24,858  | 37,785    | 2031/9/17  |
|         |                        | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.7    | 27,500  | 24,099  | 36,631    | 2033/3/23  |
|         | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.25                   | 10,000 | 8,340   | 12,676  | 2034/5/10 |            |
|         | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.7                    | 51,000 | 43,477  | 66,085  | 2039/3/16 |            |
| 小 計     |                        |                        |        |         |         | 588,277   |            |
| ドミニカ共和国 |                        |                        |        | 千ドミニカペソ | 千ドミニカペソ |           |            |
|         | 国債証券                   | DOMINICAN REPUBLIC     | 9.75   | 8,000   | 8,448   | 17,124    | 2026/6/5   |
| 小 計     |                        |                        |        |         |         | 17,124    |            |
| ルーマニア   |                        |                        |        | 千レイ     | 千レイ     |           |            |
|         | 国債証券                   | ROMANIA                | 5.85   | 550     | 559     | 14,778    | 2023/4/26  |
|         |                        | ROMANIA                | 4.4    | 400     | 400     | 10,578    | 2023/9/25  |
|         |                        | ROMANIA                | 4.0    | 500     | 497     | 13,140    | 2023/10/25 |
|         |                        | ROMANIA                | 3.25   | 1,000   | 971     | 25,676    | 2024/4/29  |
|         |                        | ROMANIA                | 4.5    | 1,300   | 1,295   | 34,228    | 2024/6/17  |
|         |                        | ROMANIA                | 3.7    | 800     | 779     | 20,601    | 2024/11/25 |
|         |                        | ROMANIA                | 4.75   | 920     | 917     | 24,246    | 2025/2/24  |
|         |                        | ROMANIA                | 3.65   | 500     | 478     | 12,633    | 2025/7/28  |
|         |                        | ROMANIA                | 4.85   | 500     | 496     | 13,116    | 2026/4/22  |
|         |                        | ROMANIA                | 3.25   | 1,100   | 1,026   | 27,126    | 2026/6/24  |
|         |                        | ROMANIA                | 5.8    | 760     | 780     | 20,620    | 2027/7/26  |
|         |                        | ROMANIA                | 5.0    | 800     | 785     | 20,750    | 2029/2/12  |
|         |                        | ROMANIA                | 3.65   | 1,400   | 1,199   | 31,690    | 2031/9/24  |
| 小 計     |                        |                        |        |         |         | 269,188   |            |
| マレーシア   |                        |                        |        | 千リンギ    | 千リンギ    |           |            |
|         | 国債証券                   | MALAYSIA GOVERNMENT    | 4.059  | 800     | 823     | 22,627    | 2024/9/30  |
|         |                        | MALAYSIA GOVERNMENT    | 3.899  | 2,000   | 2,048   | 56,256    | 2027/11/16 |
|         |                        | MALAYSIA GOVERNMENT    | 3.828  | 800     | 782     | 21,478    | 2034/7/5   |
|         |                        | MALAYSIA GOVERNMENT    | 4.762  | 1,400   | 1,510   | 41,478    | 2037/4/7   |
|         |                        | MALAYSIAN GOVERNMENT   | 3.48   | 400     | 406     | 11,162    | 2023/3/15  |
|         |                        | MALAYSIAN GOVERNMENT   | 3.757  | 1,000   | 1,019   | 27,991    | 2023/4/20  |

| 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 |
| マレーシア |      |                          | %     | 千リンギ      | 千リンギ      | 千円      |             |         |        |
|       | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 3.8   | 700       | 715       | 19,653  | 2023/ 8 /17 |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 3.478 | 1,200     | 1,219     | 33,491  | 2024/ 6 /14 |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 4.181 | 2,600     | 2,682     | 73,659  | 2024/ 7 /15 |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 3.955 | 2,200     | 2,268     | 62,293  | 2025/ 9 /15 |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 3.906 | 1,400     | 1,437     | 39,474  | 2026/ 7 /15 |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 3.9   | 2,400     | 2,462     | 67,632  | 2026/11/30  |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 3.733 | 2,500     | 2,520     | 69,227  | 2028/ 6 /15 |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 3.885 | 2,700     | 2,737     | 75,187  | 2029/ 8 /15 |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 2.632 | 2,300     | 2,107     | 57,879  | 2031/ 4 /15 |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 3.757 | 800       | 751       | 20,644  | 2040/ 5 /22 |         |        |
|       |      | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 4.065 | 1,700     | 1,596     | 43,844  | 2050/ 6 /15 |         |        |
| 小 計   |      |                          |       |           |           | 743,982 |             |         |        |
| タイ    |      |                          |       | 千バーツ      | 千バーツ      |         |             |         |        |
|       | 国債証券 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.0   | 5,000     | 5,062     | 18,074  | 2022/12/17  |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.625 | 11,700    | 12,173    | 43,457  | 2023/ 6 /16 |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.4   | 12,200    | 12,586    | 44,935  | 2023/12/17  |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 0.75  | 15,000    | 14,970    | 53,445  | 2024/ 6 /17 |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 1.45  | 17,900    | 18,160    | 64,834  | 2024/12/17  |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 0.95  | 12,500    | 12,470    | 44,518  | 2025/ 6 /17 |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.85  | 9,300     | 10,231    | 36,527  | 2025/12/12  |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.125 | 13,300    | 13,789    | 49,228  | 2026/12/17  |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.875 | 12,900    | 13,820    | 49,338  | 2028/12/17  |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 4.875 | 10,200    | 12,275    | 43,823  | 2029/ 6 /22 |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 1.6   | 15,500    | 15,051    | 53,734  | 2029/12/17  |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.65  | 12,800    | 14,443    | 51,563  | 2031/ 6 /20 |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.0   | 6,000     | 5,917     | 21,127  | 2031/12/17  |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.775 | 15,000    | 17,049    | 60,866  | 2032/ 6 /25 |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 1.6   | 3,600     | 3,227     | 11,522  | 2035/ 6 /17 |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 1.585 | 14,000    | 12,404    | 44,282  | 2035/12/17  |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.4   | 12,500    | 13,617    | 48,614  | 2036/ 6 /17 |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.3   | 5,900     | 6,336     | 22,619  | 2038/ 6 /17 |         |        |
|       |      | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.875 | 15,700    | 15,287    | 54,575  | 2046/ 6 /17 |         |        |
|       |      | 小 計                      |       |           |           |         |             | 817,091 |        |
|       |      | インドネシア                   |       |           |           | 千ルピア    | 千ルピア        |         |        |
|       | 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT     | 5.625 | 4,700,000 | 4,829,720 | 39,120  | 2023/ 5 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 8.375 | 4,730,000 | 5,113,130 | 41,416  | 2024/ 3 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 8.125 | 3,800,000 | 4,109,700 | 33,288  | 2024/ 5 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 6.5   | 6,900,000 | 7,234,650 | 58,600  | 2025/ 6 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 11.0  | 1,580,000 | 1,889,395 | 15,304  | 2025/ 9 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 5.5   | 6,700,000 | 6,754,605 | 54,712  | 2026/ 4 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 5.125 | 2,800,000 | 2,776,578 | 22,490  | 2027/ 4 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 7.0   | 6,250,000 | 6,642,187 | 53,801  | 2027/ 5 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 6.125 | 5,000,000 | 5,022,500 | 40,682  | 2028/ 5 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 9.0   | 3,230,000 | 3,711,270 | 30,061  | 2029/ 3 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 8.25  | 4,700,000 | 5,190,210 | 42,040  | 2029/ 5 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 10.5  | 1,110,000 | 1,387,056 | 11,235  | 2030/ 8 /15 |         |        |
|       |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 7.0   | 6,100,000 | 6,282,512 | 50,888  | 2030/ 9 /15 |         |        |

| 銘<br>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  |            |
| インドネシア |      |                          | %     | 千ルピア      | 千ルピア      | 千円      |            |
|        | 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT     | 6.5   | 2,900,000 | 2,902,088 | 23,506  | 2031/2/15  |
|        |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 9.5   | 2,400,000 | 2,876,441 | 23,299  | 2031/7/15  |
|        |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 8.25  | 1,600,000 | 1,778,175 | 14,403  | 2032/6/15  |
|        |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 7.5   | 3,200,000 | 3,384,800 | 27,416  | 2032/8/15  |
|        |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 6.625 | 4,900,000 | 4,887,750 | 39,590  | 2033/5/15  |
|        |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 8.375 | 7,180,000 | 8,095,450 | 65,573  | 2034/3/15  |
|        |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 7.5   | 5,000,000 | 5,272,500 | 42,707  | 2035/6/15  |
|        |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 8.25  | 5,000,000 | 5,580,000 | 45,198  | 2036/5/15  |
|        |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 7.5   | 3,400,000 | 3,564,900 | 28,875  | 2038/5/15  |
|        |      | INDONESIA GOVERNMENT     | 8.375 | 4,600,000 | 5,212,076 | 42,217  | 2039/4/15  |
| 小 計    |      |                          |       |           |           | 866,048 |            |
| 中国     |      |                          |       | 千人民元      | 千人民元      |         |            |
|        | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND    | 2.47  | 13,500    | 13,565    | 245,982 | 2024/9/2   |
|        |      | CHINA GOVERNMENT BOND    | 2.69  | 15,200    | 15,333    | 278,032 | 2026/8/12  |
|        |      | CHINA GOVERNMENT BOND    | 2.91  | 9,000     | 9,093     | 164,881 | 2028/10/14 |
|        |      | CHINA GOVERNMENT BOND    | 3.02  | 6,000     | 6,093     | 110,490 | 2031/5/27  |
|        |      | CHINA GOVERNMENT BOND    | 3.72  | 3,500     | 3,720     | 67,458  | 2051/4/12  |
| 小 計    |      |                          |       |           |           | 866,844 |            |
| メキシコ   |      |                          |       | 千メキシコペソ   | 千メキシコペソ   |         |            |
|        | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 6.75  | 8,500     | 8,440     | 47,783  | 2023/3/9   |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8.0   | 14,700    | 14,784    | 83,695  | 2024/9/5   |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10.0  | 14,100    | 14,884    | 84,262  | 2024/12/5  |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 5.75  | 14,600    | 13,596    | 76,970  | 2026/3/5   |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 5.5   | 5,000     | 4,532     | 25,661  | 2027/3/4   |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.5   | 15,650    | 15,490    | 87,694  | 2027/6/3   |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8.5   | 10,800    | 11,262    | 63,759  | 2029/5/31  |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.75  | 13,300    | 13,265    | 75,096  | 2031/5/29  |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.75  | 7,900     | 7,835     | 44,359  | 2034/11/23 |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10.0  | 2,700     | 3,196     | 18,093  | 2036/11/20 |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8.5   | 11,600    | 12,160    | 68,839  | 2038/11/18 |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7.75  | 6,700     | 6,489     | 36,738  | 2042/11/13 |
|        |      | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 8.0   | 8,500     | 8,432     | 47,738  | 2047/11/7  |
|        |      | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0   | 9,500     | 9,538     | 53,998  | 2023/12/7  |
| 小 計    |      |                          |       |           |           | 814,691 |            |
| ブラジル   |      |                          |       | 千レアル      | 千レアル      |         |            |
|        | 国債証券 | LETRA TESOIRO NACIONAL   | —     | 7,100     | 6,060     | 134,663 | 2023/7/1   |
|        |      | LETRA TESOIRO NACIONAL   | —     | 8,400     | 6,802     | 151,150 | 2024/1/1   |
|        |      | LETRA TESOIRO NACIONAL   | —     | 3,500     | 2,696     | 59,906  | 2024/7/1   |
|        |      | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0  | 480       | 4,771     | 106,018 | 2023/1/1   |
|        |      | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0  | 481       | 4,724     | 104,985 | 2025/1/1   |
|        |      | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0  | 490       | 4,748     | 105,500 | 2027/1/1   |
|        |      | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0  | 250       | 2,365     | 52,568  | 2029/1/1   |
|        |      | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0  | 160       | 1,495     | 33,223  | 2031/1/1   |
| 小 計    |      |                          |       |           |           | 748,015 |            |
| チリ     |      |                          |       | 千チリペソ     | 千チリペソ     |         |            |
|        | 国債証券 | BONOS TESORERIA PESOS    | 4.0   | 100,000   | 98,575    | 14,236  | 2023/3/1   |

| 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  |            |
| チリ    |      |                          | %      | 千チリペソ      | 千チリペソ      | 千円      |            |
|       | 国債証券 | BONOS TESORERIA PESOS    | 2.5    | 270,000    | 246,361    | 35,581  | 2025/3/1   |
|       |      | BONOS TESORERIA PESOS    | 4.5    | 190,000    | 183,549    | 26,509  | 2026/3/1   |
|       |      | BONOS TESORERIA PESOS    | 4.7    | 295,000    | 280,235    | 40,473  | 2030/9/1   |
|       |      | BONOS TESORERIA PESOS    | 5.0    | 240,000    | 227,678    | 32,882  | 2035/3/1   |
|       |      | BONOS TESORERIA PESOS    | 6.0    | 215,000    | 219,353    | 31,680  | 2043/1/1   |
| 小 計   |      |                          |        |            |            | 181,363 |            |
| コロンビア |      |                          |        | 千コロンビアペソ   | 千コロンビアペソ   |         |            |
|       | 国債証券 | REPUBLIC OF COLOMBIA     | 9.85   | 1,790,000  | 1,914,226  | 55,857  | 2027/6/28  |
|       |      | TITULOS DE TESORERIA     | 10.0   | 950,000    | 987,696    | 28,820  | 2024/7/24  |
|       |      | TITULOS DE TESORERIA     | 6.25   | 1,900,000  | 1,758,779  | 51,321  | 2025/11/26 |
|       |      | TITULOS DE TESORERIA     | 5.75   | 900,000    | 780,729    | 22,781  | 2027/11/3  |
|       |      | TITULOS DE TESORERIA     | 6.0    | 900,000    | 781,535    | 22,805  | 2028/4/28  |
|       |      | TITULOS DE TESORERIA     | 7.75   | 850,000    | 793,539    | 23,155  | 2030/9/18  |
|       |      | TITULOS DE TESORERIA     | 7.0    | 800,000    | 705,416    | 20,584  | 2031/3/26  |
|       |      | TITULOS DE TESORERIA     | 7.0    | 1,600,000  | 1,385,965  | 40,442  | 2032/6/30  |
|       |      | TITULOS DE TESORERIA     | 7.25   | 1,850,000  | 1,598,343  | 46,639  | 2034/10/18 |
|       |      | TITULOS DE TESORERIA     | 6.25   | 900,000    | 695,722    | 20,301  | 2036/7/9   |
|       |      | 小 計                      |        |            |            |         |            |
| ペルー   |      |                          |        | 千ソル        | 千ソル        |         |            |
|       | 国債証券 | BONOS DE TESORERIA       | 5.7    | 200        | 206        | 6,361   | 2024/8/12  |
|       |      | BONOS DE TESORERIA       | 5.94   | 1,000      | 1,019      | 31,413  | 2029/2/12  |
|       |      | BONOS DE TESORERIA       | 6.15   | 600        | 601        | 18,529  | 2032/8/12  |
|       |      | BONOS DE TESORERIA       | 5.4    | 700        | 636        | 19,612  | 2034/8/12  |
|       |      | BONOS DE TESORERIA       | 5.35   | 700        | 593        | 18,303  | 2040/8/12  |
|       |      | PERU BONO SOBERANO       | 8.2    | 700        | 793        | 24,453  | 2026/8/12  |
|       |      | PERU BONO SOBERANO       | 6.95   | 500        | 534        | 16,475  | 2031/8/12  |
|       |      | PERU BONO SOBERANO       | 6.9    | 1,020      | 1,033      | 31,843  | 2037/8/12  |
|       |      | REPUBLIC OF PERU         | 6.35   | 1,100      | 1,149      | 35,430  | 2028/8/12  |
| 小 計   |      |                          |        |            |            | 202,424 |            |
| ウルグアイ |      |                          |        | 千ウルグアイペソ   | 千ウルグアイペソ   |         |            |
|       | 国債証券 | REPUBLICA ORIENT URUGUAY | 8.5    | 4,000      | 4,082      | 10,903  | 2028/3/15  |
| 小 計   |      |                          |        |            |            | 10,903  |            |
| セルビア  |      |                          |        | 千セルビアディナール | 千セルビアディナール |         |            |
|       | 国債証券 | SERBIA TREASURY BONDS    | 4.5    | 22,000     | 23,567     | 26,162  | 2032/8/20  |
| 小 計   |      |                          |        |            |            | 26,162  |            |
| エジプト  |      |                          |        | 千エジプトポンド   | 千エジプトポンド   |         |            |
|       | 国債証券 | EGYPT GOVERNMENT BOND    | 14.369 | 6,000      | 6,008      | 43,844  | 2025/10/20 |
|       |      | EGYPT GOVERNMENT BOND    | 16.1   | 3,200      | 3,429      | 25,025  | 2029/5/7   |
| 小 計   |      |                          |        |            |            | 68,869  |            |
| 南アフリカ |      |                          |        | 千ランド       | 千ランド       |         |            |
|       | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.75   | 3,600      | 3,689      | 28,259  | 2023/2/28  |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10.5   | 14,900     | 16,635     | 127,428 | 2026/12/21 |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0    | 11,700     | 11,023     | 84,440  | 2030/1/31  |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.0    | 4,460      | 3,831      | 29,349  | 2031/2/28  |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.25   | 10,200     | 9,401      | 72,014  | 2032/3/31  |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.875  | 9,900      | 9,166      | 70,216  | 2035/2/28  |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.25   | 4,800      | 3,487      | 26,713  | 2036/3/31  |

| 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    |           |
| 南アフリカ |      |                          | %     | 千ランド   | 千ランド   | 千円        |           |
|       | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.5   | 11,200 | 9,833  | 75,325    | 2037/1/31 |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 9.0   | 7,100  | 6,375  | 48,832    | 2040/1/31 |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.5   | 4,450  | 3,066  | 23,491    | 2041/2/28 |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75  | 11,800 | 10,205 | 78,177    | 2044/1/31 |
|       |      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75  | 13,900 | 12,022 | 92,094    | 2048/2/28 |
| 小 計   |      |                          |       |        |        | 756,343   |           |
| 合 計   |      |                          |       |        |        | 8,742,032 |           |

\* 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。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年 2 月18日現在)

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 公社債          | 8,742,032 | 97.3  |
| コール・ローン等、その他 | 241,059   | 2.7   |
| 投資信託財産総額     | 8,983,091 | 100.0 |

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 当期末における外貨建純資産（8,968,154千円）の投資信託財産総額（8,983,091千円）に対する比率は99.8%です。

\* 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=114.95円、1トルコリラ=8.4928円、1チェココルナ=5.3542円、1フォリント=0.366334円、1ズロチ=28.8605円、1ルーブル=1.52円、1ドミニカペソ=2.027円、1レイ=26.4208円、1リンギ=27.4641円、1バーツ=3.57円、1ルビア=0.0081円、1人民元=18.1326円、1メキシコペソ=5.6611円、1レアル=22.2193円、1チリペソ=0.144426円、1コロンビアペソ=0.02918円、1ソル=30.8249円、1ウルグアイペソ=2.671円、1セルビアディナール=1.110126円、1エジプトポンド=7.2976円、1ランド=7.66円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年2月18日現在）

| 項 目             | 当 期 末          |
|-----------------|----------------|
|                 | 円              |
| (A) 資産          | 8,991,137,704  |
| コール・ローン等        | 115,615,304    |
| 公社債(評価額)        | 8,742,032,185  |
| 未収入金            | 8,046,101      |
| 未収利息            | 109,700,377    |
| 前払費用            | 15,743,737     |
| (B) 負債          | 9,420,779      |
| 未払金             | 8,095,290      |
| 未払解約金           | 1,060,580      |
| 未払利息            | 9              |
| その他未払費用         | 264,900        |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 8,981,716,925  |
| 元本              | 6,296,343,548  |
| 次期繰越損益金         | 2,685,373,377  |
| (D) 受益権総口数      | 6,296,343,548口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,265円        |

(注) 期首元本額は6,511,390,712円、期中追加設定元本額は1,808,444,665円、期中一部解約元本額は2,023,491,829円、1口当たり純資産額は1,4265円です。

○損益の状況（2021年2月19日～2022年2月18日）

| 項 目              | 当 期           |
|------------------|---------------|
|                  | 円             |
| (A) 配当等収益        | 486,536,873   |
| 受取利息             | 486,528,224   |
| その他収益金           | 15,159        |
| 支払利息             | △ 6,510       |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 374,786,157 |
| 売買益              | 542,253,771   |
| 売買損              | △ 917,039,928 |
| (C) 保管費用等        | △ 9,180,368   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 102,570,348   |
| (E) 前期繰越損益金      | 2,628,069,345 |
| (F) 追加信託差損益金     | 747,056,683   |
| (G) 解約差損益金       | △ 792,322,999 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 2,685,373,377 |
| 次期繰越損益金(H)       | 2,685,373,377 |

\* 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。  
\* 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。  
\* 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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                                  | 当期末<br>元本額    |
|----------------------------------------|---------------|
|                                        | 円             |
| ノムラFPIs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）    | 4,201,207,767 |
| 野村インデックスファンド・新興国債券                     | 738,623,490   |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス                 | 441,906,083   |
| 野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド            | 407,552,765   |
| 世界6資産分散ファンド                            | 117,527,160   |
| 野村DC運用戦略ファンド                           | 111,086,393   |
| 野村資産設計ファンド2040                         | 50,165,940    |
| 野村資産設計ファンド2030                         | 40,233,866    |
| 野村資産設計ファンド2025                         | 35,068,782    |
| 野村資産設計ファンド2035                         | 29,539,640    |
| 野村資産設計ファンド2020                         | 19,605,873    |
| 野村資産設計ファンド2015                         | 19,560,679    |
| オールウェザー・ファクターアロケーション/オープン投信（適格機関投資家専用） | 14,018,694    |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030            | 11,051,125    |

| ファンド名                                          | 当期末<br>元本額 |
|------------------------------------------------|------------|
|                                                | 円          |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）                             | 10,780,051 |
| 野村資産設計ファンド2050                                 | 8,225,651  |
| 野村資産設計ファンド2045                                 | 8,006,288  |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040                    | 7,572,622  |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型               | 4,465,269  |
| 野村資産設計ファンド2060                                 | 4,151,911  |
| ネクストコア                                         | 4,142,066  |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050                    | 4,035,338  |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型               | 2,217,431  |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060                    | 2,014,458  |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型               | 1,499,369  |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型               | 1,132,604  |
| 野村FPIs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用） | 952,233    |

○お知らせ

該当事項はございません。