東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

＜愛称 年金コンパス＞

第６期　運用報告書（全体版）

（決算日　2025年１月27日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

<table>
<tr><td>商品分類</td><td colspan="5">追加型投信／内外／資産複合
（課税上は株式投資信託として取扱われます。）</td></tr>
<tr><td>信託期間</td><td colspan="5">無期限（2019年９月20日設定）</td></tr>
<tr><td>運用方針</td><td colspan="5">信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</td></tr>
<tr><td rowspan="5">主要投資対象</td><td>東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035</td><td colspan="4">以下４つのマザーファンドを主要投資対象とします。</td></tr>
<tr><td>ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド</td><td colspan="4">TOPIXに採用されている銘柄</td></tr>
<tr><td>ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド</td><td colspan="4">わが国の公社債</td></tr>
<tr><td>ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド</td><td colspan="4">外国の株式</td></tr>
<tr><td>ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド</td><td colspan="4">外国の公社債</td></tr>
<tr><td rowspan="5">投資制限</td><td>東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035</td><td colspan="4">・株式への実質投資割合には制限を設けません。
・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</td></tr>
<tr><td>ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド</td><td rowspan="4">株式への投資制限</td><td>制限なし</td><td rowspan="4">外貨建資産への投資制限</td><td>20%以下</td></tr>
<tr><td>ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド</td><td>10%以下</td><td>20%以下</td></tr>
<tr><td>ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド</td><td>制限なし</td><td>制限なし</td></tr>
<tr><td>ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド</td><td>10%以下</td><td>制限なし</td></tr>
<tr><td>分配方針</td><td colspan="5">毎決算時に、原則として経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。
収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。</td></tr>
</table>

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、「東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035＜愛称 年金コンパス＞」は、このたび、第６期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント
東京都千代田区丸の内１－８－２　鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口
東京海上アセットマネジメント　サービスデスク　0120-712-016
受付時間：営業日の９時～17時
https://www.tokiomarineam.co.jp/

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、－印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率					
	円	円	%	%	%	%	%	百万円
2期(2021年1月25日)	11,305	0	7.6	58.9	3.2	37.0	0.7	153
3期(2022年1月25日)	12,250	0	8.4	57.7	2.2	39.2	0.7	735
4期(2023年1月25日)	12,592	0	2.8	58.7	1.4	39.0	0.7	1,888
5期(2024年1月25日)	15,064	0	19.6	58.4	2.3	38.4	0.6	3,620
6期(2025年1月27日)	16,771	0	11.3	57.6	2.0	39.6	0.5	5,505

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率				
	円	%	%	%	%	%
(期首) 2024年1月25日	15,064	－	58.4	2.3	38.4	0.6
1月末	15,158	0.6	58.8	2.4	38.2	0.6
2月末	15,624	3.7	58.4	2.3	38.9	0.6
3月末	16,034	6.4	57.9	2.9	38.9	0.6
4月末	16,025	6.4	56.9	3.0	39.8	0.5
5月末	16,118	7.0	57.7	2.8	39.2	0.5
6月末	16,547	9.8	58.1	2.4	39.2	0.5
7月末	16,176	7.4	56.6	2.8	40.4	0.5
8月末	15,973	6.0	56.6	2.6	40.5	0.6
9月末	15,969	6.0	57.1	2.6	40.0	0.6
10月末	16,456	9.2	58.6	2.0	38.8	0.6
11月末	16,377	8.7	57.7	2.0	39.6	0.6
12月末	16,816	11.6	58.4	2.3	39.1	0.5
(期末) 2025年1月27日	16,771	11.3	57.6	2.0	39.6	0.5

(注) 騰落率は期首比です。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

○運用経過

（2024年１月26日～2025年１月27日）

■期中の基準価額等の推移

期　首：15,064円
期　末：16,771円（既払分配金(税込み)：０円）
騰落率：　11.3%（分配金再投資ベース）

（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。
（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、お客様の損益の状況を示すものではありません。
（注）分配金再投資基準価額は、期首（2024年１月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因
・米国大統領選挙における減税や規制緩和などの公約実現期待
・米国を中心とした市場予想を上回る堅調な企業業績
・為替市場で円安が進行したこと
・日本経済に対するデフレ脱却期待

マイナス要因
・中東における地政学的リスクの高まり
・日銀金融政策決定会合における複数回の利上げ
・FRB（米連邦準備制度理事会）による大幅な利下げ期待の後退

■投資環境

【国内株式市場】

期初は、日本経済のデフレからの脱却、企業ガバナンスの改善、アジア域内の相対的な日本株魅力度の向上などにより、国内株式市場は大きく上昇しました。その後、2024年７月の金融政策決定会合後の日銀総裁の記者会見の内容が利上げに積極的と受け止められたほか、米国景気減速懸念により円高米ドル安が進行し、国内株式市場は歴史的な暴落を見せました。しかし、日銀副総裁の発言内容が急速な利上げに慎重な内容だったほか、９月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で0.5％の利下げが実施されたことなどから安心感が広がり、国内株式市場は反転し、緩やかながらも上昇基調に転じました。期末にかけては、11月に米国大統領選挙でトランプ氏が勝利したことを好感して国内株式市場は上昇した後に、次期政権の関税強化への警戒や国内企業業績の中間決算が失望されたことで徐々に弱含み、その後もトランプ政権の政策や日米金融政策への思惑から上下する上値の重い展開となりました。

【国内債券市場】

期初、0.7％台であった10年国債利回りは、2024年３月の日銀金融政策決定会合におけるマイナス金利の解除ならびにYCC（イールドカーブ・コントロール）政策の撤廃後、追加利上げや国債買入減額観測が高まったことなどから、10年国債利回りは1.1％程度まで徐々に水準を切り上げる展開となりました。７月末に日銀が追加利上げを決定した後、株式市場が急落する局面で10年国債利回りは0.8％程度まで大幅に低下しましたが、期末にかけては、米国による財政拡張政策への警戒感から円安が進行したことや2025年１月の日銀金融政策決定会合において短期金利を0.5％とする追加利上げを実施したことなどを背景に10年国債利回りは上昇し、1.2％程度の水準で期を終えました。

【外国株式市場】

期前半は、2024年３月の米国CPI（消費者物価指数）が事前予想を上回ったことから早期利下げへの期待が後退したことや中東の地政学的リスクが高まり、外国株式市場は下落する場面もありましたが、2024年1-3月期の企業決算が事前予想を上回り堅調な業績が好感されたことから、再び上昇しました。期後半は、10月の米国民間雇用者数の伸びが市場予想を上回りFRBによる利下げペースが緩やかになるとの見方が広がったことや、大手IT企業の決算発表で収益性に対する懸念が高まるなか、外国株式市場は下落する場面もありましたが、2024年7-9月期の米国企業決算が事前予想を上回り堅調な業績が好感されたことや、減税や規制緩和への期待が継続するなか、トランプ新大統領が就任初日に一律関税措置を講じなかったことから安心感が広がり上昇しました。

【外国債券市場】

米国債利回りは、期前半は堅調な経済指標やFRB高官による早期の利下げを否定する発言などから上昇しましたが、その後景気・雇用に鈍化の兆候が見られ、FRBによる利下げが実施されると低下しました。期後半は、発表された経済指標の多くが堅調であったことや米国大統領選挙でのトランプ氏の勝利を受けた財政悪化懸念などを背景に過度な利下げ期待が剥落したことから米国債利回りは再び上昇して期を終えました。

ドイツ国債利回りは、期初にECB（欧州中央銀行）高官から利下げ期待を後退させる発言などがあり上昇しましたが、期半ばにかけて米国債利回りに連動して低下しました。期末にかけて大幅利下げに対する期待の剥落や堅調な経済指標などによりドイツ国債利回りは再度上昇に転じ、前期末対比では上昇しました。

【為替市場】

米ドル円為替レートは、期前半は米国で経済指標が堅調であったことから早期の利下げ期待が後退し、日銀は金融緩和姿勢を維持したことから、円安米ドル高となりました。期中、日銀の追加利上げのハードルが高くないことが示唆されると、急激に円高米ドル安が進行する局面もありましたが、期後半にかけて米国大統領選挙にてトランプ氏が優位となると再度円安米ドル高が進行し、前期末対比では円安米ドル高となりました。

ユーロ円為替レートは、日銀が金融政策を修正しつつも慎重姿勢を維持する一方、ECBは利下げフェーズに転じましたが、米国主導で欧州金利が上昇した局面で円安ユーロ高が進行しました。前期末対比では、円安ユーロ高となりました。

■ポートフォリオについて

＜東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035＞

国内外の複数の資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券）を主要投資対象とするマザーファンドを、それぞれの資産配分比率に応じて組み入れました。各マザーファンドの値動きによって生じる組入比率の変動に対し、資産配分からの乖離の修正を適宜行い、期を通じて各資産の資産配分を維持しました。当期中の資産配分比率は以下の通りです。

【資産配分比率】

資産	マザーファンド	資産配分比率
国内株式	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	30%
国内債券	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	30%
外国株式	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	30%
外国債券	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	10%

以上の運用の結果、当ファンドの基準価額は、各マザーファンドの値動きを反映し、11.3%上昇しました。

＜ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

ベンチマークであるTOPIX（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は11.5%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

＜ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド＞

ベンチマークであるNOMURA－BPI（総合）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は2.6%下落し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

＜ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド＞

ベンチマークであるMSCIコクサイ指数（配当込み、円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は29.3%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

＜ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド＞

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は6.4%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

また、当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる参考指数もないため、記載する事項はありません。

■分配金

当期においては、運用の効率性などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　　目	第６期 2024年１月26日～ 2025年１月27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	6,771

（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

＜東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035＞

引き続き、国内外の複数の資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券）を主要投資対象とするマザーファンドを、それぞれの資産配分比率に応じて組み入れ、各マザーファンドの値動きによって生じる組入比率の変動に対し、資産配分からの乖離の修正を適宜行い、期を通じて各資産の資産配分を維持する運用を行います。

＜ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド＞
＜ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド＞
＜ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド＞
＜ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド＞

引き続き、上記４つのマザーファンドとも各々のベンチマークに連動する運用成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2024年１月26日～2025年１月27日）

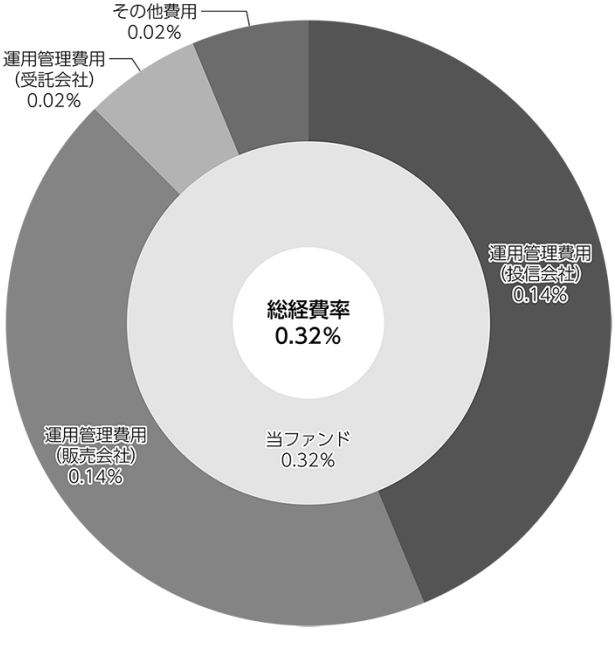
項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	50	0.310	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(23)	(0.144)	＊委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
（販売会社）	(23)	(0.144)	＊購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
（受託会社）	(4)	(0.022)	＊運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.003	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ＊売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.003)	
（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	0.002	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ＊有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.002)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	3	0.019	(d)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.008)	＊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）	(2)	(0.011)	＊監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.000)	＊その他は、信託事務等に要する諸費用
合計	54	0.334	
期中の平均基準価額は、16,106円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）消費税は報告日の税率を採用しています。
（注）各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。
（注）売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（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、売買委託手数料およ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0.32％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、売買委託手数料およ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、親投資信託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

（2024年１月26日～2025年１月27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
ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	268,517	678,379	119,609	297,897
ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	726,862	879,017	194,768	235,027
ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	101,196	639,543	66,522	428,660
ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	117,831	236,864	37,075	75,312

○株式売買比率

（2024年１月26日～2025年１月27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	
	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	11,573,003千円	62,383,511千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	66,395,485千円	244,810,940千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.17	0.25

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注) (c)は、小数点以下２位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

（2024年１月26日～2025年１月27日）

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

＜ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸ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	122	8	917

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東京海上ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

（2025年１月27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
ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	481,270	630,178	1,639,157
ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	850,660	1,382,753	1,646,583
ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	198,135	232,809	1,674,968
ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	183,626	264,381	544,044

○投資信託財産の構成

（2025年１月27日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	1,639,157	29.7
ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	1,646,583	29.8
ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	1,674,968	30.4
ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	544,044	9.9
コール・ローン等、その他	12,396	0.2
投資信託財産総額	5,517,148	100.0

（注）ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（315,144,044千円）の投資信託財産総額（315,700,097千円）に対する比率は99.8%です。

（注）ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（25,386,607千円）の投資信託財産総額（25,479,475千円）に対する比率は99.6%です。

（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは１米ドル＝155.60円、１カナダドル＝108.23円、１メキシコペソ＝7.6222円、１ユーロ＝163.01円、１英ポンド＝193.92円、１スイスフラン＝171.69円、１スウェーデンクローナ＝14.22円、１ノルウェークローネ＝13.84円、１デンマーククローネ＝21.84円、１ポーランドズロチ＝38.6793円、１豪ドル＝97.93円、１ニュージーランドドル＝88.55円、１香港ドル＝19.98円、１シンガポールドル＝115.51円、１マレーシアリンギット＝35.4502円、１イスラエルシェケル＝43.4097円、１オフショア元＝21.4372円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年１月27日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,517,148,358
TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド(評価額)	1,639,157,288
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,646,583,370
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,674,968,178
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	544,044,940
未収入金	12,394,582
(B) 負債	11,990,946
未払解約金	3,817,417
未払信託報酬	7,891,768
その他未払費用	281,761
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	5,505,157,412
元本	3,282,495,116
次期繰越損益金	2,222,662,296
(D) 受益権総口数	3,282,495,116口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	16,771円

(注) 当ファンドの期首元本額は2,403,439,077円、期中追加設定元本額は1,211,298,882円、期中一部解約元本額は332,242,843円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第10号に規定する額(元本の欠損) となります。

(注) 上記表中の１万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2024年１月26日～2025年１月27日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	12
受取利息	12
(B) 有価証券売買損益	458,368,416
売買益	528,909,966
売買損	△ 70,541,550
(C) 信託報酬等	△ 14,946,543
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	443,421,885
(E) 前期繰越損益金	444,073,279
(F) 追加信託差損益金	1,335,167,132
(配当等相当額)	(569,761,045)
(売買損益相当額)	(765,406,087)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	2,222,662,296
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	2,222,662,296
追加信託差損益金	1,335,167,132
(配当等相当額)	(572,273,792)
(売買損益相当額)	(762,893,340)
分配準備積立金	887,495,164

(注) **(B)有価証券売買損益**は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) **(C)信託報酬等**は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) **(F)追加信託差損益金**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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項　　目	当　　期
a. 配当等収益(費用控除後)	73,702,923円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	369,718,962円
c. 信託約款に規定する収益調整金	1,335,167,132円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	444,073,279円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	2,222,662,296円
f. 分配対象収益(１万口当たり)	6,771円
g. 分配金	0円
h. 分配金(１万口当たり)	0円

ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

運用報告書　第24期（決算日　2024年３月21日）

（計算期間　2023年３月21日～2024年３月21日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、－印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

○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	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
20期(2020年３月23日)	10,786	△17.8	1,972.16	△17.9	92.3	5.2	24,339
21期(2021年３月22日)	16,985	57.5	3,111.20	57.8	92.3	9.4	36,847
22期(2022年３月22日)	16,895	△ 0.5	3,087.43	△ 0.8	95.0	3.7	40,448
23期(2023年３月20日)	17,335	2.6	3,164.37	2.5	98.5	1.0	40,860
24期(2024年３月21日)	25,762	48.6	4,702.41	48.6	93.2	6.5	68,105

（注）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークはTOPIX（配当込み）です。
配当込みTOPIX（以下「TOPIX（配当込み）」といいます。）の指数値およびTOPIX（配当込み）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIX（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX（配当込み）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、TOPIX（配当込み）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX（配当込み）の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIX（配当込み）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。ＪＰＸは、TOPIX（配当込み）の指数値およびTOPIX（配当込み）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX（配当込み）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。ＪＰＸは、TOPIX（配当込み）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、TOPIX（配当込み）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。ＪＰＸは、ファンドの購入者または公衆に対し、ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。ＪＰＸは、委託会社またはファンドの購入者のニーズをTOPIX（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、ＪＰＸはファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

○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		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2023年３月20日	17,335	－	3,164.37	－	98.5	1.0
３月末	18,213	5.1	3,324.74	5.1	97.2	2.8
４月末	18,710	7.9	3,414.45	7.9	98.0	3.2
５月末	19,371	11.7	3,537.93	11.8	95.7	4.5
６月末	20,834	20.2	3,805.00	20.2	94.1	5.4
７月末	21,153	22.0	3,861.80	22.0	90.6	9.1
８月末	21,242	22.5	3,878.51	22.6	90.9	8.8
９月末	21,357	23.2	3,898.26	23.2	93.4	6.1
10月末	20,722	19.5	3,781.64	19.5	91.6	8.0
11月末	21,843	26.0	3,986.65	26.0	94.1	5.7
12月末	21,803	25.8	3,977.63	25.7	94.6	5.3
2024年１月末	23,499	35.6	4,288.36	35.5	93.1	6.4
２月末	24,653	42.2	4,499.61	42.2	93.3	6.2
(期末) 2024年３月21日	25,762	48.6	4,702.41	48.6	93.2	6.5

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

○運用経過

（2023年３月21日～2024年３月21日）

■期中の基準価額等の推移

期　首：17,335円
期　末：25,762円
騰落率：　48.6％

（注）ベンチマークは、期首（2023年３月20日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。
（注）ベンチマークは、TOPIX（配当込み）です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因
・円安による企業業績拡大への期待
・資本効率改善を企業に求める東証（東京証券取引所）のガバナンス改革への期待
・良好な需給環境への期待

マイナス要因
・米国の金融引き締め長期化への懸念

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初は、円安による企業業績拡大への期待や東証がPBR（株価純資産倍率）１倍割れの企業に対して資本効率の改善を求めたことへの評価などから、国内株式市場は上昇しました。その後、利益確定売りによる一時的な下落局面を挟みながらも米国長期金利の先高観の後退などを背景に、国内株式市場は堅調に推移しました。期後半に入ると、米国においてインフレ率の高止まりから金融引き締め長期化への懸念が高まったほか、中東の地政学的リスクや日銀の金融政策変更への警戒感などから一旦は売りが優勢となったものの、その後は、金利上昇への過度な警戒感が緩和されたことから、国内株式市場は再び上昇に転じました。2023年末にかけては、為替が円高に動いたことなどを背景に、国内株式市場には落ち着きも見られましたが、2024年に入ると、再度円安に転じたことや新NISA（少額投資非課税制度）開始に伴う資金流入など良好な需給環境への期待などを背景に、大きく上昇して期を終えました。

■ポートフォリオについて

日本の株式市場全体への投資を目的とし、TOPIX（配当込み）に連動する投資成果の達成を目標として運用を行っています。個別の銘柄選択は、市場でのウェイトが一定以上の銘柄についてはそのウェイト通り組み入れ、一定以下の銘柄については当社独自の業種分類と時価総額による規模分類に基づいて選定します。これにより、業種配分および企業規模などの特性がファンド全体でTOPIX（配当込み）とほぼ一致するよう調整しています。

期首の保有銘柄数は1,059銘柄でしたが、期中は設定・解約に応じたTOPIX先物と現物株式の売買を行い、期末における保有銘柄数は1,120銘柄となりました。なお、実質的な株式の組入比率はほぼ100％に維持しました。

以上の運用の結果、基準価額は48.6％上昇しました。

■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＋48.6%となり、ベンチマークの騰落率＋48.6%にほぼ連動しました。

（主な差異要因）

プラス要因

・特にありません

マイナス要因

・特にありません

○今後の運用方針

引き続き、基本方針に基づき、先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、TOPIX（配当込み）との連動性を高位に保つことを目指して運用します。

○１万口当たりの費用明細

（2023年３月21日～2024年３月21日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.004	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ＊売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(1)	(0.003)	
合計	1	0.004	
期中の平均基準価額は、21,116円です。			

（注）各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

（2023年３月21日～2024年３月21日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株 2,477 (6,297)	千円 6,024,819 (－)	千株 910	千円 1,611,555

（注）金額は受渡代金です。
（注）（　）内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	株式先物取引	百万円 27,876	百万円 24,994	百万円 －	百万円 －

○株式売買比率

（2023年３月21日～2024年３月21日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	7,636,375千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	50,023,714千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.15

（注）(b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
（注）(c)は、小数点以下２位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

（2023年３月21日～2024年３月21日）

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 43	百万円 －	百万円 740

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東京海上ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

（2024年３月21日現在）

国内株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
ニッスイ	20.5	20.9	20,306
マルハニチロ	3.3	3.6	10,553
サカタのタネ	2.6	2.8	10,346
ホクト	2.6	2.7	5,081
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	－	2.5	4,877
ＩＮＰＥＸ	73.9	83.2	192,275
石油資源開発	2.9	2.9	19,807
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	3	3	8,118
建設業（2.0%）			
ショーボンドホールディングス	2.6	3.3	21,473
ミライト・ワン	5.9	6	11,649
ベステラ	4.9	3	2,994
安藤・間	12.9	13	16,094
東急建設	10.7	10.7	9,180
コムシスホールディングス	7.1	6.3	22,377
東建コーポレーション	0.8	0.9	8,667
ヤマウラ	4.8	5.2	8,034
オリエンタル白石	21.7	22.9	9,160
大成建設	13.7	14.6	85,234
大林組	47.5	52.7	100,736
清水建設	44.5	43	44,118
長谷工コーポレーション	14.3	13.9	26,514
鹿島建設	33.9	33.6	107,016
西松建設	3.3	3.4	15,449
三井住友建設	13.6	21.9	9,723
奥村組	2.7	3.3	17,589
東鉄工業	2.9	3.1	9,532
戸田建設	19.9	16.9	17,643
熊谷組	2.7	3.9	16,828
東亜道路工業	－	0.7	4,599
東亜建設工業	2.8	2.8	14,476
五洋建設	20.9	22.9	18,237

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
住友林業	11.4	13.6	61,608
日本基礎技術	5.8	3.2	1,664
大和ハウス工業	39.4	42.4	193,980
積水ハウス	46.3	46.4	160,497
北陸電気工事	4.8	4.9	5,958
中電工	2.4	2.4	7,452
関電工	7	9.4	16,111
きんでん	7.9	8.8	24,494
日本電設工業	4.4	3.3	6,906
エクシオグループ	6.7	6.8	22,644
新日本空調	2.8	2.9	9,541
九電工	2.8	3.3	20,384
三機工業	4.2	4.3	9,283
日揮ホールディングス	15.8	17.2	26,341
中外炉工業	2.2	2.8	8,848
ヤマト	6.5	3.9	4,208
高砂熱学工業	4.9	5.4	25,947
三晃金属工業	1.4	0.9	4,671
大氣社	2.4	2.5	12,037
ダイダン	－	1.4	3,364
日比谷総合設備	3.6	3.6	11,124
インフロニア・ホールディングス	16.2	17.3	28,536
レイズネクスト	5.7	5.7	13,377
食料品（3.0%）			
ニップン	4	4	9,632
日清製粉グループ本社	16	14	31,003
鳥越製粉	6	3.7	2,641
フィード・ワン	－	2.7	2,718
日本甜菜製糖	1.5	1.5	3,274
ＤＭ三井製糖ホールディングス	3.7	3.7	12,506
森永製菓	3.4	6.8	18,026
江崎グリコ	4.1	3.6	15,508
井村屋グループ	－	2.7	6,922
山崎製パン	11.5	11.1	44,477

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
亀田製菓	1.9	1.9	8,160
寿スピリッツ	1.7	8.5	16,396
カルビー	7.6	7.8	26,676
森永乳業	2.8	5.8	18,009
ヤクルト本社	10.3	22.7	73,434
明治ホールディングス	8.8	18.7	64,234
雪印メグミルク	2.9	2.9	7,705
プリマハム	2.4	2.4	5,596
日本ハム	4.8	6	31,542
丸大食品	3	2.6	4,295
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	2.4	2.4	7,848
伊藤ハム米久ホールディングス	10.6	2.1	8,967
サッポロホールディングス	5.2	5.6	34,272
アサヒグループホールディングス	32.2	36.3	199,795
キリンホールディングス	62.8	65.5	138,696
宝ホールディングス	11.6	9	9,922
オエノンホールディングス	11.8	14.2	5,083
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	9.5	10.8	24,494
サントリー食品インターナショナル	9.4	10.9	55,491
ダイドーグループホールディングス	1.2	2.6	7,248
伊藤園	4.9	5.6	20,552
キーコーヒー	3.7	3.8	7,714
ユニカフェ	3.6	3.4	3,124
ジャパンフーズ	3.8	2.4	3,626
日清オイリオグループ	2	2	10,500
不二製油グループ本社	3.1	3.4	8,362
Ｊ－オイルミルズ	4.4	4.4	8,830
キッコーマン	9.8	10.4	103,740
味の素	34.1	37.5	207,225
キユーピー	8.3	8.3	22,978
ハウス食品グループ本社	5	4.3	13,450
カゴメ	5.6	6.8	24,235
アリアケジャパン	1.8	1.8	9,666
ニチレイ	6.5	7.3	29,375
東洋水産	7.5	7.9	74,252
日清食品ホールディングス	5.2	16.5	70,620
フジッコ	3.6	3.6	7,056
ロック・フィールド	3.3	4.3	7,043

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本たばこ産業	92.7	94.3	373,239
なとり	－	1.4	3,022
ユーグレナ	13.6	14.4	9,000
繊維製品（0.4%）			
片倉工業	2.4	2.5	4,757
グンゼ	1.3	1.4	7,840
東洋紡	5.9	6	6,918
倉敷紡績	3	3	11,130
シキボウ	－	1.2	1,472
日本毛織	6.4	6.4	9,132
帝国繊維	2.3	2.4	5,467
帝人	13.8	13.7	19,282
東レ	93.9	103.1	76,087
日本フエルト	8	4.5	2,011
セーレン	3.7	4.2	10,962
小松マテーレ	6.1	2.2	1,711
ワコールホールディングス	3.5	3.6	13,424
ホギメディカル	2.3	2.7	10,084
ＴＳＩホールディングス	11	11	8,327
三陽商会	－	0.9	2,396
ゴールドウイン	2.4	2.8	27,608
デサント	3.4	3	10,455
パルプ・紙（0.2%）			
特種東海製紙	1.6	1.6	6,552
王子ホールディングス	54.4	57.9	36,233
日本製紙	6.5	8.8	10,595
三菱製紙	1.8	4.3	2,640
北越コーポレーション	13.5	13.5	31,927
大王製紙	6.9	7	8,477
レンゴー	9.7	10.1	12,094
ザ・パック	1.9	2	7,260
化学（5.8%）			
クラレ	21.1	23	36,938
旭化成	92.7	102.4	116,172
共和レザー	5.8	3.6	3,078
レゾナック・ホールディングス	12.6	15.3	55,095
住友化学	108.1	114.7	39,284
住友精化	－	0.6	3,108

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日産化学	7	7.8	47,658
クレハ	1	3.9	10,806
石原産業	5	5.1	8,874
片倉コープアグリ	3.3	2.1	2,314
日本曹達	1.9	2.5	15,400
東ソー	19.3	20.9	44,004
トクヤマ	3	6.3	16,969
セントラル硝子	2.9	3.4	9,730
東亜合成	8.6	7.7	12,081
大阪ソーダ	1.9	1.9	20,558
デンカ	5.1	5.6	13,837
信越化学工業	24.9	144.5	992,426
日本カーバイド工業	－	1.8	3,375
堺化学工業	2.4	2.5	4,980
エア・ウォーター	13.6	15.1	35,900
日本酸素ホールディングス	13.2	15.5	74,927
日本パーカライジング	7.5	7.6	9,538
ステラ　ケミファ	2	2.4	9,384
日本触媒	1.7	1.9	11,297
カネカ	3.3	3.5	13,415
三菱瓦斯化学	12	11.4	30,318
三井化学	12.2	12.6	57,204
ＪＳＲ	14.8	17.6	76,155
東京応化工業	2.3	9	41,454
三菱ケミカルグループ	96.5	114.4	108,531
ＫＨネオケム	3.7	4.3	9,644
ダイセル	20.7	24.2	36,663
住友ベークライト	1.9	2.2	20,394
積水化学工業	29.5	30.8	69,115
日本ゼオン	11.9	10	13,470
アイカ工業	3.9	3.1	11,612
ＵＢＥ	6	6.9	19,085
タキロンシーアイ	－	3.3	2,191
旭有機材	2.7	2.6	13,390
タイガースポリマー	7.2	4.4	5,077
ミライアル	3	1.9	3,005
日本化薬	9	8.6	11,472
ＡＤＥＫＡ	6.6	5.2	17,180

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日油	4.2	4.8	32,102
ハリマ化成グループ	4.7	4.8	4,507
花王	34.8	35.7	201,705
ニイタカ	2.3	1.5	2,935
三洋化成工業	1.1	1.2	5,244
日本ペイントホールディングス	62.6	85.6	94,031
関西ペイント	14.6	15.9	35,361
中国塗料	6.9	6.9	16,035
太陽ホールディングス	3.1	4	13,380
ＤＩＣ	4.5	5.3	15,582
サカタインクス	6.6	6.7	10,586
ａｒｔｉｅｎｃｅ	3.3	3.4	9,989
富士フイルムホールディングス	27.7	29.2	304,556
資生堂	29.8	34.4	144,824
ライオン	16.4	20.4	27,509
高砂香料工業	2.1	2.1	7,570
マンダム	4.1	4.1	5,498
ミルボン	1.7	2.6	8,426
ファンケル	6.6	7.1	14,842
コーセー	2.9	3.4	27,176
コタ	3.7	4.1	6,851
ポーラ・オルビスホールディングス	6.1	7.4	10,815
ノエビアホールディングス	1	1.1	5,687
エステー	3.3	3.4	5,375
長谷川香料	2.9	3	9,450
小林製薬	4.2	4.6	27,866
荒川化学工業	4.5	4.5	5,341
メック	2.7	2.7	11,124
タカラバイオ	4.9	6.5	6,532
ＪＣＵ	2.7	2.8	11,046
デクセリアルズ	5.2	5.2	32,188
アース製薬	1.2	1.4	6,069
大成ラミック	1.7	1.8	5,508
クミアイ化学工業	8.6	8.8	7,339
日本農薬	8.8	8.9	6,692
日東電工	10.2	10.9	156,088
レック	6.4	6.4	7,340
前澤化成工業	4.2	4.2	7,144

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エフピコ	2.6	3.1	8,569
天馬	2.5	2.4	5,630
信越ポリマー	5	5.1	8,052
ニフコ	5.3	5.3	21,115
バルカー	1.8	2.5	13,000
ユニ・チャーム	29.6	32.9	161,177
医薬品（4.4%）			
協和キリン	16.5	19.1	54,339
武田薬品工業	127.7	140.5	615,530
アステラス製薬	138	146.6	245,848
住友ファーマ	11.1	15.5	6,417
塩野義製薬	19.2	20.2	158,610
日本新薬	3.7	4.9	22,887
中外製薬	44.5	49.7	303,170
科研製薬	1.9	1.8	6,408
エーザイ	18	19.6	125,459
ロート製薬	16.2	15.7	49,769
小野薬品工業	29.2	34.8	87,261
久光製薬	4.1	3.7	14,777
持田製薬	1.9	2	6,580
参天製薬	26.8	28.2	41,059
ツムラ	4.3	3.9	14,765
キッセイ薬品工業	1.9	2.3	8,096
生化学工業	6.9	7	5,383
栄研化学	3.7	4.5	8,851
鳥居薬品	2.1	2.1	8,568
ＪＣＲファーマ	5	8	7,120
東和薬品	2.7	3.1	9,231
ゼリア新薬工業	4	4	8,756
第一三共	125.8	140.1	688,311
杏林製薬	4	4.1	7,363
大幸薬品	9.7	16.4	6,330
大塚ホールディングス	32.5	32.8	210,182
大正製薬ホールディングス	2.9	3.3	28,271
ペプチドリーム	8	9.2	13,110
あすか製薬ホールディングス	4.6	4.7	10,076
サワイグループホールディングス	2.7	3.6	22,744

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
石油・石炭製品（0.5%）			
ニチレキ	4.7	4.7	11,933
出光興産	16.2	82	86,592
ＥＮＥＯＳホールディングス	255.5	255.3	186,649
コスモエネルギーホールディングス	6.6	6.6	49,711
ゴム製品（0.7%）			
横浜ゴム	8.6	8.9	36,570
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	7.9	9.3	26,407
ブリヂストン	45.8	46	303,370
住友ゴム工業	13.6	13.7	24,824
藤倉コンポジット	－	1.4	2,002
オカモト	1.3	1.4	7,238
ニッタ	2	2.1	8,505
住友理工	2.8	2.9	3,839
三ツ星ベルト	－	2.1	10,279
バンドー化学	6.8	6.8	13,062
ガラス・土石製品（0.7%）			
日東紡績	2.7	2.7	15,714
ＡＧＣ	14.1	15.1	83,774
日本電気硝子	5.2	6.5	24,375
住友大阪セメント	2.7	2.9	11,124
太平洋セメント	8.8	9.6	33,446
日本ヒューム	6.9	7	6,251
東海カーボン	12.8	15.9	15,752
日本カーボン	－	1	5,360
東洋炭素	2	2	16,180
ＴＯＴＯ	9.6	11.1	47,108
日本碍子	16.8	18.2	36,873
日本特殊陶業	11.8	12.7	62,852
ＭＡＲＵＷＡ	0.7	0.7	21,980
フジミインコーポレーテッド	1.7	5.1	18,870
ニチアス	3.6	3.7	14,892
ニチハ	1.9	2	6,760
鉄鋼（1.0%）			
日本製鉄	67.6	74.7	277,062
神戸製鋼所	26.5	33.3	69,680
合同製鐵	－	0.8	4,856
ＪＦＥホールディングス	37.8	46	120,704

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京製鐵	7.1	7.2	12,333
共英製鋼	3.5	3.5	8,505
大和工業	2.4	3.2	28,208
大阪製鐵	2.1	2.2	4,840
淀川製鋼所	2.2	2.3	11,109
丸一鋼管	4.9	4.6	18,735
モリ工業	—	0.5	2,840
大同特殊鋼	2.1	10.5	18,910
山陽特殊製鋼	3	3.1	7,201
愛知製鋼	1.1	1.2	4,692
大平洋金属	3.3	3.4	4,620
新日本電工	19.8	21.3	6,752
三菱製鋼	4	4.1	6,059
エンビプロ・ホールディングス	—	3.9	2,067
シンニッタン	12.5	7.6	2,302
非鉄金属（0.6%）			
日本軽金属ホールディングス	4.1	4.1	7,580
三井金属鉱業	4.1	4.9	22,711
東邦亜鉛	2.5	—	—
三菱マテリアル	9.5	11.5	34,166
住友金属鉱山	18.1	19.3	89,146
ＤＯＷＡホールディングス	4.1	4.2	22,495
古河機械金属	4.2	4.3	7,976
ＵＡＣＪ	3.5	3.4	15,351
古河電気工業	3.9	4	12,772
住友電気工業	54.2	57.5	135,585
フジクラ	20	20	41,950
タツタ電線	2.7	9.8	6,899
リョービ	4.5	4.5	13,342
ＡＲＥホールディングス	7.6	—	—
金属製品（0.5%）			
トーカロ	4.8	4.9	8,805
ＳＵＭＣＯ	26.9	28.9	72,250
東洋製罐グループホールディングス	8.2	8	20,780
横河ブリッジホールディングス	4	4	11,904
駒井ハルテック	1.6	1.1	2,428
三和ホールディングス	13.2	15.9	42,476
文化シヤッター	6.4	6.5	11,284

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三協立山	5.3	5.4	4,946
ＬＩＸＩＬ	23.5	25.7	49,755
ノーリツ	4.8	4.9	8,330
長府製作所	2.3	1.3	2,882
リンナイ	2.7	8.1	28,827
日東精工	9.6	9.7	5,965
東プレ	4.9	5	12,895
高周波熱錬	7	7.3	8,117
サンコール	—	2.6	1,274
パイオラックス	4.6	4.6	12,548
日本発條	15.6	13	19,636
三益半導体工業	2.5	2.6	7,995
機械（5.4%）			
日本製鋼所	5.2	4.5	13,684
三浦工業	6.2	6	17,838
タクマ	6.1	6.2	11,842
オークマ	1.5	1.6	11,771
芝浦機械	2.7	2.7	9,949
アマダ	22.6	22.2	40,137
アイダエンジニアリング	6	6.1	5,642
ＦＵＪＩ	5.4	5.5	14,899
牧野フライス製作所	1.9	2.1	13,146
オーエスジー	7.1	6	13,008
旭ダイヤモンド工業	10.7	10	9,760
ＤＭＧ森精機	9.2	10	39,790
ディスコ	2.4	7.7	407,792
日東工器	3	3.1	6,243
冨士ダイス	—	1.9	1,326
リケンＮＰＲ	—	1.4	4,221
島精機製作所	3.1	3.2	4,467
日阪製作所	5.2	5.3	5,517
ナブテスコ	8.7	9.5	25,151
ＳＭＣ	4.7	4.8	424,896
ユニオンツール	1.2	1.3	5,746
オイレス工業	4.3	4.4	10,181
サトーホールディングス	4	4.1	9,868
小松製作所	69.9	75.6	348,213
住友重機械工業	7.6	8.7	40,881

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日立建機	6.4	7.1	32,880
巴工業	2.4	2.4	10,176
井関農機	3.8	3.9	4,040
ＴＯＷＡ	－	1.9	19,152
ローツェ	1.2	1.2	24,948
タカキタ	10	8.1	3,985
クボタ	75.8	84.5	199,546
月島ホールディングス	4.8	4.9	7,183
帝国電機製作所	2.9	2.9	7,603
新東工業	3.7	3.8	4,392
小森コーポレーション	6.7	6.5	8,469
鶴見製作所	3.3	3.2	11,872
酒井重工業	－	0.4	2,764
荏原製作所	5.4	6.4	83,680
酉島製作所	4.5	4.5	12,244
ダイキン工業	17.6	19.3	399,896
オルガノ	－	2	15,000
栗田工業	7.9	9.3	60,468
椿本チエイン	2.1	2.2	11,550
ダイフク	7.8	27.4	95,735
タダノ	8.1	10.2	12,663
フジテック	5.6	5.2	20,035
ＣＫＤ	3.9	5.2	16,952
平和	3.9	3.9	8,002
ＳＡＮＫＹＯ	3.2	18.5	31,357
日本金銭機械	7.1	5.9	7,675
フクシマガリレイ	1.4	1.8	10,584
竹内製作所	4.1	3.8	21,926
アマノ	3.7	3.8	15,139
グローリー	4.2	4.2	12,217
大和冷機工業	5.9	5.9	8,932
セガサミーホールディングス	13.5	14.7	28,084
リケン	0.6	－	－
ホシザキ	8.8	9.4	51,756
大豊工業	6.4	6.5	6,181
日本精工	30.8	23.8	20,334
ＮＴＮ	40.1	40.1	12,920
ジェイテクト	14.9	11.1	15,617

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
不二越	1.7	1.8	6,336
日本トムソン	6.4	6.5	4,407
ＴＨＫ	8.9	8.9	29,734
ユーシン精機	6.1	5.6	3,841
キッツ	7.4	7.8	10,257
マキタ	18	19.1	81,079
日立造船	16.8	17	22,474
三菱重工業	25	28.3	381,059
ＩＨＩ	10.5	13	48,321
スター精密	3.7	4.8	8,918
電気機器（17.5%）			
日清紡ホールディングス	9	9.1	11,170
イビデン	8.8	9.3	62,356
コニカミノルタ	32.8	32.8	16,577
ブラザー工業	18.1	20.7	58,208
ミネベアミツミ	25.2	26.8	81,150
日立製作所	74	78	1,067,430
東芝	28.8	－	－
三菱電機	148.8	177.9	453,911
富士電機	8.9	9.8	95,148
安川電機	16.7	18.6	119,337
明電舎	3.9	4	11,188
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	－	6.7	25,929
ソシオネクスト	－	11.9	47,540
東芝テック	1.6	2	6,130
マブチモーター	3.8	6.6	18,592
ニデック	36	38.5	248,209
東光高岳	3.3	3.2	7,840
ダイヘン	2.2	2.2	20,636
ＪＶＣケンウッド	－	13	12,220
日新電機	4.4	－	－
オムロン	13.2	13.9	78,576
日東工業	3.5	3.5	15,487
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5.2	7.1	21,726
メルコホールディングス	1.7	1.5	5,130
テクノメディカ	1.8	3	5,325
日本電気	20	21.7	244,993
富士通	14.8	15.5	398,350

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
沖電気工業	4.7	6	7,104
サンケン電気	1.7	1.7	11,104
アイホン	2.7	2.8	8,526
ルネサスエレクトロニクス	93.1	105.4	273,354
セイコーエプソン	18	19.2	50,323
ワコム	14	15.2	10,229
アルバック	3.3	3.8	37,475
アクセル	－	1.1	2,359
ＥＩＺＯ	1.5	2	10,520
日本信号	5.2	5.3	5,501
能美防災	2.6	2.7	6,218
ホーチキ	3.9	3.9	8,607
エレコム	6.1	6.2	9,610
パナソニック　ホールディングス	170.1	189.4	277,944
シャープ	17.8	27.3	22,926
アンリツ	9.7	11.2	14,375
富士通ゼネラル	4.4	4.7	9,150
ソニーグループ	102.7	113.2	1,519,710
ＴＤＫ	23.9	25.2	189,201
アルプスアルパイン	12.5	13.8	16,014
日本トリム	1.3	1.7	6,630
ローランド　ディー．ジー．	－	0.6	3,288
フォスター電機	4.9	5	6,210
ヨコオ	2.5	2.8	4,256
ホシデン	5.9	5.9	11,623
ヒロセ電機	2.3	2.3	35,765
日本航空電子工業	3.8	3.9	10,089
アイコム	2.2	2.2	7,634
横河電機	14.7	17.3	61,276
アズビル	9.4	10.7	46,277
日本光電工業	6.2	6.9	28,269
堀場製作所	2.8	3.3	51,562
アドバンテスト	11.8	47.1	317,783
キーエンス	14.5	16	1,156,320
日置電機	1	1.2	8,400
シスメックス	12.2	13.8	116,209
日本マイクロニクス	－	2.9	23,780
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1.8	1.9	7,125

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コーセル	7.1	6.6	10,718
イリソ電子工業	1.9	1.9	5,956
オプテックスグループ	4.3	4.5	8,734
千代田インテグレ	2.4	2.4	6,362
レーザーテック	7.3	7.3	314,338
スタンレー電気	10.7	10.6	28,768
ウシオ電機	8.7	7.8	15,978
日本セラミック	1.9	3.1	8,562
図研	2.5	2.5	11,475
日本電子	3.4	4.3	28,212
カシオ計算機	12.2	12.3	15,780
ファナック	14.2	76.6	335,737
ローム	6.6	28.7	73,084
浜松ホトニクス	11.2	12	66,336
三井ハイテック	1.8	1.9	16,364
新光電気工業	5.8	5.8	33,152
京セラ	22.1	96	203,376
太陽誘電	7.9	8	28,832
村田製作所	44.2	143.2	419,074
双葉電子工業	7.7	3.5	1,778
ニチコン	6.1	6.3	8,152
日本ケミコン	3.8	3.9	5,674
ＫＯＡ	4.2	4.7	6,988
小糸製作所	16	17.9	35,549
ミツバ	7.5	8.2	13,308
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2.9	5.8	109,562
キヤノン電子	3.5	3.6	8,773
キヤノン	78.4	78.2	353,229
リコー	38.1	37.4	50,639
象印マホービン	4.1	4.7	6,800
東京エレクトロン	10.3	33.8	1,329,692
イノテック	2.8	2.9	5,834
輸送用機器（9.5%）			
トヨタ紡織	5.8	5.9	15,068
ユニプレス	7.3	7.3	8,657
豊田自動織機	11.1	13.5	213,975
モリタホールディングス	6.1	6.1	10,180
デンソー	30.3	130.3	382,039

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東海理化電機製作所	3.6	4.8	12,561
川崎重工業	11.8	13.7	68,212
日産自動車	199.1	223.4	138,865
いすゞ自動車	44.7	46.4	97,834
トヨタ自動車	793.4	877.9	3,335,142
日野自動車	21	24.2	12,538
三菱自動車工業	64.3	67.6	33,563
武蔵精密工業	5.3	6.1	10,302
日産車体	4.8	4.9	4,821
新明和工業	5.4	7.4	9,361
極東開発工業	4.2	4.3	11,524
トピー工業	3.3	3.3	9,982
ティラド	1.6	2	8,090
ＮＯＫ	7.6	5.6	11,860
フタバ産業	5.9	7.2	8,452
カヤバ	2.7	2.6	13,364
プレス工業	17.3	16.5	11,583
アイシン	10.4	11.7	70,656
マツダ	48.8	53.3	94,847
今仙電機製作所	5.9	3.6	2,336
本田技研工業	116.8	385.1	727,839
スズキ	27.4	29.5	194,169
ＳＵＢＡＲＵ	44.4	50.1	170,891
ヤマハ発動機	21.8	70.8	98,766
エクセディ	3.7	3.8	11,723
豊田合成	4.5	4.6	15,216
愛三工業	7.3	7.3	12,169
ヨロズ	4.3	4.4	4,496
エフ・シー・シー	3.3	4.9	10,868
シマノ	5.8	6.4	146,208
テイ・エス　テック	6.5	6.6	13,421
精密機器（2.3%）			
テルモ	46	47.6	271,653
クリエートメディック	4	2.5	2,467
島津製作所	18.7	20.2	89,284
ブイ・テクノロジー	2.2	2.7	6,795
東京計器	－	1.3	3,359
東京精密	2.6	3.6	41,796

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マニー	5.7	6	12,075
ニコン	23	23	37,858
トプコン	9	9.1	16,111
オリンパス	90.2	99.1	222,975
理研計器	1.5	1.5	11,610
タムロン	2.5	2.5	17,250
ＨＯＹＡ	31.3	31.8	631,548
朝日インテック	18.8	19.1	54,855
シチズン時計	20.8	20.8	21,049
メニコン	5.6	6.4	10,486
セイコーグループ	3.6	3.7	14,800
ニプロ	10.6	12.2	14,737
その他製品（2.3%）			
パラマウントベッドホールディングス	3.9	4	10,604
バンダイナムコホールディングス	13.4	43.7	126,598
アイフィスジャパン	4.4	2.7	1,717
パイロットコーポレーション	2	2.2	8,511
フジシールインターナショナル	3.4	3.4	6,664
タカラトミー	6.7	7.5	21,457
広済堂ホールディングス	－	5	3,345
タカノ	4.1	2.5	2,730
大建工業	3	－	－
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	20.7	18.8	69,748
大日本印刷	17.1	17.1	80,814
ＮＩＳＳＨＡ	4.2	5	7,205
アシックス	13.6	14.3	98,312
小松ウオール工業	2.2	2.3	7,659
ヤマハ	8.8	10.5	34,492
クリナップ	8.7	8.7	6,812
ピジョン	9.5	10.4	16,057
キングジム	6.3	6.7	5,969
リンテック	2.8	2.9	9,352
イトーキ	9.7	9.7	16,451
任天堂	92.1	100.5	841,989
三菱鉛筆	5	4.2	10,521
タカラスタンダード	3.7	3.8	7,322
コクヨ	6.8	5.2	13,124
オカムラ	6.5	6.5	14,859

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
美津濃	2.4	2.5	15,325
電気・ガス業（1.4%）			
東京電力ホールディングス	126.5	145.3	124,580
中部電力	50.7	56.4	113,589
関西電力	55.2	61.5	131,487
中国電力	22.1	27.3	31,476
北陸電力	14.7	15.8	12,451
東北電力	35.5	41.9	48,981
四国電力	14	14	16,660
九州電力	33.1	36.5	49,950
北海道電力	16.6	21.8	16,687
沖縄電力	5.1	7	7,980
電源開発	12.3	12	30,156
レノバ	4.5	7.1	8,775
東京瓦斯	29.3	33.8	120,091
大阪瓦斯	27.7	31.5	108,895
東邦瓦斯	7.1	6.5	21,547
北海道瓦斯	3.6	3.6	9,050
西部ガスホールディングス	2.2	2.3	4,427
静岡ガス	5.7	5.7	5,540
陸運業（2.5%）			
東武鉄道	14.9	16.9	66,670
相鉄ホールディングス	4.9	5.2	14,697
東急	38.6	43.1	88,161
京浜急行電鉄	19.7	21.5	28,928
小田急電鉄	20.1	26.7	58,366
京王電鉄	7.4	8.2	35,022
京成電鉄	9.8	10.2	64,464
富士急行	2.6	2.8	11,172
東日本旅客鉄道	25	29.2	262,508
西日本旅客鉄道	17.9	20	130,260
東海旅客鉄道	11.4	61.6	243,997
西武ホールディングス	21	20.7	47,030
西日本鉄道	3.6	3.7	9,096
ハマキョウレックス	－	1.4	5,320
近鉄グループホールディングス	14.8	15.9	73,887
阪急阪神ホールディングス	18.5	20.6	92,947
南海電気鉄道	6.7	7.2	22,924

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京阪ホールディングス	6.4	8.9	31,087
名古屋鉄道	14.6	15.7	34,744
ヤマトホールディングス	20.2	20.5	45,233
山九	3.6	4.3	23,443
センコーグループホールディングス	8.6	10	11,520
トナミホールディングス	0.6	0.6	2,757
ニッコンホールディングス	3.4	4.7	14,320
福山通運	2.4	2.4	8,832
セイノーホールディングス	6.4	9.9	21,690
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	3.5	3.6	7,347
九州旅客鉄道	10.3	10.3	36,966
ＳＧホールディングス	26.2	29	57,014
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	5	5.5	42,438
海運業（0.7%）			
日本郵船	40.2	46.1	194,818
商船三井	25.7	35.2	164,102
川崎汽船	14	13.6	85,557
飯野海運	10.7	8.9	11,685
空運業（0.4%）			
日本航空	34.3	39.7	113,145
ＡＮＡホールディングス	38.2	44	140,536
倉庫・運輸関連業（0.1%）			
三菱倉庫	3.9	3.5	17,223
三井倉庫ホールディングス	2.3	2.5	11,637
住友倉庫	5	5.1	13,142
東陽倉庫	13.9	1.6	2,494
安田倉庫	5.3	5.3	6,709
上組	7.6	7.6	26,014
キムラユニティー	6.5	3.5	5,904
キユーソー流通システム	3.6	3.6	3,718
エーアイテイー	3.9	3.9	6,887
情報・通信業（7.3%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	5.2	6.6	17,608
システナ	23.2	33.7	9,537
デジタルアーツ	1.6	1.7	7,531
日鉄ソリューションズ	2.2	2.3	11,868
ＴＩＳ	15.6	17	57,698
テクミラホールディングス	12.5	7.5	3,510

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
グリー	13.1	11.5	5,612
コーエーテクモホールディングス	10.3	10.3	18,509
三菱総合研究所	－	0.3	1,527
ブレインパッド	6	6.2	9,076
ＫＬａｂ	11.5	11.7	4,270
ポールトゥウィンホールディングス	－	5.2	2,579
ネクソン	36.4	38.3	103,410
エイチーム	6.6	8.4	5,384
コロプラ	9.8	9.8	5,929
サイバーリンクス	4.5	3.5	3,090
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2.8	2.9	4,471
ＳＨＩＦＴ	1.2	1.2	30,180
ティーガイア	3.1	3.1	6,472
セック	－	0.6	3,042
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4	4.4	10,113
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	3.4	3.5	35,840
ザッパラス	10.8	6.6	3,273
インターネットイニシアティブ	10	9.9	29,041
ラクス	9	9	19,206
チェンジホールディングス	5.6	5.6	7,173
マネーフォワード	4.3	4.3	27,735
電算システムホールディングス	2.5	2.5	6,672
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	－	6.2	10,409
フェイス	4	2.5	1,162
野村総合研究所	29.3	34.9	149,930
ＣＥホールディングス	10	6	3,324
日本システム技術	－	0.6	2,346
インテージホールディングス	4.7	4.7	7,665
東邦システムサイエンス	－	1	1,281
ラクスル	6.8	6.8	8,194
メルカリ	－	10.4	20,748
ウイングアーク１ｓｔ	－	1.6	4,960
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.4	3.1	3,627
Ｓａｎｓａｎ	7.9	7.6	13,558
ＪＭＤＣ	－	3.1	11,559
フジ・メディア・ホールディングス	10.8	12.2	22,807
オービック	5	5.1	118,192
ジャストシステム	3.4	3.4	9,166

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＬＩＮＥヤフー	218.8	229.7	91,535
トレンドマイクロ	8.5	7.6	58,489
日本オラクル	2.6	3	35,895
フューチャー	5.5	5.6	9,643
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3.9	3.9	7,363
ＳＢテクノロジー	2.8	2.8	5,908
オービックビジネスコンサルタント	2.3	3.2	22,720
伊藤忠テクノソリューションズ	7.5	－	－
大塚商会	8.5	8.6	58,058
サイボウズ	3.8	4	7,260
電通総研	2.5	2.6	13,000
デジタルガレージ	2.5	3.2	10,880
ウェザーニューズ	1	1.1	5,610
ビジネスエンジニアリング	－	0.3	1,153
日本エンタープライズ	33.5	22.7	2,951
ネットワンシステムズ	6.6	6.9	18,816
アルゴグラフィックス	2.5	2.6	11,310
エイベックス	5.3	5.3	6,964
ＢＩＰＲＯＧＹ	5.2	5.9	27,883
都築電気	－	0.8	1,950
ＴＢＳホールディングス	5.4	7.4	30,761
日本テレビホールディングス	9.8	12	25,680
テレビ朝日ホールディングス	3.7	5.1	10,725
スカパーＪＳＡＴホールディングス	15.5	17.6	18,462
テレビ東京ホールディングス	2.2	2.5	7,662
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	－	1.8	9,162
日本電信電話	185.7	4,778.6	861,103
ＫＤＤＩ	113	123.7	561,598
ソフトバンク	236.3	255.7	517,408
光通信	1.8	1.8	49,707
ＧＭＯインターネットグループ	6.9	7	20,370
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	9.4	8.8	25,080
ゼンリン	6.5	6.6	5,755
松竹	1	1.1	11,049
東宝	9.2	9.5	49,238
東映	0.4	0.6	11,760
ＮＴＴデータグループ	44	49.6	125,760
ビジネスブレイン太田昭和	2.9	2.9	6,374

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＤＴＳ	3.1	3.2	13,120
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7.8	7.9	48,553
カプコン	15.3	15.2	93,981
ＳＣＳＫ	10.6	12.3	36,075
ＮＳＷ	－	0.7	2,285
アイネス	3.9	4	6,404
ＴＫＣ	2	2.1	7,980
富士ソフト	1.6	3.8	23,104
ＮＳＤ	4.8	5.5	16,291
コナミグループ	6	6.4	66,560
福井コンピュータホールディングス	－	0.7	1,841
ＪＢＣＣホールディングス	－	0.9	3,082
ソフトバンクグループ	84.6	79.4	735,482
卸売業（7.4%）			
高千穂交易	－	0.3	1,197
伊藤忠食品	0.8	0.8	5,976
エレマテック	4.3	4.3	8,415
東京エレクトロン　デバイス	－	1.4	9,338
双日	17.7	19.8	80,586
アルフレッサ　ホールディングス	13.5	14.8	33,929
横浜冷凍	6.5	7.9	8,437
ラサ商事	－	2	4,012
アルコニックス	－	2.9	4,318
神戸物産	11.9	12.7	46,570
あい　ホールディングス	3.2	3.4	8,102
ダイワボウホールディングス	5.8	6.8	17,588
マクニカホールディングス	3.6	4.3	32,250
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3.4	3.4	4,386
レスターホールディングス	3	3.1	9,089
ＯＣＨＩホールディングス	3	2.1	3,645
ＴＯＫＡＩホールディングス	7.8	7.9	7,923
シップヘルスケアホールディングス	5	5.4	12,031
明治電機工業	2.8	2.9	4,500
コメダホールディングス	3.1	5.6	15,344
佐鳥電機	－	0.6	1,482
エコートレーディング	6	3.7	4,632
伯東	－	0.6	3,546
ナガイレーベン	3	2.6	6,198

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱食品	1.9	1.9	10,450
松田産業	2.3	2.4	6,148
第一興商	2.4	6.6	13,031
メディパルホールディングス	14.6	15.3	36,268
アズワン	2.4	2.4	13,262
尾家産業	3.2	2	3,498
ドウシシャ	3	3.2	6,832
リックス	－	0.4	1,584
橋本総業ホールディングス	4.3	4.3	6,269
日本ライフライン	6.4	6.7	8,482
進和	2.8	2.9	7,685
オーハシテクニカ	3.9	3.9	6,700
白銅	2	2.4	6,535
伊藤忠商事	95.4	114.1	753,402
丸紅	122.3	140	371,350
長瀬産業	7.2	5.9	15,714
豊田通商	13.9	14.8	155,104
兼松	4	6.7	17,138
三井物産	113.2	127.9	909,113
日本紙パルプ商事	1.1	1.1	5,907
山善	6.3	6.4	8,812
住友商事	93.4	102.3	380,658
内田洋行	1.1	1.2	8,400
三菱商事	96.7	335.7	1,192,070
キヤノンマーケティングジャパン	3.3	3.4	15,242
西華産業	3.5	3	10,365
菱洋エレクトロ	2.7	2.7	10,597
東京産業	4.7	5	3,650
阪和興業	3	3.2	19,136
岩谷産業	3.8	4	32,160
アステナホールディングス	12.2	12.3	5,854
三愛オブリ	5.6	4.6	9,641
稲畑産業	3.9	3.9	12,655
ワキタ	6.4	6.5	10,413
東邦ホールディングス	4	3.5	12,134
サンゲツ	3.8	4	13,480
シナネンホールディングス	1.6	1	4,840
伊藤忠エネクス	5.8	5.8	9,164

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンリオ	5.2	5	43,955
リョーサン	2.9	2.9	14,732
三信電気	2.6	2.7	6,069
モスフードサービス	2.2	2.8	9,730
加賀電子	2.3	2.3	14,605
ソーダニッカ	－	1.9	2,460
立花エレテック	2.5	2.6	8,775
フォーバル	4.6	4.7	5,983
ＰＡＬＴＡＣ	2.1	2.1	8,463
日鉄物産	1.3	－	－
トラスコ中山	4.3	4.4	10,854
オートバックスセブン	5.2	5	8,130
加藤産業	2	2	9,250
杉本商事	2.4	2.5	5,695
因幡電機産業	3.7	3	10,530
ミスミグループ本社	22.2	25.6	57,958
スズケン	5.8	6	28,026
ジェコス	5.2	5.2	6,136
グローセル	－	2.8	2,088
小売業（4.2%）			
ローソン	3.2	4.2	43,302
サンエー	1.7	1.6	7,528
エービーシー・マート	2	6.4	18,742
ハードオフコーポレーション	4.3	4.3	7,482
アスクル	5.3	4.2	8,933
ゲオホールディングス	4.3	4.3	8,376
アダストリア	2.7	2.9	11,484
ジーフット	8.9	8.1	2,300
エディオン	5.9	5.9	9,204
あみやき亭	1.9	1.8	8,901
ハニーズホールディングス	3.7	3.8	6,513
ジンズホールディングス	1.9	2	8,750
ビックカメラ	8.6	8.6	10,930
ＤＣＭホールディングス	8.2	7.1	10,635
ＭｏｎｏｔａＲＯ	21.9	24.5	44,663
Ｊ．フロント　リテイリング	18	20.7	33,854
ドトール・日レスホールディングス	5.3	4.6	9,604
マツキヨココカラ＆カンパニー	9.6	30.5	75,197

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ブロンコビリー	－	0.6	2,166
ＺＯＺＯ	11.5	10.9	43,785
トレジャー・ファクトリー	5.2	3.4	4,845
物語コーポレーション	－	2.8	12,880
三越伊勢丹ホールディングス	24.1	28.4	68,728
ウエルシアホールディングス	9	9.9	26,418
クリエイトＳＤホールディングス	2.1	2.5	8,087
シュッピン	4.3	4.4	5,513
オイシックス・ラ・大地	4.3	3.4	4,566
ジョイフル本田	4.5	4.6	10,386
すかいらーくホールディングス	18.9	22.6	53,369
ヨシックスホールディングス	－	0.8	2,428
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6	5.5	5,483
あさひ	3.4	3.5	4,672
コスモス薬品	1.6	1.7	24,310
トーエル	3.9	2.4	1,958
セブン＆アイ・ホールディングス	53.6	174.6	382,985
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11.6	12.6	13,192
ツルハホールディングス	3.6	3.6	41,364
サンマルクホールディングス	2.8	2.9	6,426
トリドールホールディングス	5.2	5.2	21,762
クスリのアオキホールディングス	1.5	5.2	16,806
力の源ホールディングス	－	1.9	3,072
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	10	10	30,150
ノジマ	4.8	5	8,525
カッパ・クリエイト	5.7	5.7	9,353
ライトオン	5.2	3.2	1,356
良品計画	18	18.2	44,189
パリミキホールディングス	5.5	3.4	1,468
アドヴァングループ	5.2	5.3	6,391
Ｇ－７ホールディングス	4.3	4.3	6,192
コーナン商事	2.5	2.5	10,812
エコス	2.9	2.9	6,728
マルシェ	11.8	－	－
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	33.4	34.6	137,915
西松屋チェーン	5.6	5.7	14,295
ゼンショーホールディングス	7.5	9.3	59,733
サイゼリヤ	2.9	3	15,270

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
魚力	2.4	2.5	6,100
ユナイテッドアローズ	3.1	3.1	6,200
ハイデイ日高	2.8	3.1	8,162
YU-WA Creation Holdings	12.3	－	－
コロワイド	6.8	7	15,620
壱番屋	1	6	7,236
スギホールディングス	3.2	9.6	24,964
薬王堂ホールディングス	2.6	2.7	7,281
スクロール	4.9	5.4	5,329
木曽路	2.4	3.4	9,169
千趣会	14	14.1	4,187
ケーヨー	7.5	－	－
上新電機	2.3	2.3	5,382
日本瓦斯	8	8.8	23,425
ロイヤルホールディングス	4.9	4.8	11,995
いなげや	3.6	3.8	5,301
チヨダ	2.8	2.8	2,466
ライフコーポレーション	2.1	2.1	8,158
ＡＯＫＩホールディングス	8.5	8.5	9,860
コメリ	1.7	1.7	6,120
青山商事	6	6	11,520
しまむら	1.8	3.6	32,713
高島屋	11.6	12.4	29,716
松屋	6.2	6.3	6,476
エイチ・ツー・オー　リテイリング	8.7	8.7	17,078
丸井グループ	12	13.4	33,165
アクシアル　リテイリング	2	2	8,280
イオン	52.9	56.8	202,889
イズミ	2.4	2.7	9,533
平和堂	3.1	3.1	6,262
フジ	3.2	2.4	4,478
ヤオコー	1.4	1.6	15,056
ゼビオホールディングス	3.5	3.5	3,475
ケーズホールディングス	13.1	9.8	13,117
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	1.3	1.3	8,424
ブックオフグループホールディングス	4.4	4.5	6,286
アインホールディングス	2.2	2.6	14,341
ヤマダホールディングス	55.7	57.7	25,936
アークランズ	－	3.2	5,638
ニトリホールディングス	6.3	6.6	155,892
吉野家ホールディングス	5.4	5.7	18,468
王将フードサービス	0.7	0.8	6,352
ミニストップ	3.2	3.2	4,886
アークス	3	3	9,420
バローホールディングス	3.9	2.8	7,011
大庄	－	2.2	2,750
ファーストリテイリング	6.9	7.6	356,136
サンドラッグ	5	5.6	27,059
ヤマザワ	2.3	1.4	1,751
ベルーナ	10.2	10.2	6,415
銀行業（7.4%）			
いよぎんホールディングス	11.9	17.4	20,679
しずおかフィナンシャルグループ	34.3	31.6	47,984
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	8.4	12.3	15,215
楽天銀行	－	6.2	18,383
京都フィナンシャルグループ	－	17.6	50,802
めぶきフィナンシャルグループ	59.5	72.8	35,832
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3.9	3.7	18,167
九州フィナンシャルグループ	16.4	26	30,290
ゆうちょ銀行	37.4	167.7	288,192
コンコルディア・フィナンシャルグループ	71.3	75.9	60,325
西日本フィナンシャルホールディングス	9.4	7.6	14,972
三十三フィナンシャルグループ	0.1	0.3	632
第四北越フィナンシャルグループ	2.8	2.8	12,866
ひろぎんホールディングス	13.2	19.1	21,010
おきなわフィナンシャルグループ	2	2	5,350
十六フィナンシャルグループ	2.5	2.3	11,028
北國フィナンシャルホールディングス	2.1	2	10,160
プロクレアホールディングス	2.6	2.6	5,025
あいちフィナンシャルグループ	4.2	4.2	11,335
ＳＢＩ新生銀行	6.2	－	－
あおぞら銀行	7.7	11.4	28,557
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	906.1	962	1,512,745
りそなホールディングス	177.3	189.2	174,915
三井住友トラスト・ホールディングス	25.8	55	183,480
三井住友フィナンシャルグループ	103.6	111.3	991,905

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
千葉銀行	45.5	39.5	51,231
群馬銀行	19.9	28.5	24,820
武蔵野銀行	1.3	1.4	4,256
千葉興業銀行	－	2.3	2,557
七十七銀行	4.8	4.8	19,512
秋田銀行	2.8	2.9	6,275
山形銀行	3.2	3.3	4,045
岩手銀行	2.9	2.9	7,827
東邦銀行	8.1	8.2	2,960
東北銀行	2.8	1.8	2,352
ふくおかフィナンシャルグループ	10.7	12.2	50,581
スルガ銀行	13.2	16.2	14,353
八十二銀行	22.4	31.7	33,094
山梨中央銀行	4.3	4.4	8,580
大垣共立銀行	3.1	3.1	7,195
福井銀行	1.5	1.6	3,252
滋賀銀行	3.1	3.1	13,578
南都銀行	3.1	3.1	9,594
百五銀行	12.3	12.4	8,283
京都銀行	4.5	－	－
紀陽銀行	4.7	4.7	9,155
ほくほくフィナンシャルグループ	9.2	9.3	18,153
山陰合同銀行	10.5	10.5	13,209
鳥取銀行	3	1.8	2,894
百十四銀行	4	4	11,928
阿波銀行	3	1.8	5,232
大分銀行	1.9	1.9	5,757
宮崎銀行	1.7	1.8	5,436
佐賀銀行	2.5	2.6	5,657
琉球銀行	8.4	8.4	10,340
セブン銀行	38.2	52.6	15,937
みずほフィナンシャルグループ	204.2	210.5	640,551
山口フィナンシャルグループ	11.5	14.4	23,644
長野銀行	3.9	－	－
名古屋銀行	1.6	1.7	11,271
北洋銀行	20.4	20.5	9,389
愛媛銀行	3.9	3.9	4,574
トマト銀行	3.1	1.9	2,525

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京葉銀行	11.4	11.4	8,949
栃木銀行	18.5	18.6	7,123
トモニホールディングス	13.9	14	6,034
フィデアホールディングス	2.6	3.8	6,342
池田泉州ホールディングス	35.2	35.3	14,331
証券、商品先物取引業（1.0%）			
ＦＰＧ	9.7	9.7	19,312
ＳＢＩホールディングス	20.8	22.1	89,549
ジャフコ　グループ	6.7	6.7	12,334
大和証券グループ本社	100.7	114.7	134,887
野村ホールディングス	256	266.8	263,865
岡三証券グループ	13.9	22.2	18,714
丸三証券	12.7	12.8	14,720
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20.1	26.8	16,857
いちよし証券	7.1	7.2	6,199
松井証券	9	12	10,452
マネックスグループ	19.6	21.3	19,255
極東証券	6.1	6.2	10,881
アイザワ証券グループ	7.4	6.4	7,558
保険業（2.7%）			
かんぽ生命保険	15.8	16.1	47,285
ＳＯＭＰＯホールディングス	24	25.9	249,468
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	31.8	34.3	274,502
第一生命ホールディングス	74.5	76.9	292,835
東京海上ホールディングス	142.4	154.8	740,872
Ｔ＆Ｄホールディングス	36.5	45.1	122,423
その他金融業（1.2%）			
全国保証	3.9	4	22,172
ジェイリース	－	2.4	3,024
クレディセゾン	11.1	10.5	34,188
芙蓉総合リース	1.6	1.7	23,103
みずほリース	2.1	3.2	18,016
東京センチュリー	3	10.4	17,170
日本証券金融	8.9	8.8	14,872
アイフル	35	35.1	14,566
リコーリース	1.6	1.7	9,435
イオンフィナンシャルサービス	9.5	9.4	12,652
アコム	31.6	31.7	12,743

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オリエントコーポレーション	7.5	7.6	8,466
オリックス	95.2	100	337,400
三菱ＨＣキャピタル	52.3	63.5	68,580
日本取引所グループ	38.5	42.3	171,315
アサックス	5.5	4	3,268
ＮＥＣキャピタルソリューション	2.3	2.3	9,188
不動産業（2.0%）			
大東建託	5.3	5.7	100,747
いちご	22.6	22.7	10,056
ヒューリック	34.1	36.1	55,612
野村不動産ホールディングス	9	10.3	41,993
プレサンスコーポレーション	－	2.8	4,958
オープンハウスグループ	5.5	6.5	31,271
東急不動産ホールディングス	46.7	47.5	56,287
飯田グループホールディングス	12.4	13.7	27,489
パーク２４	12.7	13	22,470
三井不動産	63.6	73.3	355,065
三菱地所	92.7	105.6	285,964
平和不動産	3.3	3.4	13,090
東京建物	14.8	15.9	38,438
京阪神ビルディング	4.1	5.6	8,730
住友不動産	26.9	23.7	125,681
テーオーシー	7.3	7.4	5,150
スターツコーポレーション	3.4	3.5	11,200
空港施設	7.5	7.6	4,666
ゴールドクレスト	3.5	3.6	8,812
エスリード	2.5	2.5	9,187
ＡＶＡＮＴＩＡ	6.5	3.9	3,334
イオンモール	7.7	7.9	13,923
カチタス	5	5.6	11,194
グランディハウス	－	2.3	1,559
日本空港ビルデング	5.6	5.9	35,305
サービス業（4.5%）			
ＭＩＸＩ	3.4	3.5	9,464
日本M&Aセンターホールディングス	27.6	32.6	32,172
ＵＴグループ	3.8	3.9	14,079
オープンアップグループ	－	4.4	9,006
コシダカホールディングス	－	7.9	7,457

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パソナグループ	2.9	3.5	10,031
エス・エム・エス	6.3	6.8	17,387
パーソルホールディングス	15.5	167	37,458
クックパッド	18.6	34	4,250
学情	3.7	3.7	6,460
スタジオアリス	2.2	2.9	5,930
シミックホールディングス	3.5	－	－
ＮＪＳ	2.5	2.5	7,850
綜合警備保障	5.4	27	23,392
カカクコム	12.8	12.9	24,516
アイロムグループ	2.5	2.6	4,934
ディップ	3.3	3.8	10,457
キャリアデザインセンター	3.3	1.8	3,160
ベネフィット・ワン	6.9	7.7	16,651
エムスリー	29.5	34.6	72,867
アウトソーシング	10.1	11.2	19,616
ディー・エヌ・エー	6.9	7.5	11,396
博報堂ＤＹホールディングス	20	19.9	27,322
ぐるなび	13.1	19	5,586
ファンコミュニケーションズ	11.3	11.4	4,594
ＷＤＢホールディングス	1.4	1.5	3,477
インフォマート	25	25	10,325
プレステージ・インターナショナル	－	7.7	5,028
クイック	3.4	3.4	8,007
電通グループ	14.9	15.9	66,954
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	3.9	4.7	12,013
日本空調サービス	7.2	7.3	6,526
オリエンタルランド	15.9	86.5	431,029
ダスキン	3.3	2.6	8,642
ラウンドワン	18.9	21	16,989
リゾートトラスト	6.9	7	18,312
ビー・エム・エル	2.8	2.9	8,613
りらいあコミュニケーションズ	4.7	－	－
リソー教育	20.8	20.9	4,702
早稲田アカデミー	4.8	4.6	7,594
ユー・エス・エス	17.4	17	44,752
サイバーエージェント	36.7	40.6	44,944
楽天グループ	68.4	146.2	127,647

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
テー・オー・ダブリュー	19	19	7,144
エン・ジャパン	4.6	4.6	12,659
テクノプロ・ホールディングス	9.7	9.7	29,895
インターワークス	8.7	－	－
アイ・アールジャパンホールディングス	3.2	2.5	3,455
ジャパンマテリアル	4.9	5	12,005
キャリアリンク	2	2.1	5,636
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.9	4	4,504
シグマクシス・ホールディングス	－	2.3	4,084
リクルートホールディングス	111	121.5	804,573
エラン	6.3	7.6	6,870
日本郵政	191.9	187.5	292,968
ソラスト	－	8.9	4,814
ベイカレント・コンサルティング	12.6	13	39,585
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4.4	4.5	5,485
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6.3	6.3	15,882
アンビスホールディングス	－	2.7	6,606
リログループ	9.5	11.2	13,882
ＴＲＥホールディングス	－	3.3	4,092
大栄環境	－	2.9	7,777
日本管財ホールディングス	－	3.3	8,556
共立メンテナンス	3.3	3.6	24,454
建設技術研究所	1.9	2	11,240
スバル興業	－	0.7	1,876
タナベコンサルティンググループ	－	1.1	1,161
東京都競馬	2.3	2.4	10,680
カナモト	3.6	4.3	11,455
トランス・コスモス	2.7	3.2	10,416
乃村工藝社	7.7	9.6	8,860
日本管財	3.2	－	－
白洋舎	2.7	1.7	4,661
セコム	15	16.1	187,806
セントラル警備保障	2.1	2.2	5,788
メイテックグループホールディングス	4.7	4.9	14,959
応用地質	3.3	3.4	7,718
船井総研ホールディングス	3.4	4.2	10,722
ベネッセホールディングス	5.9	5.9	15,254
イオンディライト	2	2.1	7,455
ダイセキ	3.4	3.4	12,869
ステップ	3	3.1	6,231
合計 株数・金額	16,788	24,652	63,465,634
合計 銘柄数＜比率＞	1,059	1,120	＜93.2%＞

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	4,445	－

○投資信託財産の構成

（2024年３月21日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	63,465,634	93.0
コール・ローン等、その他	4,795,409	7.0
投資信託財産総額	68,261,043	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年３月21日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	69,405,543,872
コール・ローン等	4,604,785,075
株式(評価額)	63,465,634,880
未収入金	126,114,800
未収配当金	92,220,420
未収利息	5,697
差入委託証拠金	1,116,783,000
(B) 負債	1,299,971,974
未払解約金	155,471,974
差入委託証拠金代用有価証券	1,144,500,000
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	68,105,571,898
元本	26,436,131,695
次期繰越損益金	41,669,440,203
(D) 受益権総口数	26,436,131,695口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	25,762円

(注) 当親ファンドの期首元本額は23,570,832,222円、期中追加設定元本額は9,750,457,094円、期中一部解約元本額は6,885,157,621円です。

＜元本の内訳＞

東京海上セレクション・日本株ＴＯＰＩＸ	18,082,699,952円
東京海上・ＴＯＰＩＸインデックスファンド＜適格機関投資家限定＞	3,407,951,099円
東京海上・世界インデックス・バランス６０＜適格機関投資家限定＞	2,056,355,122円
ＴＭＡ日本株式インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,099,815,347円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド２０３５	499,109,190円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド２０６５	312,033,236円
東京海上・世界インデックス・バランス４０＜適格機関投資家限定＞	287,279,152円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド２０４５	286,599,676円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド２０５５	189,381,591円
円資産インデックスバランス＜円奏会ベーシック＞（適格機関投資家専用）	63,608,763円
円資産バランスファンド２０１９－１２＜適格機関投資家限定＞	42,125,075円
円資産バランスファンド２０１９－０５＜適格機関投資家限定＞	38,961,010円
円資産バランスファンド２０１９－０９＜適格機関投資家限定＞	32,889,825円
円資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	27,257,386円
円資産バランスファンド２０１８－０９＜適格機関投資家限定＞	5,720,806円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	4,344,465円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

(注) 上記表中の１万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

(注) 2024年３月21日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。

・株式　1,611,450,000円

○損益の状況 (2023年３月21日～2024年３月21日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	1,199,376,325
受取配当金	1,175,825,352
受取利息	18,976
その他収益金	24,864,646
支払利息	△ 1,332,649
(B) 有価証券売買損益	18,798,352,774
売買益	19,482,497,952
売買損	△ 684,145,178
(C) 先物取引等取引損益	1,163,856,400
取引益	1,225,062,400
取引損	△ 61,206,000
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	21,161,585,499
(E) 前期繰越損益金	17,289,713,431
(F) 追加信託差損益金	10,755,467,141
(G) 解約差損益金	△ 7,537,325,868
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	41,669,440,203
次期繰越損益金(Ｈ)	41,669,440,203

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

(注) **(F)追加信託差損益金**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です。

(注) **(G)解約差損益金**は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

○お知らせ

従来ベンチマークに「配当を含まない指数」を採用していましたが、ベンチマークをより実態に近い「配当を含む指数」に変更することが顧客本位であると判断し、2023年10月１日付で所要の約款変更を行いました。

ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書　第19期（決算日　2024年11月11日）

（計算期間　2023年11月11日～2024年11月11日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、－印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
15期(2020年11月10日)	12,957	△0.9	386.816	△0.8	99.4	18,955
16期(2021年11月10日)	12,975	0.1	387.538	0.2	99.7	21,249
17期(2022年11月10日)	12,458	△4.0	372.013	△4.0	99.7	25,762
18期(2023年11月10日)	12,149	△2.5	362.801	△2.5	99.7	28,322
19期(2024年11月11日)	12,021	△1.1	359.078	△1.0	99.6	31,869

○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		債券組入比率
		騰落率		騰落率	
	円	%		%	%
（期　首）2023年11月10日	12,149	－	362.801	－	99.7
11月末	12,288	1.1	366.877	1.1	100.1
12月末	12,338	1.6	368.384	1.5	100.0
2024年１月末	12,248	0.8	365.748	0.8	99.9
２月末	12,286	1.1	366.902	1.1	100.0
３月末	12,271	1.0	366.497	1.0	100.1
４月末	12,131	△0.1	362.353	△0.1	100.1
５月末	11,937	△1.7	356.531	△1.7	99.7
６月末	11,968	△1.5	357.511	△1.5	100.0
７月末	11,956	△1.6	357.155	△1.6	100.1
８月末	12,097	△0.4	361.325	△0.4	99.9
９月末	12,131	△0.1	362.344	△0.1	100.1
10月末	12,070	△0.7	360.511	△0.6	99.6
（期　末）2024年11月11日	12,021	△1.1	359.078	△1.0	99.6

（注）騰落率は期首比です。

ベンチマークはNOMURA-BPI（総合）です。
NOMURA-BPI（総合）とは、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社（以下、NFRC）が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRC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などに関して一切責任を負うものではありません。

○運用経過

（2023年11月11日～2024年11月11日）

■期中の基準価額等の推移

期　首：12,149円
期　末：12,021円
騰落率：　△1.1％

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因
・保有する債券の利息収入

マイナス要因
・日銀によるマイナス金利の解除ならびにYCC（イールドカーブ・コントロール）政策の撤廃などを受けて、10年国債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

（注）ベンチマークは、期首（2023年11月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。
（注）ベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）です。

■投資環境

当期、10年国債利回りは上昇しました。

期初、米国長期金利が大幅に低下するなか、10年国債利回りもつられて低下（債券価格は上昇）しました。2024年１月以降は、米国長期金利が上昇したことや日銀によるマイナス金利解除への思惑が高まったことなどから、10年国債利回りは上昇基調となりました。３月の日銀金融政策決定会合におけるマイナス金利の解除ならびにYCC政策の撤廃後も、今後の追加利上げや国債買入減額観測が高まったことなどから、10年国債利回りは徐々に水準を切り上げる展開となりました。７月末に日銀が追加利上げを決定した後、株式市場が急落する局面で10年国債利回りは大幅に低下しましたが、株式市場が短期間で安定化に向かったことや衆議院選ならびに米国大統領選挙における財政拡張政策への警戒感から期末にかけて上昇し、1.0％程度の水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動することを目標に、ファンドとベンチマークのリスク特性値が近似するよう調整して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は1.1％下落しました。

■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△1.1％となり、ベンチマークの騰落率△1.0％にほぼ連動する値動きとなりました。

（主な差異要因）

プラス要因
・特にありません

マイナス要因
・保有する債券の時価評価の違いなどのテクニカル要因

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー（※）は、10月末現在、推定値で0.03％となっています。

※2024年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

○１万口当たりの費用明細

（2023年11月11日～2024年11月11日）

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

（2023年11月11日～2024年11月11日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	12,344,467	8,113,428
	地方債証券	99,851	－ （ 100,000）
	特殊債券	－	－ （ 100,000）
	社債券（投資法人債券を含む）	100,447	－ （ 208,764）

（注）金額は受渡代金です。（経過利子分は含まれていません）
（注）（ ）内は償還による減少分です。
（注）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）は含まれていません。

○利害関係人との取引状況等

（2023年11月11日～2024年11月11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

（2024年11月11日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	30,539,000	28,786,231	90.3	－	57.9	21.3	11.0
地方債証券	1,560,400 （1,560,400）	1,552,098 （1,552,098）	4.9 （4.9）	－ （－）	2.2 （2.2）	2.0 （2.0）	0.6 （0.6）
特殊債券（除く金融債）	100,000 （100,000）	98,367 （98,367）	0.3 （0.3）	－ （－）	－ （－）	0.3 （0.3）	－ （－）
普通社債券（含む投資法人債券）	1,287,493 （1,287,493）	1,303,022 （1,303,022）	4.1 （4.1）	－ （－）	1.3 （1.3）	2.2 （2.2）	0.6 （0.6）
合計	33,486,893 （2,947,893）	31,739,719 （2,953,488）	99.6 （9.3）	－ （－）	61.4 （3.5）	25.9 （4.5）	12.3 （1.3）

（注）（ ）内は非上場債で内書きです。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

（B）国内（邦貨建）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
国債証券	%	千円	千円	
第455回利付国債（２年）	0.005	175,000	174,329	2025/12/1
第456回利付国債（２年）	0.1	100,000	99,677	2026/1/1
第457回利付国債（２年）	0.1	100,000	99,635	2026/2/1
第458回利付国債（２年）	0.2	90,000	89,749	2026/3/1
第459回利付国債（２年）	0.2	100,000	99,683	2026/4/1
第460回利付国債（２年）	0.3	100,000	99,796	2026/5/1
第461回利付国債（２年）	0.4	140,000	139,892	2026/6/1
第462回利付国債（２年）	0.4	200,000	199,804	2026/7/1
第463回利付国債（２年）	0.4	60,000	59,928	2026/8/1
第464回利付国債（２年）	0.4	230,000	229,671	2026/9/1
第465回利付国債（２年）	0.4	27,000	26,954	2026/10/1
第146回利付国債（５年）	0.1	315,000	314,010	2025/12/20
第147回利付国債（５年）	0.005	332,000	330,147	2026/3/20
第148回利付国債（５年）	0.005	287,000	284,942	2026/6/20
第149回利付国債（５年）	0.005	351,000	347,963	2026/9/20
第150回利付国債（５年）	0.005	282,000	279,180	2026/12/20
第151回利付国債（５年）	0.005	260,000	257,067	2027/3/20
第152回利付国債（５年）	0.1	161,000	159,539	2027/3/20
第153回利付国債（５年）	0.005	293,000	289,346	2027/6/20
第154回利付国債（５年）	0.1	235,000	232,321	2027/9/20
第155回利付国債（５年）	0.3	74,000	73,501	2027/12/20
第156回利付国債（５年）	0.2	253,000	250,525	2027/12/20
第157回利付国債（５年）	0.2	94,000	92,963	2028/3/20
第158回利付国債（５年）	0.1	260,000	256,276	2028/3/20
第159回利付国債（５年）	0.1	102,000	100,359	2028/6/20
第160回利付国債（５年）	0.2	136,000	134,294	2028/6/20
第163回利付国債（５年）	0.4	230,000	228,523	2028/9/20
第164回利付国債（５年）	0.2	140,000	137,838	2028/12/20
第165回利付国債（５年）	0.3	115,000	113,685	2028/12/20
第166回利付国債（５年）	0.4	155,000	153,849	2028/12/20
第167回利付国債（５年）	0.4	210,000	208,217	2029/3/20
第168回利付国債（５年）	0.6	150,000	150,000	2029/3/20
第170回利付国債（５年）	0.6	128,000	127,884	2029/6/20
第173回利付国債（５年）	0.6	63,000	62,880	2029/9/20
第５回利付国債（40年）	2.0	73,000	70,627	2052/3/20
第６回利付国債（40年）	1.9	69,000	64,819	2053/3/20
第７回利付国債（40年）	1.7	84,000	74,840	2054/3/20
第８回利付国債（40年）	1.4	80,000	65,492	2055/3/20
第９回利付国債（40年）	0.4	124,000	72,854	2056/3/20
第10回利付国債（40年）	0.9	103,000	71,046	2057/3/20
第11回利付国債（40年）	0.8	92,000	60,371	2058/3/20
第12回利付国債（40年）	0.5	104,000	59,661	2059/3/20
第13回利付国債（40年）	0.5	114,000	63,844	2060/3/20
第14回利付国債（40年）	0.7	108,000	64,137	2061/3/20
第15回利付国債（40年）	1.0	126,000	82,410	2062/3/20
第16回利付国債（40年）	1.3	160,000	114,452	2063/3/20
第17回利付国債（40年）	2.2	72,000	66,918	2064/3/20
第１回利付国債（10年）	0.7	30,000	29,470	2033/12/20
第２回利付国債（10年）	1.0	10,000	10,034	2034/3/20
第341回利付国債（10年）	0.3	90,000	89,915	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	200,000	199,140	2026/3/20
第343回利付国債（10年）	0.1	195,000	193,898	2026/6/20
第344回利付国債（10年）	0.1	190,000	188,689	2026/9/20
第345回利付国債（10年）	0.1	190,000	188,476	2026/12/20
第346回利付国債（10年）	0.1	221,000	218,995	2027/3/20

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	
第347回利付国債（10年）	0.1	345,000	341,539	2027/6/20
第348回利付国債（10年）	0.1	145,000	143,347	2027/9/20
第349回利付国債（10年）	0.1	174,000	171,765	2027/12/20
第350回利付国債（10年）	0.1	252,000	248,391	2028/3/20
第351回利付国債（10年）	0.1	258,000	253,851	2028/6/20
第352回利付国債（10年）	0.1	357,000	350,670	2028/9/20
第353回利付国債（10年）	0.1	346,000	339,273	2028/12/20
第354回利付国債（10年）	0.1	336,000	328,806	2029/3/20
第355回利付国債（10年）	0.1	313,000	305,713	2029/6/20
第356回利付国債（10年）	0.1	430,000	419,065	2029/9/20
第357回利付国債（10年）	0.1	313,000	304,642	2029/12/20
第358回利付国債（10年）	0.1	304,000	295,506	2030/3/20
第359回利付国債（10年）	0.1	349,000	338,714	2030/6/20
第360回利付国債（10年）	0.1	280,000	271,311	2030/9/20
第361回利付国債（10年）	0.1	313,000	302,714	2030/12/20
第362回利付国債（10年）	0.1	341,000	329,058	2031/3/20
第363回利付国債（10年）	0.1	295,000	284,008	2031/6/20
第364回利付国債（10年）	0.1	297,000	285,250	2031/9/20
第365回利付国債（10年）	0.1	320,000	306,486	2031/12/20
第366回利付国債（10年）	0.2	325,000	312,763	2032/3/20
第367回利付国債（10年）	0.2	408,000	391,435	2032/6/20
第368回利付国債（10年）	0.2	310,000	296,580	2032/9/20
第369回利付国債（10年）	0.5	256,000	250,152	2032/12/20
第370回利付国債（10年）	0.5	285,000	277,761	2033/3/20
第371回利付国債（10年）	0.4	276,000	265,934	2033/6/20
第372回利付国債（10年）	0.8	319,000	317,162	2033/9/20
第373回利付国債（10年）	0.6	295,000	287,309	2033/12/20
第374回利付国債（10年）	0.8	229,000	226,341	2034/3/20
第375回利付国債（10年）	1.1	326,000	330,156	2034/6/20
第376回利付国債（10年）	0.9	101,000	100,138	2034/9/20
第１回利付国債（30年）	2.8	5,000	5,515	2029/9/20
第２回利付国債（30年）	2.4	6,000	6,548	2030/2/20
第３回利付国債（30年）	2.3	20,000	21,804	2030/5/20
第５回利付国債（30年）	2.2	20,000	21,945	2031/5/20
第21回利付国債（30年）	2.3	7,000	7,858	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	8,000	9,148	2036/3/20
第25回利付国債（30年）	2.3	5,000	5,604	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	11,000	12,446	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	8,000	9,142	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	20,000	22,847	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	50,000	56,390	2038/9/20
第31回利付国債（30年）	2.2	44,000	48,239	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	13,000	14,387	2040/3/20
第33回利付国債（30年）	2.0	40,000	42,452	2040/9/20
第34回利付国債（30年）	2.2	53,000	57,530	2041/3/20
第35回利付国債（30年）	2.0	40,000	42,151	2041/9/20
第36回利付国債（30年）	2.0	53,000	55,614	2042/3/20
第37回利付国債（30年）	1.9	64,000	65,933	2042/9/20
第38回利付国債（30年）	1.8	66,000	66,689	2043/3/20
第39回利付国債（30年）	1.9	73,000	74,746	2043/6/20
第40回利付国債（30年）	1.8	69,000	69,390	2043/9/20
第41回利付国債（30年）	1.7	71,000	70,089	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	65,000	63,974	2044/3/20
第43回利付国債（30年）	1.7	71,000	69,668	2044/6/20
第44回利付国債（30年）	1.7	74,000	72,387	2044/9/20

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	
第45回利付国債（30年）	1.5	101,000	95,122	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	87,000	81,712	2045/3/20
第47回利付国債（30年）	1.6	72,000	68,649	2045/6/20
第48回利付国債（30年）	1.4	81,000	74,230	2045/9/20
第49回利付国債（30年）	1.4	99,000	90,386	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	114,000	91,814	2046/3/20
第51回利付国債（30年）	0.3	75,000	53,505	2046/6/20
第52回利付国債（30年）	0.5	70,000	52,090	2046/9/20
第53回利付国債（30年）	0.6	87,000	65,954	2046/12/20
第54回利付国債（30年）	0.8	90,000	71,120	2047/3/20
第55回利付国債（30年）	0.8	93,000	73,178	2047/6/20
第56回利付国債（30年）	0.8	69,000	54,020	2047/9/20
第57回利付国債（30年）	0.8	104,000	81,075	2047/12/20
第58回利付国債（30年）	0.8	100,000	77,565	2048/3/20
第59回利付国債（30年）	0.7	95,000	71,582	2048/6/20
第60回利付国債（30年）	0.9	92,000	72,438	2048/9/20
第61回利付国債（30年）	0.7	83,000	61,926	2048/12/20
第62回利付国債（30年）	0.5	91,000	64,082	2049/3/20
第63回利付国債（30年）	0.4	92,000	62,663	2049/6/20
第64回利付国債（30年）	0.4	90,000	60,933	2049/9/20
第65回利付国債（30年）	0.4	85,000	57,203	2049/12/20
第66回利付国債（30年）	0.4	80,000	53,475	2050/3/20
第67回利付国債（30年）	0.6	101,000	71,097	2050/6/20
第68回利付国債（30年）	0.6	117,000	81,960	2050/9/20
第69回利付国債（30年）	0.7	107,000	76,697	2050/12/20
第70回利付国債（30年）	0.7	103,000	73,489	2051/3/20
第71回利付国債（30年）	0.7	118,000	83,796	2051/6/20
第72回利付国債（30年）	0.7	100,000	70,680	2051/9/20
第73回利付国債（30年）	0.7	93,000	65,425	2051/12/20
第74回利付国債（30年）	1.0	81,000	61,714	2052/3/20
第75回利付国債（30年）	1.3	76,000	62,377	2052/6/20
第76回利付国債（30年）	1.4	85,000	71,345	2052/9/20
第77回利付国債（30年）	1.6	99,000	87,021	2052/12/20
第78回利付国債（30年）	1.4	86,000	71,792	2053/3/20
第79回利付国債（30年）	1.2	55,000	43,474	2053/6/20
第80回利付国債（30年）	1.8	91,000	83,325	2053/9/20
第81回利付国債（30年）	1.6	62,000	54,009	2053/12/20
第82回利付国債（30年）	1.8	88,000	80,289	2054/3/20
第83回利付国債（30年）	2.2	94,000	93,663	2054/6/20
第84回利付国債（30年）	2.1	22,000	21,429	2054/9/20
第83回利付国債（20年）	2.1	15,000	15,282	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	60,000	61,065	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	20,000	20,452	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	20,000	20,506	2026/3/20
第87回利付国債（20年）	2.2	25,000	25,599	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	20,000	20,588	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	20,000	20,556	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	65,000	67,067	2026/9/20
第93回利付国債（20年）	2.0	8,000	8,282	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	8,000	8,301	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	16,000	16,748	2027/6/20
第99回利付国債（20年）	2.1	20,000	20,971	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	20,000	21,106	2028/3/20
第105回利付国債（20年）	2.1	20,000	21,166	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	20,000	21,241	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	8,000	8,490	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	25,000	26,333	2028/12/20

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	
第111回利付国債（20年）	2.2	11,000	11,788	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	10,000	10,671	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	5,000	5,348	2029/9/20
第115回利付国債（20年）	2.2	10,000	10,784	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	40,000	43,295	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	60,000	64,648	2030/3/20
第120回利付国債（20年）	1.6	25,000	26,326	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	30,000	32,169	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	35,000	37,333	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	58,000	63,029	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	40,000	43,233	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	45,000	49,298	2031/3/20
第126回利付国債（20年）	2.0	31,000	33,572	2031/3/20
第127回利付国債（20年）	1.9	25,000	26,922	2031/3/20
第128回利付国債（20年）	1.9	20,000	21,575	2031/6/20
第129回利付国債（20年）	1.8	28,000	30,028	2031/6/20
第130回利付国債（20年）	1.8	54,000	57,998	2031/9/20
第131回利付国債（20年）	1.7	45,000	48,037	2031/9/20
第132回利付国債（20年）	1.7	52,000	55,556	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	71,000	76,337	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	46,000	49,519	2032/3/20
第135回利付国債（20年）	1.7	40,000	42,781	2032/3/20
第136回利付国債（20年）	1.6	40,000	42,486	2032/3/20
第137回利付国債（20年）	1.7	28,000	29,967	2032/6/20
第138回利付国債（20年）	1.5	47,000	49,606	2032/6/20
第139回利付国債（20年）	1.6	52,000	55,258	2032/6/20
第140回利付国債（20年）	1.7	78,000	83,527	2032/9/20
第141回利付国債（20年）	1.7	86,000	92,100	2032/12/20
第142回利付国債（20年）	1.8	72,000	77,686	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	124,000	131,867	2033/3/20
第144回利付国債（20年）	1.5	92,000	97,078	2033/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	211,000	226,010	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	131,000	140,283	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	127,000	134,763	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	126,000	132,405	2034/3/20
第149回利付国債（20年）	1.5	125,000	131,165	2034/6/20
第150回利付国債（20年）	1.4	177,000	183,763	2034/9/20
第151回利付国債（20年）	1.2	192,000	195,344	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	195,000	197,915	2035/3/20
第153回利付国債（20年）	1.3	172,000	175,849	2035/6/20
第154回利付国債（20年）	1.2	161,000	162,638	2035/9/20
第155回利付国債（20年）	1.0	170,000	167,818	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	198,000	182,266	2036/3/20
第157回利付国債（20年）	0.2	175,000	156,537	2036/6/20
第158回利付国債（20年）	0.5	175,000	161,532	2036/9/20
第159回利付国債（20年）	0.6	162,000	150,690	2036/12/20
第160回利付国債（20年）	0.7	160,000	150,022	2037/3/20
第161回利付国債（20年）	0.6	166,000	153,085	2037/6/20
第162回利付国債（20年）	0.6	176,000	161,627	2037/9/20
第163回利付国債（20年）	0.6	166,000	151,798	2037/12/20
第164回利付国債（20年）	0.5	171,000	153,602	2038/3/20
第165回利付国債（20年）	0.5	141,000	125,994	2038/6/20
第166回利付国債（20年）	0.7	150,000	137,098	2038/9/20
第167回利付国債（20年）	0.5	178,000	157,369	2038/12/20
第168回利付国債（20年）	0.4	170,000	147,395	2039/3/20
第169回利付国債（20年）	0.3	150,000	127,369	2039/6/20
第170回利付国債（20年）	0.3	137,000	115,623	2039/9/20

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	
第171回利付国債（20年）	0.3	135,000	113,238	2039/12/20
第172回利付国債（20年）	0.4	159,000	134,738	2040/3/20
第173回利付国債（20年）	0.4	170,000	143,187	2040/6/20
第174回利付国債（20年）	0.4	192,000	160,727	2040/9/20
第175回利付国債（20年）	0.5	158,000	133,773	2040/12/20
第176回利付国債（20年）	0.5	158,000	133,059	2041/3/20
第177回利付国債（20年）	0.4	160,000	131,702	2041/6/20
第178回利付国債（20年）	0.5	157,000	130,859	2041/9/20
第179回利付国債（20年）	0.5	163,000	135,110	2041/12/20
第180回利付国債（20年）	0.8	154,000	133,903	2042/3/20
第181回利付国債（20年）	0.9	173,000	152,390	2042/6/20
第182回利付国債（20年）	1.1	130,000	118,021	2042/9/20
第183回利付国債（20年）	1.4	157,000	149,239	2042/12/20
第184回利付国債（20年）	1.1	71,000	63,967	2043/3/20
第185回利付国債（20年）	1.1	130,000	116,667	2043/6/20
第186回利付国債（20年）	1.5	132,000	126,424	2043/9/20
第187回利付国債（20年）	1.3	85,000	78,455	2043/12/20
第188回利付国債（20年）	1.6	104,000	100,653	2044/3/20
第189回利付国債（20年）	1.9	106,000	107,457	2044/6/20
第190回利付国債（20年）	1.8	28,000	27,857	2044/9/20
小計		30,539,000	28,786,231	
地方債証券				
第781回東京都公募公債	0.16	100,000	98,274	2028/6/20
第26回神奈川県公募公債（20年）	1.477	20,000	20,754	2034/6/20
第６回大阪府公募公債（20年）	1.98	50,000	53,543	2030/9/13
平成28年度第２回京都府公募公債（15年）	0.21	50,000	48,250	2031/4/22
第２回兵庫県公募公債（15年）	1.51	100,000	101,966	2026/12/28
第４回静岡県公募公債（20年）	2.29	100,000	103,989	2027/3/19
平成31年度第１回愛知県公募公債（10年）	0.09	100,000	97,343	2029/4/26
平成29年度第７回広島県公募公債	0.2	100,000	98,584	2028/3/23
第４回埼玉県公募公債（10年）	0.995	100,000	99,482	2034/5/19
平成27年度第３回福岡県公募公債	0.529	200,000	200,218	2025/8/25
令和４年度第１回長野県公募公債（10年）	0.299	100,000	96,109	2032/4/23
第24回群馬県公募公債（10年）	0.08	100,000	95,258	2031/8/18

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
令和４年度第２回熊本県公募公債（５年）	0.11	140,400	138,600	2027/7/29
平成24年度第２回福井県公募公債	1.711	100,000	106,370	2032/12/21
令和元年度第２回徳島県公募公債	0.09	100,000	96,873	2029/11/28
令和元年度第３回岡山県公募公債（10年）	0.05	100,000	96,485	2030/3/27
小計		1,560,400	1,552,098	
特殊債券（除く金融債）				
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	98,367	2028/5/31
小計		100,000	98,367	
普通社債券（含む投資法人債券）				
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	100,105	2025/3/25
第536回関西電力株式会社社債	0.44	100,000	96,308	2030/12/20
第33回道路債券	2.91	100,000	115,773	2034/6/20
第23回国際協力銀行債券	2.09	100,000	101,712	2025/12/19
第101回都市再生債券	0.935	100,000	100,709	2029/11/20
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	20,141	20,566	2046/11/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	22,636	23,092	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	21,576	22,011	2047/1/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	23,140	23,637	2047/4/10
第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	100,000	98,749	2027/6/18
第21回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.22	100,000	98,707	2027/6/2
第80回三菱商事株式会社無担保社債	1.485	100,000	102,321	2028/9/8
第32回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	0.967	100,000	100,131	2029/6/20
第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	100,000	98,965	2026/12/18
第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.633	100,000	101,889	2026/12/22
第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	100,000	98,345	2028/6/6
小計		1,287,493	1,303,022	
合計		33,486,893	31,739,719	

（注）株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

（注）永久債は、実質的な償還日を記載しています。

○投資信託財産の構成

（2024年11月11日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	31,739,719	99.5
コール・ローン等、その他	151,434	0.5
投資信託財産総額	31,891,153	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年11月11日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	31,891,153,157
コール・ローン等	95,212,423
公社債(評価額)	31,739,719,674
未収利息	51,386,296
前払費用	4,834,764
(B) 負債	21,303,659
未払解約金	21,303,659
(C) 純資産総額(A－B)	31,869,849,498
元本	26,511,945,773
次期繰越損益金	5,357,903,725
(D) 受益権総口数	26,511,945,773口
１万口当たり基準価額(C／D)	12,021円

(注) 当親ファンドの期首元本額は23,312,003,573円、期中追加設定元本額は7,523,090,161円、期中一部解約元本額は4,323,147,961円です。

＜元本の内訳＞

東京海上セレクション・日本債券インデックス	4,939,814,254円
東京海上・世界インデックス・バランス６０＜適格機関投資家限定＞	4,837,761,695円
円資産インデックスバランス＜円奏会ベーシック＞(適格専用)	3,006,372,750円
円資産バランスファンド２０１９－１２＜適格機関投資家限定＞	2,203,739,520円
円資産バランスファンド２０１９－０５＜適格機関投資家限定＞	2,171,148,061円
円資産バランスファンド２０１９－０９＜適格機関投資家限定＞	1,720,624,532円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年１回決算型)	1,653,366,737円
円資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	1,369,634,684円
東京海上・世界インデックス・バランス４０＜適格機関投資家限定＞	1,319,764,350円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド２０３５	1,285,380,632円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド２０４５	633,534,181円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド２０６５	505,677,614円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド２０５５	366,608,719円
円資産バランスファンド２０１８－０９＜適格機関投資家限定＞	299,312,034円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	185,279,783円
TMA日本債券インデックスVA＜適格機関投資家限定＞	13,926,227円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の１万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2023年11月11日～2024年11月11日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	196,925,235
受取利息	196,931,793
支払利息	△ 6,558
(B) 有価証券売買損益	△ 528,412,335
売買益	45,162,510
売買損	△ 573,574,845
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 331,487,100
(D) 前期繰越損益金	5,010,067,532
(E) 追加信託差損益金	1,618,205,638
(F) 解約差損益金	△ 938,882,345
(G) 計(C＋D＋E＋F)	5,357,903,725
次期繰越損益金(G)	5,357,903,725

(注) **(B)有価証券売買損益**は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) **(E)追加信託差損益金**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です。

(注) **(F)解約差損益金**は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書　第19期（決算日　2024年11月11日）

（計算期間　2023年11月11日～2024年11月11日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、－印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

○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	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
15期(2020年11月10日)	28,804	8.7	1,357,341	9.2	94.8	2.8	2.2	27,743
16期(2021年11月10日)	40,956	42.2	1,931,538	42.3	95.3	2.5	2.2	61,829
17期(2022年11月10日)	42,274	3.2	1,994,363	3.3	95.8	2.1	2.2	104,312
18期(2023年11月10日)	51,021	20.7	2,415,077	21.1	96.8	1.2	1.9	173,295
19期(2024年11月11日)	69,379	36.0	3,301,718	36.7	97.2	0.9	1.9	294,602

（注）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、MSCIコクサイ指数（配当込み、円ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値（TTM）を用いて計算しているため、基準日前日のMSCIコクサイ指数（米ドルベース）を基準日のTTMで委託会社が円換算したものを使用しています。
MSCIコクサイ指数とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用などすることは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

○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		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2023年11月10日	51,021	－	2,415,077	－	96.8	1.2	1.9
11月末	52,063	2.0	2,460,562	1.9	96.0	3.7	1.9
12月末	52,972	3.8	2,507,430	3.8	96.0	3.8	2.1
2024年１月末	56,238	10.2	2,657,967	10.1	97.9	1.3	2.0
２月末	58,900	15.4	2,787,384	15.4	98.1	1.3	1.9
３月末	61,312	20.2	2,905,434	20.3	98.3	1.4	1.9
４月末	62,116	21.7	2,944,494	21.9	95.8	3.7	1.8
５月末	63,569	24.6	3,015,925	24.9	96.4	2.8	1.8
６月末	67,437	32.2	3,201,194	32.6	96.7	2.7	1.8
７月末	63,705	24.9	3,021,760	25.1	96.3	3.1	1.9
８月末	62,588	22.7	2,970,217	23.0	95.9	3.5	1.9
９月末	63,271	24.0	3,006,814	24.5	96.3	2.9	2.0
10月末	68,046	33.4	3,235,867	34.0	96.8	2.1	2.0
(期末) 2024年11月11日	69,379	36.0	3,301,718	36.7	97.2	0.9	1.9

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

○運用経過

（2023年11月11日～2024年11月11日）

■期中の基準価額等の推移

期　首：51,021円
期　末：69,379円
騰落率：　36.0％

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

・米国において利下げ期待が高まるなか、期後半には利下げが実施されたこと
・半導体企業の好決算などを受けて、AI（人工知能）関連市場拡大への期待が高まったこと

マイナス要因

・米国において景気減速懸念が高まる場面があったこと

（注）ベンチマークは、期首（2023年11月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。
（注）ベンチマークは、MSCIコクサイ指数（配当込み、円ヘッジなし・円ベース）です。

■投資環境

当期の外国株式市場は上昇しました。

期前半は、FRB（米連邦準備制度理事会）による利下げ期待が高まったことや、米国の堅調な経済指標によって景気減速への懸念が後退したこと、さらに米国大手半導体企業の決算が事前予想を上回ったことでAI関連市場拡大への期待が高まったことなどから、外国株式市場は上昇しました。

期後半に入ると、低調な米国雇用統計を受けて景気減速懸念が高まり、2024年８月初旬に外国株式市場は下落しましたが、その後はFRBによる利下げ期待が高まるなか、９月には利下げが実施されたことなどから、外国株式市場は上昇に転じました。

期末にかけては米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことにより、今後の政策に対する期待感から外国株式市場は上昇し、期初から大幅に上昇した水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ指数（配当込み、円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果の達成を目標として運用を行いました。

個別銘柄の選択は、最適化法を用いてファンドとベンチマークのリスク特性がほぼ一致するように調整しました。その結果、保有銘柄数は前期末の1,050銘柄に対して、当期末には1,030銘柄となりました。また、期中の設定・解約に応じて外国株式指数先物と現物株式の売買を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は36.0％上昇しました。

■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＋36.0％となり、ベンチマークの騰落率＋36.7％にほぼ連動しました。

（主な差異要因）

プラス要因

・特にありません

マイナス要因

・配当課税や売買コストなどの影響

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー(※)は、過去１年で0.16％となりました。

※毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。ファンドとベンチマークで外貨建資産を円換算する際の為替レートが異なる点を考慮して、トラッキングエラーを算出しています。

○今後の運用方針

ファンドの基本方針に基づき、外国株式指数先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100％に維持し、ベンチマークとの連動性を高位に保つことを目指して運用します。

○１万口当たりの費用明細

（2023年11月11日～2024年11月11日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	6	0.010	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ＊売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(5)	(0.008)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(1)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	5	0.009	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ＊有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(5)	(0.009)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	10	0.016	(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）	(10)	(0.016)	＊保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(0)	(0.000)	＊その他は、信託事務等に要する諸費用
合計	21	0.035	
期中の平均基準価額は、61,018円です。			

（注）各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

（2023年11月11日～2024年11月11日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
外国	アメリカ	百株 23,180 (9,412)	千米ドル 291,779 (4,251)	百株 2,409 (147)	千米ドル 20,796 (2,292)
	カナダ	2,573 (362)	千カナダドル 17,510 (144)	407 (—)	千カナダドル 611 (144)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,574	8,404	969 (—)	517 (98)
	イタリア	2,159	2,127	23	61
	フランス	1,475 (204)	10,161 (15)	480 (—)	611 (136)
	オランダ	1,360 (87)	5,754 (266)	310 (50)	500 (181)
	スペイン	4,373 (2,703)	2,976 (69)	3,106 (—)	559 (0.86946)
	ベルギー	107 (16)	666 (135)	104 (—)	142 (135)
	オーストリア	15	65	—	—
	ルクセンブルク	116	219	—	—
	フィンランド	1,713	1,909	103	97
	アイルランド	48	330	77 (49)	320 (692)
	ポルトガル	491	293	—	—
	その他	16	181	— (—)	— (7)
	イギリス	20,428 (405)	千英ポンド 12,888 (791)	2,153 (342)	千英ポンド 914 (1,839)
	スイス	934	千スイスフラン 8,877	11 (—)	千スイスフラン 181 (85)
	スウェーデン	2,455	千スウェーデンクローナ 40,072	704	千スウェーデンクローナ 8,909
	ノルウェー	515	千ノルウェークローネ 7,502	—	千ノルウェークローネ —
	デンマーク	480 (4)	千デンマーククローネ 28,975 (106)	37 (—)	千デンマーククローネ 1,869 (106)
	オーストラリア	4,818	千豪ドル 11,484	590	千豪ドル 1,069
	ニュージーランド	328	千ニュージーランドドル 368	—	千ニュージーランドドル —
	香港	10,626	千香港ドル 32,747	1,408	千香港ドル 8,813

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	シンガポール	百株 4,034 (39)	千シンガポールドル 2,366 (—)	百株 943	千シンガポールドル 591

(注) 金額は受渡代金です。
(注) ( )内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

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	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	0.637	81	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	2	584	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.918	185	—	—
	BXP, INC.	1	121	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.66	77	—	—
	CROWN CASTLE INC	2	258	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2	359	—	—
	EQUINIX INC	0.501	411	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	0.321	23	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	1	94	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.378	101	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2	351	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9	176	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	3	70	—	—
	INVITATION HOMES INC	2	78	0.606	20
	IRON MOUNTAIN INC	9	1,111	—	—
	KIMCO REALTY CORP	4	86	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	0.807	117	—	—
	PROLOGIS INC	5	697	—	—
	PUBLIC STORAGE	0.983	297	—	—
	REALTY INCOME CORP	10	622	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	0.798	56	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	2	351	—	—
	SUN COMMUNITIES INC	0.699	93	—	—
	UDR INC	1	44	—	—
	VENTAS INC	2	123	—	—
	VICI PROPERTIES INC	9	308	—	—
	WP CAREY INC	0.352	21	—	—
	WELLTOWER INC	6	695	0.241	21
	WEYERHAEUSER CO	4	161	—	—
	小計	92	7,768	0.847	41
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2	44	14	275
	小計	2	44	14	275

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	—	—	— (—)	— (0.70092)
	GECINA SA	0.615	61	—	—
	COVIVIO	1	55	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2	215	— (—)	— (10)
	小計	4	332	— (—)	— (11)
	ユーロ計	4	332	— (—)	— (11)
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	SEGRO PLC	1	13	—	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1	11	—	—
	小計	3	25	—	—
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	34	73	—	—
	GPT GROUP	24	115	—	—
	STOCKLAND	57	261	—	—
	DEXUS/AU	18	132	—	—
	GOODMAN GROUP	13	417	—	—
	SCENTRE GROUP	63	192	—	—
	小計	210	1,193	—	—
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	38	1,380	—	—
	小計	38	1,380	—	—
	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	48	95	— (—)	— (0.736)
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	192	296	266 (—)	358 (3)
	小計	240	392	266 (—)	358 (4)

(注) 金額は受渡代金です。
(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。
(注) ( )内は分割・償還による増減分で、上段の数字には含まれていません。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 65,923	百万円 65,961	百万円 —	百万円 —

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

○株式売買比率

(2023年11月11日～2024年11月11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	62,936,606千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	225,455,025千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.27

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注) (c)は、小数点以下２位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2023年11月11日～2024年11月11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

(2024年11月11日現在)

外国株式

銘　　柄	期首(前期末)	当　期　末			業　種　等
	株　数	株　数	評　価　額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	116	146	1,584	242,638	保険
AES CORPORATION	203	252	343	52,644	公益事業
AT&T INC	1,566	1,999	4,467	684,085	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	372	475	5,541	848,682	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	386	506	10,113	1,548,713	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	102	126	6,260	958,759	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	362	467	6,911	1,058,379	半導体・半導体製造装置
AGILENT TECHNOLOGIES INC	63	84	1,149	176,031	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIRBNB INC-CLASS A	101	134	1,809	277,075	消費者サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	48	63	1,995	305,609	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	39	45	405	62,080	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	31	50	509	78,031	素材
ALIGN TECHNOLOGY INC	20	23	516	79,154	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	60	60	349	53,593	公益事業
ALLSTATE CORP	60	76	1,513	231,818	保険
ALLY FINANCIAL INC	84	133	501	76,828	金融サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	1,170	1,422	25,581	3,917,549	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	1,301	1,675	29,874	4,574,983	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	370	445	2,407	368,675	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	2,033	2,655	55,273	8,464,640	一般消費財・サービス流通・小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMEREN CORPORATION	58	67	608	93,187	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	102	149	1,444	221,159	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	136	166	4,789	733,493	金融サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	14	21	295	45,243	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	158	175	1,327	203,326	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	43	56	769	117,917	公益事業
CENCORA INC	38	51	1,269	194,430	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	24	29	1,625	248,945	金融サービス
AMETEK INC	40	59	1,141	174,810	資本財
AMGEN INC	117	155	5,055	774,249	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	127	367	2,711	415,200	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES	108	139	3,149	482,308	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	22	23	818	125,344	ソフトウェア・サービス
ELEVANCE HEALTH INC	49	61	2,609	399,581	ヘルスケア機器・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	102	127	2,067	316,633	金融サービス
APPLE INC	3,455	4,121	93,552	14,326,553	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	191	239	4,604	705,161	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	102	—	—	—	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	122	144	751	115,085	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	63	80	3,226	494,033	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	15	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	15	17	361	55,377	保険
ATLASSIAN CORP-CL A	—	52	1,240	189,985	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	37	42	610	93,492	公益事業
AUTODESK INC	53	67	2,056	314,873	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	92	112	3,419	523,643	商業・専門サービス
AUTOZONE INC	4	4	1,523	233,379	一般消費財・サービス流通・小売り
AVANTOR INC	187	228	515	78,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVERY DENNISON CORP	17	20	424	64,957	素材
AXON ENTERPRISE INC	20	25	1,513	231,758	資本財
BAKER HUGHES COMPANY	257	319	1,376	210,761	エネルギー
BALL CORP	72	87	524	80,313	素材
BANK OF AMERICA CORP	1,555	1,981	8,942	1,369,442	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	160	233	1,798	275,375	金融サービス
BAXTER INTL INC	125	156	542	83,093	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	61	76	1,768	270,874	ヘルスケア機器・サービス
WR BERKLEY CORP	49	96	584	89,471	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	280	370	17,151	2,626,545	金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	47	66	596	91,317	一般消費財・サービス流通・小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A	7	9	332	50,892	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	48	78	524	80,381	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	29	42	739	113,205	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	46	58	445	68,224	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	31	—	—	—	金融サービス
BLACKSTONE INC	168	214	3,804	582,685	金融サービス
BLACKROCK INC	—	41	4,362	668,134	金融サービス
BOEING CO	128	209	3,181	487,189	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	8	10	4,958	759,283	消費者サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	36	40	748	114,596	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	82	—	—	—	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	322	426	3,765	576,627	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	446	569	3,084	472,412	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	30	34	775	118,813	商業・専門サービス
BROADCOM INC	91	1,262	23,186	3,550,763	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	65	75	843	129,165	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	78	83	338	51,858	食品・飲料・タバコ
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	46	826	126,593	資本財
BURLINGTON STORES INC	19	23	614	94,067	一般消費財・サービス流通・小売り
CBOE GLOBAL MARKETS INC	25	31	626	96,018	金融サービス
CBRE GROUP INC - A	70	93	1,270	194,618	不動産管理・開発
CDW CORP/DE	33	39	798	122,309	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	55	53	451	69,160	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	26	38	420	64,388	運輸
THE CIGNA GROUP	64	77	2,470	378,289	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	78	97	2,194	336,141	金融サービス
CMS ENERGY CORP	75	95	640	98,043	公益事業
CSX CORP	424	493	1,775	271,825	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	275	351	1,950	298,624	ヘルスケア機器・サービス
COTERRA ENERGY INC	214	300	737	112,936	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC	65	80	2,435	372,988	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	51	67	307	47,063	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	87	114	2,124	325,409	金融サービス
CARDINAL HEALTH INC	65	75	910	139,466	ヘルスケア機器・サービス
CARLISLE COS INC	14	16	730	111,918	資本財
CARMAX INC	49	63	479	73,423	一般消費財・サービス流通・小売り
CARLYLE GROUP INC/THE	91	112	590	90,459	金融サービス
CARRIER GLOBAL CORP	200	253	1,940	297,139	資本財
CATALENT INC	55	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	114	139	5,468	837,405	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	32	40	342	52,503	素材
CELSIUS HOLDINGS INC	—	73	211	32,361	食品・飲料・タバコ
CENTENE CORP	122	161	973	149,122	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	185	192	583	89,360	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	16	24	530	81,241	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	21	28	1,104	169,181	メディア・娯楽
CHENIERE ENERGY INC	61	65	1,348	206,489	エネルギー
CHEVRONTEXACO CORP	407	481	7,552	1,156,648	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	6	423	2,490	381,393	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	60	69	739	113,313	家庭用品・パーソナル用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	38	43	643	98,527	保険
CISCO SYSTEMS INC	869	1,100	6,391	978,835	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	18	105	2,391	366,234	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	402	545	3,746	573,677	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	141	137	631	96,636	銀行
CLEVELAND-CLIFFS INC	186	—	—	—	素材
CLOROX COMPANY	31	37	619	94,796	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	82	106	975	149,354	ソフトウェア・サービス
COCA-COLA COMPANY	875	1,124	7,189	1,101,004	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	49	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	108	125	1,004	153,856	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	155	205	1,904	291,688	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	885	1,057	4,643	711,102	メディア・娯楽
CONAGRA BRANDS INC	108	134	382	58,587	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	276	348	3,888	595,513	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	68	104	1,023	156,753	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	36	42	985	150,929	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION ENERGY	81	97	2,324	356,013	公益事業
COOPER COS INC/THE	12	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
COOPER COS INC/THE	—	62	644	98,713	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	216	252	1,414	216,651	商業・専門サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	23	32	565	86,559	ソフトウェア・サービス
CORNING INC	176	259	1,265	193,724	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORPAY INC	—	20	745	114,231	金融サービス
CORTEVA INC	142	188	1,096	167,951	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	97	125	11,863	1,816,786	生活必需品流通・小売り
COSTAR GROUP INC	96	121	936	143,426	不動産管理・開発
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A	56	72	2,378	364,196	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC	30	35	330	50,619	素材
CUMMINS INC	29	42	1,502	230,144	資本財
DR HORTON INC	72	90	1,524	233,437	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	45	56	667	102,214	公益事業
DANAHER CORP	155	190	4,666	714,602	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DARDEN RESTAURANTS INC	35	44	750	114,967	消費者サービス
DATADOG INC - CLASS A	71	95	1,183	181,167	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	21	26	397	60,918	ヘルスケア機器・サービス
DECKERS OUTDOOR CORP	—	49	874	133,980	耐久消費財・アパレル
DEERE & CO	61	71	2,835	434,191	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	74	95	1,277	195,651	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	—	80	488	74,821	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	69	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	169	230	896	137,325	エネルギー
DEXCOM INC	93	139	976	149,520	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	65	1,187	181,797	エネルギー
THE WALT DISNEY CO	397	510	5,056	774,360	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	63	83	1,470	225,147	金融サービス
EVEREST GROUP LTD	11	12	447	68,469	保険
DOCUSIGN INC	67	72	576	88,339	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	53	69	532	81,557	生活必需品流通・小売り
DOLLAR TREE INC	49	72	444	68,040	生活必需品流通・小売り
DOMINION ENERGY INC	175	246	1,425	218,275	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	9	11	544	83,357	消費者サービス
DOORDASH INC - A	—	99	1,707	261,537	消費者サービス
DOVER CORP	28	41	834	127,812	資本財
DOW INC	143	182	848	129,923	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DUKE ENERGY CORP	157	204	2,317	354,863	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	91	118	995	152,486	素材
DYNATRACE INC	84	111	591	90,512	ソフトウェア・サービス
EOG RESOURCES INC	138	179	2,407	368,698	エネルギー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	94	120	1,227	188,009	保険
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	26	36	369	56,531	素材
EBAY INC	121	155	962	147,351	一般消費財・サービス流通・小売り
ECOLAB INC	53	72	1,808	276,959	素材
EDISON INTERNATIONAL	101	119	993	152,163	公益事業
Edwards Lifesciences Corp	140	192	1,272	194,927	ヘルスケア機器・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	56	64	1,015	155,468	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	120	157	2,003	306,808	資本財
ENPHASE ENERGY INC	39	47	315	48,346	半導体・半導体製造装置
ENTERGY CORP	47	74	1,109	169,901	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	15	21	496	76,041	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	31	42	1,156	177,038	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	122	133	633	97,041	金融サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	9	386	59,236	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	78	126	502	76,916	公益事業
ETSY INC	41	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
EVERGY INC	55	59	369	56,642	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	87	110	679	104,107	公益事業
EXELON CORP	212	257	982	150,503	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	45	49	898	137,577	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	34	34	411	63,045	運輸
EXXON MOBIL CORPORATION	891	1,264	15,317	2,345,778	エネルギー
FMC CORP	32	—	—	—	素材
META PLATFORMS INC-A	488	623	36,732	5,625,197	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	9	10	501	76,774	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	6	8	1,870	286,447	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	113	150	1,257	192,616	資本財
FEDEX CORP	54	66	1,901	291,191	運輸
FERGUSON ENTERPRISES INC	—	59	1,225	187,667	資本財
F5 INC	13	16	387	59,385	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	140	160	1,411	216,210	金融サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	80	96	579	88,814	保険
FIFTH THIRD BANCORP	185	214	992	152,021	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	3	783	120,056	銀行
FIRST SOLAR INC	27	32	636	97,499	半導体・半導体製造装置
FISERV INC	137	166	3,502	536,335	金融サービス
FIRSTENERGY CORP	122	140	585	89,594	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	18	—	—	—	金融サービス
FORD MOTOR CO	931	1,199	1,315	201,472	自動車・自動車部品
FORTINET INC	169	207	1,913	292,992	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	76	96	724	110,992	資本財
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	41	50	398	61,024	資本財
FOX CORP-CLASS A	31	52	235	36,124	メディア・娯楽
FOX CORP-CLASS B	46	61	255	39,090	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FRANKLIN RESOURCES INC	91	120	253	38,880	金融サービス
FREEPORT-MCMORAN INC	353	451	2,091	320,353	素材
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	95	131	1,127	172,657	ヘルスケア機器・サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	50	62	1,847	282,944	保険
GARTNER INC	19	23	1,263	193,476	ソフトウェア・サービス
GE VERNOVA INC	—	84	2,877	440,662	資本財
GENERAC HOLDINGS INC	19	—	—	—	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	51	59	1,832	280,656	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	249	321	5,946	910,610	資本財
GENERAL MILS INC	122	140	923	141,415	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	308	358	1,990	304,755	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	38	48	589	90,223	一般消費財・サービス流通・小売り
GILEAD SCIENCES INC	265	363	3,508	537,276	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	61	70	777	119,115	金融サービス
GLOBE LIFE INC	18	—	—	—	保険
GODADDY INC - CLASS A	40	49	883	135,246	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	72	95	5,599	857,453	金融サービス
GRACO INC	41	48	424	64,950	資本財
WW GRAINGER INC	10	12	1,487	227,766	資本財
HCA HEALTHCARE INC	44	57	2,031	311,043	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	204	307	1,131	173,285	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	231	279	817	125,259	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	55	98	1,158	177,368	保険
HASBRO INC	37	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HEICO CORP	—	10	278	42,675	資本財
HEICO CORP	26	27	557	85,421	資本財
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	18	18	337	51,728	金融サービス
HERSHEY CO/THE	30	39	701	107,393	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	69	93	1,324	202,776	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	334	408	901	138,008	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	66	79	1,965	301,049	消費者サービス
HOLOGIC INC	54	60	473	72,452	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	218	281	11,423	1,749,417	一般消費財・サービス流通・小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	140	173	3,814	584,222	資本財
HORMEL FOODS CORP	82	97	296	45,429	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	112	130	1,478	226,378	資本財
HUBBELL INC	15	18	862	132,067	資本財
HUBSPOT INC	13	16	1,083	166,000	ソフトウェア・サービス
HUMANA INC	26	33	962	147,325	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	22	25	483	74,086	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	406	483	835	127,914	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11	15	323	49,532	資本財
IDEX CORP	15	19	438	67,153	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	19	26	1,128	172,781	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	60	76	2,068	316,845	資本財
ILLUMINA INC	40	54	821	125,870	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	52	68	572	87,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	106	134	1,375	210,610	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
INTEL CORP	924	1,219	3,194	489,280	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	122	164	2,574	394,285	金融サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	199	265	5,680	869,938	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	70	84	777	119,088	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	69	104	600	92,036	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC	96	96	288	44,201	メディア・娯楽
INTUIT INC	64	81	5,577	854,073	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	79	104	5,602	857,994	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	44	56	1,241	190,089	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	636	809	19,191	2,938,963	銀行
JACOBS SOLUTIONS INC	31	38	561	86,019	商業・専門サービス
JOHNSON & JOHNSON	516	667	10,379	1,589,538	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	71	100	391	60,027	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	32	40	2,790	427,290	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC	155	190	2,901	444,318	金融サービス
KELLANOVA	55	90	732	112,160	食品・飲料・タバコ
KENVUE INC	353	575	1,363	208,798	家庭用品・パーソナル用品
KEURIG DR PEPPER INC	194	306	1,007	154,219	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	323	371	703	107,789	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	41	53	883	135,351	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	66	88	1,178	180,507	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	429	617	1,658	254,035	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	46	81	488	74,760	運輸
KRAFT HEINZ CO/THE	177	234	773	118,492	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	140	174	1,048	160,528	生活必需品流通・小売り
LKQ CORP	67	105	405	62,067	一般消費財・サービス流通・小売り
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	21	23	737	112,993	金融サービス
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	42	46	1,213	185,892	資本財
LABCORP HOLDINGS INC	—	23	559	85,634	ヘルスケア機器・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	18	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	31	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LAM RESEARCH CORP	—	369	2,885	441,897	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	43	63	513	78,626	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	103	140	707	108,336	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	56	73	469	71,855	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	20	—	—	—	自動車・自動車部品
LEIDOS HOLDINGS INC	37	45	908	139,076	商業・専門サービス
LENNAR CORP-CL A	60	77	1,334	204,374	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	10	11	697	106,865	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	27	—	—	—	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	53	65	534	81,787	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	75	—	—	—	メディア・娯楽
ELI LILLY AND COMPANY	179	230	19,186	2,938,162	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIVE NATION	42	55	685	104,993	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORP	48	57	3,223	493,581	資本財
LOEWS CORP	46	57	479	73,488	保険
LOWE'S COMPANIES	128	163	4,431	678,583	一般消費財・サービス流通・小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	26	33	1,041	159,462	耐久消費財・アパレル

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	
M & T BANK CORP	41	43	904	138,570	銀行
MSCI INC	18	23	1,385	212,221	金融サービス
MARATHON OIL CORP	—	236	673	103,124	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	101	107	1,658	253,982	エネルギー
MARKEL GROUP INC	3	3	584	89,489	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	10	12	348	53,379	金融サービス
MARSH & MCLENNAN COS	105	129	2,921	447,443	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	63	76	2,148	329,092	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	15	19	1,229	188,341	素材
MARVELL TECHNOLOGY INC	208	257	2,417	370,173	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	57	67	545	83,466	資本財
MASTERCARD INC - A	184	230	12,107	1,854,106	金融サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	61	72	559	85,666	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	158	202	6,066	929,008	消費者サービス
MCKESSON CORP	30	36	2,261	346,304	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC	10	13	2,568	393,324	一般消費財・サービス流通・小売り
MERCK & CO. INC.	548	703	7,243	1,109,239	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	146	163	1,322	202,563	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	5	6	800	122,577	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	1,554	1,998	84,428	12,929,454	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	121	141	1,034	158,372	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	247	317	3,558	544,885	半導体・半導体製造装置
MODERNA INC	80	124	585	89,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC	17	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	13	18	626	95,866	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	59	60	360	55,218	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	297	359	2,381	364,760	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	19	25	752	115,305	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	11	15	1,200	183,855	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	177	205	1,114	170,728	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	36	48	2,296	351,638	金融サービス
MORGAN STANLEY	279	359	4,652	712,537	金融サービス
MOSAIC CO/THE	107	159	442	67,707	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	35	47	2,380	364,580	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	71	82	797	122,170	公益事業
NVR INC	0.84	0.95	884	135,400	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	85	137	1,081	165,575	金融サービス
NETAPP INC	54	67	838	128,416	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	98	122	9,767	1,495,728	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	29	41	525	80,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	32	48	195	29,998	資本財
NEWMONT CORPORATION	252	348	1,569	240,320	素材
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	104	156	461	70,667	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	451	594	4,572	700,253	公益事業
NIKE INC -CL B	268	340	2,582	395,472	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	134	141	507	77,729	公益事業
NORDSON CORP	10	16	419	64,219	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	46	64	1,747	267,552	運輸

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
NORTHERN TRUST CORP	53	60	631	96,675	金融サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	32	35	1,893	290,014	資本財
GEN DIGITAL INC	168	194	574	88,043	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	58	75	1,194	182,946	素材
NVIDIA CORP	545	6,980	103,052	15,781,396	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	13	16	2,040	312,538	一般消費財・サービス流通・小売り
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	169	224	1,132	173,381	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	23	57	1,300	199,136	運輸
OMNICOM GROUP	44	49	516	79,089	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	112	127	896	137,327	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	144	186	2,003	306,843	エネルギー
ORACLE CORPORATION	367	478	9,056	1,386,950	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	74	99	999	153,078	資本財
OWENS CORNING	31	31	602	92,216	資本財
P G & E CORP	—	621	1,279	195,994	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	87	117	2,403	368,053	銀行
PPG INDUSTRIES INC	50	54	683	104,626	素材
PPL CORPORATION	153	170	563	86,239	公益事業
PTC INC	31	39	762	116,702	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	116	150	1,724	264,056	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	18	25	603	92,478	素材
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	621	3,630	555,986	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	72	97	3,807	583,086	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	30	37	2,605	399,028	資本財
PAYCHEX INC	67	83	1,238	189,660	商業・専門サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	18	21	501	76,752	商業・専門サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	237	285	2,368	362,779	金融サービス
PEPSICO INC	294	375	6,200	949,601	食品・飲料・タバコ
REVVITY INC	37	42	514	78,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	1,220	1,580	4,223	646,831	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	336	436	5,510	843,878	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	108	132	1,673	256,328	エネルギー
PINTEREST INC- CLASS A	164	192	562	86,114	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	56	—	—	—	エネルギー
POOL CORP	11	15	572	87,696	一般消費財・サービス流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	48	58	683	104,723	金融サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	63	69	590	90,422	保険
PROCTER & GAMBLE CO	508	654	10,983	1,682,012	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	132	167	4,374	669,982	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	81	105	1,286	197,078	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	102	148	1,275	195,376	公益事業
PULTE HOMES INC	66	74	985	150,868	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	23	34	242	37,125	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	240	312	5,345	818,565	半導体・半導体製造装置
QUANTA SERVICES INC	37	48	1,593	243,953	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	21	28	449	68,800	ヘルスケア機器・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	37	38	515	78,881	素材
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	50	61	971	148,788	金融サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
RTX CORPORATION	324	372	4,602	704,881	資本財
Regeneron Pharmaceuticals Inc	23	32	2,727	417,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	243	232	596	91,408	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	44	61	1,302	199,439	商業・専門サービス
RESMED INC	36	49	1,252	191,817	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INC	25	—	—	—	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	27	33	921	141,154	資本財
ROKU INC	41	58	430	65,861	メディア・娯楽
ROLLINS INC	80	91	459	70,344	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	22	27	1,562	239,305	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	79	98	1,405	215,298	一般消費財・サービス流通・小売り
S&P GLOBAL INC	72	92	4,644	711,266	金融サービス
SEI INVESTMENTS COMPANY	11	17	142	21,837	金融サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	58	67	504	77,276	商業・専門サービス
SALESFORCE INC	220	281	9,054	1,386,658	ソフトウェア・サービス
HENRY SCHEIN INC	25	46	317	48,683	ヘルスケア機器・サービス
SCHLUMBERGER LTD	333	387	1,671	255,999	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	342	438	3,240	496,218	金融サービス
SEAGEN INC	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEALED AIR CORP	43	—	—	—	素材
SEMPRA	128	161	1,472	225,568	公益事業
SERVICENOW INC	46	60	6,068	929,351	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	54	70	2,725	417,344	素材
SKYWORKS SOLUTIONS INC	32	43	391	59,913	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	32	40	299	45,879	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	26	32	371	56,911	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	11	13	478	73,339	資本財
SNOWFLAKE INC-CLASS A	64	102	1,240	189,925	ソフトウェア・サービス
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	20	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SOLVENTUM CORP	—	49	359	55,082	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHERN CO	233	302	2,681	410,664	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	83	85	272	41,659	運輸
BLOCK INC	143	179	1,337	204,818	金融サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	41	53	486	74,497	資本財
STARBUCKS CORP	260	336	3,284	503,034	消費者サービス
STATE STREET CORP	77	87	830	127,249	金融サービス
STEEL DYNAMICS INC	42	52	773	118,499	素材
STRYKER CORP	76	95	3,589	549,721	ヘルスケア機器・サービス
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	191	468	71,750	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SYNOPSYS INC	36	45	2,555	391,366	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	98	142	907	139,000	金融サービス
SYSCO CORP	100	121	938	143,675	生活必需品流通・小売り
TJX COMPANIES INC	254	316	3,731	571,486	一般消費財・サービス流通・小売り
T-MOBILE US INC	129	154	3,634	556,602	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	45	55	981	150,248	メディア・娯楽
TARGET CORP	101	131	1,963	300,753	生活必需品流通・小売り
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	12	13	669	102,493	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	11	22	439	67,379	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TERADYNE INC	39	51	566	86,691	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	632	819	26,318	4,030,368	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS	186	249	5,488	840,445	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	56	61	538	82,532	資本財
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	108	137	1,724	264,057	メディア・娯楽
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	85	107	5,933	908,727	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	116	165	2,226	340,953	資本財
TRACTOR SUPPLY COMPANY	26	35	1,024	156,918	一般消費財・サービス流通・小売り
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	33	43	573	87,886	金融サービス
TRANSDIGM GROUP INC	13	16	2,276	348,608	資本財
TRANSUNION	70	75	802	122,931	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	41	60	1,555	238,204	保険
TRIMBLE INC	70	79	574	87,970	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRUIST FINANCIAL CORP	302	368	1,666	255,144	銀行
TWILIO INC - A	56	62	576	88,304	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	12	14	913	139,819	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	68	98	586	89,878	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	346	455	2,287	350,356	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	424	555	4,005	613,357	運輸
ULTA BEAUTY INC	11	15	582	89,265	一般消費財・サービス流通・小売り
UNION PACIFIC CORP	130	163	3,942	603,727	運輸
UNITED PARCEL SERVICE CL B	152	195	2,583	395,638	運輸
UNITED RENTALS INC	17	21	1,873	286,891	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	202	258	15,940	2,441,182	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	15	21	436	66,857	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	108	—	—	—	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	13	—	—	—	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	86	99	1,355	207,505	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	34	46	1,101	168,711	ヘルスケア機器・サービス
VERALTO CORP	52	76	805	123,330	商業・専門サービス
VERISIGN INC	20	22	410	62,911	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	904	1,161	4,703	720,299	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	33	37	1,080	165,446	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	57	77	3,998	612,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERTIV HOLDINGS CO	—	119	1,504	230,452	資本財
PARAMOUNT GLOBAL CLASS-B	140	209	232	35,534	メディア・娯楽
VIATRIS INC	308	389	504	77,232	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC-CLASS A SHARES	351	438	13,488	2,065,566	金融サービス
VMWARE INC-CLASS A	59	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VULCAN MATERIALS CO	30	42	1,239	189,845	素材
WEC ENERGY GROUP INC	60	81	794	121,726	公益事業
WABTEC CORP/DE	43	60	1,220	186,860	資本財
WALMART INC	318	1,237	10,497	1,607,619	生活必需品流通・小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	183	306	278	42,609	生活必需品流通・小売り
WARNER BROS DISCOVERY INC	566	833	764	117,119	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	54	71	1,320	202,191	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	85	110	2,484	380,525	商業・専門サービス
WATERS CORP	14	18	700	107,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期末			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	
WELLS FARGO & COMPANY	801	986	6,910	1,058,316	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	18	23	753	115,395	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN DIGITAL CORP	95	109	763	116,962	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTROCK CO	77	—	—	—	素材
WHIRLPOOL CORP	21	—	—	—	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	286	382	2,155	330,065	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	51	65	1,671	255,912	ソフトウェア・サービス
XCEL ENERGY INC	112	154	1,039	159,253	公益事業
XYLEM INC	52	75	937	143,626	資本財
YUM! BRANDS INC	60	75	1,040	159,399	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	15	18	731	111,966	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	44	54	588	90,172	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	102	128	2,279	349,146	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZSCALER INC	27	36	717	109,825	ソフトウェア・サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	70	84	685	105,012	ソフトウェア・サービス
CRH PUBLIC LIMITED COMPANY	—	203	2,045	313,188	素材
INVESCO LTD	107	—	—	—	金融サービス
CHUBB LTD	86	102	2,897	443,757	保険
LyondellBasell Industries NV	60	66	566	86,711	素材
GARMIN LTD	30	50	1,082	165,746	耐久消費財・アパレル
ACCENTURE PLC-CL A	140	178	6,352	972,893	ソフトウェア・サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV	57	70	1,642	251,513	半導体・半導体製造装置
TE CONNECTIVITY LTD	62	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APTIV PLC	71	82	461	70,704	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	90	116	4,276	654,955	資本財
WILLIS TOWERS WATSON PLC	22	26	830	127,198	保険
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	47	—	—	—	資本財
ALLEGION PLC	22	26	386	59,119	資本財
STERIS PLC	25	29	644	98,753	ヘルスケア機器・サービス
WIX COM LTD	—	27	467	71,615	ソフトウェア・サービス
AMCOR PLC	266	347	355	54,400	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	51	67	2,753	421,710	資本財
FERGUSON PLC	46	—	—	—	資本財
AON PLC	43	52	2,023	309,905	保険
PENTAIR PLC	55	65	686	105,101	資本財
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	82	90	238	36,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE PLC	106	131	6,032	923,748	素材
BUNGE GLOBAL SA	37	39	344	52,685	食品・飲料・タバコ
CYBERARK SOFTWARE LTD	17	19	576	88,248	ソフトウェア・サービス
TE CONNECTIVITY PLC	—	76	1,187	181,869	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SMURFIT WESTROCK PLC	—	174	912	139,728	素材
MEDTRONIC PLC	275	339	2,977	456,038	ヘルスケア機器・サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	—	59	1,466	224,566	消費者サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	142	189	1,607	246,202	資本財
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	59	69	541	82,888	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	72,375	102,412	1,455,883	222,953,969	
小計 銘柄数<比率>	518	510	—	<75.7%>	

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	130	164	1,920	211,441	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	317	—	—	—	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	181	218	1,686	185,657	生活必需品流通・小売り
ALTAGAS LTD	—	167	562	61,906	公益事業
BCE INC	46	62	247	27,288	電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	144	203	2,634	289,963	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	222	317	2,385	262,551	銀行
BARRICK GOLD CORP	400	540	1,383	152,319	素材
BROOKFIELD CORP	345	423	3,363	370,263	金融サービス
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	110	141	1,111	122,307	金融サービス
CAE INC	114	138	362	39,938	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B	43	74	608	66,943	素材
CGI INC	54	54	848	93,412	ソフトウェア・サービス
CAMECO CORP	127	162	1,185	130,495	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	174	287	2,570	282,908	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	113	139	2,152	236,931	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES	263	662	3,150	346,750	エネルギー
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	211	269	2,911	320,500	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	19	21	324	35,664	一般消費財・サービス流通・小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	81	116	404	44,503	公益事業
CENOVUS ENERGY INC	383	523	1,173	129,191	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	5	6	2,771	305,009	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC	77	99	1,504	165,590	一般消費財・サービス流通・小売り
EMERA INC	83	107	539	59,381	公益事業
ENBRIDGE INC	464	606	3,574	393,395	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6	7	1,297	142,851	保険
FORTIS INC	119	119	736	81,036	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	46	55	950	104,670	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	62	75	516	56,897	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	94	128	631	69,508	保険
HYDRO ONE LTD	121	126	564	62,148	公益事業
IGM FINANCIAL INC	63	89	398	43,876	金融サービス
IMPERIAL OIL LTD	67	81	832	91,655	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	41	61	1,624	178,754	保険
KEYERA CORP	106	130	570	62,819	エネルギー
LOBLAW COMPANIES LTD	39	54	1,004	110,528	生活必需品流通・小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	82	90	546	60,119	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	357	553	2,447	269,448	保険
METRO INC	56	69	597	65,759	生活必需品流通・小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	82	112	1,504	165,583	銀行
NUTRIEN LTD	118	153	1,030	113,378	素材
OPEN TEXT CORP	98	120	491	54,085	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	163	190	1,088	119,808	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	168	192	896	98,649	保険
RB GLOBAL INC	53	68	877	96,570	商業・専門サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	84	104	988	108,819	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	104	127	645	71,091	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	282	394	6,779	746,209	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
SAPUTO INC	89	93	249	27,456	食品・飲料・タバコ
SHOPIFY INC - CLASS A	288	366	4,445	489,330	ソフトウェア・サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	104	142	1,176	129,474	保険
SUNCOR ENERGY INC	293	385	2,100	231,223	エネルギー
TC ENERGY CORP	233	337	2,288	251,919	エネルギー
TELUS CORP	16	16	34	3,841	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	43	51	1,203	132,482	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK	382	464	3,663	403,273	銀行
WSP GLOBAL INC	37	40	965	106,297	資本財
WESTON (GEORGE) LTD	21	29	689	75,897	生活必需品流通・小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	126	159	1,438	158,319	素材
小計 株数・金額	8,176	10,705	84,656	9,318,106	
小計 銘柄数<比率>	58	58	—	<3.2%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	37	47	1,039	170,570	耐久消費財・アパレル
Fresenius SE & CO KG	92	120	408	66,932	ヘルスケア機器・サービス
HANNOVER RUECK SE	13	18	431	70,843	保険
GEA GROUP AG	29	46	215	35,412	資本財
CONTINENTAL AG	30	34	195	32,086	自動車・自動車部品
DHL GROUP	187	259	918	150,715	運輸
MERCK KGAA	28	35	537	88,192	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	140	173	522	85,676	公益事業
SAP SE	229	301	6,678	1,095,546	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	507	647	771	126,479	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	16	26	184	30,193	家庭用品・パーソナル用品
PUMA AG	31	38	176	29,014	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	199	278	671	110,191	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	31	46	360	59,198	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	172	247	1,072	175,879	素材
BEIERSDORF AG	22	32	404	66,397	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERG MATERIALS AG	33	36	425	69,852	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	52	61	242	39,771	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE	81	103	2,982	489,249	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	243	317	200	32,860	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	28	36	1,734	284,571	保険
RHEINMETALL AG	11	15	822	134,975	資本財
VOLKSWAGEN AG	11	—	—	—	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	33	40	336	55,278	自動車・自動車部品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	160	185	969	158,993	自動車・自動車部品
SIEMENS AG	164	213	3,903	640,291	資本財
DEUTSCHE BANK AG -REG	457	632	981	161,069	金融サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	55	66	450	73,887	自動車・自動車部品
Bayerische Motoren Werke AG	25	31	200	32,900	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	667	931	2,657	435,935	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	9	12	286	47,000	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	290	359	1,036	169,959	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	39	55	1,170	192,077	金融サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	25	25	93	15,323	自動車・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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MTU AERO ENGINES AG	15	17	547	89,819	資本財
SYMRISE AG	29	39	423	69,452	素材
BRENNTAG SE	32	36	221	36,283	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	65	74	135	22,295	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	850	—	—	—	電気通信サービス
COMMERZBANK AG	331	369	584	95,860	銀行
LEG IMMOBILIEN SE	29	33	293	48,095	不動産管理・開発
VONOVIA SE	194	249	751	123,271	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG	18	23	174	28,621	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	69	80	421	69,085	ヘルスケア機器・サービス
DR ING HC F PORSCHE AG	27	37	242	39,802	自動車・自動車部品
SIEMENS ENERGY AG	255	240	951	156,035	資本財
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	107	151	569	93,369	資本財
ZALANDO SE	75	94	255	41,990	一般消費財・サービス流通・小売り
SCOUT24 SE	24	24	207	34,030	メディア・娯楽
COVESTRO AG	55	63	363	59,610	素材
HELLOFRESH SE	65	—	—	—	生活必需品流通・小売り
小計 株数・金額	6,410	7,015	39,227	6,434,952	
小計 銘柄数<比率>	51	48	—	<2.2%>	
(ユーロ…イタリア)					
GENERALI	165	251	634	104,109	保険
INTESA SANPAOLO	3,468	4,267	1,636	268,482	銀行
MEDIOBANCA SPA	196	263	404	66,385	銀行
ENEL SPA	1,671	2,091	1,396	229,114	公益事業
ENI SPA	417	652	909	149,208	エネルギー
SNAM SPA	361	556	234	38,506	公益事業
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	353	357	276	45,418	公益事業
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	37	38	199	32,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FINMECCANICA SPA	—	186	461	75,673	資本財
Prysmian SpA	68	101	633	103,863	資本財
MONCLER SPA	59	62	302	49,669	耐久消費財・アパレル
FINECOBANK SPA	173	221	328	53,855	銀行
UNICREDIT SPA	434	451	1,807	296,433	銀行
POSTE ITALIANE SPA	158	198	263	43,268	保険
小計 株数・金額	7,566	9,702	9,489	1,556,666	
小計 銘柄数<比率>	13	14	—	<0.5%>	
(ユーロ…フランス)					
BOUYGUES	31	78	233	38,319	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	180	217	618	101,459	公益事業
L'OREAL	52	65	2,204	361,598	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	60	76	4,592	753,291	耐久消費財・アパレル
THALES SA	26	30	491	80,681	資本財
CAPGEMINI	38	45	734	120,563	ソフトウェア・サービス
PUBLICIS GROUPE	52	68	704	115,580	メディア・娯楽
BOLLORE	206	231	134	22,002	メディア・娯楽
PERNOD-RICARD	42	54	610	100,101	食品・飲料・タバコ
REMY COINTREAU	12	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SCHNEIDER ELECTRIC SE	114	157	3,797	622,996	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VIVENDI SA	142	208	193	31,815	メディア・娯楽
ORANGE	314	402	397	65,167	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	7	9	1,867	306,328	耐久消費財・アパレル
KERING	14	19	439	72,034	耐久消費財・アパレル
CARREFOUR SA	129	165	249	40,967	生活必需品流通・小売り
SANOFI	251	312	2,990	490,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA	82	99	439	72,150	消費者サービス
SOCIETE GENERALE-A	188	227	605	99,260	銀行
TELEPERFORMANCE	16	21	199	32,739	商業・専門サービス
SODEXO	27	42	352	57,745	消費者サービス
AXA SA	353	464	1,574	258,251	保険
ESSILORLUXOTTICA	61	82	1,889	309,983	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT AGRICOLE SA	311	316	418	68,586	銀行
BNP PARIBAS	233	282	1,686	276,710	銀行
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	98	133	1,149	188,496	資本財
Wendel	20	—	—	—	金融サービス
SAFRAN SA	78	95	2,102	344,839	資本財
ENGIE	425	496	753	123,620	公益事業
ALSTOM	128	192	388	63,720	資本財
Ipsen SA	—	11	128	21,006	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Arkema SA	14	20	165	27,224	素材
Legrand SA	49	70	693	113,744	資本財
Eiffage SA	11	11	97	15,985	資本財
TOTALENERGIES SE	513	577	3,281	538,323	エネルギー
Aeroports de Paris	14	14	152	24,949	運輸
VINCI S.A.	103	122	1,232	202,240	資本財
DANONE	121	160	1,048	172,041	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE	108	155	2,506	411,242	素材
Bureau Veritas SA	51	129	375	61,619	商業・専門サービス
GETLINK SE	108	137	210	34,599	運輸
EDENRED	65	103	309	50,758	金融サービス
VALEO SA	86	—	—	—	自動車・自動車部品
DASSAULT SYSTEMES SE	157	196	641	105,291	ソフトウェア・サービス
EUROFINS SCIENTIFIC	35	56	257	42,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDLINE SA	123	—	—	—	金融サービス
MICHELIN (CGDE)	135	192	603	98,926	自動車・自動車部品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	10	15	283	46,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI- W/I	—	40	271	44,612	金融サービス
小計 株数・金額	5,416	6,615	44,080	7,230,966	
小計 銘柄数<比率>	47	45	—	<2.5%>	
(ユーロ…オランダ)					
AIRBUS SE	130	164	2,337	383,500	資本財
ASM INTERNATIONAL NV	12	14	760	124,778	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	25	25	108	17,796	商業・専門サービス
WOLTERS KLUWER	54	66	1,075	176,397	商業・専門サービス
KONIKLIJKE KPN NV	544	1,009	365	59,910	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	150	171	424	69,553	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	229	262	653	107,136	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV	57	76	552	90,628	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	25	40	249	40,918	食品・飲料・タバコ
ASML HOLDING NV	88	112	6,996	1,147,660	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	165	221	718	117,853	生活必需品流通・小売り
FERRARI NV	29	38	1,624	266,533	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV	235	—	—	—	資本財
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	16	31	340	55,791	半導体・半導体製造装置
AKZO NOBEL	37	37	223	36,598	素材
PROSUS NV	385	434	1,671	274,203	一般消費財・サービス流通・小売り
JDE PEET'S NV	30	55	104	17,084	食品・飲料・タバコ
STELLANTIS NV	512	621	778	127,723	自動車・自動車部品
QIAGEN N.V.	—	71	293	48,069	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXOR NV	17	22	214	35,105	金融サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	209	335	202	33,157	食品・飲料・タバコ
IMCD NV	14	20	320	52,496	資本財
NN GROUP NV	69	71	323	53,095	保険
ARGENX SE	14	20	1,133	185,889	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	180	239	568	93,244	メディア・娯楽
ABN AMRO BANK NV-CVA	—	120	182	29,960	銀行
QIAGEN N V	49	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV	6	6	862	141,537	金融サービス
ING GROEP NV-CVA	815	900	1,350	221,547	銀行
小計 株数・金額	4,108	5,195	24,434	4,008,168	
小計 銘柄数<比率>	27	27	—	<1.4%>	
(ユーロ…スペイン)					
ENDESA SA	92	117	226	37,200	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,368	1,654	1,506	247,081	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	71	—	—	—	公益事業
REPSOL SA	370	378	434	71,347	エネルギー
BANCO SANTANDER S.A	3,610	4,367	1,936	317,682	銀行
TELEFONICA SA	1,124	1,274	536	87,945	電気通信サービス
ENAGAS SA	70	—	—	—	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	52	72	309	50,805	資本財
Banco de Sabadell SA	—	1,989	351	57,597	銀行
CaixaBank SA	1,083	1,288	709	116,317	銀行
IBERDROLA SA	1,195	1,639	2,165	355,278	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA	100	139	945	155,128	消費者サービス
REDEIA CORPORACION SA	62	118	194	31,849	公益事業
INDITEX	237	339	1,764	289,519	一般消費財・サービス流通・小売り
AENA SME SA	18	22	440	72,186	運輸
CELLNEX TELECOM SAU	148	176	584	95,830	電気通信サービス
小計 株数・金額	9,607	13,577	12,105	1,985,772	
小計 銘柄数<比率>	15	14	—	<0.7%>	
(ユーロ…ベルギー)					
KBC GROEP NV	61	67	461	75,761	銀行
SOLVAY SA	16	—	—	—	素材

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA		32	46	851	139,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		17	20	136	22,395	金融サービス
AGEAS		34	51	245	40,324	保険
UMICORE		71	—	—	—	素材
SYENSQO SA		—	30	238	39,184	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		186	223	1,189	195,116	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	419	439	3,123	512,411	
	銘柄数<比率>	7	6	—	<0.2%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		63	75	282	46,394	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		107	111	598	98,220	銀行
小計	株数・金額	171	187	881	144,615	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
TENARIS SA		154	210	362	59,450	エネルギー
ARCELORMITTAL		92	152	367	60,325	素材
小計	株数・金額	246	362	730	119,776	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS		60	70	139	22,875	生活必需品流通・小売り
WARTSILA		154	239	444	72,972	資本財
UPM-KYMMENE OYJ		115	145	380	62,431	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS		144	182	184	30,344	素材
FORTUM OYJ		120	178	244	40,114	公益事業
ELISA OYJ		13	31	139	22,805	電気通信サービス
NOKIA OYJ		1,007	1,426	601	98,684	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ		103	164	211	34,673	エネルギー
KONE OYJ-B		65	83	415	68,215	資本財
ORION OYJ		51	45	207	33,994	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OUTOTEC OYJ		237	307	270	44,423	資本財
NORDEA BANK ABP		—	797	851	139,727	銀行
SAMPO OYJ-A SHS		83	93	374	61,381	保険
小計	株数・金額	2,157	3,767	4,466	732,646	
	銘柄数<比率>	12	13	—	<0.2%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KINGSPAN GROUP PLC		44	54	426	69,993	資本財
KERRY GROUP PLC-A		30	49	436	71,547	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		60	—	—	—	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		46	—	—	—	消費者サービス
小計	株数・金額	182	104	862	141,541	
	銘柄数<比率>	4	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		606	1,042	355	58,383	公益事業
Galp Energia SGPS SA		198	222	351	57,711	エネルギー
JERONIMO MARTINS		75	106	199	32,677	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額	880	1,372	906	148,772	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	

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…その他)		百株	百株	千ユーロ	千円	
DSM-FIRMENICH AG		39	56	592	97,131	素材
AEGON LTD		526	526	323	53,105	保険
小計	株数・金額	566	583	915	150,236	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額	37,732	48,923	141,224	23,166,527	
	銘柄数<比率>	185	178	—	<7.9%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ASHTEAD GROUP PLC		101	132	835	165,189	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		283	475	200	39,733	耐久消費財・アパレル
CRH PLC		169	—	—	—	素材
DIAGEO PLC		475	585	1,359	268,840	食品・飲料・タバコ
DCC PLC		23	45	218	43,150	資本財
BAE SYSTEMS PLC		711	853	1,175	232,376	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		434	562	1,538	304,268	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC		99	121	309	61,205	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC		661	661	611	120,853	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		193	200	474	93,778	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC		4,406	5,111	3,526	697,447	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		1,390	1,756	381	75,344	保険
Associated British Foods PLC		95	112	254	50,384	食品・飲料・タバコ
PERSIMMON PLC		81	122	160	31,791	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC		626	762	489	96,834	保険
RIO TINTO PLC		259	336	1,666	329,522	素材
ST JAMES'S PLACE PLC		289	—	—	—	金融サービス
SSE PLC		259	304	522	103,397	公益事業
BP PLC		4,028	4,621	1,725	341,191	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		13,724	17,599	934	184,736	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC		—	1,000	137	27,200	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC		193	235	216	42,778	ヘルスケア機器・サービス
ASTRAZENECA PLC		343	433	4,295	849,459	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC		1,534	2,004	280	55,481	電気通信サービス
BARCLAYS PLC		3,573	4,424	1,112	220,063	銀行
INTERTEK GROUP PLC		32	58	271	53,694	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		99	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC		31	37	373	73,776	一般消費財・サービス流通・小売り
KINGFISHER PLC		557	911	264	52,259	一般消費財・サービス流通・小売り
SAINSBURY (J) PLC		673	701	174	34,547	生活必需品流通・小売り
ADMIRAL GROUP PLC		62	88	222	43,984	保険
CENTRICA PLC		—	1,743	200	39,612	公益事業
BUNZL PLC		76	84	292	57,932	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC		812	989	399	78,960	商業・専門サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		—	90	166	32,942	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
London Stock Exchange Group PLC		93	132	1,418	280,561	金融サービス
UNILEVER PLC		526	674	3,060	605,164	家庭用品・パーソナル用品
EXPERIAN PLC		204	248	964	190,763	商業・専門サービス
MONDI PLC		101	—	—	—	素材
SEVERN TRENT PLC		84	130	342	67,658	公益事業
Whitbread PLC		75	97	295	58,383	消費者サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	176	142	155	30,799	金融サービス
SMITHS GROUP PLC	59	73	113	22,423	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	321	417	990	195,918	素材
3I GROUP PLC	222	292	990	195,803	金融サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	150	197	941	186,280	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	409	484	1,789	353,906	商業・専門サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	205	—	—	—	公益事業
GLENCORE PLC	2,516	3,260	1,287	254,522	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	—	2,693	1,489	294,637	資本財
SAGE GROUP PLC/THE	319	344	358	70,890	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	217	258	218	43,301	メディア・娯楽
COMPASS GROUP PLC	399	480	1,255	248,249	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	746	1,363	1,330	263,178	公益事業
ABRDN PLC	851	—	—	—	金融サービス
VODAFONE GROUP PLC	4,754	5,671	408	80,793	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	55	60	561	110,962	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	37	44	158	31,365	素材
M&G PLC	1,039	1,154	224	44,340	金融サービス
ENDEAVOUR MINING PLC	—	89	149	29,565	素材
TESCO PLC	1,540	1,752	605	119,640	生活必需品流通・小売り
NATWEST GROUP PLC	1,542	2,059	784	155,071	銀行
INFORMA PLC	375	398	330	65,258	メディア・娯楽
MONDI PLC	—	118	142	28,225	素材
HALEON PLC	1,291	1,944	706	139,666	家庭用品・パーソナル用品
GSK PLC	836	1,066	1,472	291,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	484	245	48,505	資本財
SHELL PLC-NEW	1,416	1,718	4,405	871,264	エネルギー
SCHRODERS PLC	223	378	114	22,612	金融サービス
AVIVA PLC	661	685	312	61,861	保険
AUTO TRADER GROUP PLC	232	317	246	48,780	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	19	22	146	28,993	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	78	—	—	—	素材
小計 株数・金額	58,091	76,429	52,810	10,443,224	
小計 銘柄数<比率>	66	66	—	<3.5%>	
(スイス)			千スイスフラン		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.87	1	206	36,052	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM AG-REG	5	5	296	51,880	電気通信サービス
Lindt & Spruengli AG	0.26	0.29	298	52,251	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.03	304	53,161	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	2	2	1,069	186,940	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	29	37	1,948	340,581	保険
NOVARTIS AG-REG SHS	441	537	4,994	872,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	327	457	2,287	399,737	資本財
ROCHE HOLDING AG-BR	10	14	404	70,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	147	191	5,048	882,251	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG(REG)	60	74	184	32,249	商業・専門サービス
HOLCIM LTD	111	143	1,304	227,920	素材
CLARIANT AG-REG	127	157	182	31,930	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
NESTLE SA-REGISTERED	576	718	5,675	991,809	食品・飲料・タバコ
Baloise Holding AG	10	22	386	67,566	保険
TEMENOS GROUP AG-REG	21	31	187	32,712	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG	12	16	540	94,498	ヘルスケア機器・サービス
THE SWATCH GROUP AG-B	9	10	168	29,510	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	19	22	1,221	213,455	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG	7	8	643	112,476	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG	—	1	111	19,538	素材
SWISS PRIME SITE	15	23	218	38,233	不動産管理・開発
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5	7	865	151,295	金融サービス
Schindler Holding AG	5	6	177	31,031	資本財
Schindler Holding AG	10	11	286	50,061	資本財
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	14	14	306	53,577	運輸
Logitech International SA	46	51	356	62,325	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEBERIT AG-REG	6	7	410	71,763	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	59	79	442	77,325	金融サービス
SWISS RE AG	68	86	1,023	178,885	保険
BKW AG	—	9	135	23,592	公益事業
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	120	152	1,821	318,341	耐久消費財・アパレル
SIKA AG-REG	34	46	1,106	193,435	素材
ALCON INC	113	145	1,180	206,382	ヘルスケア機器・サービス
SANDOZ GROUP AG	118	138	554	96,882	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG	24	43	388	67,894	商業・専門サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	32	38	429	75,113	ヘルスケア機器・サービス
UBS GROUP AG	770	968	2,733	477,641	金融サービス
小計 株数・金額	3,365	4,288	39,905	6,973,851	
小計 銘柄数<比率>	36	38	—	<2.4%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	384	514	7,913	111,971	銀行
Swedbank AB	205	265	5,763	81,554	銀行
SECURITAS AB-B SHS	158	237	3,371	47,711	商業・専門サービス
HENNES & MAURITZ AB-B	193	257	4,092	57,912	一般消費財・サービス流通・小売り
ERICSSON LM-B SHS	642	926	8,191	115,903	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA COMPANY AB	762	995	3,060	43,305	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	87	129	2,927	41,426	資本財
ALFA LAVAL AB	77	100	4,759	67,344	資本財
Husqvarna AB	244	253	1,696	24,001	資本財
SKF AB-B SHARES	95	164	3,464	49,023	資本財
VOLVO AB-A SHS	107	127	3,651	51,674	資本財
VOLVO AB-B SHS	241	373	10,583	149,754	資本財
SANDVIK AB	214	260	5,516	78,053	資本財
Industrivarden AB	72	77	2,879	40,745	金融サービス
Industrivarden AB	33	33	1,233	17,449	金融サービス
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	151	201	2,814	39,824	素材
TELE2 AB-B SHS	276	276	3,073	43,493	電気通信サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B	139	194	5,753	81,414	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB	132	176	5,474	77,460	金融サービス
EVOLUTION AB	52	64	6,259	88,578	消費者サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS		487	674	12,225	172,984	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS		460	555	8,810	124,668	資本財
EPIROC AB-A		102	110	2,329	32,956	資本財
EPIROC AB-B		144	204	3,860	54,623	資本財
INVESTOR AB-B SHS		357	460	13,948	197,368	金融サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		411	616	3,030	42,880	資本財
HEXAGON AB-B SHS		487	599	6,089	86,159	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BOLIDEN AB		106	142	4,755	67,293	素材
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		324	455	5,070	71,741	銀行
ASSA ABLOY AB-B		186	282	9,384	132,785	資本財
NORDEA BANK ABP		637	—	—	—	銀行
小計	株数・金額	7,981	9,732	161,983	2,292,064	
	銘柄数<比率>	31	30	—	<0.8%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
TELENOR ASA		167	280	3,678	51,164	電気通信サービス
EQUINOR ASA		237	296	7,434	103,410	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		38	54	1,765	24,554	素材
MOWI ASA		114	135	2,645	36,803	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		518	735	5,099	70,932	素材
AKER BP ASA		115	185	4,146	57,674	エネルギー
ORKLA ASA		225	225	2,291	31,873	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		129	147	2,881	40,083	保険
DNB BANK ASA		235	235	5,400	75,120	銀行
小計	株数・金額	1,781	2,296	35,342	491,616	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B		20	23	1,758	38,686	食品・飲料・タバコ
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		0.93	1	1,446	31,828	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		0.96	1	1,550	34,119	運輸
DANSKE BANK A/S		176	209	4,295	94,507	銀行
GENMAB A/S		15	21	3,484	76,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV A/S		43	62	9,243	203,354	運輸
PANDORA A/S		23	28	3,044	66,978	耐久消費財・アパレル
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S		24	—	—	—	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES		42	106	4,526	99,580	素材
COLOPLAST-B		28	39	3,563	78,390	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		237	301	3,152	69,358	資本財
NOVO NORDISK A/S-B		724	918	68,467	1,506,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRYG A/S		64	119	1,903	41,875	保険
ORSTED A/S		57	74	2,825	62,168	公益事業
DEMANT A/S		51	51	1,350	29,707	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	1,512	1,959	110,614	2,433,517	
	銘柄数<比率>	15	14	—	<0.8%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD		67	81	313	31,649	ヘルスケア機器・サービス
ANZ GROUP HOLDINGS LTD		571	764	2,455	247,740	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION		676	973	3,129	315,737	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		402	484	947	95,601	素材
TELSTRA GROUP LTD		637	637	247	24,975	電気通信サービス
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE		42	57	376	37,956	金融サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円	
BHP GROUP LIMITED	1,113	1,448	6,287	634,425	素材
COMPUTERSHARE LTD	165	189	547	55,214	商業・専門サービス
CSL LIMITED	103	136	3,903	393,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRANSURBAN GROUP	723	840	1,074	108,415	運輸
COCHLEAR LIMITED	17	20	594	60,027	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	606	720	713	72,018	公益事業
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	352	471	7,044	710,756	銀行
RIO TINTO LIMITED	95	113	1,397	141,017	素材
APA GROUP	327	502	341	34,486	公益事業
ARISTOCRAT LEISURE LTD	164	184	1,186	119,756	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	585	726	564	56,999	保険
ORICA LTD	168	168	296	29,928	素材
LENDLEASE GROUP	409	—	—	—	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	130	178	398	40,177	素材
SUNCORP GROUP LTD	347	389	726	73,265	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	675	869	3,447	347,867	銀行
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	374	419	765	77,238	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	396	492	826	83,433	素材
SANTOS LTD	980	1,205	818	82,555	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	92	132	359	36,291	ヘルスケア機器・サービス
WESFARMERS LIMITED	226	323	2,211	223,116	一般消費財・サービス流通・小売り
WOOLWORTHS GROUP LTD	229	302	902	91,066	生活必需品流通・小売り
SEEK LTD	141	167	421	42,528	メディア・娯楽
BRAMBLES LTD	353	452	866	87,451	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	78	106	2,442	246,497	金融サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	122	140	681	68,713	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	233	327	375	37,912	食品・飲料・タバコ
XERO LTD	50	53	843	85,115	ソフトウェア・サービス
AMPOL LTD	91	130	369	37,320	エネルギー
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	476	655	1,578	159,293	エネルギー
LOTTERY CORP LTD/THE	640	970	484	48,873	消費者サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	406	419	198	20,001	生活必需品流通・小売り
TREASURY WINE ESTA-RIGHTS	23	—	—	—	食品・飲料・タバコ
NEWMONT CORP-CDI	100	—	—	—	素材
MEDIBANK PRIVATE LTD	—	718	267	26,982	保険
SOUTH32 LTD	1,581	2,163	821	82,936	素材
COLES GROUP LTD	237	309	549	55,457	生活必需品流通・小売り
小計 株数・金額	15,221	19,450	51,780	5,224,679	
小計 銘柄数<比率>	42	40	—	<1.8%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	149	214	807	73,790	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD	239	339	103	9,419	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	365	473	350	32,015	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	616	670	394	36,041	公益事業
小計 株数・金額	1,369	1,698	1,655	151,267	
小計 銘柄数<比率>	4	4	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
CLP HOLDINGS LIMITED	355	565	3,745	73,795	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	287	276	9,367	184,538	金融サービス
MTR CORPORATION	280	730	2,058	40,554	運輸
HANG SENG BANK	125	247	2,362	46,542	銀行

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		584	984	2,563	50,498	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED		175	575	2,909	57,317	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS		2,375	4,535	2,757	54,329	公益事業
Galaxy Entertainment Group Limited		710	1,070	3,884	76,516	消費者サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		670	1,145	2,982	58,759	銀行
SINO LAND CO		1,418	1,498	1,187	23,401	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		285	395	3,288	64,780	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A		245	290	1,912	37,677	資本財
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		365	455	4,986	98,239	資本財
AIA GROUP LTD		2,597	3,361	20,822	410,193	保険
HKT Trust / HKT Ltd		850	1,720	1,658	32,664	電気通信サービス
Sands China Ltd		1,032	1,620	3,369	66,381	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		840	—	—	—	不動産管理・開発
WH Group Limited		2,110	4,505	2,802	55,201	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		408	783	3,231	63,651	資本財
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)		375	465	2,501	49,283	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LIMITED		293	378	1,252	24,666	不動産管理・開発
小計	株数・金額	16,381	25,598	79,644	1,568,994	
	銘柄数<比率>	21	20	—	<0.5%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		726	993	464	53,619	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD		355	570	2,417	278,943	銀行
CITY DEVELOPMENTS		371	—	—	—	不動産管理・開発
SINGAPORE EXCHANGE LTD		263	282	323	37,360	金融サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD		—	471	303	35,051	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		258	346	1,236	142,681	銀行
UNITED OVERSEAS LAND LTD		373	—	—	—	不動産管理・開発
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,908	2,828	919	106,045	電気通信サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		597	797	1,280	147,708	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		802	955	300	34,626	食品・飲料・タバコ
KEPPEL LTD		611	753	482	55,690	資本財
GENTING SINGAPORE LTD		3,372	4,351	343	39,659	消費者サービス
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI		1,059	1,480	412	47,642	不動産管理・開発
小計	株数・金額	10,697	13,828	8,485	979,030	
	銘柄数<比率>	12	11	—	<0.3%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		208	208	488	19,957	銀行
BANK HAPOALIM BM		311	311	1,299	53,044	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		202	202	802	32,769	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		4	4	390	15,959	資本財
ICL GROUP LTD		228	228	355	14,516	素材
NICE LTD		8	8	617	25,194	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		55	55	900	36,786	銀行
AZRIELI GROUP LTD		21	21	623	25,451	不動産管理・開発
小計	株数・金額	1,039	1,039	5,478	223,679	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	235,727	318,363	—	286,220,529	
	銘柄数<比率>	1,005	986	—	<97.2%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。
(注) 小計、合計欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。
(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

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)		千口	千口	千米ドル	千円	%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC		4	5	611	93,572	0.0
AMERICAN TOWER CORP		10	13	2,671	409,102	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC		2	3	894	137,028	0.0
BXP,INC.		5	6	562	86,163	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST		2	3	434	66,612	0.0
CROWN CASTLE INC		9	11	1,254	192,038	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC		7	9	1,733	265,418	0.1
EQUINIX INC		2	2	2,448	374,913	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC		4	5	372	57,078	0.0
EQUITY RESIDENTIAL		7	8	645	98,776	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		1	1	572	87,712	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC		5	7	1,216	186,294	0.1
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		12	22	504	77,206	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		20	24	435	66,755	0.0
INVITATION HOMES INC		16	17	594	90,980	0.0
IRON MOUNTAIN INC		—	9	1,193	182,847	0.1
KIMCO REALTY CORP		19	23	597	91,508	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC		2	3	532	81,617	0.0
PROLOGIS INC		20	26	3,048	466,851	0.2
PUBLIC STORAGE		3	4	1,517	232,397	0.1
REALTY INCOME CORP		13	24	1,395	213,668	0.1
REGENCY CENTERS CORP		4	4	361	55,310	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		7	9	1,696	259,867	0.1
SUN COMMUNITIES INC		3	4	523	80,182	0.0
UDR INC		8	9	440	67,421	0.0
VENTAS INC		10	12	839	128,514	0.0
VICI PROPERTIES INC		21	31	977	149,759	0.1
WP CAREY INC		5	5	335	51,343	0.0
WELLTOWER INC		11	17	2,482	380,104	0.1
WEYERHAEUSER CO		16	21	698	107,019	0.0
小計	口数・金額	262	354	31,592	4,838,070	
	銘柄数<比率>	29	30	—	<1.6%>	
(カナダ)				千カナダドル		
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		12	—	—	—	—
小計	口数・金額	12	—	—	—	
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
KLEPIERRE		6	6	197	32,469	0.0
GECINA SA		1	1	187	30,772	0.0
COVIVIO		3	4	260	42,795	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		2	5	431	70,821	0.0
ユーロ計	口数・金額	14	19	1,078	176,859	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.1%>	

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)		千口	千口	千英ポンド	千円	%
SEGRO PLC		38	39	310	61,347	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		28	30	180	35,747	0.0
小計	口数・金額	66	70	490	97,095	
	銘柄数<比率>	2	2	－	<0.0%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		131	166	350	35,323	0.0
GPT GROUP		48	72	328	33,123	0.0
STOCKLAND		58	115	582	58,824	0.0
DEXUS/AU		22	40	287	29,020	0.0
GOODMAN GROUP		40	54	1,931	194,860	0.1
SCENTRE GROUP		96	159	549	55,481	0.0
小計	口数・金額	398	609	4,030	406,634	
	銘柄数<比率>	6	6	－	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		58	96	3,523	69,413	0.0
小計	口数・金額	58	96	3,523	69,413	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		219	268	528	60,961	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		74	－	－	－	－
小計	口数・金額	293	268	528	60,961	
	銘柄数<比率>	2	1	－	<0.0%>	
合計	口数・金額	1,107	1,418	－	5,649,033	
	銘柄数<比率>	45	44	－	<1.9%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。
(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。
(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

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		百万円	百万円
		S&P 500 EMIN	2,029	－
		DJ EU STX 50	331	－
		FTSE 100 IDX	159	－

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

○投資信託財産の構成

(2024年11月11日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	286,220,529	97.1
投資証券	5,649,033	1.9
コール・ローン等、その他	2,964,880	1.0
投資信託財産総額	294,834,442	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(294,465,363千円)の投資信託財産総額(294,834,442千円)に対する比率は99.9%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=153.14円、1カナダドル=110.07円、1ユーロ=164.04円、1英ポンド=197.75円、1スイスフラン=174.76円、1スウェーデンクローナ=14.15円、1ノルウェークローネ=13.91円、1デンマーククローネ=22.00円、1豪ドル=100.90円、1ニュージーランドドル=91.36円、1香港ドル=19.70円、1シンガポールドル=115.38円、1イスラエルシェケル=40.8304円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年11月11日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	295,059,384,532
コール・ローン等	806,482,839
株式(評価額)	286,220,529,245
投資証券(評価額)	5,649,033,906
未収入金	283,310,981
未収配当金	168,953,375
未収利息	2,147
差入委託証拠金	1,931,072,039
(B) 負債	456,814,554
未払金	233,169,961
未払解約金	223,644,593
(C) 純資産総額(A－B)	294,602,569,978
元本	42,462,727,551
次期繰越損益金	252,139,842,427
(D) 受益権総口数	42,462,727,551口
１万口当たり基準価額(C／D)	69,379円

(注) 当親ファンドの期首元本額は33,965,791,316円、期中追加設定元本額は12,241,804,814円、期中一部解約元本額は3,744,868,579円です。

＜元本の内訳＞

東京海上セレクション・外国株式インデックス2＜適格機関投資家限定＞	23,637,457,359円
東京海上セレクション・外国株式インデックス	13,234,650,226円
先進国株式インデックス（適格機関投資家専用）	2,782,280,041円
東京海上・世界インデックス・バランス60＜適格機関投資家限定＞	1,724,393,654円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	292,972,262円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	227,754,615円
東京海上・世界インデックス・バランス40＜適格機関投資家限定＞	196,015,675円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	138,482,719円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	138,164,210円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	89,322,764円
TMA外国株式インデックスVA＜適格機関投資家限定＞	1,234,026円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

(注) 上記表中の１万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2023年11月11日～2024年11月11日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	4,011,089,886
受取配当金	3,863,213,349
受取利息	60,535,731
その他収益金	87,372,352
支払利息	△ 31,546
(B) 有価証券売買損益	65,298,589,729
売買益	70,203,166,953
売買損	△ 4,904,577,224
(C) 先物取引等取引損益	421,767,073
取引益	866,988,461
取引損	△ 445,221,388
(D) 保管費用等	△ 37,234,271
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	69,694,212,417
(F) 前期繰越損益金	139,329,644,923
(G) 追加信託差損益金	62,052,103,769
(H) 解約差損益金	△ 18,936,118,682
(I) 計(E＋F＋G＋H)	252,139,842,427
次期繰越損益金(I)	252,139,842,427

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

(注) **(G)追加信託差損益金**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です。

(注) **(H)解約差損益金**は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書　第19期（決算日　2024年11月11日）

（計算期間　2023年11月11日～2024年11月11日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、－印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
15期(2020年11月10日)	16,671	5.5	287.164	5.5	98.8	6,878
16期(2021年11月10日)	17,599	5.6	303.543	5.7	99.3	9,910
17期(2022年11月10日)	17,776	1.0	307.252	1.2	98.6	12,958
18期(2023年11月10日)	18,930	6.5	327.088	6.5	98.8	17,668
19期(2024年11月11日)	20,507	8.3	354.543	8.4	98.7	24,613

○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		債券組入比率
		騰落率		騰落率	
	円	%		%	%
(期　首) 2023年11月10日	18,930	－	327.088	－	98.8
11月末	19,027	0.5	328.916	0.6	98.5
12月末	19,052	0.6	329.251	0.7	98.2
2024年１月末	19,389	2.4	335.106	2.5	98.4
２月末	19,637	3.7	339.486	3.8	98.4
３月末	19,883	5.0	343.803	5.1	98.3
４月末	20,251	7.0	350.129	7.0	98.4
５月末	20,368	7.6	352.183	7.7	98.5
６月末	21,071	11.3	364.447	11.4	98.2
７月末	20,312	7.3	351.180	7.4	98.6
８月末	19,795	4.6	342.231	4.6	98.7
９月末	19,841	4.8	342.901	4.8	98.6
10月末	20,656	9.1	357.115	9.2	98.4
(期　末) 2024年11月11日	20,507	8.3	354.543	8.4	98.7

(注) 騰落率は期首比です。

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。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値を用いて計算しているため、FTSE世界国債インデックス（国内投信用）を使用しています。
FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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。

○運用経過

（2023年11月11日～2024年11月11日）

■期中の基準価額等の推移

期　首：18,930円
期　末：20,507円
騰落率：　8.3%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

・欧米中央銀行の利下げを背景とした世界的な国債利回りの低下（債券価格の上昇）
・米国経済が堅調であることを受けて円安が進行したこと
・保有する債券の利息収入

マイナス要因

・期中に日銀の利上げなどにより内外金利差が縮小し、円高が急速に進行する場面があったこと

（注）ベンチマークは、期首（2023年11月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。
（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。

■投資環境

【外国債券市場】

米国債利回りは低下しました。期初は米国で雇用統計やCPI（消費者物価指数）に落ち着きが見られたことを背景にFRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締め姿勢に後退の兆しが見え、米国債利回りは低下しました。期半ばにかけて、堅調な経済指標が確認されたことや、FRB高官による早期の利下げを否定する発言などから、米国債利回りは上昇（債券価格は下落）に転じる局面もありましたが、その後は、景気や雇用に鈍化の兆候が見られ、FRBによる利下げが実施されると、再度低下基調となりました。しかし、期末にかけて発表された経済指標の多くが堅調だったことを受けて過度な利下げ期待が剥落するなか、米国債利回りは再び上昇しましたが、前期末からは低下して期を終えました。

ドイツ国債利回りは低下しました。欧州域内の物価・景気指標に減速感が見られたことにより、ECB（欧州中央銀行）が利下げ姿勢に転換したことから、ドイツ国債利回りは低下しました。

【為替市場】

米ドル円為替レートは、日銀が金融政策を修正しつつも慎重な姿勢を維持するなか、FRBは利下げ姿勢に転じたものの米国経済は依然として堅調であることから、円安米ドル高が進行しました。期中、日銀による利上げの実施を受けて内外金利差が縮小し円高が急速に進行する場面もありましたが、前期末対比円安米ドル高となりました。

ユーロ円為替レートは、日銀が金融政策に慎重な姿勢を維持するなか、ECBは利下げ姿勢に転じたものの米国債に連動して欧州国債利回りが上昇した局面で円安ユーロ高が進行しました。期中、日銀による利上げの実施を受けて円高が急速に進行する場面もありましたが、前期末対比円安ユーロ高となりました。

■ポートフォリオについて

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は8.3%上昇しました。

■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＋8.3%となり、ベンチマークの騰落率＋8.4%にほぼ連動しました。

（主な差異要因）

プラス要因

・特にありません

マイナス要因

・個別銘柄要因

・取引などに係るコスト

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー(※)は、10月末現在、推定値で0.10%となっています。

※2024年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

○１万口当たりの費用明細

（2023年11月11日～2024年11月11日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	7	0.033	(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）	(7)	(0.033)	＊保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(0)	(0.000)	＊その他は、信託事務等に要する諸費用
合計	7	0.033	
期中の平均基準価額は、19,940円です。			

（注）各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

（2023年11月11日～2024年11月11日）

公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 27,994	千米ドル 11,360
	カナダ	国債証券	千カナダドル 1,662	千カナダドル 689
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 6,894	千メキシコペソ 2,533
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	2,559	1,180
	イタリア	国債証券	3,202	1,480
	フランス	国債証券	3,119	1,347
	オランダ	国債証券	467	193
	スペイン	国債証券	1,981	1,045
	ベルギー	国債証券	422	97
	オーストリア	国債証券	483	96
	フィンランド	国債証券	291	100
	アイルランド	国債証券	166	101
	ポルトガル	国債証券	807	－
	イギリス	国債証券	千英ポンド 2,224	千英ポンド 585
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 592	千スウェーデンクローナ 496
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 954	千ノルウェークローネ 390
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 444	千デンマーククローネ 291
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 1,489	千ポーランドズロチ 674
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 642	千豪ドル 195
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 285	千ニュージーランドドル －
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 294	千シンガポールドル 100
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 922	千マレーシアリンギット 201
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 979	千イスラエルシェケル 388
	中国	国債証券	千オフショア元 76,121	千オフショア元 11,956

（注）金額は受渡代金です。（経過利子分は含まれていません）

○利害関係人との取引状況等

（2023年11月11日～2024年11月11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

（2024年11月11日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	80,350	74,003	11,332,877	46.0	－	19.8	17.1	9.2
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	4,500	4,325	476,059	1.9	－	1.1	0.4	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	26,100	23,456	178,506	0.7	－	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	9,200	8,627	1,415,214	5.7	－	3.3	1.7	0.7
イタリア	10,600	10,293	1,688,532	6.9	－	4.0	1.8	1.1
フランス	12,100	11,037	1,810,665	7.4	－	4.2	2.2	0.9
オランダ	2,100	1,934	317,394	1.3	－	0.8	0.4	0.1
スペイン	6,900	6,581	1,079,623	4.4	－	2.4	1.4	0.5
ベルギー	2,600	2,361	387,376	1.6	－	1.1	0.4	0.1
オーストリア	1,900	1,710	280,603	1.1	－	0.8	0.2	0.2
フィンランド	800	743	121,907	0.5	－	0.4	0.1	－
アイルランド	800	714	117,244	0.5	－	0.3	0.1	0.1
ポルトガル	800	802	131,641	0.5	－	0.4	0.1	－
	千英ポンド	千英ポンド						
イギリス	7,840	6,385	1,262,785	5.1	－	3.6	1.3	0.3
	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
スウェーデン	2,800	2,744	38,840	0.2	－	0.1	0.1	－
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	2,800	2,591	36,052	0.1	－	0.1	0.0	0.0
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	2,900	2,805	61,715	0.3	－	0.2	0.0	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	3,600	3,348	126,887	0.5	－	0.1	0.3	0.1
	千豪ドル	千豪ドル						
オーストラリア	3,500	3,105	313,381	1.3	－	0.9	0.2	0.2
	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル						
ニュージーランド	800	732	66,942	0.3	－	0.2	0.1	－
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	900	895	103,302	0.4	－	0.3	0.0	0.0
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	3,500	3,583	124,813	0.5	－	0.3	0.1	0.0
	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル						
イスラエル	2,100	1,883	76,910	0.3	－	0.2	0.1	0.0
	千オフショア元	千オフショア元						
中国	122,900	128,459	2,732,579	11.1	－	5.1	4.0	2.1
合計	－	－	24,281,859	98.7	－	50.0	32.4	16.3

（注）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

（B）外国（外貨建）公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
（アメリカ）	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 0 1/2 02/28/26	0.5	100	95	14,579	2026/2/28
T 0 1/2 04/30/27	0.5	100	91	13,991	2027/4/30
T 0 1/2 05/31/27	0.5	200	182	27,893	2027/5/31
T 0 1/2 06/30/27	0.5	100	90	13,907	2027/6/30
T 0 1/2 08/31/27	0.5	300	270	41,482	2027/8/31
T 0 1/2 10/31/27	0.5	200	179	27,485	2027/10/31
T 0 1/4 10/31/25	0.25	400	384	58,893	2025/10/31
T 0 3/4 01/31/28	0.75	300	268	41,188	2028/1/31
T 0 3/4 03/31/26	0.75	300	285	43,758	2026/3/31
T 0 3/4 04/30/26	0.75	200	189	29,095	2026/4/30
T 0 3/4 05/31/26	0.75	100	94	14,506	2026/5/31
T 0 3/4 08/31/26	0.75	300	281	43,165	2026/8/31
T 0 3/8 01/31/26	0.375	500	476	73,003	2026/1/31
T 0 3/8 07/31/27	0.375	200	180	27,637	2027/7/31
T 0 3/8 09/30/27	0.375	400	358	54,931	2027/9/30
T 0 3/8 11/30/25	0.375	100	95	14,693	2025/11/30
T 0 3/8 12/31/25	0.375	300	286	43,942	2025/12/31
T 0 5/8 05/15/30	0.625	400	330	50,543	2030/5/15
T 0 5/8 07/31/26	0.625	300	282	43,189	2026/7/31
T 0 5/8 08/15/30	0.625	400	327	50,083	2030/8/15
T 0 5/8 11/30/27	0.625	400	359	55,011	2027/11/30
T 0 5/8 12/31/27	0.625	300	268	41,139	2027/12/31
T 0 7/8 06/30/26	0.875	200	189	28,994	2026/6/30
T 0 7/8 09/30/26	0.875	400	375	57,537	2026/9/30
T 0 7/8 11/15/30	0.875	500	412	63,185	2030/11/15
T 1 07/31/28	1.0	300	267	40,903	2028/7/31
T 1 1/2 01/31/27	1.5	200	188	28,874	2027/1/31
T 1 1/2 02/15/30	1.5	500	436	66,846	2030/2/15
T 1 1/2 11/30/28	1.5	400	359	55,108	2028/11/30
T 1 1/4 04/30/28	1.25	300	271	41,590	2028/4/30
T 1 1/4 05/15/50	1.25	200	100	15,426	2050/5/15
T 1 1/4 05/31/28	1.25	300	270	41,495	2028/5/31
T 1 1/4 06/30/28	1.25	200	180	27,599	2028/6/30
T 1 1/4 08/15/31	1.25	500	412	63,215	2031/8/15
T 1 1/4 09/30/28	1.25	400	357	54,794	2028/9/30
T 1 1/4 11/30/26	1.25	500	470	72,107	2026/11/30
T 1 1/4 12/31/26	1.25	600	563	86,353	2026/12/31
T 1 1/8 02/15/31	1.125	500	416	63,777	2031/2/15
T 1 1/8 02/29/28	1.125	300	271	41,609	2028/2/29
T 1 1/8 05/15/40	1.125	200	125	19,156	2040/5/15
T 1 1/8 08/15/40	1.125	100	61	9,490	2040/8/15
T 1 1/8 08/31/28	1.125	300	267	40,990	2028/8/31
T 1 1/8 10/31/26	1.125	400	376	57,676	2026/10/31
T 1 3/4 01/31/29	1.75	200	181	27,728	2029/1/31
T 1 3/4 08/15/41	1.75	300	201	30,928	2041/8/15
T 1 3/4 11/15/29	1.75	300	267	40,988	2029/11/15
T 1 3/4 12/31/26	1.75	300	285	43,648	2026/12/31
T 1 3/8 08/15/50	1.375	200	103	15,884	2050/8/15

銘柄	当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
（アメリカ）	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 1 3/8 10/31/28	1.375	400	358	54,949	2028/10/31
T 1 3/8 11/15/31	1.375	900	744	113,972	2031/11/15
T 1 3/8 11/15/40	1.375	500	321	49,265	2040/11/15
T 1 3/8 12/31/28	1.375	600	536	82,094	2028/12/31
T 1 5/8 02/15/26	1.625	600	580	88,879	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	200	192	29,447	2026/5/15
T 1 5/8 05/15/31	1.625	500	426	65,272	2031/5/15
T 1 5/8 08/15/29	1.625	300	267	40,945	2029/8/15
T 1 5/8 09/30/26	1.625	200	190	29,194	2026/9/30
T 1 5/8 11/15/50	1.625	600	332	50,905	2050/11/15
T 1 5/8 11/30/26	1.625	300	284	43,609	2026/11/30
T 1 7/8 02/15/32	1.875	500	426	65,243	2032/2/15
T 1 7/8 02/15/41	1.875	300	208	31,981	2041/2/15
T 1 7/8 02/15/51	1.875	300	177	27,146	2051/2/15
T 1 7/8 02/28/27	1.875	300	284	43,594	2027/2/28
T 1 7/8 02/28/29	1.875	200	181	27,834	2029/2/28
T 1 7/8 07/31/26	1.875	100	96	14,711	2026/7/31
T 1 7/8 11/15/51	1.875	800	469	71,894	2051/11/15
T 2 02/15/50	2.0	500	307	47,021	2050/2/15
T 2 08/15/51	2.0	400	242	37,208	2051/8/15
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	71	10,947	2046/2/15
T 2 1/2 03/31/27	2.5	200	192	29,456	2027/3/31
T 2 1/2 05/15/46	2.5	100	71	10,914	2046/5/15
T 2 1/4 02/15/52	2.25	300	193	29,581	2052/2/15
T 2 1/4 05/15/41	2.25	300	221	33,880	2041/5/15
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	94	14,536	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	200	135	20,718	2046/8/15
T 2 1/4 08/15/49	2.25	200	130	20,030	2049/8/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	378	57,886	2027/11/15
T 2 11/15/26	2.0	100	95	14,662	2026/11/15
T 2 11/15/41	2.0	800	558	85,545	2041/11/15
T 2 3/4 02/15/28	2.75	600	573	87,826	2028/2/15
T 2 3/4 04/30/27	2.75	200	193	29,583	2027/4/30
T 2 3/4 05/31/29	2.75	200	187	28,789	2029/5/31
T 2 3/4 07/31/27	2.75	300	288	44,229	2027/7/31
T 2 3/4 08/15/32	2.75	300	270	41,365	2032/8/15
T 2 3/4 08/15/42	2.75	100	78	11,950	2042/8/15
T 2 3/4 08/15/47	2.75	100	73	11,294	2047/8/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	155	23,803	2042/11/15
T 2 3/4 11/15/47	2.75	200	147	22,554	2047/11/15
T 2 3/8 02/15/42	2.375	300	221	33,977	2042/2/15
T 2 3/8 03/31/29	2.375	300	278	42,586	2029/3/31
T 2 3/8 05/15/27	2.375	100	95	14,648	2027/5/15
T 2 3/8 05/15/29	2.375	100	92	14,179	2029/5/15
T 2 3/8 05/15/51	2.375	300	199	30,605	2051/5/15
T 2 3/8 11/15/49	2.375	500	335	51,358	2049/11/15
T 2 5/8 01/31/26	2.625	100	98	15,008	2026/1/31
T 2 5/8 02/15/29	2.625	100	93	14,375	2029/2/15

銘柄	当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
（アメリカ）	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 2 5/8 05/31/27	2.625	200	192	29,461	2027/5/31
T 2 5/8 07/31/29	2.625	200	186	28,573	2029/7/31
T 2 7/8 04/30/29	2.875	200	189	28,976	2029/4/30
T 2 7/8 05/15/28	2.875	100	95	14,650	2028/5/15
T 2 7/8 05/15/32	2.875	600	546	83,720	2032/5/15
T 2 7/8 05/15/43	2.875	100	78	12,050	2043/5/15
T 2 7/8 05/15/52	2.875	300	222	34,018	2052/5/15
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	95	14,604	2028/8/15
T 2 7/8 08/15/45	2.875	100	76	11,788	2045/8/15
T 2 7/8 11/15/46	2.875	200	152	23,289	2046/11/15
T 3 02/15/47	3.0	300	232	35,654	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	300	231	35,375	2048/2/15
T 3 02/15/49	3.0	400	306	46,863	2049/2/15
T 3 05/15/47	3.0	100	77	11,858	2047/5/15
T 3 08/15/48	3.0	200	153	23,495	2048/8/15
T 3 08/15/52	3.0	300	228	34,919	2052/8/15
T 3 1/2 01/31/28	3.5	300	293	44,976	2028/1/31
T 3 1/2 01/31/30	3.5	200	193	29,612	2030/1/31
T 3 1/2 02/15/33	3.5	500	473	72,449	2033/2/15
T 3 1/2 04/30/30	3.5	200	193	29,576	2030/4/30
T 3 1/2 09/30/26	3.5	700	690	105,728	2026/9/30
T 3 1/4 05/15/42	3.25	100	84	12,928	2042/5/15
T 3 1/4 06/30/27	3.25	300	292	44,859	2027/6/30
T 3 1/4 06/30/29	3.25	200	191	29,398	2029/6/30
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	82	12,576	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	78	12,048	2048/5/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	242	37,158	2044/8/15
T 3 1/8 08/31/27	3.125	300	291	44,639	2027/8/31
T 3 1/8 08/31/29	3.125	100	95	14,598	2029/8/31
T 3 1/8 11/15/28	3.125	200	192	29,416	2028/11/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	83	12,830	2041/11/15
T 3 11/15/44	3.0	100	79	12,110	2044/11/15
T 3 11/15/45	3.0	400	314	48,093	2045/11/15
T 3 3/4 04/15/26	3.75	200	198	30,393	2026/4/15
T 3 3/4 05/31/30	3.75	200	195	29,934	2030/5/31
T 3 3/4 06/30/30	3.75	200	195	29,919	2030/6/30
T 3 3/4 08/15/27	3.75	1,000	988	151,327	2027/8/15
T 3 3/4 08/31/31	3.75	300	291	44,603	2031/8/31
T 3 3/4 11/15/43	3.75	200	178	27,407	2043/11/15
T 3 3/4 12/31/28	3.75	900	884	135,403	2028/12/31
T 3 3/4 12/31/30	3.75	500	487	74,586	2030/12/31
T 3 3/8 05/15/33	3.375	500	467	71,633	2033/5/15
T 3 3/8 08/15/42	3.375	300	257	39,390	2042/8/15
T 3 3/8 09/15/27	3.375	500	489	74,915	2027/9/15
T 3 3/8 11/15/48	3.375	400	328	50,234	2048/11/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	87	13,432	2044/2/15
T 3 5/8 02/15/53	3.625	300	258	39,511	2053/2/15
T 3 5/8 03/31/28	3.625	300	294	45,112	2028/3/31
T 3 5/8 03/31/30	3.625	300	291	44,655	2030/3/31

銘柄	当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
（アメリカ）	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 3 5/8 05/15/26	3.625	400	396	60,662	2026/5/15
T 3 5/8 05/15/53	3.625	300	258	39,537	2053/5/15
T 3 5/8 05/31/28	3.625	600	588	90,132	2028/5/31
T 3 5/8 08/15/43	3.625	100	88	13,484	2043/8/15
T 3 5/8 08/31/29	3.625	400	390	59,772	2029/8/31
T 3 5/8 09/30/31	3.625	300	289	44,258	2031/9/30
T 3 7/8 01/15/26	3.875	300	298	45,706	2026/1/15
T 3 7/8 02/15/43	3.875	100	91	14,042	2043/2/15
T 3 7/8 05/15/43	3.875	300	274	42,030	2043/5/15
T 3 7/8 08/15/33	3.875	600	581	89,087	2033/8/15
T 3 7/8 08/15/34	3.875	600	579	88,790	2034/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	200	187	28,653	2040/8/15
T 3 7/8 09/30/29	3.875	300	295	45,269	2029/9/30
T 3 7/8 11/30/27	3.875	400	396	60,675	2027/11/30
T 3 7/8 11/30/29	3.875	100	98	15,083	2029/11/30
T 3 7/8 12/31/27	3.875	1,100	1,089	166,838	2027/12/31
T 3 7/8 12/31/29	3.875	700	689	105,541	2029/12/31
T 4 01/15/27	4.0	300	298	45,717	2027/1/15
T 4 01/31/29	4.0	500	495	75,949	2029/1/31
T 4 01/31/31	4.0	400	394	60,471	2031/1/31
T 4 02/15/26	4.0	100	99	15,255	2026/2/15
T 4 02/15/34	4.0	700	684	104,765	2034/2/15
T 4 02/28/30	4.0	100	99	15,162	2030/2/28
T 4 02/29/28	4.0	200	198	30,435	2028/2/29
T 4 07/31/29	4.0	700	694	106,303	2029/7/31
T 4 07/31/30	4.0	300	296	45,437	2030/7/31
T 4 1/2 02/15/44	4.5	400	397	60,806	2044/2/15
T 4 1/2 03/31/26	4.5	200	200	30,702	2026/3/31
T 4 1/2 04/15/27	4.5	100	100	15,410	2027/4/15
T 4 1/2 05/15/27	4.5	300	301	46,247	2027/5/15
T 4 1/2 05/31/29	4.5	500	506	77,531	2029/5/31
T 4 1/2 07/15/26	4.5	200	200	30,731	2026/7/15
T 4 1/2 11/15/25	4.5	300	300	46,003	2025/11/15
T 4 1/2 11/15/33	4.5	900	913	139,901	2033/11/15
T 4 1/4 01/31/26	4.25	600	599	91,794	2026/1/31
T 4 1/4 02/15/54	4.25	400	385	59,034	2054/2/15
T 4 1/4 02/28/29	4.25	500	500	76,692	2029/2/28
T 4 1/4 02/28/31	4.25	200	200	30,651	2031/2/28
T 4 1/4 03/15/27	4.25	500	500	76,623	2027/3/15
T 4 1/4 06/30/29	4.25	400	400	61,378	2029/6/30
T 4 1/4 08/15/54	4.25	500	482	73,866	2054/8/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	97	14,972	2040/11/15
T 4 1/4 12/31/25	4.25	700	699	107,064	2025/12/31
T 4 1/8 02/15/27	4.125	500	498	76,387	2027/2/15
T 4 1/8 03/31/29	4.125	300	298	45,788	2029/3/31
T 4 1/8 03/31/31	4.125	100	99	15,217	2031/3/31
T 4 1/8 06/15/26	4.125	500	498	76,368	2026/6/15
T 4 1/8 07/31/28	4.125	500	498	76,351	2028/7/31
T 4 1/8 07/31/31	4.125	500	496	76,034	2031/7/31

銘柄	当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 4 1/8 08/15/44	4.125	200	188	28,862	2044/8/15
T 4 1/8 08/15/53	4.125	400	376	57,687	2053/8/15
T 4 1/8 08/31/30	4.125	200	198	30,468	2030/8/31
T 4 1/8 09/30/27	4.125	200	199	30,572	2027/9/30
T 4 1/8 10/31/27	4.125	300	299	45,845	2027/10/31
T 4 1/8 11/15/32	4.125	1,000	991	151,791	2032/11/15
T 4 10/31/29	4.0	300	297	45,514	2029/10/31
T 4 11/15/42	4.0	400	374	57,279	2042/11/15
T 4 11/15/52	4.0	500	460	70,502	2052/11/15
T 4 12/15/25	4.0	300	298	45,771	2025/12/15
T 4 3/4 02/15/41	4.75	100	103	15,855	2041/2/15
T 4 3/4 11/15/43	4.75	400	410	62,865	2043/11/15
T 4 3/4 11/15/53	4.75	500	522	80,024	2053/11/15
T 4 3/8 02/15/38	4.375	100	100	15,382	2038/2/15
T 4 3/8 05/15/34	4.375	700	704	107,826	2034/5/15
T 4 3/8 05/15/40	4.375	100	99	15,219	2040/5/15
T 4 3/8 07/15/27	4.375	300	301	46,126	2027/7/15
T 4 3/8 07/31/26	4.375	700	700	107,350	2026/7/31
T 4 3/8 08/15/43	4.375	200	195	29,956	2043/8/15
T 4 3/8 08/31/28	4.375	100	100	15,395	2028/8/31
T 4 3/8 11/15/39	4.375	300	298	45,716	2039/11/15
T 4 3/8 11/30/28	4.375	500	502	77,027	2028/11/30
T 4 3/8 11/30/30	4.375	300	302	46,304	2030/11/30
T 4 3/8 12/15/26	4.375	500	501	76,764	2026/12/15
T 4 5/8 02/28/26	4.625	500	501	76,845	2026/2/28
T 4 5/8 03/15/26	4.625	100	100	15,371	2026/3/15
T 4 5/8 04/30/29	4.625	200	203	31,150	2029/4/30
T 4 5/8 04/30/31	4.625	200	204	31,289	2031/4/30
T 4 5/8 05/15/44	4.625	200	201	30,891	2044/5/15
T 4 5/8 05/15/54	4.625	400	410	62,844	2054/5/15
T 4 5/8 05/31/31	4.625	500	510	78,210	2031/5/31
T 4 5/8 06/30/26	4.625	700	703	107,750	2026/6/30
T 4 5/8 09/15/26	4.625	800	804	123,272	2026/9/15
T 4 5/8 09/30/30	4.625	200	204	31,259	2030/9/30
T 4 5/8 10/15/26	4.625	200	201	30,831	2026/10/15
T 4 5/8 11/15/26	4.625	500	503	77,120	2026/11/15
T 4 7/8 04/30/26	4.875	100	100	15,437	2026/4/30
T 4 7/8 05/31/26	4.875	600	605	92,659	2026/5/31
T 4 7/8 10/31/28	4.875	1,000	1,023	156,789	2028/10/31
T 4 7/8 10/31/30	4.875	200	206	31,668	2030/10/31
T 4 7/8 11/30/25	4.875	1,000	1,005	153,936	2025/11/30
T 5 05/15/37	5.0	50	53	8,173	2037/5/15
T 5 10/31/25	5.0	1,000	1,005	154,043	2025/10/31
T 5 3/8 02/15/31	5.375	100	106	16,314	2031/2/15
小計				11,332,877	
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CAN 0 1/2 12/01/30	0.5	300	257	28,366	2030/12/1
CAN 0 1/4 03/01/26	0.25	100	96	10,606	2026/3/1

銘柄	当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
(カナダ)	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
国債証券					
CAN 1 06/01/27	1.0	100	95	10,488	2027/6/1
CAN 1 1/2 06/01/26	1.5	100	97	10,751	2026/6/1
CAN 1 1/2 06/01/31	1.5	200	181	19,923	2031/6/1
CAN 1 1/2 12/01/31	1.5	200	179	19,777	2031/12/1
CAN 1 1/4 06/01/30	1.25	100	90	9,997	2030/6/1
CAN 1 3/4 12/01/53	1.75	200	145	16,027	2053/12/1
CAN 2 06/01/28	2.0	100	96	10,655	2028/6/1
CAN 2 06/01/32	2.0	100	92	10,169	2032/6/1
CAN 2 1/2 12/01/32	2.5	200	190	21,004	2032/12/1
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	97	10,696	2029/6/1
CAN 2 12/01/51	2.0	200	156	17,197	2051/12/1
CAN 2 3/4 09/01/27	2.75	100	99	10,927	2027/9/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	92	10,160	2048/12/1
CAN 2 3/4 12/01/55	2.75	200	182	20,092	2055/12/1
CAN 3 04/01/26	3.0	100	99	10,986	2026/4/1
CAN 3 06/01/34	3.0	100	98	10,844	2034/6/1
CAN 3 1/2 03/01/34	3.5	100	102	11,289	2034/3/1
CAN 3 1/2 09/01/29	3.5	100	102	11,243	2029/9/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	104	11,499	2045/12/1
CAN 3 1/4 09/01/28	3.25	200	201	22,213	2028/9/1
CAN 3 1/4 11/01/26	3.25	100	100	11,042	2026/11/1
CAN 3 1/4 12/01/33	3.25	100	100	11,074	2033/12/1
CAN 3 1/4 12/01/34	3.25	100	100	11,066	2034/12/1
CAN 3 10/01/25	3.0	100	99	10,983	2025/10/1
CAN 4 03/01/29	4.0	200	208	22,894	2029/3/1
CAN 4 05/01/26	4.0	200	202	22,282	2026/5/1
CAN 4 06/01/41	4.0	100	110	12,137	2041/6/1
CAN 4 1/2 02/01/26	4.5	100	101	11,180	2026/2/1
CAN 4 1/2 11/01/25	4.5	200	202	22,275	2025/11/1
CAN 5 3/4 06/01/33	5.75	200	238	26,200	2033/6/1
小計				476,059	
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10 11/20/36	10.0	500	505	3,843	2036/11/20
MBONO 5 1/2 03/04/27	5.5	2,700	2,463	18,745	2027/3/4
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	2,200	2,085	15,871	2026/3/5
MBONO 7 09/03/26	7.0	2,400	2,285	17,392	2026/9/3
MBONO 7 1/2 05/26/33	7.5	1,900	1,646	12,529	2033/5/26
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	1,700	1,616	12,298	2027/6/3
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	2,400	2,177	16,571	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	2,200	1,774	13,504	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	1,400	1,216	9,254	2034/11/23
MBONO 8 05/24/35	8.0	100	87	669	2035/5/24
MBONO 8 07/31/53	8.0	2,200	1,775	13,510	2053/7/31
MBONO 8 1/2 03/01/29	8.5	2,100	2,005	15,264	2029/3/1
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	1,500	1,432	10,904	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	1,300	1,160	8,835	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	1,500	1,223	9,311	2047/11/7
小計				178,506	

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…ドイツ）	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
BKO 2 1/2 03/19/26	2.5	100	100	16,452	2026/3/19
BKO 2 12/10/26	2.0	100	99	16,344	2026/12/10
BKO 2.9 06/18/26	2.9	100	101	16,569	2026/6/18
BKO 3.1 12/12/25	3.1	200	201	33,062	2025/12/12
DBR 0 02/15/30	－	100	89	14,681	2030/2/15
DBR 0 02/15/31	－	200	175	28,713	2031/2/15
DBR 0 02/15/32	－	200	170	27,987	2032/2/15
DBR 0 05/15/35	－	100	77	12,773	2035/5/15
DBR 0 05/15/36	－	200	151	24,809	2036/5/15
DBR 0 08/15/26	－	100	96	15,802	2026/8/15
DBR 0 08/15/29	－	200	181	29,711	2029/8/15
DBR 0 08/15/30	－	400	354	58,114	2030/8/15
DBR 0 08/15/31	－	300	259	42,552	2031/8/15
DBR 0 08/15/50	－	300	156	25,707	2050/8/15
DBR 0 08/15/52	－	200	99	16,295	2052/8/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	97	16,055	2026/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	96	15,751	2027/2/15
DBR 0 1/4 02/15/29	0.25	100	92	15,198	2029/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	300	280	46,031	2028/8/15
DBR 0 11/15/27	－	200	187	30,824	2027/11/15
DBR 0 11/15/28	－	300	276	45,321	2028/11/15
DBR 1 05/15/38	1.0	200	165	27,082	2038/5/15
DBR 1 1/4 08/15/48	1.25	200	153	25,148	2048/8/15
DBR 1.7 08/15/32	1.7	200	192	31,560	2032/8/15
DBR 1.8 08/15/53	1.8	200	168	27,614	2053/8/15
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	200	197	32,338	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	200	197	32,324	2046/8/15
DBR 2 1/2 08/15/54	2.5	100	98	16,080	2054/8/15
DBR 2.1 11/15/29	2.1	200	199	32,658	2029/11/15
DBR 2.2 02/15/34	2.2	200	197	32,435	2034/2/15
DBR 2.3 02/15/33	2.3	100	100	16,423	2033/2/15
DBR 2.3 02/15/33	2.3	300	300	49,299	2033/2/15
DBR 2.4 11/15/30	2.4	200	201	33,127	2030/11/15
DBR 2.6 05/15/41	2.6	100	99	16,398	2041/5/15
DBR 2.6 08/15/33	2.6	100	102	16,777	2033/8/15
DBR 2.6 08/15/34	2.6	200	204	33,473	2034/8/15
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	100	109	17,923	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	200	231	37,963	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	120	19,766	2034/7/4
DBR 4 3/4 07/04/40	4.75	100	127	20,968	2040/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	100	120	19,756	2039/7/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	100	118	19,455	2031/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	111	18,226	2027/7/4
OBL 0 04/10/26	－	200	193	31,818	2026/4/10
OBL 0 04/16/27	－	200	190	31,188	2027/4/16
OBL 0 10/09/26	－	300	288	47,268	2026/10/9
OBL 1.3 10/15/27	1.3	400	391	64,178	2027/10/15
OBL 2.1 04/12/29	2.1	100	99	16,350	2029/4/12
OBL 2.1 04/12/29	2.1	200	199	32,711	2029/4/12

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…ドイツ）	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
OBL 2.2 04/13/28	2.2	100	100	16,450	2028/4/13
OBL 2.4 10/19/28	2.4	300	302	49,681	2028/10/19
（ユーロ…イタリア）					
国債証券					
BTPS 0 04/01/26	－	200	192	31,655	2026/4/1
BTPS 0 08/01/26	－	200	191	31,396	2026/8/1
BTPS 0 1/2 02/01/26	0.5	100	97	15,979	2026/2/1
BTPS 0 1/2 07/15/28	0.5	100	92	15,106	2028/7/15
BTPS 0 1/4 03/15/28	0.25	100	92	15,104	2028/3/15
BTPS 0.45 02/15/29	0.45	100	90	14,821	2029/2/15
BTPS 0.6 08/01/31	0.6	100	84	13,834	2031/8/1
BTPS 0.85 01/15/27	0.85	300	288	47,397	2027/1/15
BTPS 0.9 04/01/31	0.9	100	86	14,251	2031/4/1
BTPS 0.95 03/01/37	0.95	200	145	23,907	2037/3/1
BTPS 0.95 06/01/32	0.95	100	84	13,853	2032/6/1
BTPS 0.95 08/01/30	0.95	200	177	29,120	2030/8/1
BTPS 0.95 12/01/31	0.95	200	171	28,102	2031/12/1
BTPS 1 1/2 04/30/45	1.5	100	65	10,777	2045/4/30
BTPS 1.1 04/01/27	1.1	100	96	15,831	2027/4/1
BTPS 1.45 03/01/36	1.45	100	79	13,074	2036/3/1
BTPS 1.6 06/01/26	1.6	200	197	32,325	2026/6/1
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	89	14,706	2032/3/1
BTPS 1.65 12/01/30	1.65	200	183	30,102	2030/12/1
BTPS 1.7 09/01/51	1.7	100	62	10,280	2051/9/1
BTPS 1.8 03/01/41	1.8	100	74	12,182	2041/3/1
BTPS 2 02/01/28	2.0	100	97	16,045	2028/2/1
BTPS 2 1/2 12/01/32	2.5	200	188	30,875	2032/12/1
BTPS 2 1/4 09/01/36	2.25	100	86	14,177	2036/9/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	99	16,298	2025/12/1
BTPS 2.15 09/01/52	2.15	100	68	11,209	2052/9/1
BTPS 2.45 09/01/33	2.45	100	92	15,219	2033/9/1
BTPS 2.45 09/01/50	2.45	100	74	12,211	2050/9/1
BTPS 2.65 12/01/27	2.65	300	299	49,120	2027/12/1
BTPS 2.7 03/01/47	2.7	100	80	13,209	2047/3/1
BTPS 2.8 03/01/67	2.8	100	75	12,397	2067/3/1
BTPS 2.8 06/15/29	2.8	100	99	16,297	2029/6/15
BTPS 2.8 12/01/28	2.8	100	99	16,400	2028/12/1
BTPS 2.95 02/15/27	2.95	100	100	16,500	2027/2/15
BTPS 2.95 09/01/38	2.95	100	90	14,881	2038/9/1
BTPS 3 08/01/29	3.0	200	200	32,910	2029/8/1
BTPS 3 1/2 01/15/26	3.5	100	100	16,551	2026/1/15
BTPS 3 1/2 02/15/31	3.5	100	101	16,668	2031/2/15
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	100	102	16,818	2030/3/1
BTPS 3 1/4 03/01/38	3.25	100	94	15,420	2038/3/1
BTPS 3 1/4 09/01/46	3.25	100	88	14,524	2046/9/1
BTPS 3.1 03/01/40	3.1	100	90	14,858	2040/3/1
BTPS 3.1 08/28/26	3.1	100	100	16,521	2026/8/28
BTPS 3.15 11/15/31	3.15	100	99	16,244	2031/11/15
BTPS 3.2 01/28/26	3.2	100	100	16,496	2026/1/28

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	
(ユーロ…イタリア)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
BTPS 3.35 03/01/35	3.35	100	98	16,094	2035/3/1
BTPS 3.35 07/01/29	3.35	200	203	33,324	2029/7/1
BTPS 3.4 04/01/28	3.4	100	101	16,730	2028/4/1
BTPS 3.45 03/01/48	3.45	100	90	14,870	2048/3/1
BTPS 3.45 07/15/27	3.45	200	203	33,429	2027/7/15
BTPS 3.45 07/15/31	3.45	200	202	33,185	2031/7/15
BTPS 3.6 09/29/25	3.6	100	100	16,520	2025/9/29
BTPS 3.7 06/15/30	3.7	100	102	16,891	2030/6/15
BTPS 3.8 04/15/26	3.8	100	101	16,660	2026/4/15
BTPS 3.8 08/01/28	3.8	300	310	50,871	2028/8/1
BTPS 3.85 02/01/35	3.85	100	101	16,724	2035/2/1
BTPS 3.85 07/01/34	3.85	100	102	16,795	2034/7/1
BTPS 3.85 09/01/49	3.85	100	96	15,761	2049/9/1
BTPS 3.85 09/15/26	3.85	200	204	33,502	2026/9/15
BTPS 3.85 12/15/29	3.85	200	207	34,078	2029/12/15
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	103	16,943	2037/2/1
BTPS 4 04/30/35	4.0	100	103	17,051	2035/4/30
BTPS 4 1/2 10/01/53	4.5	100	105	17,256	2053/10/1
BTPS 4 10/30/31	4.0	100	104	17,214	2031/10/30
BTPS 4 11/15/30	4.0	200	208	34,281	2030/11/15
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	106	17,541	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	100	109	17,963	2044/9/1
BTPS 4.05 10/30/37	4.05	100	102	16,879	2037/10/30
BTPS 4.1 02/01/29	4.1	100	104	17,165	2029/2/1
BTPS 4.15 10/01/39	4.15	200	204	33,604	2039/10/1
BTPS 4.2 03/01/34	4.2	100	105	17,292	2034/3/1
BTPS 4.3 10/01/54	4.3	100	100	16,535	2054/10/1
BTPS 4.35 11/01/33	4.35	200	213	35,022	2033/11/1
BTPS 4.4 05/01/33	4.4	100	107	17,611	2033/5/1
BTPS 4.45 09/01/43	4.45	100	104	17,220	2043/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	200	223	36,734	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	112	18,392	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	112	18,377	2040/9/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	116	19,145	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	116	19,128	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	110	18,184	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	108	17,873	2026/11/1
(ユーロ…フランス)					
国債証券					
FRTR 0 02/25/26	－	300	291	47,755	2026/2/25
FRTR 0 02/25/27	－	500	473	77,656	2027/2/25
FRTR 0 05/25/32	－	100	80	13,227	2032/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/26	0.5	100	97	15,952	2026/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/29	0.5	200	181	29,815	2029/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/40	0.5	200	131	21,575	2040/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/72	0.5	100	36	5,929	2072/5/25
FRTR 0 1/2 06/25/44	0.5	100	58	9,673	2044/6/25
FRTR 0 1/4 11/25/26	0.25	300	287	47,137	2026/11/25
FRTR 0 11/25/29	－	300	262	43,042	2029/11/25

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…フランス)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
FRTR 0 11/25/30	－	500	424	69,569	2030/11/25
FRTR 0 11/25/31	－	600	492	80,769	2031/11/25
FRTR 0 3/4 02/25/28	0.75	700	660	108,413	2028/2/25
FRTR 0 3/4 05/25/28	0.75	100	93	15,409	2028/5/25
FRTR 0 3/4 05/25/52	0.75	200	103	17,022	2052/5/25
FRTR 0 3/4 05/25/53	0.75	200	101	16,591	2053/5/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	300	278	45,742	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	300	289	47,489	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	200	184	30,287	2031/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/50	1.5	200	132	21,761	2050/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/34	1.25	300	255	41,902	2034/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	300	244	40,094	2036/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/38	1.25	300	233	38,254	2038/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	300	295	48,482	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/66	1.75	100	62	10,274	2066/5/25
FRTR 1 3/4 06/25/39	1.75	200	164	27,029	2039/6/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	200	152	25,029	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	200	197	32,430	2030/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/43	2.5	100	87	14,308	2043/5/25
FRTR 2 1/2 09/24/26	2.5	500	500	82,163	2026/9/24
FRTR 2 1/2 09/24/27	2.5	300	300	49,212	2027/9/24
FRTR 2 11/25/32	2.0	500	466	76,487	2032/11/25
FRTR 2 3/4 02/25/29	2.75	500	501	82,299	2029/2/25
FRTR 2 3/4 02/25/30	2.75	200	200	32,809	2030/2/25
FRTR 3 05/25/33	3.0	200	199	32,806	2033/5/25
FRTR 3 05/25/54	3.0	200	178	29,260	2054/5/25
FRTR 3 06/25/49	3.0	100	92	15,095	2049/6/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	203	33,327	2026/4/25
FRTR 3 1/2 11/25/33	3.5	300	310	50,982	2033/11/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	200	194	31,887	2045/5/25
FRTR 3 1/4 05/25/55	3.25	100	93	15,285	2055/5/25
FRTR 3 11/25/34	3.0	200	198	32,482	2034/11/25
FRTR 4 04/25/55	4.0	100	107	17,596	2055/4/25
FRTR 4 04/25/60	4.0	100	107	17,702	2060/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	107	17,707	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	200	228	37,524	2035/4/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	223	36,650	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	200	239	39,303	2032/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	200	228	37,455	2041/4/25
(ユーロ…オランダ)					
国債証券					
NETHER 0 01/15/27	－	100	95	15,653	2027/1/15
NETHER 0 01/15/29	－	200	181	29,832	2029/1/15
NETHER 0 01/15/38	－	100	69	11,435	2038/1/15
NETHER 0 01/15/52	－	100	48	7,980	2052/1/15
NETHER 0 07/15/30	－	100	87	14,346	2030/7/15
NETHER 0 07/15/31	－	100	85	13,975	2031/7/15
NETHER 0 1/2 01/15/40	0.5	100	72	11,836	2040/1/15
NETHER 0 1/2 07/15/26	0.5	100	97	15,950	2026/7/15

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
NETHER 0 1/2 07/15/32	0.5	100	86	14,154	2032/7/15
NETHER 0 3/4 07/15/27	0.75	100	96	15,786	2027/7/15
NETHER 0 3/4 07/15/28	0.75	100	94	15,536	2028/7/15
NETHER 2 01/15/54	2.0	100	85	13,954	2054/1/15
NETHER 2 1/2 01/15/30	2.5	100	100	16,503	2030/1/15
NETHER 2 1/2 01/15/33	2.5	100	99	16,374	2033/1/15
NETHER 2 1/2 07/15/33	2.5	100	99	16,319	2033/7/15
NETHER 2 1/2 07/15/34	2.5	100	99	16,243	2034/7/15
NETHER 2 3/4 01/15/47	2.75	100	99	16,374	2047/1/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	113	18,549	2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	100	113	18,562	2037/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	109	18,025	2028/1/15
(ユーロ…スペイン)					
国債証券					
SPGB 0 01/31/26	−	200	194	31,834	2026/1/31
SPGB 0 01/31/27	−	300	284	46,636	2027/1/31
SPGB 0 01/31/28	−	500	461	75,690	2028/1/31
SPGB 0 1/2 10/31/31	0.5	200	171	28,075	2031/10/31
SPGB 0.1 04/30/31	0.1	100	84	13,846	2031/4/30
SPGB 0.6 10/31/29	0.6	100	90	14,850	2029/10/31
SPGB 0.8 07/30/27	0.8	200	191	31,376	2027/7/30
SPGB 0.8 07/30/29	0.8	300	275	45,223	2029/7/30
SPGB 0.85 07/30/37	0.85	100	74	12,244	2037/7/30
SPGB 1 07/30/42	1.0	100	67	11,043	2042/7/30
SPGB 1 1/4 10/31/30	1.25	300	275	45,225	2030/10/31
SPGB 1 10/31/50	1.0	100	56	9,237	2050/10/31
SPGB 1.2 10/31/40	1.2	200	144	23,736	2040/10/31
SPGB 1.3 10/31/26	1.3	200	195	32,124	2026/10/31
SPGB 1.4 07/30/28	1.4	100	96	15,751	2028/7/30
SPGB 1.45 04/30/29	1.45	100	95	15,614	2029/4/30
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	97	15,923	2027/10/31
SPGB 1.85 07/30/35	1.85	200	176	28,994	2035/7/30
SPGB 1.9 10/31/52	1.9	100	69	11,334	2052/10/31
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	99	16,299	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	200	192	31,515	2030/7/30
SPGB 2 1/2 05/31/27	2.5	100	99	16,403	2027/5/31
SPGB 2.35 07/30/33	2.35	200	190	31,267	2033/7/30
SPGB 2.55 10/31/32	2.55	400	390	63,983	2032/10/31
SPGB 2.7 10/31/48	2.7	100	85	13,998	2048/10/31
SPGB 2.8 05/31/26	2.8	300	301	49,453	2026/5/31
SPGB 2.9 10/31/46	2.9	100	89	14,697	2046/10/31
SPGB 3 1/2 05/31/29	3.5	200	207	34,003	2029/5/31
SPGB 3 1/4 04/30/34	3.25	200	203	33,318	2034/4/30
SPGB 3.1 07/30/31	3.1	100	101	16,686	2031/7/30
SPGB 3.45 07/30/43	3.45	100	98	16,094	2043/7/30
SPGB 3.45 07/30/66	3.45	100	92	15,237	2066/7/30
SPGB 3.45 10/31/34	3.45	100	102	16,888	2034/10/31
SPGB 3.55 10/31/33	3.55	200	208	34,176	2033/10/31
SPGB 3.9 07/30/39	3.9	100	105	17,288	2039/7/30

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…スペイン)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
SPGB 4 10/31/54	4.0	100	104	17,088	2054/10/31
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	109	17,970	2037/1/31
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	115	18,908	2041/7/30
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	117	19,238	2040/7/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	100	119	19,647	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	109	17,984	2028/10/31
SPGB 5.15 10/31/44	5.15	100	122	20,071	2044/10/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	113	18,634	2029/1/31
(ユーロ…ベルギー)					
国債証券					
BGB 0 10/22/27	−	100	93	15,298	2027/10/22
BGB 0 10/22/31	−	100	82	13,604	2031/10/22
BGB 0.1 06/22/30	0.1	100	87	14,283	2030/6/22
BGB 0.35 06/22/32	0.35	200	166	27,337	2032/6/22
BGB 0.4 06/22/40	0.4	100	65	10,719	2040/6/22
BGB 0.8 06/22/27	0.8	100	96	15,761	2027/6/22
BGB 0.8 06/22/28	0.8	100	94	15,480	2028/6/22
BGB 0.9 06/22/29	0.9	100	92	15,244	2029/6/22
BGB 1 06/22/26	1.0	200	195	32,117	2026/6/22
BGB 1 06/22/31	1.0	100	89	14,741	2031/6/22
BGB 1 1/4 04/22/33	1.25	100	88	14,532	2033/4/22
BGB 1.4 06/22/53	1.4	100	62	10,301	2053/6/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	71	11,809	2047/6/22
BGB 1.7 06/22/50	1.7	100	70	11,585	2050/6/22
BGB 1.9 06/22/38	1.9	100	86	14,137	2038/6/22
BGB 2.15 06/22/66	2.15	100	73	12,018	2066/6/22
BGB 2.7 10/22/29	2.7	100	100	16,503	2029/10/22
BGB 3 06/22/33	3.0	100	101	16,587	2033/6/22
BGB 3 06/22/34	3.0	100	100	16,527	2034/6/22
BGB 3 3/4 06/22/45	3.75	100	105	17,322	2045/6/22
BGB 3.3 06/22/54	3.3	100	96	15,753	2054/6/22
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	112	18,419	2041/3/28
BGB 5 03/28/35	5.0	100	117	19,291	2035/3/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	109	17,998	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア)					
国債証券					
RAGB 0 02/20/30	−	100	87	14,365	2030/2/20
RAGB 0 02/20/31	−	100	84	13,938	2031/2/20
RAGB 0 1/2 02/20/29	0.5	100	92	15,125	2029/2/20
RAGB 0 1/2 04/20/27	0.5	100	95	15,710	2027/4/20
RAGB 0 1/4 10/20/36	0.25	100	72	11,974	2036/10/20
RAGB 0 10/20/28	−	100	91	14,933	2028/10/20
RAGB 0 10/20/40	−	100	62	10,218	2040/10/20
RAGB 0 3/4 03/20/51	0.75	100	58	9,636	2051/3/20
RAGB 0 3/4 10/20/26	0.75	100	97	15,931	2026/10/20
RAGB 0.9 02/20/32	0.9	100	88	14,480	2032/2/20
RAGB 1 1/2 02/20/47	1.5	100	75	12,349	2047/2/20
RAGB 1.2 10/20/25	1.2	100	98	16,216	2025/10/20
RAGB 1.85 05/23/49	1.85	100	79	13,079	2049/5/23

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…オーストリア)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
RAGB 2 07/15/26	2.0	100	99	16,316	2026/7/15
RAGB 2.4 05/23/34	2.4	100	96	15,846	2034/5/23
RAGB 2.9 02/20/33	2.9	100	101	16,572	2033/2/20
RAGB 3.15 06/20/44	3.15	100	101	16,592	2044/6/20
RAGB 3.8 01/26/62	3.8	100	115	18,895	2062/1/26
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	112	18,420	2037/3/15
(ユーロ…フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0 09/15/30	—	100	86	14,131	2030/9/15
RFGB 0 1/2 09/15/28	0.5	100	93	15,259	2028/9/15
RFGB 0 3/4 04/15/31	0.75	100	89	14,601	2031/4/15
RFGB 1 1/2 09/15/32	1.5	100	91	14,991	2032/9/15
RFGB 1 1/8 04/15/34	1.125	100	86	14,119	2034/4/15
RFGB 2 5/8 07/04/42	2.625	100	94	15,463	2042/7/4
RFGB 2 7/8 04/15/29	2.875	100	101	16,667	2029/4/15
RFGB 3 09/15/33	3.0	100	101	16,671	2033/9/15
(ユーロ…アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0.2 10/18/30	0.2	100	87	14,418	2030/10/18
IRISH 1 05/15/26	1.0	100	98	16,097	2026/5/15
IRISH 1 1/2 05/15/50	1.5	100	75	12,407	2050/5/15
IRISH 1.1 05/15/29	1.1	100	94	15,522	2029/5/15
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	90	14,832	2033/5/15
IRISH 1.35 03/18/31	1.35	100	93	15,336	2031/3/18
IRISH 1.7 05/15/37	1.7	100	88	14,466	2037/5/15
IRISH 2 02/18/45	2.0	100	86	14,163	2045/2/18
(ユーロ…ポルトガル)					
国債証券					
PGB 0.3 10/17/31	0.3	100	86	14,109	2031/10/17
PGB 1.95 06/15/29	1.95	200	196	32,236	2029/6/15
PGB 2 1/4 04/18/34	2.25	200	191	31,334	2034/4/18
PGB 3 7/8 02/15/30	3.875	100	107	17,581	2030/2/15
PGB 4.1 04/15/37	4.1	200	221	36,380	2037/4/15
ユーロ計				7,350,202	
(イギリス)		千英ポンド	千英ポンド		
国債証券					
UKT 0 1/2 01/31/29	0.5	200	171	34,000	2029/1/31
UKT 0 1/2 10/22/61	0.5	200	57	11,271	2061/10/22
UKT 0 1/4 07/31/31	0.25	200	154	30,491	2031/7/31
UKT 0 1/8 01/30/26	0.125	100	95	18,877	2026/1/30
UKT 0 1/8 01/31/28	0.125	100	88	17,441	2028/1/31
UKT 0 3/8 10/22/26	0.375	100	92	18,379	2026/10/22
UKT 0 3/8 10/22/30	0.375	100	80	15,879	2030/10/22
UKT 0 5/8 07/31/35	0.625	100	67	13,393	2035/7/31
UKT 0 5/8 10/22/50	0.625	100	38	7,621	2050/10/22
UKT 0 7/8 01/31/46	0.875	100	47	9,455	2046/1/31
UKT 0 7/8 07/31/33	0.875	100	74	14,818	2033/7/31
UKT 0 7/8 10/22/29	0.875	100	85	16,934	2029/10/22
UKT 1 01/31/32	1.0	300	239	47,359	2032/1/31
UKT 1 1/2 07/22/26	1.5	200	190	37,769	2026/7/22

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
国債証券					
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	54	10,710	2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	92	18,300	2027/7/22
UKT 1 1/4 07/31/51	1.25	200	92	18,351	2051/7/31
UKT 1 1/4 10/22/41	1.25	200	119	23,645	2041/10/22
UKT 1 1/8 01/31/39	1.125	300	191	37,934	2039/1/31
UKT 1 1/8 10/22/2073	1.125	100	34	6,845	2073/10/22
UKT 1 3/4 01/22/49	1.75	100	56	11,092	2049/1/22
UKT 1 3/4 07/22/57	1.75	100	50	9,909	2057/7/22
UKT 1 3/4 09/07/37	1.75	100	73	14,443	2037/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	90	17,984	2028/10/22
UKT 1 5/8 10/22/54	1.625	100	49	9,798	2054/10/22
UKT 1 5/8 10/22/71	1.625	100	43	8,528	2071/10/22
UKT 2 1/2 07/22/65	2.5	100	59	11,772	2065/7/22
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	82	16,309	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	76	15,214	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	80	15,841	2044/1/22
UKT 3 1/4 01/31/33	3.25	300	277	54,783	2033/1/31
UKT 3 3/4 01/29/38	3.75	200	183	36,261	2038/1/29
UKT 3 3/4 03/07/27	3.75	300	295	58,441	2027/3/7
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	82	16,373	2052/7/22
UKT 3 3/4 10/22/53	3.75	300	246	48,830	2053/10/22
UKT 4 01/22/60	4.0	100	85	16,984	2060/1/22
UKT 4 1/2 06/07/28	4.5	300	301	59,597	2028/6/7
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	100	96	19,047	2042/12/7
UKT 4 1/4 03/07/36	4.25	100	97	19,338	2036/3/7
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	30	5,934	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/40	4.25	100	94	18,687	2040/12/7
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	100	91	18,071	2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	90	17,938	2049/12/7
UKT 4 1/4 12/07/55	4.25	100	90	17,799	2055/12/7
UKT 4 1/8 01/29/27	4.125	200	198	39,303	2027/1/29
UKT 4 1/8 07/22/29	4.125	200	198	39,225	2029/7/22
UKT 4 10/22/31	4.0	100	98	19,383	2031/10/22
UKT 4 10/22/63	4.0	100	85	16,870	2063/10/22
UKT 4 3/4 10/22/43	4.75	200	197	39,075	2043/10/22
UKT 4 3/4 12/07/30	4.75	100	102	20,321	2030/12/7
UKT 4 3/4 12/07/38	4.75	100	101	20,006	2038/12/7
UKT 4 3/8 07/31/54	4.375	100	91	18,150	2054/7/31
UKT 4 5/8 01/31/34	4.625	300	304	60,231	2034/1/31
UKT 4.25 06/07/32	4.25	100	99	19,738	2032/6/7
UKT 4.5 09/07/34	4.5	100	100	19,902	2034/9/7
UKT 6 12/07/28	6.0	10	10	2,110	2028/12/7
小計				1,262,785	
(スウェーデン)		ﾁｽｳｪｰﾃﾞﾝｸﾛｰﾅ	ﾁｽｳｪｰﾃﾞﾝｸﾛｰﾅ		
国債証券					
SGB 0 1/8 05/12/31	0.125	300	265	3,749	2031/5/12
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	500	480	6,799	2028/5/12
SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	0.75	500	470	6,664	2029/11/12
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	500	491	6,958	2026/11/12

銘柄	当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
(スウェーデン)	%	チスウェーデンクローナ	チスウェーデンクローナ	千円	
国債証券					
SGB 1 3/4 11/11/33 #1065	1.75	300	290	4,114	2033/11/11
SGB 2 1/4 05/11/35 #1066	2.25	100	100	1,421	2035/5/11
SGB 2 1/4 06/01/32 #1056	2.25	300	303	4,289	2032/6/1
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	300	342	4,841	2039/3/30
小計				38,840	
(ノルウェー)		チノルウェークローネ	チノルウェークローネ		
国債証券					
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	400	387	5,389	2026/2/19
NGB 1 1/4 09/17/31	1.25	300	254	3,546	2031/9/17
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	300	286	3,983	2027/2/17
NGB 1 3/4 09/06/29	1.75	300	273	3,807	2029/9/6
NGB 1 3/8 08/19/30	1.375	300	263	3,660	2030/8/19
NGB 2 04/26/28	2.0	300	282	3,934	2028/4/26
NGB 2 1/8 05/18/32	2.125	300	267	3,725	2032/5/18
NGB 3 08/15/33	3.0	300	282	3,925	2033/8/15
NGB 3 1/2 10/06/42	3.5	100	96	1,345	2042/10/6
NGB 3 5/8 04/13/34	3.625	200	196	2,735	2034/4/13
小計				36,052	
(デンマーク)		チデンマーククローネ	チデンマーククローネ		
国債証券					
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	400	384	8,460	2027/11/15
DGB 0 1/2 11/15/29	0.5	400	373	8,210	2029/11/15
DGB 0 1/4 11/15/52	0.25	400	231	5,093	2052/11/15
DGB 0 11/15/31	—	400	348	7,669	2031/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	400	399	8,780	2025/11/15
DGB 2 1/4 11/15/26	2.25	100	100	2,218	2026/11/15
DGB 2 1/4 11/15/33	2.25	200	202	4,452	2033/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	600	764	16,829	2039/11/15
小計				61,715	
(ポーランド)		チポーランドズロチ	チポーランドズロチ		
国債証券					
POLGB 0 04/25/26	—	100	93	3,549	2026/4/25
POLGB 0 1/4 10/25/26	0.25	300	274	10,407	2026/10/25
POLGB 1 1/4 10/25/30	1.25	300	237	9,003	2030/10/25
POLGB 1 3/4 04/25/32	1.75	300	231	8,786	2032/4/25
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	200	192	7,287	2026/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	93	3,558	2027/7/25
POLGB 2 3/4 04/25/28	2.75	200	185	7,023	2028/4/25
POLGB 2 3/4 10/25/29	2.75	600	534	20,257	2029/10/25
POLGB 3 3/4 05/25/27	3.75	400	388	14,731	2027/5/25
POLGB 4 3/4 07/25/29	4.75	400	390	14,783	2029/7/25
POLGB 5 10/25/34	5.0	100	94	3,599	2034/10/25
POLGB 6 10/25/33	6.0	300	307	11,659	2033/10/25
POLGB 7 1/2 07/25/28	7.5	300	322	12,239	2028/7/25
小計				126,887	
(オーストラリア)		千豪ドル	千豪ドル		
国債証券					
ACGB 0 1/2 09/21/26	0.5	100	93	9,452	2026/9/21
ACGB 0 1/4 11/21/25	0.25	100	96	9,695	2025/11/21
ACGB 1 1/2 06/21/31	1.5	200	167	16,898	2031/6/21

銘柄	当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
(オーストラリア)	%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
国債証券					
ACGB 1 1/4 05/21/32	1.25	100	79	8,046	2032/5/21
ACGB 1 11/21/31	1.0	100	79	8,034	2031/11/21
ACGB 1 12/21/30	1.0	200	164	16,633	2030/12/21
ACGB 1 3/4 06/21/51	1.75	100	52	5,265	2051/6/21
ACGB 1 3/4 11/21/32	1.75	300	245	24,741	2032/11/21
ACGB 2 1/2 05/21/30	2.5	100	91	9,234	2030/5/21
ACGB 2 1/4 05/21/28	2.25	100	94	9,485	2028/5/21
ACGB 2 3/4 05/21/41	2.75	100	76	7,695	2041/5/21
ACGB 2 3/4 06/21/35	2.75	200	169	17,064	2035/6/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	200	192	19,423	2027/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/28	2.75	100	95	9,586	2028/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/29	2.75	100	93	9,439	2029/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	73	7,403	2047/3/21
ACGB 3 1/2 12/21/34	3.5	100	91	9,219	2034/12/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	96	9,727	2029/4/21
ACGB 3 1/4 06/21/39	3.25	100	84	8,494	2039/6/21
ACGB 3 11/21/33	3.0	100	88	8,949	2033/11/21
ACGB 3 3/4 04/21/37	3.75	100	91	9,222	2037/4/21
ACGB 3 3/4 05/21/34	3.75	100	93	9,470	2034/5/21
ACGB 4 1/2 04/21/33	4.5	200	200	20,187	2033/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	200	200	20,223	2026/4/21
ACGB 4 1/4 06/21/34	4.25	100	97	9,853	2034/6/21
ACGB 4 3/4 04/21/27	4.75	100	101	10,245	2027/4/21
ACGB 4 3/4 06/21/54	4.75	100	96	9,687	2054/6/21
小計				313,381	
(ニュージーランド)		チニュージーランドドル	チニュージーランドドル		
国債証券					
NZGB 1 1/2 05/15/31	1.5	100	84	7,683	2031/5/15
NZGB 2 05/15/32	2.0	100	84	7,731	2032/5/15
NZGB 2 3/4 04/15/37	2.75	100	80	7,389	2037/4/15
NZGB 3 04/20/29	3.0	100	95	8,738	2029/4/20
NZGB 3 1/2 04/14/33	3.5	100	92	8,495	2033/4/14
NZGB 4 1/2 04/15/27	4.5	100	101	9,259	2027/4/15
NZGB 4 1/4 05/15/34	4.25	100	97	8,906	2034/5/15
NZGB 4 1/4 05/15/36	4.25	100	95	8,737	2036/5/15
小計				66,942	
(シンガポール)		チシンガポールドル	チシンガポールドル		
国債証券					
SIGB 2 1/4 08/01/36	2.25	100	94	10,868	2036/8/1
SIGB 2 1/8 06/01/26	2.125	100	99	11,441	2026/6/1
SIGB 2 3/4 03/01/46	2.75	100	98	11,381	2046/3/1
SIGB 2 3/4 04/01/42	2.75	100	98	11,348	2042/4/1
SIGB 2 3/8 07/01/39	2.375	100	93	10,839	2039/7/1
SIGB 2 7/8 09/01/30	2.875	100	100	11,612	2030/9/1
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	100	101	11,731	2027/3/1
SIGB 3 3/8 05/01/34	3.375	100	104	12,049	2034/5/1
SIGB 3 3/8 09/01/33	3.375	100	104	12,028	2033/9/1
小計				103,302	

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（マレーシア）	%	ﾏﾚｰｼｱﾘﾝｷﾞｯﾄ	ﾏﾚｰｼｱﾘﾝｷﾞｯﾄ	千円	
国債証券					
MGS 2.632 04/15/31	2.632	100	93	3,248	2031/4/15
MGS 3.502 05/31/27	3.502	300	300	10,451	2027/5/31
MGS 3.582 07/15/32	3.582	100	98	3,415	2032/7/15
MGS 3.733 06/15/28	3.733	100	100	3,502	2028/6/15
MGS 3.757 05/22/40	3.757	100	96	3,358	2040/5/22
MGS 3.828 07/05/34	3.828	100	99	3,466	2034/7/5
MGS 3.844 04/15/33	3.844	200	199	6,934	2033/4/15
MGS 3.885 08/15/29	3.885	200	202	7,048	2029/8/15
MGS 3.899 11/16/27	3.899	100	101	3,521	2027/11/16
MGS 4.054 04/18/39	4.054	100	100	3,494	2039/4/18
MGS 4.065 06/15/50	4.065	200	195	6,806	2050/6/15
MGS 4.18 05/16/44	4.18	100	100	3,510	2044/5/16
MGS 4.232 06/30/31	4.232	200	204	7,129	2031/6/30
MGS 4.254 05/31/35	4.254	100	102	3,571	2035/5/31
MGS 4.392 04/15/26	4.392	300	304	10,598	2026/4/15
MGS 4.457 03/31/53	4.457	100	103	3,622	2053/3/31
MGS 4.498 04/15/30	4.498	200	207	7,239	2030/4/15
MGS 4.696 10/15/42	4.696	200	214	7,472	2042/10/15
MGS 4.736 03/15/46	4.736	100	107	3,753	2046/3/15
MGS 4.762 04/07/37	4.762	200	214	7,479	2037/4/7
MGS 4.893 06/08/38	4.893	100	108	3,795	2038/6/8
MGS 4.921 07/06/48	4.921	100	110	3,857	2048/7/6
MGS 4.935 09/30/43	4.935	100	110	3,845	2043/9/30
MGS 5.248 09/28	5.248	100	105	3,688	2028/9/15
小計				124,813	
（イスラエル）		ﾃｨｽﾗｴﾙｼｪｹﾙ	ﾃｨｽﾗｴﾙｼｪｹﾙ		
国債証券					
ILGOV 0 1/2 02/27/26	－	200	190	7,797	2026/2/27
ILGOV 1 03/31/30	－	200	167	6,846	2030/3/31
ILGOV 1 1/2 05/31/37	－	200	139	5,708	2037/5/31
ILGOV 1.3 04/30/32	－	200	159	6,529	2032/4/30
ILGOV 2 03/31/27	－	200	191	7,816	2027/3/31
ILGOV 2 1/4 09/28/28	－	200	184	7,541	2028/9/28
ILGOV 2.8 11/29/52	－	100	68	2,813	2052/11/29
ILGOV 3 3/4 02/28/29	－	200	199	8,136	2029/2/28
ILGOV 3 3/4 03/31/47	－	200	171	6,990	2047/3/31
ILGOV 3 3/4 09/30/27	－	100	98	4,017	2027/9/30
ILGOV 4 03/30/35	－	100	96	3,943	2035/3/30
ILGOV 5 1/2 01/31/42	－	100	111	4,540	2042/1/31
ILGOV 6 1/4 10/30/26	－	100	103	4,227	2026/10/30
小計				76,910	
（中国）		千ｵﾌｼｮｱ元	千ｵﾌｼｮｱ元		
国債証券					
CGB 1.35 09/25/26	1.35	1,600	1,597	33,985	2026/9/25
CGB 1.62 08/15/27	1.62	2,600	2,609	55,506	2027/8/15
CGB 1.67 06/15/26	1.67	3,700	3,720	79,136	2026/6/15
CGB 1.85 05/15/27	1.85	3,100	3,128	66,541	2027/5/15
CGB 1.91 07/15/29	1.91	3,400	3,425	72,870	2029/7/15
CGB 1.99 03/15/26	1.99	3,200	3,224	68,592	2026/3/15

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	
（中国）	%	千ｵﾌｼｮｱ元	千ｵﾌｼｮｱ元	千円	
国債証券					
CGB 2 1/2 07/25/27	2.5	1,100	1,126	23,963	2027/7/25
CGB 2 3/4 02/17/32	2.75	300	315	6,703	2032/2/17
CGB 2 3/4 06/15/29	2.75	500	521	11,096	2029/6/15
CGB 2.04 02/25/27	2.04	2,300	2,328	49,527	2027/2/25
CGB 2.05 04/15/29	2.05	3,000	3,038	64,626	2029/4/15
CGB 2.11 08/25/34	2.11	1,900	1,901	40,455	2034/8/25
CGB 2.12 06/25/31	2.12	3,600	3,635	77,344	2031/6/25
CGB 2.18 08/15/26	2.18	2,200	2,227	47,381	2026/8/15
CGB 2.27 05/25/34	2.27	2,000	2,027	43,125	2034/5/25
CGB 2.28 03/25/31	2.28	2,000	2,037	43,341	2031/3/25
CGB 2.28 11/25/25	2.28	1,300	1,311	27,903	2025/11/25
CGB 2.3 05/15/26	2.3	1,200	1,214	25,845	2026/5/15
CGB 2.33 12/15/25	2.33	5,800	5,856	124,577	2025/12/15
CGB 2.35 02/25/34	2.35	2,500	2,549	54,230	2034/2/25
CGB 2.37 01/15/29	2.37	2,400	2,461	52,358	2029/1/15
CGB 2.37 01/20/27	2.37	600	611	13,002	2027/1/20
CGB 2.39 11/15/26	2.39	3,500	3,562	75,774	2026/11/15
CGB 2.4 07/15/28	2.4	2,100	2,151	45,763	2028/7/15
CGB 2.44 10/15/27	2.44	4,900	5,022	106,833	2027/10/15
CGB 2.46 02/15/26	2.46	1,900	1,924	40,930	2026/2/15
CGB 2.48 04/15/27	2.48	600	614	13,061	2027/4/15
CGB 2.49 05/25/44	2.49	200	205	4,378	2044/5/25
CGB 2.52 08/25/33	2.52	1,500	1,548	32,936	2033/8/25
CGB 2.54 12/25/30	2.54	4,500	4,658	99,099	2030/12/25
CGB 2.55 10/15/28	2.55	6,800	7,012	149,162	2028/10/15
CGB 2.6 09/01/32	2.6	800	831	17,686	2032/9/1
CGB 2.6 09/15/30	2.6	2,400	2,492	53,011	2030/9/15
CGB 2.62 04/15/28	2.62	1,500	1,547	32,925	2028/4/15
CGB 2.62 06/25/30	2.62	1,100	1,144	24,338	2030/6/25
CGB 2.62 09/25/29	2.62	600	623	13,267	2029/9/25
CGB 2.64 01/15/28	2.64	1,100	1,134	24,140	2028/1/15
CGB 2.67 05/25/33	2.67	700	731	15,551	2033/5/25
CGB 2.67 11/25/33	2.67	3,900	4,075	86,703	2033/11/25
CGB 2.68 05/21/30	2.68	700	731	15,560	2030/5/21
CGB 2.69 08/12/26	2.69	900	919	19,553	2026/8/12
CGB 2.69 08/15/32	2.69	400	418	8,910	2032/8/15
CGB 2.76 05/15/32	2.76	300	315	6,704	2032/5/15
CGB 2.79 12/15/29	2.79	3,800	3,983	84,737	2029/12/15
CGB 2.8 03/24/29	2.8	600	626	13,319	2029/3/24
CGB 2.8 03/25/30	2.8	1,400	1,469	31,250	2030/3/25
CGB 2.8 11/15/32	2.8	4,600	4,851	103,192	2032/11/15
CGB 2.85 06/04/27	2.85	500	516	10,996	2027/6/4
CGB 2.88 02/25/33	2.88	900	957	20,372	2033/2/25
CGB 2.89 11/18/31	2.89	1,900	2,015	42,876	2031/11/18
CGB 2.91 10/14/28	2.91	800	836	17,804	2028/10/14
CGB 3 1/4 06/06/26	3.25	500	514	10,939	2026/6/6
CGB 3 1/4 11/22/28	3.25	500	532	11,321	2028/11/22
CGB 3 10/15/53	3.0	1,400	1,613	34,311	2053/10/15
CGB 3.01 05/13/28	3.01	700	733	15,592	2028/5/13

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	
(中国)	%	ﾁｵﾌｼｮｱ元	ﾁｵﾌｼｮｱ元	千円	
国債証券					
CGB 3.02 05/27/31	3.02	500	534	11,366	2031/5/27
CGB 3.03 03/11/26	3.03	700	715	15,217	2026/3/11
CGB 3.12 10/25/52	3.12	1,600	1,865	39,682	2052/10/25
CGB 3.12 12/05/26	3.12	900	930	19,787	2026/12/5
CGB 3.13 11/21/29	3.13	400	427	9,086	2029/11/21
CGB 3.19 04/15/53	3.19	700	830	17,662	2053/4/15
CGB 3.22 12/06/25	3.22	500	509	10,846	2025/12/6
CGB 3.27 11/19/30	3.27	1,000	1,083	23,045	2030/11/19
CGB 3.28 12/03/27	3.28	400	421	8,967	2027/12/3
CGB 3.29 05/23/29	3.29	300	321	6,845	2029/5/23
CGB 3.32 04/15/52	3.32	400	481	10,247	2052/4/15
CGB 3.39 03/16/50	3.39	600	724	15,413	2050/3/16
CGB 3.53 10/18/51	3.53	1,500	1,864	39,663	2051/10/18
CGB 3.54 08/16/28	3.54	100	107	2,288	2028/8/16

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	
(中国)	%	ﾁｵﾌｼｮｱ元	ﾁｵﾌｼｮｱ元	千円	
国債証券					
CGB 3.72 04/12/51	3.72	500	639	13,597	2051/4/12
CGB 3.81 09/14/50	3.81	2,800	3,618	76,975	2050/9/14
CGB 3.86 07/22/49	3.86	1,700	2,198	46,760	2049/7/22
小計				2,732,579	
合計				24,281,859	

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

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2024年11月11日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	24,281,859	98.5
コール・ローン等、その他	363,482	1.5
投資信託財産総額	24,645,341	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(24,603,645千円)の投資信託財産総額(24,645,341千円)に対する比率は99.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=153.14円、1カナダドル=110.07円、1メキシコペソ=7.6101円、1ユーロ=164.04円、1英ポンド=197.75円、1スウェーデンクローナ=14.15円、1ノルウェークローネ=13.91円、1デンマーククローネ=22.00円、1ポーランドズロチ=37.8969円、1豪ドル=100.90円、1ニュージーランドドル=91.36円、1シンガポールドル=115.38円、1マレーシアリンギット=34.8344円、1イスラエルシェケル=40.8304円、1オフショア元=21.2719円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年11月11日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	24,645,341,617
コール・ローン等	126,983,895
公社債(評価額)	24,281,859,508
未収利息	214,664,418
前払費用	21,833,796
(B) 負債	32,079,859
未払解約金	32,079,859
(C) 純資産総額(A－B)	24,613,261,758
元本	12,002,273,864
次期繰越損益金	12,610,987,894
(D) 受益権総口数	12,002,273,864口
１万口当たり基準価額(C／D)	20,507円

(注) 当親ファンドの期首元本額は9,333,811,825円、期中追加設定元本額は4,073,840,281円、期中一部解約元本額は1,405,378,242円です。

＜元本の内訳＞

東京海上セレクション・外国債券インデックス	6,799,903,277円
東京海上・世界インデックス・バランス６０＜適格機関投資家限定＞	2,836,859,224円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年１回決算型)	965,921,897円
東京海上・世界インデックス・バランス４０＜適格機関投資家限定＞	773,931,029円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	250,306,970円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	142,351,032円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	134,281,755円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	89,239,341円
TMA外国債券インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	9,479,339円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第10号に規定する額(元本の欠損) となります。

(注) 上記表中の１万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2023年11月11日～2024年11月11日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	586,183,896
受取利息	586,183,143
その他収益金	5,286
支払利息	△ 4,533
(B) 有価証券売買損益	1,073,924,283
売買益	1,166,520,786
売買損	△ 92,596,503
(C) 保管費用等	△ 7,220,832
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	1,652,887,347
(E) 前期繰越損益金	8,335,131,781
(F) 追加信託差損益金	4,027,009,749
(G) 解約差損益金	△ 1,404,040,983
(H) 計(D＋E＋F＋G)	12,610,987,894
次期繰越損益金(H)	12,610,987,894

(注) **(B)有価証券売買損益**は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) **(F)追加信託差損益金**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です。

(注) **(G)解約差損益金**は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。