

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／資産複合 |
| 信託期間 | 2024年11月13日まで（2015年1月30日設定） |
| 運用方針 | ファンド・オブ・ファンズ方式により、信託財産の十分な成長をはかることを目的として運用を行います。 |
| 主要運用対象 | 投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券ならびに投資証券および外国投資証券をいいます。） |
| 運用方法 | <ul style="list-style-type: none"> ・世界各国の株式・債券・リートに分散投資を行います。 ・目標リスク水準を年率標準偏差8.0%とします。（目標リスク水準は、当ファンドの変動リスクの目処を表示したもので、当ファンドのポートフォリオを構築する際の目標値として使用します。） ・三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 投資顧問部からアドバイスを受け、運用を行います。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主な組入制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・株式への直接投資は行いません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・1発行体等あたりの株式等、債券等およびデリバティブ等の当ファンドの純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とします。 |
| 分配方針 | 毎年8月13日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して、分配金額を決定しますが、信託財産の十分な成長に資することに配慮して分配を行わないことがあります。 |

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

スマート・クオリティ・オープン （安定成長型）（1年決算型）

愛称：スマラップN

第2期（決算日：2016年8月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「スマート・クオリティ・オープン（安定成長型）（1年決算型）（愛称：スマラップN）」は、去る8月15日に第2期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

(9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆ 目 次

スマート・クオリティ・オープン（安定成長型）（1年決算型）のご報告

| | |
|---------------------|----|
| ◇設定以来の運用実績 | 1 |
| ◇当期中の基準価額と市況等の推移 | 1 |
| ◇運用経過 | 2 |
| ◇今後の運用方針 | 7 |
| ◇1万口当たりの費用明細 | 8 |
| ◇売買及び取引の状況 | 9 |
| ◇利害関係人との取引状況等 | 9 |
| ◇自社による当ファンドの設定・解約状況 | 9 |
| ◇組入資産の明細 | 10 |
| ◇投資信託財産の構成 | 10 |
| ◇資産、負債、元本及び基準価額の状況 | 11 |
| ◇損益の状況 | 11 |
| ◇お知らせ | 12 |

投資対象ファンドのご報告

| | |
|--|----|
| （組入投資信託証券） | |
| ◇（ご参考）組入投資信託証券の概要 | 13 |
| ◇国際 J P X日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用） | 14 |
| ◇MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 20 |
| ◇国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定） | 44 |
| ◇iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF | 47 |
| ◇iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・クオリティ・ファクター UCITS ETF | 54 |
| ◇MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 62 |
| ◇先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定） | 80 |
| ◇iシェアーズ エッジ MSCI ミニマム・ボラティリティ・エマージング・マーケット ETF | 90 |
| ◇iシェアーズ J.P. モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF | 96 |

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | | 投 資 信 託 率 証 券 比 率 | 純 資 産 額 総 額 |
|-----------------------|-------------|----------------|---------|----------------------|----------------|
| | (分配落) | 税 込 み 分 配 金 | 期 騰 落 率 | | |
| (設 定 日) 2015年1月30日 | 円 10,000 | 円 — | % — | % — | 百万円 529 |
| 1期(2015年8月13日) | 10,368 | 0 | 3.7 | 97.2 | 2,112 |
| 2期(2016年8月15日) | 9,720 | 0 | △ 6.3 | 95.7 | 3,437 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

※当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 投 資 信 託 率 証 券 比 率 |
|---------------------|-------------|--------|----------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | |
| (期 首) 2015年8月13日 | 円 10,368 | % — | % 97.2 |
| 8月末 | 10,038 | △ 3.2 | 97.4 |
| 9月末 | 9,742 | △ 6.0 | 96.8 |
| 10月末 | 10,179 | △ 1.8 | 97.3 |
| 11月末 | 10,238 | △ 1.3 | 93.0 |
| 12月末 | 10,116 | △ 2.4 | 97.1 |
| 2016年1月末 | 9,750 | △ 6.0 | 96.7 |
| 2月末 | 9,693 | △ 6.5 | 96.8 |
| 3月末 | 9,953 | △ 4.0 | 96.8 |
| 4月末 | 9,952 | △ 4.0 | 96.7 |
| 5月末 | 9,937 | △ 4.2 | 96.9 |
| 6月末 | 9,595 | △ 7.5 | 96.8 |
| 7月末 | 9,806 | △ 5.4 | 96.5 |
| (期 末) 2016年8月15日 | 9,720 | △ 6.3 | 95.7 |

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第2期：2015/8/14～2016/8/15）

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.3%の下落となりました。



基準価額の主な変動要因

下落要因

国内株式が大幅下落したことに加えて、米ドルが対円で下落したことなどが、基準価額のマイナス要因となりました。

投資環境について

（第2期：2015/8/14～2016/8/15）

◎国内債券市況

- ・期を通して見ると、国内債券は上昇しました。
- ・日銀が2016年1月に導入を決定したマイナス金利政策の影響などから、国債金利は大幅に低下しました。特に10年を超える償還年限を持つ国債の金利がより大幅に低下しました。その後、日銀は7月の金融政策決定会合においてはマイナス金利の拡大を見送り、9月の同会合において経済・物価動向と政策効果について総括的な検証を行うことを発表しました。これを受けて量的緩和やマイナス金利政策の方向転換が図られるのではないかと市場の観測などから金利は上昇したものの、期を通して見ると金利は大幅に低下し、債券価格は上昇しました。

◎国内株式市況

- ・期を通して見ると、国内株式は下落しました。
- ・2015年8月中旬から9月にかけて、中国経済の先行き不安などから、国内株式は大幅に下落しました。10月に入ると、相場は落ち着きを取り戻し、一時上昇に転じたものの、その後、原油をはじめとする資源価格の下落や、2016年1月に発表された中国製造業の活動状況を表す経済指標が市場予想を下回ったことなどを背景に、世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり、再び急落しました。国内株式の下落は、2月中旬以降落ち着きを見せましたが、円高が進行したことなどが、株価の上値を押さえる要因となりました。4月後半には日銀による追加金融緩和への期待などから国内株式市場は一時上昇したものの、日銀が追加金融緩和を実施しなかったことに加えて、米国の雇用統計の一時的な悪化や英国が国民投票でEU（欧州連合）離脱を選択したことなどを受けて再び下落しました。その後、7月中旬以降は参院選で与党が圧勝し景気対策への期待が高まったことなどから国内株式市場は堅調に推移しました。

◎国内リート市況

- ・期を通して見ると、国内リートは上昇しました。
- ・中国の景気減速懸念を背景とした世界的なリスク回避姿勢の高まりや、英国のEU離脱問題などから下落する局面があったものの、日銀によるマイナス金利政策などを受けて国内金利が低下する中、投資家の利回りを求める動きなどから、国内リートは上昇しました。

◎先進国債券市況

- ・期を通して見ると、先進国債券は上昇しました。
- ・2016年1月初めから顕著となった株式やクレジット商品などのリスク資産の値下がりや、中国経済の悪化懸念、中東地域における地政学リスク増大懸念、原油需給悪化懸念、そして米国における利上げが金融市場からの資金流出につながることへの懸念などが引き起こしたものでした。このような厳しい環境下、各国中央銀行は積極的に金融緩和策を実施しました。日銀は1月末にマイナス金利政策導入を決定し、ECB（欧州中

中央銀行）は3月に政策金利を引き下げました。加えて、米国連邦準備制度理事会（FRB）は追加の利上げを見送り、利上げペースは緩やかなものとなっています。このような環境下、主要先進国債の金利は低下し、債券価格は上昇しました。

◎先進国株式市況

- ・期末の先進国株式は、期の初めとほぼ同じ水準となりました。
- ・2015年8月中旬から9月にかけては、中国による人民元の対米ドル為替レートの基準値引き下げを発端とする中国経済への先行き不安や、原油をはじめとする資源価格の下落などを背景に投資家がリスク回避姿勢を強め、先進国の株式市場は大幅に下落しました。その後、徐々に市場は落ち着きを取り戻したものの、米国連邦準備制度理事会（FRB）が12月に利上げを実施して以降、株価の上値が重くなり、2016年に入ると中国経済への先行き不安や米国景気の減速懸念、原油需給悪化懸念などを背景とした投資家のリスク回避姿勢の強まりなどから、下落しました。
- ・2月中旬以降は、中国の景気減速への警戒が和らぎ、原油市況が落ち着きを取り戻すなか、投資家のリスク回避姿勢が後退し、先進国株式は米国を中心に堅調となりました。米国の雇用統計の一時的な悪化や英国が国民投票でEU離脱を選択したことなどを受けて一時的に下落する場面があったものの、日本や欧州の中央銀行の金融緩和姿勢が株価を下支えしました。

◎先進国リート市況

- ・期を通して見ると、先進国リートは上昇しました。
- ・米国における利上げペースが緩やかなものに留まっていることに加えて、日本や欧州の中央銀行の金融緩和姿勢を背景に底堅く推移しました。

◎新興国株式市況

- ・期を通して見ると、新興国株式市場は上昇しました。
- ・2016年2月中旬以降、原油価格が反発したことに加えて、米国の利上げペースが緩やかなものに留まったことや、日本や欧州の中央銀行の金融緩和姿勢などを背景に上昇しました。

◎新興国債券市況

- ・期を通して見ると、新興国債券市場は上昇しました。
- ・原油をはじめとする資源価格が大幅下落したことなどを受けて、資源輸出国を中心に下落する場面があったものの、その後、米国債利回りが低下基調にある中、原油など資源価格の回復などを背景に新興国の信用力が改善したことなどから、上昇に転じました。

◎為替市況

- ・米国の利上げペースが緩やかなものに留まるなか、米ドルは対円で下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

- ・投資信託証券への投資を通じて、主として「国内株式」、「国内債券」、「国内リート」、「先進国株式」、「先進国債券」、「先進国リート」、「新興国株式」、「新興国債券」の8資産（以下「8資産」ということがあります。）に分散投資を行いました。
- ・8資産への投資にあたっては、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 投資顧問部からのアドバイスを基に、当ファンドの目標リスク水準（年率標準偏差8.0%）に応じた8資産の基本資産配分比率を決定し、この比率に基づき、指定投資信託証券の中から選定した投資信託証券に投資を行いました。
- ・2015年11月に原則年1回実施される基本資産配分比率の変更を設定来初めて行いました。今回の変更では、相対的に高い投資妙味が見込まれる日本株式への配分を引き上げるとともに、先進国株式においては「iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・クオリティ・ファクター UCITS ETF」を新たに加え、米国における今後の追加利上げを念頭においた比率に変更を行いました。なお、当該投資信託証券への投資は12月に行いました。（当該投資信託証券は、期中に名称変更を行っており、変更後の名称を記載しています。）
- ・2016年2月には臨時の基本資産配分比率の変更を行いました。市場の変動性が上昇していたことなどを背景に基本資産配分比率をリスク水準引き下げ方向に若干調整（国内株式等の組入比率を引き下げ、国内債券等の組入比率を引き上げ）しましたが、3月上旬には市場の変動性が落ち着きを見せたことなどから、従来の基本資産配分比率に戻しました。
- ・外貨建資産については、為替ヘッジは行いませんでした。
- ・前記の運用の結果、国内株式が大幅下落したことに加えて、米ドルが対円で下落したことなどから、基準価額は期首と比較して6.3%下落しました。

※指定投資信託証券の決定や投資する投資信託証券の選定等についても、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 投資顧問部からアドバイスを受けます。

（ご参考）
ポートフォリオの状況

| 資産区分 | 選定した投資信託証券の名称 | 期首 (2015年8月13日) 比率 | 期末 (2016年8月15日) 比率 |
|--------|---|--------------------------|--------------------------|
| 国内株式 | 国際 J P X日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用） | 12.9% | 19.2% |
| 国内債券 | MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 42.3% | 40.2% |
| 国内リート | 国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定） | 2.0% | 1.9% |
| 先進国株式 | iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF | 26.0% | 11.4% |
| | iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・クオリティ・ファクター UCITS ETF | — | 11.2% |
| 先進国債券 | MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 5.1% | 3.8% |
| 先進国リート | 先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定） | 2.0% | 2.9% |
| 新興国株式 | iシェアーズ エッジ MSCI ミニマム・ボラティリティ・エマージング・マーケット ETF | 2.9% | 3.2% |
| 新興国債券 | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF | 4.0% | 1.9% |

（注）比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

（注）上記は指定投資信託証券の中から選定した投資信託証券を記載しています。

（注）上記の「選定した投資信託証券の名称」については、期末の名称を記載しています。（一部ファンドにおいて、期中に名称変更を行っています。）

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。
- ・従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案し、分配金額を決定しますが、信託財産の十分な成長に資することに配慮して、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】 （単位：円、1万口当たり、税込み）

| 項目 | 第2期 |
|-----------|-----------------------|
| | 2015年8月14日～2016年8月15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 | 171 |

（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

◎運用環境の見通し

- ・グローバル金融市場環境は大きく変化しました。
- ・米国の積極的な利上げや中国経済悪化懸念、原油需給悪化懸念など、投資家が恐れていた懸念の多くは後退し、各国中央銀行が金融緩和姿勢を強めたことで市場は安定し、投資家は再びリスク資産に回帰してきました。しかし、日本では消費者物価指数が低位で推移し、円高の進行が経済に大きな影響をもたらしており、日銀は政策効果について総合的な検証を実施する方針を決めています。
- ・一方、原油を初めとした商品価格の回復が新興国経済と通貨に改善をもたらし、市況が回復基調にあります。また、世界の金融市場環境は今後も緩和的になると見ており、現在減速傾向にある先進国経済の成長回復を徐々に後押しすると予測しています。

◎今後の運用方針

- ・今後も、経済・金融市場の環境を多角的に分析しつつ、基本資産配分比率を維持し、中長期的に当ファンドが目標とするリスク水準をめざした運用を行います。
- ・当ファンドにおいては、引き続き目標リスク水準（年率標準偏差8.0%）に応じた基本資産配分比率を維持した運用を行います。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2015年8月14日～2016年8月15日）

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|----------------------|-------|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 151円 | 1.520% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× （期中の日数÷年間日数） |
| (投信会社) | (67) | (0.673) | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 |
| (販売会社) | (81) | (0.814) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託会社) | (3) | (0.033) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 5 | 0.051 | (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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (投資信託証券) | (5) | (0.051) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.000 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 2 | 0.021 | (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) | (0.010) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| (監査費用) | (1) | (0.011) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計 | 158 | 1.592 | |
| 期中の平均基準価額は、9,916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は四捨五入してあります。

(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

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

○売買及び取引の状況

（2015年8月14日～2016年8月15日）

投資信託証券

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|----|---------------------------------------|-----------|-----------|---------|---------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | 国際 JPX日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用） | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| | | 671,627 | 691,576 | 209,921 | 210,625 |
| | 国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定） | 19,049 | 18,458 | 2,729 | 2,747 |
| | 先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定） | 70,041 | 73,738 | 8,805 | 9,040 |
| | MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 702,643 | 853,691 | 355,855 | 438,993 |
| | MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 49,035 | 66,926 | 16,747 | 23,298 |
| 小計 | | 1,512,397 | 1,704,391 | 594,059 | 684,705 |
| 外国 | アメリカ | 千口 | 千アメリカドル | 千口 | 千アメリカドル |
| | ISHARES JP MORGAN USD EMERG1 | 2 | 290 | 3 | 363 |
| | ISHARES EDGE MSCI MIN VOL EM | 16 | 817 | 6 | 291 |
| | ISH EDGE MSCI WLD MIN VOL | 70 | 2,440 | 100 | 3,473 |
| | ISH EDGE MSCI WLD QLY FCTR | 152 | 4,037 | 16 | 433 |
| | 小計 | 242 | 7,586 | 126 | 4,562 |

（注）金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

（2015年8月14日～2016年8月15日）

利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 投資信託証券 | 百万円 2,597 | 百万円 1,704 | % 65.6 | 百万円 1,225 | 百万円 684 | % 55.8 |
| 為替直物取引 | 542 | 35 | 6.5 | 196 | — | — |

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三菱UFJ信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2015年8月14日～2016年8月15日）

| 期首残高（元本） | 当期設定元本 | 当期解約元本 | 期末残高（元本） | 取引の理由 |
|----------|----------|----------|----------|-----------------------|
| 百万円 1 | 百万円 — | 百万円 1 | 百万円 — | 商品性を適正に維持するための取得とその処分 |

○組入資産の明細

（2016年8月15日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘柄 | 期首（前期末） | 当 期 末 | | |
|---------------------------------------|-----------|-----------|-----------|------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| 国際 JPY日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用） | 229,927 | 691,633 | 660,233 | 19.2 |
| 国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定） | 41,505 | 57,825 | 64,111 | 1.9 |
| 先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定） | 37,622 | 98,858 | 101,072 | 2.9 |
| MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 753,989 | 1,100,777 | 1,383,677 | 40.2 |
| MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 74,486 | 106,774 | 131,898 | 3.8 |
| 合 計 | 1,137,531 | 2,055,869 | 2,340,993 | 68.1 |

（注）比率はスマート・クオリティ・オープン（安定成長型）（1年決算型）の純資産総額に対する比率。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| 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 | |
| | 千口 | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| （アメリカ） | | | | | |
| ISHARES JP MORGAN USD EMERGI | 6 | 5 | 658 | 66,767 | 1.9 |
| ISHARES EDGE MSCI MIN VOL EM | 9 | 19 | 1,068 | 108,427 | 3.2 |
| ISH EDGE MSCI WLD MIN VOL | 127 | 98 | 3,851 | 390,804 | 11.4 |
| ISH EDGE MSCI WLD QLY FCTR | — | 135 | 3,784 | 384,026 | 11.2 |
| 合 計 | 143 | 258 | 9,362 | 950,025 | 27.6 |

（注）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注）比率はスマート・クオリティ・オープン（安定成長型）（1年決算型）の純資産総額に対する比率。

○投資信託財産の構成

（2016年8月15日現在）

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 2,340,993 | 67.5 |
| 投資証券 | 950,025 | 27.4 |
| コール・ローン等、その他 | 175,351 | 5.1 |
| 投資信託財産総額 | 3,466,369 | 100.0 |

（注）期末における外貨建純資産（952,313千円）の投資信託財産総額（3,466,369千円）に対する比率は27.5%です。
（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

| | | |
|------------------|--|--|
| 1 アメリカドル=101.47円 | | |
|------------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年8月15日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 3,466,369,499 |
| コール・ローン等 | 175,350,738 |
| 投資信託受益証券（評価額） | 2,340,993,069 |
| 投資証券（評価額） | 950,025,692 |
| (B) 負債 | 28,411,517 |
| 未払解約金 | 2,940,124 |
| 未払信託報酬 | 25,290,597 |
| 未払利息 | 214 |
| その他未払費用 | 180,582 |
| (C) 純資産総額（A－B） | 3,437,957,982 |
| 元本 | 3,536,950,203 |
| 次期繰越損益金 | △ 98,992,221 |
| (D) 受益権総口数 | 3,536,950,203口 |
| 1万口当たり基準価額（C/D） | 9,720円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 2,037,607,976円
 期中追加設定元本額 2,090,810,292円
 期中一部解約元本額 591,468,065円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9720円です。
- ②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は98,992,221円です。
- ③分配金の計算過程

| 項 目 | 2015年8月14日～ 2016年8月15日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 0円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | 0円 |
| 収益調整金額 | 32,702,324円 |
| 分配準備積立金額 | 27,978,762円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 60,681,086円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 171円 |
| 1万口当たり分配金額 | －円 |
| 収益分配金金額 | －円 |

○損益の状況（2015年8月14日～2016年8月15日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 4,998,151 |
| 受取配当金 | 4,991,373 |
| 受取利息 | 29,823 |
| 支払利息 | △ 23,045 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 114,441,682 |
| 売買益 | 165,972,429 |
| 売買損 | △ 280,414,111 |
| (C) 信託報酬等 | △ 46,048,357 |
| (D) 当期損益金（A+B+C） | △ 155,491,888 |
| (E) 前期繰越損益金 | 27,978,762 |
| (F) 追加信託差損益金 | 28,520,905 |
| （配当等相当額） | （ 32,702,324） |
| （売買損益相当額） | （△ 4,181,419） |
| (G) 計（D+E+F） | △ 98,992,221 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金（G+H） | △ 98,992,221 |
| 追加信託差損益金 | 28,520,905 |
| （配当等相当額） | （ 32,702,324） |
| （売買損益相当額） | （△ 4,181,419） |
| 分配準備積立金 | 27,978,762 |
| 繰越損益金 | △ 155,491,888 |

- (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) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
- (注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほか、当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

- ①投資顧問会社である三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 投資顧問部から指定投資信託証券の追加に関する助言（「iシェアーズ MSCI ワールド クオリティ・ファクター UCITS ETF」の追加）を受けたことに対応するため、投資対象となる投資信託証券（指定投資信託証券）を追加するための、所要の約款変更を行いました。（2015年11月12日）
- ②投資対象である「iシェアーズ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF」、「iシェアーズ MSCI ワールド クオリティ・ファクター UCITS ETF」、「iシェアーズ MSCI エマージング・マーケット・ミニマム・ボラティリティ ETF」の名称を「iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF」、「iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・クオリティ・ファクター UCITS ETF」、「iシェアーズ エッジ MSCI ミニマム・ボラティリティ・エマージング・マーケット ETF」へそれぞれ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。（2016年7月29日）
- ③2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

〈ご参考〉組入投資信託証券の概要

| 資産区分 | 投資信託証券の名称 | 概要 |
|--------|---|---|
| 国内株式 | 国際 JPY日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用） | 日本の株式を主要投資対象として、JPX日経インデックス400に連動する運用成果を目指す投資信託です。 |
| 国内債券 | MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 円建の債券等（国債、社債等）を主要投資対象として、NOMURA-BPI総合インデックスに連動する運用成果を目指す投資信託です。 |
| 国内リート | 国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定） | 日本の不動産投資信託証券等を主要投資対象として、S&P J-REIT指数（配当込み）に連動する運用成果を目指す投資信託です。 |
| 先進国株式 | iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF | 先進国の株式等を主要投資対象として、MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ・インデックスに連動する運用成果を目指すETFです。 |
| | iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・クオリティ・ファクター UCITS ETF | 先進国の株式等を主要投資対象として、MSCI ワールド・セクター・ニュートラル・クオリティ・インデックスに連動する運用成果を目指すETFです。 |
| 先進国債券 | MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 日本を除く先進国の国債等を主要投資対象として、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する運用成果を目指す投資信託です。 |
| 先進国リート | 先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定） | 日本を除く先進国の不動産投資信託証券等を主要投資対象として、S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、円換算ベース）に連動する運用成果を目指す投資信託です。 |
| 新興国株式 | iシェアーズ エッジ MSCI ミニマム・ボラティリティ・エマージング・マーケット ETF | 新興国の株式等を主要投資対象として、MSCI エマージング・マーケット・ミニマム・ボラティリティ・インデックスに連動する運用成果を目指すETFです。 |
| 新興国債券 | iシェアーズ J.P. モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF | 新興国の米ドル建の債券等（国債、社債等）を主要投資対象として、J.P. モルガン EMBIグローバル・コア・インデックスに連動する運用成果を目指すETFです。 |

次頁以降に、各投資信託証券の直近の開示されている決算資料に基づく、損益の状況および組入資産の明細を掲載しています。

■組入投資信託証券の対象指数（ベンチマーク）について

- ・「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下総称して「JPXグループ」という。）並びに株式会社日本経済新聞社（以下「日経」といいます。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有している。「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負わない。本商品は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」及び「日経」は、その運用及び本商品の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ・「NOMURA-BPI総合インデックス」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる三菱UFJ国際投信の事業活動・サービスに関し一切の責任を負いません。
- ・MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ・インデックス、MSCI ワールド・セクター・ニュートラル・クオリティ・インデックス、MSCIエマージング・マーケット・ミニマム・ボラティリティ・インデックス（出所：MSCI）。ここに掲載される全ての情報は、信頼の置ける情報源から得たものでありますが、その確実性及び完結性をMSCIは何ら保証するものではありません。またその著作権はMSCIに帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他あらゆる形態を用い、またはあらゆる情報保存、検索システムを用いて出版物、資料、データ等の全部または一部を複製・頒布・使用等することは禁じられています。
- ・シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）はCitigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている債券インデックスです。
- ・J.P. モルガン EMBI グローバル・コア・インデックス：情報は、信頼性があると信じられる情報源から取得したものです。J.P. Morgan はその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morgan からの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2015, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

国際 J P X日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用）

損益の状況、組入資産の明細は「国際 J P X日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用）」の第2期（2015年2月14日～2016年2月15日）の決算資料から抜粋したものです。

○損益の状況（2015年2月14日～2016年2月15日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 24,562 |
| 受取利息 | 24,562 |
| (B) 有価証券売買損益 | △3,246,906,492 |
| 売買益 | 465,491,567 |
| 売買損 | △3,712,398,059 |
| (C) 信託報酬等 | △ 30,799,612 |
| (D) 当期損益金（A+B+C） | △3,277,681,542 |
| (E) 前期繰越損益金 | 115,347,721 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,678,337,840 |
| （配当等相当額） | （ 479,300,110） |
| （売買損益相当額） | （ 1,199,037,730） |
| (G) 計（D+E+F） | △1,483,995,981 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金（G+H） | △1,483,995,981 |
| 追加信託差損益金 | 1,678,337,840 |
| （配当等相当額） | （ 507,958,784） |
| （売買損益相当額） | （ 1,170,379,056） |
| 分配準備積立金 | 308,144,954 |
| 繰越損益金 | △3,470,478,775 |

- (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) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○組入資産の明細

（2016年2月15日現在）

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首（前期末） | 当 期 末 | |
|---------------------------------|-----------|------------|------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国際 J P X日経インデックス400オープン マザーファンド | 5,346,851 | 19,845,958 | 18,424,988 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

下記は、国際 J P X日経インデックス400オープン マザーファンド全体の内容です。

国内株式

2016年2月15日現在

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 鉱業 (0.4%) | | | |
| 国際石油開発帝石 | 20.8 | 75.3 | 71,211 |
| 建設業 (3.2%) | | | |
| 安藤・間 | 2.6 | 9.5 | 5,044 |
| コムシスホールディングス | 1.7 | 6.1 | 10,034 |
| ミサワホーム | 0.4 | 1.7 | 1,054 |
| 大成建設 | 20 | 74 | 55,870 |
| 大林組 | — | 42.9 | 46,803 |
| 清水建設 | — | 44 | 39,600 |
| 長谷工コーポレーション | 4.9 | 16.7 | 17,368 |
| 鹿島建設 | 17 | 67 | 46,967 |
| 三井住友建設 | — | 54.8 | 4,877 |
| 大東建託 | 1.5 | 5.3 | 78,970 |
| N I P P O | 1 | 3 | 5,220 |
| 住友林業 | 2.9 | 9.8 | 12,632 |
| 大和ハウス工業 | 11.6 | 42.2 | 127,233 |
| 積水ハウス | 12.1 | 47.8 | 84,749 |
| 協和エクシオ | 1.6 | 5.6 | 6,837 |
| 日揮 | 4 | 14 | 24,248 |
| 東芝プラントシステム | 0.6 | — | — |
| 千代田化工建設 | 3 | 10 | 8,080 |
| 食料品 (5.4%) | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 4.3 | — | — |
| カルビー | 1.5 | 5.3 | 24,035 |
| ヤクルト本社 | 2.1 | 7.7 | 43,197 |
| 明治ホールディングス | 1.2 | 8.5 | 79,815 |
| 日本ハム | 3 | 11 | 28,787 |
| アサヒグループホールディングス | 7.9 | 26.8 | 94,925 |
| キリンホールディングス | 16.9 | 57.9 | 92,234 |
| 伊藤園 | 1.2 | 4.2 | 12,957 |
| キッコーマン | 3 | 11 | 43,175 |
| 味の素 | 9 | 31 | 89,652 |
| キュービー | 2 | 7.3 | 19,001 |
| ニチレイ | 4 | 15 | 13,800 |
| 東洋水産 | 2.1 | 7 | 30,205 |
| 日清食品ホールディングス | 1.7 | 6 | 33,120 |
| 日本たばこ産業 | 18.9 | 83.1 | 376,609 |
| 繊維製品 (0.5%) | | | |
| 東レ | 29 | 97 | 91,024 |
| パルプ・紙 (0.2%) | | | |
| 王子ホールディングス | 15 | 55 | 23,485 |
| 大王製紙 | — | 5.9 | 5,504 |
| 化学 (6.6%) | | | |
| クラレ | 6.3 | 21.1 | 26,775 |
| 旭化成 | 23 | 83 | 58,415 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 昭和電工 | 25 | — | — |
| 住友化学 | — | 98 | 47,040 |
| 日産化学工業 | 2.5 | 8 | 21,392 |
| 東ソー | 9 | 36 | 15,372 |
| 東亜合成 | 5 | — | — |
| デンカ | 8 | 28 | 11,144 |
| 信越化学工業 | 6.6 | 24 | 136,200 |
| エア・ウォーター | 3 | 11 | 17,677 |
| 大陽日酸 | 5 | 10.3 | 10,938 |
| 日本パーカライジング | 0.9 | 6.8 | 6,568 |
| 日本触媒 | 3 | — | — |
| J S R | 3.6 | 12.5 | 19,850 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 23.1 | 89.5 | 54,621 |
| 日本合成化学工業 | 1 | 3 | 2,013 |
| ダイセル | 5.2 | 18.8 | 29,046 |
| 積水化学工業 | 9 | 30.3 | 38,905 |
| 日本ゼオン | 3 | 12 | 8,352 |
| アイカ工業 | 1.1 | 4 | 8,312 |
| 宇部興産 | 19 | 72 | 14,040 |
| 日立化成 | 1.8 | 6.6 | 12,368 |
| 日本化薬 | 2 | 9 | 10,584 |
| 日油 | — | 10 | 8,040 |
| 花王 | 9.9 | 35.9 | 207,430 |
| 日本ペイントホールディングス | 3.2 | 10.3 | 23,381 |
| 関西ペイント | 4 | 15.1 | 25,111 |
| D I C | 15 | 54 | 13,716 |
| 東洋インキS Cホールディングス | 4 | — | — |
| 富士フイルムホールディングス | 8.4 | 30.6 | 131,549 |
| 資生堂 | 6.6 | 25.4 | 57,340 |
| コーセー | — | 2.2 | 19,206 |
| シース・ホールディングス | 0.2 | 1.7 | 3,099 |
| 小林製薬 | 0.6 | 2 | 19,260 |
| 日東電工 | 2.9 | 10.3 | 58,514 |
| エフビコ | 0.4 | — | — |
| ニフコ | 0.8 | 2.6 | 13,234 |
| ユニ・チャーム | 7.5 | 27.1 | 62,736 |
| 医薬品 (7.4%) | | | |
| 協和発酵キリン | 4 | 16 | 26,016 |
| 武田薬品工業 | 13.8 | 53.2 | 292,493 |
| アステラス製薬 | 42 | 149.6 | 240,257 |
| 塩野義製薬 | 5.8 | 19.5 | 90,714 |
| 田辺三菱製薬 | 4.3 | 15.6 | 31,543 |
| 中外製薬 | 3.7 | 13.3 | 45,220 |
| 科研製薬 | 1 | 2.3 | 16,008 |
| エーザイ | 4.9 | 16.4 | 116,981 |

国際 J P X 日経インデックス400オープン (適格機関投資家専用)

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | |
|-------------------------|---------|------|---------|-------|-----|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | | |
| ロート製薬 | 1.7 | 6.5 | 12,987 | | | |
| 小野薬品工業 | 1.7 | 6.1 | 115,961 | | | |
| 久光製薬 | 1 | 4.1 | 19,946 | | | |
| 持田製薬 | 0.3 | 0.9 | 8,109 | | | |
| 参天製薬 | 1.4 | 24.6 | 42,066 | | | |
| ツムラ | 1.2 | 4.2 | 11,692 | | | |
| 沢井製薬 | 0.6 | 2.3 | 16,468 | | | |
| 第一三共 | 12.4 | 44.9 | 101,406 | | | |
| キョーリン製薬ホールディングス | 1 | 3.6 | 7,797 | | | |
| 大塚ホールディングス | 7.3 | 28.7 | 120,540 | | | |
| 大正製薬ホールディングス | 0.9 | 3.2 | 27,392 | | | |
| 石油・石炭製品 (0.1%) | | | | | | |
| 昭和シェル石油 | 3.3 | 13.4 | 12,783 | | | |
| 東燃ゼネラル石油 | 6 | — | — | | | |
| 出光興産 | 1.7 | — | — | | | |
| J Xホールディングス | 40.9 | — | — | | | |
| ゴム製品 (1.2%) | | | | | | |
| 横浜ゴム | 4 | 8.1 | 14,183 | | | |
| 東洋ゴム工業 | 1.7 | 6 | 10,608 | | | |
| ブリヂストン | 11.6 | 45.1 | 179,678 | | | |
| 住友ゴム工業 | 2.9 | 12.5 | 18,650 | | | |
| ガラス・土石製品 (0.8%) | | | | | | |
| 旭硝子 | 18 | 71 | 40,328 | | | |
| 日本電気硝子 | 7 | — | — | | | |
| 太平洋セメント | 23 | 83 | 19,256 | | | |
| TOTO | 5 | 9.8 | 31,115 | | | |
| 日本碍子 | — | 17 | 35,394 | | | |
| 日本特殊陶業 | 3.2 | 11.5 | 26,496 | | | |
| ニチアス | 2 | — | — | | | |
| 鉄鋼 (1.1%) | | | | | | |
| 新日鐵住金 | 156 | 60.2 | 115,945 | | | |
| 神戸製鋼所 | — | 245 | 20,825 | | | |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 9.4 | 36.5 | 48,891 | | | |
| 大同特殊鋼 | 6 | — | — | | | |
| 日立金属 | 4 | 15.3 | 17,442 | | | |
| 非鉄金属 (0.9%) | | | | | | |
| 三井金属鉱業 | 10 | 34 | 5,372 | | | |
| 三菱マテリアル | 23 | 83 | 24,402 | | | |
| 住友金属鉱山 | 10 | 37 | 41,551 | | | |
| DOWAホールディングス | 4 | 17 | 10,251 | | | |
| 住友電気工業 | 13.9 | 53.5 | 73,000 | | | |
| アサヒホールディングス | 0.5 | 2 | 3,016 | | | |
| 金属製品 (0.3%) | | | | | | |
| 三和ホールディングス | — | 13.5 | 9,625 | | | |
| 三協立山 | — | 1.7 | 2,179 | | | |
| LIXILグループ | 5.5 | — | — | | | |
| リンナイ | 0.7 | 2.5 | 24,750 | | | |
| ジーテクト | 0.3 | — | — | | | |
| 日本発條 | 3.2 | 12.6 | 12,637 | | | |
| 機械 (4.7%) | | | | | | |
| 日本製鋼所 | 5 | — | — | | | |
| オーエスジー | 1.7 | 6.1 | 11,547 | | | |
| ディスコ | 0.4 | 1.7 | 17,289 | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | |
|---------------------|---------|-------|---------|-------|-----|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | | |
| ニューフレアテクノロジー | — | 0.2 | 1,006 | | | |
| ナブテスコ | 2.2 | 6.9 | 15,338 | | | |
| SMC | 1.1 | 4 | 108,480 | | | |
| 小松製作所 | 18.3 | 65.5 | 113,020 | | | |
| 住友重機械工業 | 10 | 39 | 18,213 | | | |
| 日立建機 | 1.6 | 6 | 10,014 | | | |
| クボタ | 18 | 64.1 | 91,663 | | | |
| 荏原製作所 | 8 | 30 | 13,560 | | | |
| ダイキン工業 | 5.1 | 18.6 | 139,574 | | | |
| 栗田工業 | 2.1 | — | — | | | |
| 橋本チエン | 2 | 8 | 5,080 | | | |
| タダノ | 2 | 6 | 5,658 | | | |
| 平和 | 0.8 | 4 | 9,292 | | | |
| SANKYO | 1.1 | — | — | | | |
| ユニバーサルエンターテインメント | 0.3 | 1.3 | 2,158 | | | |
| セガサミーホールディングス | 3.8 | 13.7 | 15,933 | | | |
| TPR | 0.4 | 1.6 | 4,028 | | | |
| ホシザキ電機 | 1 | 3.7 | 29,933 | | | |
| 日本精工 | 7 | 26.2 | 26,304 | | | |
| ジェイテクト | 3.8 | 13.6 | 20,889 | | | |
| 不二越 | 3 | 12 | 4,440 | | | |
| THK | 2.3 | 8.5 | 16,864 | | | |
| イーグル工業 | — | 1.6 | 2,302 | | | |
| マキタ | 2.3 | 8.3 | 54,531 | | | |
| 三菱重工業 | 59 | 227 | 87,553 | | | |
| IHI | 25 | 98 | 16,758 | | | |
| 電気機器 (11.8%) | | | | | | |
| コニカミノルタ | 8.4 | 31.9 | 29,475 | | | |
| ブラザー工業 | 4.6 | 16.5 | 18,942 | | | |
| ミネベア | 5 | 21 | 15,708 | | | |
| 日立製作所 | 85 | 325 | 151,287 | | | |
| 東芝 | 74 | — | — | | | |
| 三菱電機 | 35 | 136 | 143,752 | | | |
| 富士電機 | 10 | 38 | 13,984 | | | |
| 安川電機 | 4.1 | 15.8 | 19,197 | | | |
| 日本電産 | 3.8 | 15.4 | 108,985 | | | |
| オムロン | 3.8 | 14.6 | 43,727 | | | |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 7 | — | — | | | |
| 日本電気 | — | 175 | 47,425 | | | |
| 富士通 | 34 | 123 | 47,022 | | | |
| 沖電気工業 | 12 | 55 | 7,425 | | | |
| セイコーエプソン | 2.4 | 19 | 32,566 | | | |
| ワコム | 2.8 | 10 | 4,380 | | | |
| パナソニック | 42.9 | 145.8 | 129,382 | | | |
| アンリツ | 2.2 | 7.7 | 4,720 | | | |
| 富士通ゼネラル | 1 | 4 | 6,056 | | | |
| 日立国際電気 | — | 3 | 3,747 | | | |
| TDK | 2.1 | 7.7 | 43,736 | | | |
| アルプス電気 | — | 10.8 | 19,202 | | | |
| ヒロセ電機 | 0.6 | 2.1 | 26,397 | | | |
| 日本航空電子工業 | — | 4 | 4,408 | | | |
| 横河電機 | 3.5 | 12.8 | 15,718 | | | |
| 日本光電工業 | 0.7 | 5.3 | 14,410 | | | |

国際 J P X 日経インデックス400オープン (適格機関投資家専用)

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 堀場製作所 | 0.7 | 2.4 | 8,676 |
| キーエンス | 0.8 | 2.9 | 160,660 |
| シスメックス | 2.7 | 9.9 | 57,519 |
| スタンレー電気 | 2.5 | 9.2 | 22,696 |
| カシオ計算機 | 3.5 | 12.8 | 25,177 |
| ファナック | 3.7 | 13.1 | 216,739 |
| エンプラス | — | 0.7 | 2,614 |
| 浜松ホトニクス | 1.5 | 10 | 26,940 |
| 京セラ | 5.8 | 20.9 | 104,019 |
| 村田製作所 | 3.7 | 13.4 | 170,850 |
| 小糸製作所 | 2.1 | 7.6 | 36,328 |
| ミツバ | 0.6 | 2.2 | 3,196 |
| キャノン | 20.4 | 68.7 | 221,145 |
| リコー | 10.6 | 41.3 | 47,040 |
| 東京エレクトロン | — | 11.4 | 74,533 |
| 輸送用機器 (8.6%) | | | |
| トヨタ紡織 | 1.2 | 4.5 | 7,929 |
| 鬼怒川ゴム工業 | 1 | — | — |
| ユニプレス | 0.7 | 2.6 | 4,490 |
| 豊田自動織機 | 3.2 | 11.6 | 56,956 |
| デンソー | 8.7 | 31.5 | 134,190 |
| 東海理化電機製作所 | — | 3.7 | 9,201 |
| 三井造船 | 14 | 49 | 6,566 |
| 川崎重工業 | 26 | 99 | 29,106 |
| 名村造船所 | 0.7 | 3.8 | 2,489 |
| 日産自動車 | 49.4 | 179.1 | 177,362 |
| いすゞ自動車 | 11.1 | 37 | 40,293 |
| トヨタ自動車 | 11.4 | 37.3 | 233,348 |
| 日野自動車 | 5 | 18.2 | 20,547 |
| 三菱自動車工業 | 12.9 | 50.7 | 42,486 |
| NOK | 1.7 | 6.2 | 11,408 |
| KYB | 4 | — | — |
| 大同メタル工業 | 0.5 | — | — |
| カルソニックカンセイ | 3 | 10 | 7,480 |
| アイシン精機 | 3.2 | 12.8 | 56,256 |
| マツダ | 10.5 | 40.4 | 65,084 |
| ダイハツ工業 | 4.2 | 15.2 | 25,262 |
| 本田技研工業 | 19.7 | 85.7 | 253,286 |
| スズキ | 7.4 | 26.7 | 76,829 |
| 富士重工業 | 12 | 40.3 | 151,810 |
| ヤマハ発動機 | 5.4 | 18 | 32,958 |
| エクセディ | 0.5 | 1.7 | 3,908 |
| 豊田合成 | 1.1 | 4.6 | 10,253 |
| 日本精機 | — | 3 | 6,348 |
| エフ・シー・シー | 0.5 | — | — |
| シマノ | 1.5 | 5.1 | 86,853 |
| ティ・エス テック | 0.7 | 3 | 7,383 |
| 精密機器 (1.8%) | | | |
| テルモ | 5.4 | 19.6 | 76,048 |
| ニコン | 6.6 | 23.8 | 40,293 |
| トプコン | — | 4.3 | 4,295 |
| オリンパス | — | 19 | 76,285 |
| HOYA | 8.4 | 29.7 | 118,889 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| セイコーホールディングス | — | 8 | 3,240 |
| その他製品 (0.6%) | | | |
| パンダイナムコホールディングス | 3.9 | 13.2 | 30,135 |
| パイロットコーポレーション | — | 2.2 | 7,711 |
| アシックス | 3.5 | 11.9 | 21,527 |
| ヤマハ | — | 9.4 | 28,670 |
| ビジョン | 0.7 | 7.2 | 16,898 |
| 電気・ガス業 (1.0%) | | | |
| 電源開発 | 2.4 | 10.9 | 38,477 |
| 東京瓦斯 | 43 | 142 | 79,122 |
| 大阪瓦斯 | 36 | 132 | 59,307 |
| 陸運業 (6.3%) | | | |
| 東武鉄道 | 19 | 68 | 40,256 |
| 相鉄ホールディングス | 8 | 29 | 20,474 |
| 東京急行電鉄 | 19 | 74 | 67,192 |
| 小田急電鉄 | 11 | 41 | 53,710 |
| 京王電鉄 | 10 | 36 | 39,348 |
| 京成電鉄 | 5 | 19 | 31,122 |
| 東日本旅客鉄道 | 6.5 | 23.3 | 236,378 |
| 西日本旅客鉄道 | 3.4 | 12.3 | 86,530 |
| 東海旅客鉄道 | 3.2 | 11.4 | 244,815 |
| 西日本鉄道 | 6 | 22 | 18,546 |
| 近鉄グループホールディングス | 35 | 128 | 63,104 |
| 阪急阪神ホールディングス | 24 | 86 | 62,780 |
| 南海電気鉄道 | — | 38 | 25,840 |
| 京阪電気鉄道 | 11 | 38 | 29,336 |
| 名古屋鉄道 | 17 | 62 | 34,844 |
| 日本通運 | 14 | 49 | 25,039 |
| ヤマトホールディングス | 6.2 | 23.6 | 55,436 |
| 山九 | 4 | 17 | 8,738 |
| 日立物流 | 0.7 | — | — |
| 海運業 (0.1%) | | | |
| 日本郵船 | — | 115 | 23,920 |
| 空運業 (0.4%) | | | |
| ANAホールディングス | 69 | 237 | 73,801 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.0%) | | | |
| 上組 | 4 | — | — |
| 近鉄エクスプレス | 0.3 | 2.3 | 3,500 |
| 情報・通信業 (8.4%) | | | |
| グリー | 2.1 | 7.6 | 4,195 |
| ネクソン | — | 12 | 18,804 |
| ディーガイア | 0.3 | 1.3 | 1,446 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 8.8 | 29.3 | 7,852 |
| インターネットイニシアティブ | 0.6 | — | — |
| 野村総合研究所 | 2 | 8.8 | 33,616 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 3.6 | 13.1 | 17,030 |
| オービック | 1.2 | 4.3 | 23,134 |
| ヤフー | 24.9 | 90.2 | 38,515 |
| トレンドマイクロ | 1.8 | 6.1 | 25,467 |
| 日本オラクル | 0.6 | 2 | 10,000 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 0.4 | 2.9 | 6,090 |
| 大塚商会 | 0.9 | 3.4 | 18,700 |
| USEN | 2 | 5.7 | 1,601 |

国際 J P X 日経インデックス400オープン (適格機関投資家専用)

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 0.7 | 2.3 | 2,845 |
| 日本テレビホールディングス | 3.2 | 11.5 | 22,287 |
| 日本電信電話 | 11 | 75.7 | 371,687 |
| KDD I | 11.8 | 115 | 339,997 |
| 光通信 | 0.3 | 1.5 | 11,760 |
| NTTドコモ | 28.7 | 97.1 | 257,606 |
| GMOインターネット | 1.2 | 4.7 | 5,466 |
| 東宝 | 2.5 | 9 | 25,848 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 2.1 | 7.8 | 45,630 |
| SCSK | 0.8 | 3 | 13,110 |
| コナミホールディングス | 1.4 | — | — |
| ソフトバンクグループ | 10 | 50.5 | 222,200 |
| 卸売業 (4.4%) | | | |
| 双日 | 23.2 | 79.3 | 16,732 |
| アルフレッサ ホールディングス | 4.1 | 15.8 | 31,141 |
| シップヘルスケアホールディングス | 0.6 | 2.6 | 6,773 |
| 三菱食品 | 0.4 | — | — |
| 第一興商 | 0.8 | 3 | 13,650 |
| メディカルホールディングス | 3.5 | 12.6 | 20,953 |
| 伊藤忠商事 | 29.1 | 98.8 | 130,070 |
| 丸紅 | 30.4 | 123.9 | 67,798 |
| 豊田通商 | 3.9 | 14 | 32,508 |
| 兼松 | 7 | 27 | 4,158 |
| 三井物産 | 29.5 | 113.9 | 147,443 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 1.2 | 4.4 | 12,601 |
| 山善 | 1.3 | — | — |
| 住友商事 | 20.5 | 79.3 | 86,238 |
| 三菱商事 | 26.6 | 94.5 | 163,532 |
| 岩谷産業 | 4 | 15 | 8,835 |
| 東邦ホールディングス | 1.2 | 4 | 9,500 |
| サンリオ | 1 | 3.9 | 8,240 |
| 日鉄住金物産 | 3 | 11 | 3,608 |
| ミスミグループ本社 | 1.3 | 14.1 | 21,544 |
| 小売業 (4.8%) | | | |
| ローソン | 1.3 | 4.8 | 45,504 |
| エービーシー・マート | 0.5 | 1.6 | 10,448 |
| ゲオホールディングス | 0.6 | 2.4 | 4,056 |
| 日本マクドナルドホールディングス | 1.4 | — | — |
| スターバックス コーヒー ジャパン | 0.7 | — | — |
| バル | 0.2 | — | — |
| セリア | 0.4 | 1.4 | 8,106 |
| MonotaRO | 0.7 | 4.4 | 10,340 |
| J. フロント リテイリング | 4.4 | 15.9 | 22,021 |
| マツモトキヨシホールディングス | 0.8 | 2.6 | 13,182 |
| スタートトゥデイ | 1.1 | 3.8 | 12,901 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 6.9 | 25 | 32,350 |
| ウエルシアホールディングス | 0.4 | 1.5 | 8,250 |
| コスモ薬品 | 0.2 | 0.6 | 10,098 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 14.5 | 52.7 | 244,949 |
| ツルハホールディングス | 0.7 | 2.9 | 27,173 |
| 良品計画 | 0.4 | 1.4 | 31,934 |
| ドンキホーテホールディングス | 1.1 | 8.1 | 29,119 |
| V Tホールディングス | 1.4 | 5.7 | 3,129 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------|---------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ユニテッドアローズ | 0.4 | 1.8 | 8,784 |
| スギホールディングス | 0.6 | 2.3 | 12,581 |
| ファミリーマート | 1.2 | 3.9 | 22,932 |
| 日本瓦斯 | — | 1.9 | 4,153 |
| AOKIホールディングス | 0.8 | 2.9 | 3,482 |
| コメリ | 0.6 | — | — |
| しまむら | 0.4 | 1.5 | 18,495 |
| 高島屋 | 5 | 18 | 16,452 |
| イオン | 13.9 | 51.8 | 72,157 |
| ユニグループ・ホールディングス | 3.3 | — | — |
| イズミ | 0.8 | 2.5 | 10,787 |
| ヤオコー | — | 1.4 | 5,971 |
| ケーズホールディングス | 0.8 | 2.7 | 9,895 |
| アインホールディングス | 0.4 | 1.5 | 7,072 |
| ヤマダ電機 | 13.7 | — | — |
| ニトリホールディングス | 1.5 | 5.4 | 44,496 |
| 王将フードサービス | 0.2 | — | — |
| アークス | 0.8 | — | — |
| パローホールディングス | 0.7 | 2.7 | 6,517 |
| ファーストリテイリング | 0.7 | 2.5 | 83,050 |
| サンドラッグ | 0.7 | 2.7 | 20,790 |
| 銀行業 (6.2%) | | | |
| 新生銀行 | 33 | 109 | 14,933 |
| あおぞら銀行 | 23 | 80 | 28,000 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 119.1 | 386 | 187,132 |
| りそなホールディングス | 40.7 | 147.3 | 60,319 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 77 | 263 | 83,897 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 16.5 | 65.9 | 207,980 |
| 西日本シティ銀行 | 12 | 41 | 8,036 |
| 千葉銀行 | 13 | 49 | 26,019 |
| 横浜銀行 | 24 | 84 | 41,370 |
| 常陽銀行 | 13 | 46 | 18,400 |
| 群馬銀行 | 8 | 28 | 13,916 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 14 | 54 | 20,358 |
| 静岡銀行 | 10 | 37 | 31,376 |
| 十六銀行 | 6 | 21 | 7,686 |
| スルガ銀行 | 3.7 | 12 | 22,584 |
| 八十二銀行 | 8 | 30 | 15,420 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 24 | 86 | 14,276 |
| 広島銀行 | 10 | 37 | 16,169 |
| 中国銀行 | 3.3 | 11.9 | 13,946 |
| 伊予銀行 | 5 | 18 | 14,184 |
| セブン銀行 | 11.7 | 47.2 | 21,853 |
| みずほフィナンシャルグループ | 358.1 | 1,293.8 | 217,746 |
| 山口フィナンシャルグループ | 5 | 16 | 16,880 |
| 北洋銀行 | 5.2 | 19 | 5,453 |
| 京業銀行 | 4 | 14 | 5,950 |
| 証券、商品先物取引業 (1.3%) | | | |
| SBIホールディングス | — | 15.1 | 14,964 |
| ジャフコ | — | 2.1 | 6,594 |
| 大和証券グループ本社 | 33 | 118 | 76,322 |
| 野村ホールディングス | 71.1 | 242.3 | 119,938 |
| 岡三証券グループ | 3 | 11 | 5,962 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | |
|-----------------------|---------|------|---------|-------|-----|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 4 | 14.4 | 7,531 | | | |
| 松井証券 | 1.8 | 6.4 | 6,086 | | | |
| カブドットコム証券 | — | 11.2 | 3,595 | | | |
| 保険業 (3.1%) | | | | | | |
| 損保ジャパン日本興亜ホールディングス | — | 28 | 82,852 | | | |
| MS&ADインシュアランスグループホール | — | 37.6 | 107,498 | | | |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 3.3 | 12.1 | 18,331 | | | |
| 第一生命保険 | 22.3 | 80.7 | 108,178 | | | |
| 東京海上ホールディングス | 14.3 | 51 | 189,873 | | | |
| T & Dホールディングス | 12.7 | 45.9 | 52,876 | | | |
| その他金融業 (1.5%) | | | | | | |
| クレディセゾン | 2.8 | 9.5 | 18,202 | | | |
| 芙蓉総合リース | 0.4 | 1.4 | 6,629 | | | |
| 興銀リース | 0.7 | 2.4 | 4,471 | | | |
| 東京センチュリーリース | 0.8 | 3 | 11,445 | | | |
| Jトラスト | 1 | — | — | | | |
| アイフル | 5.8 | — | — | | | |
| リコーリース | 0.3 | — | — | | | |
| イオンフィナンシャルサービス | 2.3 | 8.3 | 19,496 | | | |
| アコム | 7 | 25.3 | 11,663 | | | |
| 日立キャピタル | 0.7 | 3 | 7,047 | | | |
| オリックス | 24.6 | 89.2 | 121,891 | | | |
| 三菱UFJリース | 8.8 | 31.9 | 15,056 | | | |
| 日本取引所グループ | 5.1 | 37 | 62,752 | | | |
| 不動産業 (3.4%) | | | | | | |
| ヒューリック | 5.9 | 26.2 | 24,235 | | | |
| 野村不動産ホールディングス | 2.1 | 8.4 | 16,430 | | | |
| プレサンスコーポレーション | — | 0.4 | 1,364 | | | |
| 東急不動産ホールディングス | 9.1 | 30.5 | 20,038 | | | |
| 飯田グループホールディングス | 2.3 | 11.7 | 23,598 | | | |
| パーク24 | 1.7 | 6.3 | 19,215 | | | |
| 三井不動産 | 18 | 67 | 167,600 | | | |
| 三菱地所 | 26 | 94 | 199,515 | | | |
| 東京建物 | — | 13.8 | 15,552 | | | |
| 住友不動産 | 8 | 30 | 87,240 | | | |
| 大京 | 6 | 23 | 4,002 | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | |
|----------------------|---------|-------|---------|------------|-----|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | | |
| レオパレス21 | 3.8 | 14.8 | 9,072 | | | |
| スターツコーポレーション | — | 1.9 | 4,170 | | | |
| 住友不動産販売 | 0.2 | 0.9 | 1,890 | | | |
| タカラレーベン | 1.5 | 5.6 | 2,822 | | | |
| イオンモール | 2.2 | 8.1 | 12,984 | | | |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 2.2 | 7.8 | 8,049 | | | |
| サービス業 (3.5%) | | | | | | |
| ミクシィ | — | 2.7 | 8,680 | | | |
| 日本M&Aセンター | — | 2.1 | 10,290 | | | |
| アコーディア・ゴルフ | 1.4 | — | — | | | |
| テンポホールディングス | 0.7 | 9.3 | 14,238 | | | |
| クックパッド | — | 3 | 5,511 | | | |
| 総合警備保障 | — | 4.4 | 25,080 | | | |
| カカコム | 2.4 | 9.7 | 19,749 | | | |
| エムスリー | 3.2 | 11.5 | 29,739 | | | |
| ディー・エヌ・エー | 1.8 | 6 | 9,840 | | | |
| 博報堂DYホールディングス | 5.1 | 18.5 | 23,513 | | | |
| 電通 | 4.1 | 14.9 | 82,844 | | | |
| みらかホールディングス | 1 | 3.4 | 15,385 | | | |
| オリエンタルランド | 1 | 14.4 | 117,288 | | | |
| リゾートトラスト | 1.4 | 5.6 | 14,660 | | | |
| りらいあコミュニケーションズ | 0.7 | — | — | | | |
| ユー・エス・エス | 4.4 | 16.1 | 25,438 | | | |
| サイバーエージェント | 0.9 | 3.3 | 16,302 | | | |
| 楽天 | 16 | 62.3 | 61,739 | | | |
| リロ・ホールディング | 0.2 | 0.7 | 8,988 | | | |
| エイチ・アイ・エス | 0.6 | 2.2 | 7,282 | | | |
| カナモト | — | 1.9 | 4,622 | | | |
| セコム | 3.6 | 13.9 | 113,938 | | | |
| ベネッセホールディングス | 1.3 | 4.5 | 15,637 | | | |
| イオンディライト | 0.4 | 1.3 | 4,758 | | | |
| 合 計 | 株 数・金 額 | 3,754 | 13,521 | 18,077,321 | | |
| | 銘柄数<比率> | 399 | 400 | <98.1%> | | |

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

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当 期 末 | |
|--------|-------|-------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 百万円 | 百万円 |
| 株式先物取引 | 322 | — |

MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

損益の状況、組入資産の明細は「MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）」の第9期（2015年5月13日～2016年5月12日）の運用報告書から抜粋したものです。

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

| 項 目 | 当 期 | 円 |
|------------------|-----|-----------------|
| (A) 配当等収益 | △ | 11,804 |
| 受取利息 | | 107,507 |
| 支払利息 | △ | 119,311 |
| (B) 有価証券売買損益 | | 13,513,561,787 |
| 売買益 | | 15,416,210,819 |
| 売買損 | △ | 1,902,649,032 |
| (C) 信託報酬等 | △ | 311,900,748 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | | 13,201,649,235 |
| (E) 前期繰越損益金 | | 3,547,314,875 |
| (F) 追加信託差損益金 | | 38,499,556,884 |
| (配当等相当額) | (| 25,284,549,647) |
| (売買損益相当額) | (| 13,215,007,237) |
| (G) 計(D+E+F) | | 55,248,520,994 |
| (H) 収益分配金 | | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | | 55,248,520,994 |
| 追加信託差損益金 | | 38,499,556,884 |
| (配当等相当額) | (| 25,404,375,540) |
| (売買損益相当額) | (| 13,095,181,344) |
| 分配準備積立金 | | 16,748,964,110 |

(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) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

○組入資産の明細

(2016年5月12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 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 113,326,227 | 199,687,055 | 269,038,369 |

下記は、日本債券インデックスマザーファンド全体の内容です。

国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | |
|----------------|-----|-----------|-----------|------------|
| | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第353回利付国債（2年） | 0.1 | 1,190,000 | 1,194,843 | 2017/6/15 |
| 第354回利付国債（2年） | 0.1 | 680,000 | 682,978 | 2017/7/15 |
| 第355回利付国債（2年） | 0.1 | 4,850,000 | 4,872,795 | 2017/8/15 |
| 第356回利付国債（2年） | 0.1 | 2,250,000 | 2,261,430 | 2017/9/15 |
| 第357回利付国債（2年） | 0.1 | 2,750,000 | 2,764,850 | 2017/10/15 |
| 第358回利付国債（2年） | 0.1 | 3,800,000 | 3,821,736 | 2017/11/15 |
| 第359回利付国債（2年） | 0.1 | 2,000,000 | 2,012,080 | 2017/12/15 |
| 第360回利付国債（2年） | 0.1 | 1,150,000 | 1,157,130 | 2018/1/15 |
| 第361回利付国債（2年） | 0.1 | 600,000 | 603,852 | 2018/2/15 |
| 第362回利付国債（2年） | 0.1 | 2,200,000 | 2,214,762 | 2018/3/15 |
| 第363回利付国債（2年） | 0.1 | 2,630,000 | 2,648,199 | 2018/4/15 |
| 第105回利付国債（5年） | 0.2 | 240,000 | 241,226 | 2017/6/20 |
| 第106回利付国債（5年） | 0.2 | 3,130,000 | 3,149,875 | 2017/9/20 |
| 第107回利付国債（5年） | 0.2 | 3,120,000 | 3,143,493 | 2017/12/20 |
| 第108回利付国債（5年） | 0.1 | 1,530,000 | 1,539,072 | 2017/12/20 |
| 第109回利付国債（5年） | 0.1 | 2,350,000 | 2,365,886 | 2018/3/20 |
| 第110回利付国債（5年） | 0.3 | 1,080,000 | 1,091,296 | 2018/3/20 |
| 第111回利付国債（5年） | 0.4 | 1,410,000 | 1,427,371 | 2018/3/20 |
| 第112回利付国債（5年） | 0.4 | 1,400,000 | 1,419,460 | 2018/6/20 |
| 第113回利付国債（5年） | 0.3 | 6,040,000 | 6,111,272 | 2018/6/20 |
| 第114回利付国債（5年） | 0.3 | 1,390,000 | 1,408,375 | 2018/9/20 |
| 第115回利付国債（5年） | 0.2 | 3,670,000 | 3,709,856 | 2018/9/20 |
| 第116回利付国債（5年） | 0.2 | 4,280,000 | 4,330,889 | 2018/12/20 |
| 第117回利付国債（5年） | 0.2 | 4,970,000 | 5,034,013 | 2019/3/20 |
| 第118回利付国債（5年） | 0.2 | 2,560,000 | 2,595,532 | 2019/6/20 |
| 第119回利付国債（5年） | 0.1 | 520,000 | 525,595 | 2019/6/20 |
| 第120回利付国債（5年） | 0.2 | 2,690,000 | 2,730,403 | 2019/9/20 |
| 第121回利付国債（5年） | 0.1 | 2,580,000 | 2,610,031 | 2019/9/20 |
| 第122回利付国債（5年） | 0.1 | 4,310,000 | 4,363,961 | 2019/12/20 |
| 第123回利付国債（5年） | 0.1 | 6,170,000 | 6,251,382 | 2020/3/20 |
| 第124回利付国債（5年） | 0.1 | 5,430,000 | 5,506,345 | 2020/6/20 |
| 第125回利付国債（5年） | 0.1 | 4,260,000 | 4,322,664 | 2020/9/20 |
| 第126回利付国債（5年） | 0.1 | 4,460,000 | 4,529,397 | 2020/12/20 |
| 第127回利付国債（5年） | 0.1 | 4,570,000 | 4,644,993 | 2021/3/20 |
| 第1回利付国債（40年） | 2.4 | 385,000 | 624,543 | 2048/3/20 |
| 第2回利付国債（40年） | 2.2 | 620,000 | 976,574 | 2049/3/20 |
| 第3回利付国債（40年） | 2.2 | 653,000 | 1,037,381 | 2050/3/20 |
| 第4回利付国債（40年） | 2.2 | 948,000 | 1,518,601 | 2051/3/20 |
| 第5回利付国債（40年） | 2.0 | 935,000 | 1,449,418 | 2052/3/20 |
| 第6回利付国債（40年） | 1.9 | 1,070,000 | 1,635,270 | 2053/3/20 |
| 第7回利付国債（40年） | 1.7 | 1,110,000 | 1,629,824 | 2054/3/20 |
| 第8回利付国債（40年） | 1.4 | 1,320,000 | 1,809,403 | 2055/3/20 |
| 第286回利付国債（10年） | 1.8 | 1,070,000 | 1,094,342 | 2017/6/20 |
| 第287回利付国債（10年） | 1.9 | 2,400,000 | 2,457,240 | 2017/6/20 |

| 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288回利付国債 (10年) | 1.7 | 2,026,000 | 2,079,992 | 2017/9/20 |
| 第289回利付国債 (10年) | 1.5 | 2,453,000 | 2,522,444 | 2017/12/20 |
| 第290回利付国債 (10年) | 1.4 | 1,640,000 | 1,690,266 | 2018/3/20 |
| 第291回利付国債 (10年) | 1.3 | 940,000 | 967,072 | 2018/3/20 |
| 第292回利付国債 (10年) | 1.7 | 794,000 | 822,750 | 2018/3/20 |
| 第293回利付国債 (10年) | 1.8 | 1,081,000 | 1,127,807 | 2018/6/20 |
| 第294回利付国債 (10年) | 1.7 | 1,570,000 | 1,634,668 | 2018/6/20 |
| 第295回利付国債 (10年) | 1.5 | 1,240,000 | 1,285,855 | 2018/6/20 |
| 第296回利付国債 (10年) | 1.5 | 2,020,000 | 2,103,486 | 2018/9/20 |
| 第297回利付国債 (10年) | 1.4 | 836,000 | 871,830 | 2018/12/20 |
| 第298回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,640,000 | 2,746,233 | 2018/12/20 |
| 第299回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,760,000 | 2,881,688 | 2019/3/20 |
| 第300回利付国債 (10年) | 1.5 | 957,000 | 1,004,677 | 2019/3/20 |
| 第301回利付国債 (10年) | 1.5 | 1,872,000 | 1,973,892 | 2019/6/20 |
| 第302回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,850,000 | 2,996,233 | 2019/6/20 |
| 第303回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,325,000 | 2,453,688 | 2019/9/20 |
| 第304回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,170,000 | 1,230,804 | 2019/9/20 |
| 第305回利付国債 (10年) | 1.3 | 3,808,000 | 4,020,029 | 2019/12/20 |
| 第306回利付国債 (10年) | 1.4 | 2,488,000 | 2,646,286 | 2020/3/20 |
| 第307回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,610,000 | 1,706,181 | 2020/3/20 |
| 第308回利付国債 (10年) | 1.3 | 1,374,000 | 1,461,221 | 2020/6/20 |
| 第309回利付国債 (10年) | 1.1 | 2,300,000 | 2,426,983 | 2020/6/20 |
| 第310回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,886,000 | 3,041,872 | 2020/9/20 |
| 第311回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,700,000 | 2,822,121 | 2020/9/20 |
| 第312回利付国債 (10年) | 1.2 | 4,030,000 | 4,297,753 | 2020/12/20 |
| 第313回利付国債 (10年) | 1.3 | 2,969,000 | 3,191,496 | 2021/3/20 |
| 第314回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,590,000 | 1,693,572 | 2021/3/20 |
| 第315回利付国債 (10年) | 1.2 | 2,253,000 | 2,420,352 | 2021/6/20 |
| 第316回利付国債 (10年) | 1.1 | 980,000 | 1,047,747 | 2021/6/20 |
| 第317回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,557,000 | 1,670,022 | 2021/9/20 |
| 第318回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,490,000 | 2,657,253 | 2021/9/20 |
| 第319回利付国債 (10年) | 1.1 | 1,519,000 | 1,634,474 | 2021/12/20 |
| 第320回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,850,000 | 3,050,497 | 2021/12/20 |
| 第321回利付国債 (10年) | 1.0 | 2,515,000 | 2,699,827 | 2022/3/20 |
| 第322回利付国債 (10年) | 0.9 | 1,770,000 | 1,889,581 | 2022/3/20 |
| 第323回利付国債 (10年) | 0.9 | 1,675,000 | 1,793,121 | 2022/6/20 |
| 第324回利付国債 (10年) | 0.8 | 3,440,000 | 3,661,295 | 2022/6/20 |
| 第325回利付国債 (10年) | 0.8 | 3,435,000 | 3,665,248 | 2022/9/20 |
| 第326回利付国債 (10年) | 0.7 | 1,360,000 | 1,445,204 | 2022/12/20 |
| 第327回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,240,000 | 2,395,344 | 2022/12/20 |
| 第328回利付国債 (10年) | 0.6 | 740,000 | 782,979 | 2023/3/20 |
| 第329回利付国債 (10年) | 0.8 | 3,210,000 | 3,447,251 | 2023/6/20 |
| 第330回利付国債 (10年) | 0.8 | 2,390,000 | 2,572,070 | 2023/9/20 |
| 第331回利付国債 (10年) | 0.6 | 1,480,000 | 1,570,635 | 2023/9/20 |
| 第332回利付国債 (10年) | 0.6 | 3,110,000 | 3,304,468 | 2023/12/20 |

| 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333回利付国債（10年） | 0.6 | 4,060,000 | 4,318,825 | 2024/3/20 |
| 第334回利付国債（10年） | 0.6 | 4,200,000 | 4,472,790 | 2024/6/20 |
| 第335回利付国債（10年） | 0.5 | 4,240,000 | 4,484,351 | 2024/9/20 |
| 第336回利付国債（10年） | 0.5 | 1,360,000 | 1,439,492 | 2024/12/20 |
| 第337回利付国債（10年） | 0.3 | 3,980,000 | 4,143,180 | 2024/12/20 |
| 第338回利付国債（10年） | 0.4 | 4,440,000 | 4,663,021 | 2025/3/20 |
| 第339回利付国債（10年） | 0.4 | 5,380,000 | 5,652,819 | 2025/6/20 |
| 第340回利付国債（10年） | 0.4 | 5,330,000 | 5,602,576 | 2025/9/20 |
| 第341回利付国債（10年） | 0.3 | 4,820,000 | 5,018,969 | 2025/12/20 |
| 第342回利付国債（10年） | 0.1 | 3,680,000 | 3,758,752 | 2026/3/20 |
| 第1回利付国債（30年） | 2.8 | 76,000 | 104,404 | 2029/9/20 |
| 第2回利付国債（30年） | 2.4 | 98,000 | 130,290 | 2030/2/20 |
| 第3回利付国債（30年） | 2.3 | 117,000 | 154,486 | 2030/5/20 |
| 第4回利付国債（30年） | 2.9 | 127,000 | 179,675 | 2030/11/20 |
| 第5回利付国債（30年） | 2.2 | 108,000 | 142,701 | 2031/5/20 |
| 第6回利付国債（30年） | 2.4 | 169,000 | 229,611 | 2031/11/20 |
| 第7回利付国債（30年） | 2.3 | 164,000 | 221,729 | 2032/5/20 |
| 第8回利付国債（30年） | 1.8 | 142,000 | 181,231 | 2032/11/22 |
| 第9回利付国債（30年） | 1.4 | 116,000 | 140,505 | 2032/12/20 |
| 第10回利付国債（30年） | 1.1 | 185,000 | 215,108 | 2033/3/20 |
| 第11回利付国債（30年） | 1.7 | 137,000 | 173,261 | 2033/6/20 |
| 第12回利付国債（30年） | 2.1 | 220,000 | 293,774 | 2033/9/20 |
| 第13回利付国債（30年） | 2.0 | 205,000 | 270,716 | 2033/12/20 |
| 第14回利付国債（30年） | 2.4 | 493,000 | 686,965 | 2034/3/20 |
| 第15回利付国債（30年） | 2.5 | 346,000 | 488,818 | 2034/6/20 |
| 第16回利付国債（30年） | 2.5 | 302,000 | 427,961 | 2034/9/20 |
| 第17回利付国債（30年） | 2.4 | 327,000 | 458,454 | 2034/12/20 |
| 第18回利付国債（30年） | 2.3 | 427,000 | 591,984 | 2035/3/20 |
| 第19回利付国債（30年） | 2.3 | 303,000 | 420,809 | 2035/6/20 |
| 第20回利付国債（30年） | 2.5 | 495,000 | 707,726 | 2035/9/20 |
| 第21回利付国債（30年） | 2.3 | 379,000 | 528,094 | 2035/12/20 |
| 第22回利付国債（30年） | 2.5 | 570,000 | 817,875 | 2036/3/20 |
| 第23回利付国債（30年） | 2.5 | 554,000 | 796,319 | 2036/6/20 |
| 第24回利付国債（30年） | 2.5 | 411,000 | 592,349 | 2036/9/20 |
| 第25回利付国債（30年） | 2.3 | 742,000 | 1,043,021 | 2036/12/20 |
| 第26回利付国債（30年） | 2.4 | 1,064,000 | 1,520,211 | 2037/3/20 |
| 第27回利付国債（30年） | 2.5 | 910,000 | 1,327,635 | 2037/9/20 |
| 第28回利付国債（30年） | 2.5 | 1,191,000 | 1,747,852 | 2038/3/20 |
| 第29回利付国債（30年） | 2.4 | 1,400,000 | 2,037,070 | 2038/9/20 |
| 第30回利付国債（30年） | 2.3 | 1,336,000 | 1,925,763 | 2039/3/20 |
| 第31回利付国債（30年） | 2.2 | 1,228,000 | 1,752,380 | 2039/9/20 |
| 第32回利付国債（30年） | 2.3 | 1,509,000 | 2,197,677 | 2040/3/20 |
| 第33回利付国債（30年） | 2.0 | 1,834,000 | 2,561,786 | 2040/9/20 |
| 第34回利付国債（30年） | 2.2 | 1,626,000 | 2,359,374 | 2041/3/20 |
| 第35回利付国債（30年） | 2.0 | 1,769,000 | 2,495,032 | 2041/9/20 |

| 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36回利付国債（30年） | 2.0 | 1,809,000 | 2,565,035 | 2042/3/20 |
| 第37回利付国債（30年） | 1.9 | 1,827,000 | 2,559,517 | 2042/9/20 |
| 第38回利付国債（30年） | 1.8 | 1,425,000 | 1,970,703 | 2043/3/20 |
| 第39回利付国債（30年） | 1.9 | 1,200,000 | 1,693,860 | 2043/6/20 |
| 第40回利付国債（30年） | 1.8 | 970,000 | 1,347,960 | 2043/9/20 |
| 第41回利付国債（30年） | 1.7 | 1,060,000 | 1,445,596 | 2043/12/20 |
| 第42回利付国債（30年） | 1.7 | 1,010,000 | 1,380,447 | 2044/3/20 |
| 第43回利付国債（30年） | 1.7 | 1,270,000 | 1,739,722 | 2044/6/20 |
| 第44回利付国債（30年） | 1.7 | 1,250,000 | 1,716,162 | 2044/9/20 |
| 第45回利付国債（30年） | 1.5 | 1,130,000 | 1,493,035 | 2044/12/20 |
| 第46回利付国債（30年） | 1.5 | 1,530,000 | 2,025,459 | 2045/3/20 |
| 第47回利付国債（30年） | 1.6 | 1,380,000 | 1,867,567 | 2045/6/20 |
| 第48回利付国債（30年） | 1.4 | 1,580,000 | 2,054,331 | 2045/9/20 |
| 第49回利付国債（30年） | 1.4 | 1,520,000 | 1,977,185 | 2045/12/20 |
| 第50回利付国債（30年） | 0.8 | 890,000 | 1,007,747 | 2046/3/20 |
| 第36回利付国債（20年） | 3.0 | 201,000 | 209,890 | 2017/9/20 |
| 第38回利付国債（20年） | 2.7 | 400,000 | 421,936 | 2018/3/20 |
| 第40回利付国債（20年） | 2.3 | 601,000 | 637,120 | 2018/9/20 |
| 第42回利付国債（20年） | 2.6 | 869,000 | 939,797 | 2019/3/20 |
| 第43回利付国債（20年） | 2.9 | 74,000 | 81,828 | 2019/9/20 |
| 第44回利付国債（20年） | 2.5 | 480,000 | 530,817 | 2020/3/20 |
| 第47回利付国債（20年） | 2.2 | 114,000 | 126,145 | 2020/9/21 |
| 第48回利付国債（20年） | 2.5 | 209,000 | 235,526 | 2020/12/21 |
| 第49回利付国債（20年） | 2.1 | 515,000 | 573,704 | 2021/3/22 |
| 第51回利付国債（20年） | 2.0 | 200,000 | 223,124 | 2021/6/21 |
| 第52回利付国債（20年） | 2.1 | 214,000 | 241,075 | 2021/9/21 |
| 第54回利付国債（20年） | 2.2 | 480,000 | 546,288 | 2021/12/20 |
| 第55回利付国債（20年） | 2.0 | 241,000 | 272,930 | 2022/3/21 |
| 第56回利付国債（20年） | 2.0 | 449,000 | 511,060 | 2022/6/20 |
| 第58回利付国債（20年） | 1.9 | 147,000 | 167,224 | 2022/9/20 |
| 第59回利付国債（20年） | 1.7 | 589,000 | 665,145 | 2022/12/20 |
| 第61回利付国債（20年） | 1.0 | 289,000 | 313,715 | 2023/3/20 |
| 第63回利付国債（20年） | 1.8 | 442,000 | 506,359 | 2023/6/20 |
| 第64回利付国債（20年） | 1.9 | 441,000 | 510,633 | 2023/9/20 |
| 第65回利付国債（20年） | 1.9 | 318,000 | 369,659 | 2023/12/20 |
| 第66回利付国債（20年） | 1.8 | 500,000 | 577,365 | 2023/12/20 |
| 第68回利付国債（20年） | 2.2 | 846,000 | 1,007,391 | 2024/3/20 |
| 第70回利付国債（20年） | 2.4 | 422,000 | 511,447 | 2024/6/20 |
| 第71回利付国債（20年） | 2.2 | 160,000 | 191,284 | 2024/6/20 |
| 第72回利付国債（20年） | 2.1 | 534,000 | 636,645 | 2024/9/20 |
| 第73回利付国債（20年） | 2.0 | 620,000 | 736,739 | 2024/12/20 |
| 第74回利付国債（20年） | 2.1 | 318,000 | 380,646 | 2024/12/20 |
| 第75回利付国債（20年） | 2.1 | 575,000 | 690,644 | 2025/3/20 |
| 第76回利付国債（20年） | 1.9 | 200,000 | 236,640 | 2025/3/20 |
| 第77回利付国債（20年） | 2.0 | 210,000 | 250,353 | 2025/3/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第78回利付国債（20年） | 1.9 | 410,000 | 486,834 | 2025/6/20 |
| 第79回利付国債（20年） | 2.0 | 50,000 | 59,830 | 2025/6/20 |
| 第80回利付国債（20年） | 2.1 | 315,000 | 379,833 | 2025/6/20 |
| 第81回利付国債（20年） | 2.0 | 350,000 | 420,546 | 2025/9/20 |
| 第82回利付国債（20年） | 2.1 | 662,000 | 801,695 | 2025/9/20 |
| 第83回利付国債（20年） | 2.1 | 413,000 | 501,530 | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債（20年） | 2.0 | 670,000 | 807,122 | 2025/12/20 |
| 第85回利付国債（20年） | 2.1 | 490,000 | 597,167 | 2026/3/20 |
| 第86回利付国債（20年） | 2.3 | 515,000 | 637,879 | 2026/3/20 |
| 第87回利付国債（20年） | 2.2 | 450,000 | 552,892 | 2026/3/20 |
| 第88回利付国債（20年） | 2.3 | 804,000 | 1,000,795 | 2026/6/20 |
| 第89回利付国債（20年） | 2.2 | 410,000 | 506,173 | 2026/6/20 |
| 第90回利付国債（20年） | 2.2 | 980,000 | 1,214,406 | 2026/9/20 |
| 第91回利付国債（20年） | 2.3 | 468,000 | 584,831 | 2026/9/20 |
| 第92回利付国債（20年） | 2.1 | 1,212,000 | 1,495,183 | 2026/12/20 |
| 第93回利付国債（20年） | 2.0 | 510,000 | 626,035 | 2027/3/20 |
| 第94回利付国債（20年） | 2.1 | 965,000 | 1,195,113 | 2027/3/20 |
| 第95回利付国債（20年） | 2.3 | 917,000 | 1,160,674 | 2027/6/20 |
| 第96回利付国債（20年） | 2.1 | 380,000 | 472,476 | 2027/6/20 |
| 第97回利付国債（20年） | 2.2 | 853,000 | 1,073,875 | 2027/9/20 |
| 第98回利付国債（20年） | 2.1 | 620,000 | 773,450 | 2027/9/20 |
| 第99回利付国債（20年） | 2.1 | 1,695,000 | 2,122,563 | 2027/12/20 |
| 第100回利付国債（20年） | 2.2 | 1,100,000 | 1,395,702 | 2028/3/20 |
| 第101回利付国債（20年） | 2.4 | 573,000 | 740,699 | 2028/3/20 |
| 第102回利付国債（20年） | 2.4 | 680,000 | 882,204 | 2028/6/20 |
| 第103回利付国債（20年） | 2.3 | 550,000 | 706,860 | 2028/6/20 |
| 第104回利付国債（20年） | 2.1 | 280,000 | 353,043 | 2028/6/20 |
| 第105回利付国債（20年） | 2.1 | 1,790,000 | 2,263,938 | 2028/9/20 |
| 第106回利付国債（20年） | 2.2 | 531,000 | 678,177 | 2028/9/20 |
| 第107回利付国債（20年） | 2.1 | 607,000 | 770,483 | 2028/12/20 |
| 第108回利付国債（20年） | 1.9 | 1,230,000 | 1,530,169 | 2028/12/20 |
| 第109回利付国債（20年） | 1.9 | 700,000 | 873,061 | 2029/3/20 |
| 第110回利付国債（20年） | 2.1 | 966,000 | 1,229,708 | 2029/3/20 |
| 第111回利付国債（20年） | 2.2 | 531,000 | 684,878 | 2029/6/20 |
| 第112回利付国債（20年） | 2.1 | 1,210,000 | 1,544,782 | 2029/6/20 |
| 第113回利付国債（20年） | 2.1 | 1,792,000 | 2,294,297 | 2029/9/20 |
| 第114回利付国債（20年） | 2.1 | 1,810,000 | 2,325,234 | 2029/12/20 |
| 第115回利付国債（20年） | 2.2 | 654,000 | 849,055 | 2029/12/20 |
| 第116回利付国債（20年） | 2.2 | 746,000 | 971,858 | 2030/3/20 |
| 第117回利付国債（20年） | 2.1 | 1,260,000 | 1,624,051 | 2030/3/20 |
| 第118回利付国債（20年） | 2.0 | 666,000 | 851,953 | 2030/6/20 |
| 第119回利付国債（20年） | 1.8 | 660,000 | 825,712 | 2030/6/20 |
| 第120回利付国債（20年） | 1.6 | 800,000 | 978,352 | 2030/6/20 |
| 第121回利付国債（20年） | 1.9 | 1,369,000 | 1,735,974 | 2030/9/20 |
| 第122回利付国債（20年） | 1.8 | 760,000 | 952,857 | 2030/9/20 |

| 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123回利付国債（20年） | 2.1 | 1,748,000 | 2,273,868 | 2030/12/20 |
| 第124回利付国債（20年） | 2.0 | 700,000 | 900,417 | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債（20年） | 2.2 | 734,000 | 967,947 | 2031/3/20 |
| 第126回利付国債（20年） | 2.0 | 810,000 | 1,044,268 | 2031/3/20 |
| 第127回利付国債（20年） | 1.9 | 560,000 | 713,697 | 2031/3/20 |
| 第128回利付国債（20年） | 1.9 | 1,214,000 | 1,551,649 | 2031/6/20 |
| 第129回利付国債（20年） | 1.8 | 600,000 | 757,884 | 2031/6/20 |
| 第130回利付国債（20年） | 1.8 | 1,182,000 | 1,495,903 | 2031/9/20 |
| 第131回利付国債（20年） | 1.7 | 890,000 | 1,112,820 | 2031/9/20 |
| 第132回利付国債（20年） | 1.7 | 827,000 | 1,035,776 | 2031/12/20 |
| 第133回利付国債（20年） | 1.8 | 1,190,000 | 1,508,789 | 2031/12/20 |
| 第134回利付国債（20年） | 1.8 | 965,000 | 1,225,636 | 2032/3/20 |
| 第135回利付国債（20年） | 1.7 | 370,000 | 464,139 | 2032/3/20 |
| 第136回利付国債（20年） | 1.6 | 770,000 | 953,860 | 2032/3/20 |
| 第137回利付国債（20年） | 1.7 | 472,000 | 593,039 | 2032/6/20 |
| 第138回利付国債（20年） | 1.5 | 890,000 | 1,089,965 | 2032/6/20 |
| 第139回利付国債（20年） | 1.6 | 480,000 | 595,468 | 2032/6/20 |
| 第140回利付国債（20年） | 1.7 | 2,427,000 | 3,056,515 | 2032/9/20 |
| 第141回利付国債（20年） | 1.7 | 1,550,000 | 1,954,891 | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債（20年） | 1.8 | 840,000 | 1,073,133 | 2032/12/20 |
| 第143回利付国債（20年） | 1.6 | 1,380,000 | 1,720,032 | 2033/3/20 |
| 第144回利付国債（20年） | 1.5 | 1,020,000 | 1,254,467 | 2033/3/20 |
| 第145回利付国債（20年） | 1.7 | 2,790,000 | 3,528,457 | 2033/6/20 |
| 第146回利付国債（20年） | 1.7 | 2,070,000 | 2,621,344 | 2033/9/20 |
| 第147回利付国債（20年） | 1.6 | 2,360,000 | 2,951,746 | 2033/12/20 |
| 第148回利付国債（20年） | 1.5 | 2,170,000 | 2,679,103 | 2034/3/20 |
| 第149回利付国債（20年） | 1.5 | 2,500,000 | 3,086,425 | 2034/6/20 |
| 第150回利付国債（20年） | 1.4 | 2,420,000 | 2,946,979 | 2034/9/20 |
| 第151回利付国債（20年） | 1.2 | 2,620,000 | 3,098,097 | 2034/12/20 |
| 第152回利付国債（20年） | 1.2 | 2,920,000 | 3,453,367 | 2035/3/20 |
| 第153回利付国債（20年） | 1.3 | 2,400,000 | 2,885,568 | 2035/6/20 |
| 第154回利付国債（20年） | 1.2 | 2,290,000 | 2,708,978 | 2035/9/20 |
| 第155回利付国債（20年） | 1.0 | 2,530,000 | 2,895,306 | 2035/12/20 |
| 第156回利付国債（20年） | 0.4 | 1,510,000 | 1,552,808 | 2036/3/20 |
| 第14回ポーランド共和国円貨債券（2013） | 0.67 | 100,000 | 100,703 | 2018/11/15 |
| 小 計 | | 380,496,000 | 430,939,878 | |
| 地方債証券 | | | | |
| 第1回東京都公募公債（20年） | 1.54 | 20,000 | 22,141 | 2023/6/20 |
| 第7回東京都公募公債（30年） | 2.51 | 10,000 | 14,225 | 2038/9/17 |
| 第8回東京都公募公債（30年） | 2.23 | 80,000 | 109,130 | 2038/9/17 |
| 第16回東京都公募公債（20年） | 2.01 | 100,000 | 123,399 | 2028/12/20 |
| 第20回東京都公募公債（20年） | 2.09 | 80,000 | 100,457 | 2029/9/20 |
| 第21回東京都公募公債（20年） | 2.19 | 80,000 | 101,831 | 2029/12/20 |
| 第22回東京都公募公債（20年） | 1.92 | 120,000 | 149,548 | 2030/6/20 |
| 第24回東京都公募公債（20年） | 1.98 | 70,000 | 88,857 | 2031/6/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第28回東京都公募公債（20年） | 1.59 | 100,000 | 122,170 | 2033/3/18 |
| 第666回東京都公募公債 | 1.46 | 150,000 | 156,177 | 2019/3/20 |
| 第669回東京都公募公債 | 1.63 | 50,000 | 52,511 | 2019/6/20 |
| 第678回東京都公募公債 | 1.38 | 100,000 | 104,916 | 2019/12/20 |
| 第680回東京都公募公債 | 1.39 | 100,000 | 105,319 | 2020/3/19 |
| 第681回東京都公募公債 | 1.4 | 100,000 | 105,349 | 2020/3/19 |
| 第686回東京都公募公債 | 1.08 | 100,000 | 104,369 | 2020/6/19 |
| 第692回東京都公募公債 | 1.35 | 100,000 | 106,165 | 2020/12/18 |
| 第693回東京都公募公債 | 1.38 | 100,000 | 106,670 | 2021/3/19 |
| 第701回東京都公募公債 | 0.99 | 120,000 | 126,288 | 2021/9/17 |
| 第705回東京都公募公債 | 1.06 | 170,000 | 180,438 | 2022/3/18 |
| 第709回東京都公募公債 | 0.78 | 100,000 | 104,731 | 2022/6/20 |
| 第716回東京都公募公債 | 0.77 | 100,000 | 105,018 | 2022/12/20 |
| 第717回東京都公募公債 | 0.63 | 100,000 | 104,217 | 2023/3/20 |
| 第718回東京都公募公債 | 0.6 | 100,000 | 104,012 | 2023/3/20 |
| 第719回東京都公募公債 | 0.86 | 250,000 | 264,480 | 2023/3/20 |
| 第723回東京都公募公債 | 0.76 | 200,000 | 210,802 | 2023/9/20 |
| 第728回東京都公募公債 | 0.65 | 300,000 | 314,115 | 2023/12/20 |
| 第730回東京都公募公債 | 0.664 | 100,000 | 105,089 | 2024/3/19 |
| 平成19年度第2回北海道公募公債 | 1.84 | 112,000 | 114,084 | 2017/5/31 |
| 平成19年度第4回北海道公募公債 | 1.98 | 20,000 | 20,435 | 2017/6/29 |
| 平成19年度第16回北海道公募公債 | 1.58 | 100,000 | 102,857 | 2018/3/23 |
| 平成20年度第6回北海道公募公債 | 1.72 | 53,990 | 56,059 | 2018/8/29 |
| 平成21年度第2回北海道公募公債 | 1.66 | 100,000 | 104,893 | 2019/5/29 |
| 平成21年度第12回北海道公募公債 | 1.42 | 100,000 | 104,897 | 2019/12/25 |
| 平成22年度第8回北海道公募公債 | 0.96 | 100,000 | 103,939 | 2020/10/29 |
| 平成24年度第9回北海道公募公債 | 0.79 | 100,000 | 104,506 | 2022/10/31 |
| 平成24年度第13回北海道公募公債（5年） | 0.23 | 100,000 | 100,318 | 2018/1/31 |
| 平成26年度第13回北海道公募公債 | 0.461 | 200,000 | 206,354 | 2024/12/26 |
| 第1回神奈川県公募公債（20年） | 2.55 | 100,000 | 120,230 | 2024/6/20 |
| 第2回神奈川県公募公債（20年） | 2.23 | 80,000 | 94,514 | 2024/9/20 |
| 第2回神奈川県公募公債（30年） | 2.87 | 80,000 | 116,556 | 2036/6/20 |
| 第3回神奈川県公募公債（20年） | 2.11 | 100,000 | 118,721 | 2025/6/20 |
| 第27回神奈川県公募公債（20年） | 1.398 | 100,000 | 119,313 | 2034/9/20 |
| 第152回神奈川県公募公債 | 1.53 | 110,000 | 113,100 | 2018/3/20 |
| 第162回神奈川県公募公債 | 1.62 | 140,450 | 147,450 | 2019/6/20 |
| 第163回神奈川県公募公債 | 1.4 | 114,000 | 118,902 | 2019/6/20 |
| 第165回神奈川県公募公債 | 1.4 | 54,660 | 57,210 | 2019/9/20 |
| 第170回神奈川県公募公債 | 1.38 | 240,000 | 252,619 | 2020/3/20 |
| 第171回神奈川県公募公債 | 1.41 | 100,000 | 105,374 | 2020/3/20 |
| 第176回神奈川県公募公債 | 1.16 | 128,900 | 135,261 | 2020/9/18 |
| 第191回神奈川県公募公債 | 0.83 | 100,000 | 104,876 | 2022/6/20 |
| 第192回神奈川県公募公債 | 0.805 | 200,000 | 209,782 | 2022/9/20 |
| 第5回大阪府公募公債（20年） | 2.16 | 100,000 | 126,762 | 2030/5/28 |
| 第11回大阪府公募公債（20年） | 1.693 | 200,000 | 246,444 | 2033/9/27 |

| 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 | |
| 第89回大阪府公募公債（5年） | 0.2 | 100,000 | 100,219 | 2017/12/27 |
| 第92回大阪府公募公債（5年） | 0.14 | 100,000 | 100,131 | 2018/3/28 |
| 第306回大阪府公募公債 | 1.83 | 30,000 | 30,727 | 2017/9/27 |
| 第313回大阪府公募公債 | 1.66 | 100,000 | 103,120 | 2018/4/27 |
| 第314回大阪府公募公債 | 1.8 | 30,000 | 31,063 | 2018/5/29 |
| 第316回大阪府公募公債 | 1.85 | 100,000 | 103,951 | 2018/7/30 |
| 第325回大阪府公募公債 | 1.66 | 153,000 | 160,184 | 2019/4/26 |
| 第326回大阪府公募公債 | 1.66 | 10,000 | 10,482 | 2019/5/28 |
| 第331回大阪府公募公債 | 1.41 | 100,000 | 104,606 | 2019/10/29 |
| 第332回大阪府公募公債 | 1.58 | 71,600 | 75,386 | 2019/11/27 |
| 第334回大阪府公募公債 | 1.47 | 264,000 | 277,561 | 2020/1/28 |
| 第337回大阪府公募公債 | 1.44 | 110,000 | 115,897 | 2020/4/28 |
| 第343回大阪府公募公債 | 0.98 | 70,000 | 72,688 | 2020/10/28 |
| 第348回大阪府公募公債 | 1.32 | 10,000 | 10,605 | 2021/3/30 |
| 第351回大阪府公募公債 | 1.19 | 100,000 | 105,761 | 2021/7/28 |
| 第358回大阪府公募公債 | 0.97 | 56,000 | 58,844 | 2022/2/28 |
| 第359回大阪府公募公債 | 0.99 | 56,000 | 58,948 | 2022/3/29 |
| 第366回大阪府公募公債 | 0.79 | 156,000 | 163,112 | 2022/11/29 |
| 第386回大阪府公募公債 | 0.585 | 100,000 | 104,249 | 2024/7/30 |
| 第389回大阪府公募公債 | 0.53 | 100,000 | 103,915 | 2024/10/30 |
| 平成21年度第5回京都市公募公債 | 1.35 | 20,000 | 20,950 | 2019/12/24 |
| 平成22年度第5回京都市公募公債 | 1.26 | 110,000 | 116,176 | 2020/12/21 |
| 平成23年度第9回京都市公募公債 | 1.01 | 140,000 | 147,919 | 2022/3/16 |
| 平成24年度第3回京都市公募公債（20年） | 1.63 | 200,000 | 244,844 | 2032/8/13 |
| 平成24年度第10回京都市公募公債 | 0.67 | 100,000 | 104,352 | 2023/3/22 |
| 平成25年度第1回京都市公募公債 | 0.58 | 100,000 | 103,752 | 2023/4/28 |
| 平成25年度第2回京都市公募公債（15年） | 1.05 | 100,000 | 110,713 | 2028/4/28 |
| 第2回兵庫県公募公債（30年） | 2.36 | 40,000 | 55,785 | 2040/3/19 |
| 第4回兵庫県公募公債（15年） | 1.31 | 100,000 | 113,124 | 2027/12/24 |
| 第8回兵庫県公募公債（15年） | 1.09 | 100,000 | 111,085 | 2029/4/16 |
| 第16回兵庫県公募公債（20年） | 1.7 | 100,000 | 122,916 | 2032/11/19 |
| 平成20年度第5回兵庫県公募公債 | 1.93 | 50,000 | 51,984 | 2018/6/20 |
| 平成21年度第1回兵庫県公募公債 | 1.62 | 120,000 | 125,515 | 2019/4/23 |
| 平成21年度第3回兵庫県公募公債 | 1.62 | 190,000 | 198,975 | 2019/5/22 |
| 平成21年度第25回兵庫県公募公債 | 1.54 | 100,000 | 105,176 | 2019/11/20 |
| 平成20年度第1回静岡県公募公債 | 1.73 | 14,500 | 15,009 | 2018/5/28 |
| 平成20年度第2回静岡県公募公債 | 1.91 | 100,000 | 104,035 | 2018/6/26 |
| 平成20年度第4回静岡県公募公債 | 1.65 | 100,000 | 103,788 | 2018/8/28 |
| 平成20年度第5回静岡県公募公債 | 1.59 | 11,000 | 11,427 | 2018/10/30 |
| 平成21年度第4回静岡県公募公債 | 1.56 | 52,920 | 55,604 | 2019/8/20 |
| 平成22年度第1回静岡県公募公債 | 1.455 | 101,700 | 107,458 | 2020/4/20 |
| 平成22年度第6回静岡県公募公債 | 1.178 | 100,000 | 104,831 | 2020/7/22 |
| 平成22年度第8回静岡県公募公債 | 1.059 | 100,000 | 104,429 | 2020/8/25 |
| 平成23年度第6回静岡県公募公債 | 1.201 | 170,000 | 180,285 | 2021/7/23 |
| 平成24年度第10回静岡県公募公債 | 0.678 | 100,000 | 104,442 | 2023/3/22 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 平成25年度第1回静岡県公募公債 | 0.581 | 100,000 | 103,782 | 2023/4/19 |
| 平成25年度第5回静岡県公募公債 | 0.926 | 100,000 | 106,325 | 2023/7/25 |
| 平成25年度第8回静岡県公募公債 | 0.699 | 100,000 | 104,897 | 2023/10/24 |
| 平成25年度第9回静岡県公募公債 | 0.679 | 300,000 | 314,514 | 2023/11/22 |
| 平成25年度第11回静岡県公募公債 (5年) | 0.204 | 100,000 | 100,557 | 2019/3/26 |
| 平成26年度第5回静岡県公募公債 | 0.61 | 100,000 | 104,574 | 2024/7/25 |
| 平成27年度第3回静岡県公募公債 | 0.544 | 121,000 | 126,367 | 2025/5/21 |
| 平成23年度第7回愛知県公募公債 | 1.11 | 100,000 | 105,595 | 2021/7/29 |
| 平成23年度第9回愛知県公募公債 | 1.019 | 100,000 | 105,289 | 2021/9/30 |
| 平成23年度第14回愛知県公募公債 | 1.006 | 100,000 | 105,381 | 2021/11/30 |
| 平成23年度第17回愛知県公募公債 | 0.996 | 100,000 | 105,489 | 2022/1/31 |
| 平成24年度第13回愛知県公募公債 | 0.772 | 100,000 | 104,819 | 2022/11/30 |
| 平成25年度第2回愛知県公募公債 | 0.576 | 200,000 | 207,514 | 2023/4/26 |
| 平成25年度第9回愛知県公募公債 | 0.849 | 240,000 | 253,852 | 2023/7/25 |
| 平成25年度第15回愛知県公募公債 | 0.699 | 600,000 | 629,394 | 2023/10/25 |
| 平成26年度第9回愛知県公募公債 | 0.576 | 100,000 | 104,385 | 2024/8/26 |
| 平成19年度第2回広島県公募公債 | 1.94 | 46,050 | 47,202 | 2017/8/24 |
| 平成20年度第4回広島県公募公債 | 1.73 | 60,000 | 62,601 | 2018/11/26 |
| 平成22年度第8回広島県公募公債 | 1.33 | 26,650 | 28,340 | 2021/3/25 |
| 平成23年度第1回広島県公募公債 | 1.19 | 100,000 | 105,867 | 2021/5/27 |
| 平成25年度第3回広島県公募公債 | 0.8 | 100,000 | 105,589 | 2023/9/25 |
| 平成19年度第3回埼玉県公募公債 | 1.94 | 39,100 | 40,081 | 2017/8/28 |
| 平成19年度第6回埼玉県公募公債 | 1.63 | 100,000 | 102,786 | 2018/1/30 |
| 平成21年度第8回埼玉県公募公債 | 1.3 | 100,000 | 104,633 | 2019/12/25 |
| 平成23年度第1回埼玉県公募公債 | 1.37 | 100,000 | 106,688 | 2021/4/27 |
| 平成23年度第4回埼玉県公募公債 | 1.2 | 100,000 | 106,057 | 2021/7/27 |
| 平成24年度第6回埼玉県公募公債 | 0.801 | 100,000 | 104,938 | 2022/10/26 |
| 平成26年度第6回埼玉県公募公債 | 0.554 | 150,000 | 156,303 | 2024/9/26 |
| 平成26年度第8回埼玉県公募公債 | 0.335 | 100,000 | 102,491 | 2025/1/28 |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年) | 2.62 | 70,000 | 100,073 | 2037/9/18 |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年) | 2.28 | 80,000 | 109,944 | 2038/9/17 |
| 平成21年度第11回福岡県公募公債 | 1.44 | 100,000 | 105,464 | 2020/2/25 |
| 平成22年度第3回福岡県公募公債 | 1.11 | 100,000 | 104,734 | 2020/8/24 |
| 平成22年度第5回福岡県公募公債 | 0.94 | 20,000 | 20,825 | 2020/10/28 |
| 平成24年度第11回福岡県公募公債 | 0.8 | 550,000 | 578,946 | 2023/2/27 |
| 平成25年度第11回福岡県公募公債 | 0.694 | 300,000 | 315,363 | 2024/2/26 |
| 第9回千葉県公募公債 (20年) | 1.84 | 80,000 | 98,802 | 2030/10/11 |
| 平成20年度第2回千葉県公募公債 | 1.8 | 90,000 | 93,280 | 2018/5/25 |
| 平成20年度第3回千葉県公募公債 | 1.78 | 80,000 | 83,119 | 2018/7/25 |
| 平成20年度第5回千葉県公募公債 | 1.6 | 80,000 | 83,026 | 2018/9/25 |
| 平成22年度第7回千葉県公募公債 | 0.92 | 120,000 | 124,717 | 2020/10/23 |
| 平成22年度第11回千葉県公募公債 | 1.26 | 80,000 | 84,612 | 2021/1/25 |
| 平成23年度第6回千葉県公募公債 | 1.11 | 200,000 | 212,056 | 2021/12/24 |
| 平成23年度第9回千葉県公募公債 | 1.0 | 20,000 | 21,130 | 2022/3/25 |
| 平成24年度第1回千葉県公募公債 | 1.05 | 20,000 | 21,206 | 2022/4/25 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 平成24年度第6回千葉県公募公債 | 0.81 | 100,000 | 105,057 | 2022/11/25 |
| 平成25年度第1回千葉県公募公債 | 0.58 | 82,500 | 85,621 | 2023/4/25 |
| 平成26年度第9回千葉県公募公債 | 0.465 | 188,000 | 195,057 | 2025/3/25 |
| 平成21年度第1回新潟県公募公債 | 1.42 | 23,000 | 24,053 | 2019/7/29 |
| 平成23年度第1回新潟県公募公債 | 1.02 | 119,000 | 125,530 | 2021/11/30 |
| 平成24年度第1回大分県公募公債 | 0.8 | 100,260 | 105,214 | 2022/10/31 |
| 第58回共同発行市場公募地方債 | 1.59 | 21,000 | 21,568 | 2018/1/25 |
| 第59回共同発行市場公募地方債 | 1.57 | 100,800 | 103,619 | 2018/2/23 |
| 第62回共同発行市場公募地方債 | 1.74 | 100,000 | 103,533 | 2018/5/25 |
| 第63回共同発行市場公募地方債 | 1.88 | 200,000 | 207,950 | 2018/6/25 |
| 第64回共同発行市場公募地方債 | 1.78 | 100,000 | 103,856 | 2018/7/25 |
| 第65回共同発行市場公募地方債 | 1.62 | 90,000 | 93,321 | 2018/8/24 |
| 第74回共同発行市場公募地方債 | 1.57 | 100,000 | 104,726 | 2019/5/24 |
| 第75回共同発行市場公募地方債 | 1.64 | 100,000 | 105,084 | 2019/6/25 |
| 第77回共同発行市場公募地方債 | 1.54 | 10,000 | 10,500 | 2019/8/23 |
| 第78回共同発行市場公募地方債 | 1.39 | 30,000 | 31,401 | 2019/9/25 |
| 第81回共同発行市場公募地方債 | 1.32 | 109,500 | 114,673 | 2019/12/25 |
| 第90回共同発行市場公募地方債 | 1.12 | 30,000 | 31,434 | 2020/9/25 |
| 第95回共同発行市場公募地方債 | 1.28 | 100,000 | 105,974 | 2021/2/25 |
| 第100回共同発行市場公募地方債 | 1.21 | 100,000 | 106,124 | 2021/7/23 |
| 第101回共同発行市場公募地方債 | 1.05 | 100,000 | 105,385 | 2021/8/25 |
| 第103回共同発行市場公募地方債 | 1.0 | 100,000 | 105,281 | 2021/10/25 |
| 第104回共同発行市場公募地方債 | 1.03 | 200,000 | 211,058 | 2021/11/25 |
| 第107回共同発行市場公募地方債 | 1.01 | 200,000 | 211,334 | 2022/2/25 |
| 第109回共同発行市場公募地方債 | 1.05 | 170,000 | 180,305 | 2022/4/25 |
| 第110回共同発行市場公募地方債 | 0.89 | 100,000 | 105,149 | 2022/5/25 |
| 第113回共同発行市場公募地方債 | 0.77 | 100,000 | 104,648 | 2022/8/25 |
| 第114回共同発行市場公募地方債 | 0.82 | 100,000 | 105,024 | 2022/9/22 |
| 第116回共同発行市場公募地方債 | 0.8 | 250,000 | 262,565 | 2022/11/25 |
| 第117回共同発行市場公募地方債 | 0.72 | 100,000 | 104,554 | 2022/12/22 |
| 第118回共同発行市場公募地方債 | 0.84 | 200,000 | 210,776 | 2023/1/25 |
| 第119回共同発行市場公募地方債 | 0.8 | 300,000 | 315,663 | 2023/2/24 |
| 第120回共同発行市場公募地方債 | 0.68 | 100,000 | 104,459 | 2023/3/24 |
| 第128回共同発行市場公募地方債 | 0.66 | 300,000 | 314,214 | 2023/11/24 |
| 第130回共同発行市場公募地方債 | 0.76 | 230,000 | 242,721 | 2024/1/25 |
| 第132回共同発行市場公募地方債 | 0.66 | 200,000 | 209,724 | 2024/3/25 |
| 第133回共同発行市場公募地方債 | 0.689 | 400,000 | 420,408 | 2024/4/25 |
| 第135回共同発行市場公募地方債 | 0.659 | 200,000 | 210,018 | 2024/6/25 |
| 第136回共同発行市場公募地方債 | 0.611 | 100,000 | 104,624 | 2024/7/25 |
| 第137回共同発行市場公募地方債 | 0.566 | 400,000 | 417,364 | 2024/8/23 |
| 第138回共同発行市場公募地方債 | 0.554 | 300,000 | 312,732 | 2024/9/25 |
| 第140回共同発行市場公募地方債 | 0.505 | 300,000 | 311,736 | 2024/11/25 |
| 第142回共同発行市場公募地方債 | 0.345 | 200,000 | 205,324 | 2025/1/24 |
| 第144回共同発行市場公募地方債 | 0.47 | 100,000 | 103,752 | 2025/3/25 |
| 第145回共同発行市場公募地方債 | 0.406 | 100,000 | 103,218 | 2025/4/25 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第146回共同発行市場公募地方債 | 0.553 | 200,000 | 209,040 | 2025/5/23 |
| 第148回共同発行市場公募地方債 | 0.553 | 300,000 | 313,971 | 2025/7/25 |
| 第150回共同発行市場公募地方債 | 0.51 | 300,000 | 313,041 | 2025/9/25 |
| 平成19年度第1回堺市公募公債 | 1.73 | 100,000 | 102,753 | 2017/12/19 |
| 平成24年度第2回熊本県公募公債 | 0.8 | 50,000 | 52,483 | 2022/10/26 |
| 平成22年度第1回新潟市公募公債 | 1.21 | 54,980 | 57,959 | 2020/12/24 |
| 平成23年度第1回浜松市公募公債 | 1.045 | 38,200 | 40,343 | 2021/11/25 |
| 平成25年度第1回浜松市公募公債 | 0.761 | 61,000 | 64,376 | 2024/1/24 |
| 第1回大阪市公募公債（15年） | 1.753 | 200,000 | 232,506 | 2026/7/17 |
| 第5回大阪市公募公債（20年） | 2.47 | 100,000 | 127,775 | 2028/9/21 |
| 平成19年度第4回大阪市公募公債 | 1.9 | 30,000 | 30,622 | 2017/6/21 |
| 平成21年度第6回大阪市公募公債 | 1.57 | 125,000 | 131,766 | 2019/11/25 |
| 平成23年度第10回大阪市公募公債 | 0.956 | 10,000 | 10,519 | 2022/1/27 |
| 平成26年度第5回大阪市公募公債 | 0.593 | 100,000 | 104,529 | 2024/9/27 |
| 第1回名古屋市公募公債（12年） | 1.033 | 100,000 | 108,957 | 2025/6/20 |
| 第2回名古屋市公募公債（20年） | 2.56 | 100,000 | 120,310 | 2024/6/20 |
| 第10回名古屋市公募公債（20年） | 2.26 | 80,000 | 101,690 | 2029/8/17 |
| 第477回名古屋市公募公債 | 1.034 | 100,000 | 105,561 | 2021/12/20 |
| 第5回京都市公募公債（20年） | 2.36 | 50,000 | 61,661 | 2026/12/18 |
| 平成23年度第2回京都市公募公債 | 1.049 | 100,000 | 105,299 | 2021/8/26 |
| 平成24年度第4回京都市公募公債 | 0.801 | 100,000 | 104,861 | 2022/10/21 |
| 平成18年度第3回神戸市公募公債（20年） | 2.54 | 120,000 | 148,916 | 2026/6/19 |
| 平成22年度第9回神戸市公募公債（20年） | 2.09 | 80,000 | 101,530 | 2031/1/24 |
| 第7回横浜市公募公債（20年） | 2.06 | 200,000 | 239,212 | 2025/12/19 |
| 第17回横浜市公募公債（20年） | 2.07 | 80,000 | 99,007 | 2028/12/20 |
| 平成20年度第4回横浜市公募公債 | 1.71 | 100,000 | 104,222 | 2018/11/16 |
| 第20回横浜市公募公債（20年） | 2.1 | 80,000 | 100,220 | 2029/10/19 |
| 平成24年度第4回横浜市公募公債 | 0.81 | 100,000 | 105,209 | 2023/2/20 |
| 平成24年度第3回横浜市公募公債 | 0.729 | 100,000 | 104,509 | 2022/12/22 |
| 第25回横浜市公募公債（20年） | 1.72 | 100,000 | 123,821 | 2032/7/16 |
| 第27回横浜市公募公債（20年） | 1.599 | 60,000 | 73,401 | 2033/5/20 |
| 平成21年度第5回札幌市公募公債 | 1.36 | 112,000 | 117,075 | 2019/9/20 |
| 平成22年度第8回札幌市公募公債（30年） | 2.277 | 80,000 | 111,830 | 2040/9/20 |
| 第44回川崎市公募公債（5年） | 0.162 | 130,400 | 131,131 | 2020/6/19 |
| 第82回川崎市公募公債 | 1.52 | 100,000 | 105,070 | 2019/9/20 |
| 第17回北九州市公募公債（20年） | 1.529 | 100,000 | 121,211 | 2034/6/20 |
| 平成20年度第3回福岡市公募公債 | 1.52 | 100,000 | 103,166 | 2018/6/20 |
| 平成20年度第5回福岡市公募公債 | 1.57 | 91,000 | 94,502 | 2018/10/24 |
| 平成22年度第9回福岡市公募公債 | 1.32 | 106,500 | 113,040 | 2021/3/25 |
| 平成23年度第6回福岡市公募公債 | 1.0 | 100,000 | 105,261 | 2021/10/28 |
| 平成24年度第1回福岡市公募公債（5年） | 0.25 | 34,700 | 34,796 | 2017/6/26 |
| 平成24年度第3回福岡市公募公債（5年） | 0.25 | 42,500 | 42,645 | 2017/9/28 |
| 平成25年度第3回福岡市公募公債（5年） | 0.31 | 31,500 | 31,731 | 2018/9/26 |
| 平成25年度第4回福岡市公募公債 | 0.68 | 50,000 | 52,378 | 2023/10/24 |
| 平成26年度第6回福岡市公募公債（20年） | 1.371 | 100,000 | 118,430 | 2034/9/20 |

| 銘柄 | 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 | |
| 平成25年度第2回広島市公募公債 | | 0.72 | 100,000 | 105,210 | 2023/12/27 |
| 平成24年度第2回千葉市公募公債 | | 0.81 | 100,000 | 105,085 | 2022/11/22 |
| 平成26年度第2回千葉市公募公債 | | 0.505 | 100,000 | 103,826 | 2024/11/27 |
| 平成22年度第1回三重県公募公債 | | 1.056 | 87,050 | 91,089 | 2020/11/30 |
| 平成23年度第1回三重県公募公債 | | 1.021 | 98,410 | 103,787 | 2021/11/30 |
| 平成24年度第1回三重県公募公債 | | 0.801 | 140,660 | 147,602 | 2022/10/25 |
| 平成24年度第4回福井県公募公債 | | 0.46 | 100,000 | 102,988 | 2023/4/26 |
| 平成20年度第1回徳島県公募公債 | | 1.73 | 36,000 | 37,586 | 2018/11/28 |
| 平成24年度第1回徳島県公募公債 | | 0.68 | 100,000 | 104,495 | 2023/3/24 |
| 平成26年度第1回徳島県公募公債 | | 0.495 | 100,000 | 103,831 | 2024/11/28 |
| 平成20年度第1回岡山県公募公債 | | 1.56 | 48,700 | 50,691 | 2018/12/25 |
| 小 | 計 | | 28,006,180 | 30,032,413 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.9 | 200,000 | 204,682 | 2017/7/31 |
| 第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.8 | 106,000 | 108,832 | 2017/10/31 |
| 第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 100,000 | 102,590 | 2018/1/31 |
| 第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.4 | 100,000 | 102,616 | 2018/3/23 |
| 第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.7 | 100,000 | 103,476 | 2018/5/30 |
| 第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.7 | 34,000 | 35,280 | 2018/7/31 |
| 第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.6 | 206,000 | 213,535 | 2018/8/29 |
| 第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 224,000 | 231,945 | 2018/9/28 |
| 第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.6 | 50,000 | 51,963 | 2018/10/31 |
| 第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.6 | 115,000 | 119,656 | 2018/11/28 |
| 第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 159,000 | 164,736 | 2019/2/27 |
| 第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 141,000 | 146,187 | 2019/3/19 |
| 第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 200,000 | 209,120 | 2019/5/31 |
| 第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.1 | 200,000 | 250,406 | 2029/5/31 |
| 第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.5 | 210,000 | 219,819 | 2019/6/28 |
| 第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 79,000 | 82,464 | 2019/9/30 |
| 第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.1 | 100,000 | 125,662 | 2029/9/28 |
| 第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.1 | 100,000 | 125,749 | 2029/10/31 |
| 第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.2 | 139,000 | 144,989 | 2019/12/27 |
| 第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 210,000 | 220,096 | 2020/1/31 |
| 第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.3 | 100,000 | 142,066 | 2040/2/29 |
| 第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 50,000 | 52,494 | 2020/3/19 |
| 第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.1 | 100,000 | 126,997 | 2030/4/30 |
| 第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.3 | 200,000 | 210,680 | 2020/6/30 |
| 第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.0 | 100,000 | 104,342 | 2020/9/30 |
| 第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.9 | 112,000 | 116,538 | 2020/11/30 |
| 第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.2 | 71,000 | 74,912 | 2020/12/28 |
| 第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 2.0 | 100,000 | 126,565 | 2031/1/31 |
| 第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.1 | 91,000 | 96,051 | 2021/5/31 |
| 第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.1 | 60,000 | 63,432 | 2021/7/30 |
| 第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.0 | 122,000 | 128,503 | 2021/8/31 |
| 第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.0 | 100,000 | 105,464 | 2021/10/29 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.8 | 200,000 | 249,240 | 2031/10/31 |
| 第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.0 | 136,000 | 143,553 | 2021/11/30 |
| 第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.9 | 112,000 | 117,816 | 2022/2/28 |
| 第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.9 | 370,000 | 389,425 | 2022/3/18 |
| 第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.977 | 100,000 | 105,770 | 2022/4/28 |
| 第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.737 | 100,000 | 124,167 | 2032/4/30 |
| 第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.83 | 200,000 | 268,736 | 2042/5/30 |
| 第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.895 | 12,000 | 12,658 | 2022/6/30 |
| 第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.839 | 300,000 | 315,585 | 2022/7/29 |
| 第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.791 | 350,000 | 367,808 | 2022/10/31 |
| 第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.805 | 100,000 | 105,275 | 2022/11/30 |
| 第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.734 | 222,000 | 232,802 | 2022/12/28 |
| 第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.834 | 200,000 | 211,194 | 2023/1/31 |
| 第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.668 | 100,000 | 104,576 | 2023/3/17 |
| 第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.4 | 100,000 | 119,209 | 2033/4/28 |
| 第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.541 | 153,000 | 158,765 | 2023/4/28 |
| 第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.605 | 474,000 | 494,026 | 2023/5/31 |
| 第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.882 | 100,000 | 106,292 | 2023/6/30 |
| 第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.911 | 121,000 | 128,913 | 2023/7/31 |
| 第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.835 | 398,000 | 422,126 | 2023/8/31 |
| 第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.669 | 228,000 | 239,431 | 2023/11/30 |
| 第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.693 | 188,000 | 197,864 | 2023/12/28 |
| 第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.645 | 322,000 | 338,093 | 2024/3/29 |
| 第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.644 | 100,000 | 105,148 | 2024/6/28 |
| 第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.601 | 100,000 | 104,852 | 2024/7/31 |
| 第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.39 | 100,000 | 119,327 | 2034/8/31 |
| 第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.539 | 100,000 | 104,477 | 2024/10/31 |
| 第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.466 | 241,000 | 250,478 | 2024/12/27 |
| 第344回政府保証道路債券 | | 1.6 | 100,000 | 106,646 | 2020/7/15 |
| 第4回政府保証首都高速道路債券 | | 1.7 | 179,000 | 183,226 | 2017/9/25 |
| 第7回政府保証東日本高速道路債券 | | 1.9 | 34,000 | 34,838 | 2017/8/24 |
| 第13回政府保証東日本高速道路債券 | | 1.6 | 28,000 | 29,085 | 2018/10/19 |
| 第17回政府保証中日本高速道路債券 | | 1.7 | 100,000 | 102,315 | 2017/9/15 |
| 第20回政府保証中日本高速道路債券 | | 1.4 | 10,000 | 10,257 | 2018/3/16 |
| 第23回政府保証中日本高速道路債券 | | 1.5 | 90,000 | 93,139 | 2018/9/14 |
| 第1回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.5 | 280,000 | 292,913 | 2019/6/14 |
| 第2回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.4 | 25,000 | 26,104 | 2019/7/12 |
| 第3回政府保証地方公共団体金融機構債券 | | 1.5 | 200,000 | 209,750 | 2019/8/16 |
| 第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | | 0.4 | 200,000 | 201,394 | 2018/1/30 |
| 第4回政府保証公営企業債券(15年) | | 2.0 | 100,000 | 111,858 | 2022/4/22 |
| 第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | | 1.3 | 200,000 | 206,932 | 2019/1/22 |
| 第5回政府保証公営企業債券(15年) | | 2.2 | 100,000 | 113,551 | 2022/7/15 |
| 第7回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | | 0.25 | 300,000 | 301,743 | 2018/10/29 |
| 第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | | 1.4 | 100,000 | 104,062 | 2019/4/15 |
| 第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | | 1.5 | 148,000 | 154,689 | 2019/5/24 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第9回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 0.32 | 100,000 | 100,906 | 2019/4/25 |
| 第10回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 100,000 | 104,965 | 2020/3/13 |
| 第12回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 200,000 | 210,410 | 2020/5/22 |
| 第16回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.0 | 100,000 | 104,298 | 2020/9/14 |
| 第18回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.9 | 101,000 | 105,069 | 2020/11/17 |
| 第22回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.3 | 15,000 | 15,939 | 2021/3/12 |
| 第25回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.2 | 100,000 | 106,125 | 2021/6/14 |
| 第29回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.0 | 21,000 | 22,141 | 2021/10/18 |
| 第31回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 1.1 | 50,000 | 53,075 | 2021/12/14 |
| 第37回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.895 | 100,000 | 105,511 | 2022/6/17 |
| 第39回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.801 | 100,000 | 105,012 | 2022/8/15 |
| 第45回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.815 | 354,000 | 373,516 | 2023/2/17 |
| 第46回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.668 | 17,000 | 17,777 | 2023/3/17 |
| 第47回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.541 | 345,000 | 357,965 | 2023/4/21 |
| 第48回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.605 | 36,000 | 37,526 | 2023/5/16 |
| 第50回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.911 | 168,000 | 178,914 | 2023/7/14 |
| 第51回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.835 | 150,000 | 159,033 | 2023/8/14 |
| 第55回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.693 | 160,000 | 168,364 | 2023/12/18 |
| 第58回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.645 | 200,000 | 210,030 | 2024/3/15 |
| 第62回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.601 | 100,000 | 104,828 | 2024/7/16 |
| 第63回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.556 | 200,000 | 209,014 | 2024/8/16 |
| 第879回政府保証公営企業債券 | 1.7 | 102,000 | 104,380 | 2017/9/19 |
| 第883回政府保証公営企業債券 | 1.4 | 100,000 | 102,589 | 2018/3/19 |
| 第884回政府保証公営企業債券 | 1.4 | 114,000 | 117,073 | 2018/4/17 |
| 第2回政府保証公営企業債券(15年) | 2.1 | 100,000 | 110,341 | 2021/4/16 |
| 第5回政府保証日本政策金融公庫債券 | 1.3 | 123,000 | 128,334 | 2019/9/17 |
| 第23回政府保証日本政策金融公庫債券 | 0.734 | 134,000 | 140,488 | 2022/12/16 |
| 第25回政府保証日本政策金融公庫債券 | 0.815 | 100,000 | 105,526 | 2023/2/24 |
| 第26回政府保証日本政策金融公庫債券 | 0.911 | 484,000 | 515,503 | 2023/7/19 |
| 第191回政府保証中小企業債券 | 1.7 | 211,000 | 215,884 | 2017/9/15 |
| 第16回政府保証民間都市開発債券 | 0.699 | 197,000 | 207,173 | 2023/10/20 |
| 第21回政府保証国民生活債券 | 1.5 | 2,000 | 2,048 | 2017/12/18 |
| 第2回政府保証新関西国際空港債券 | 0.882 | 202,000 | 214,833 | 2023/6/27 |
| 第5回政府保証日本政策投資銀行 | 1.4 | 50,000 | 52,031 | 2019/4/15 |
| 第7回政府保証日本政策投資銀行 | 1.4 | 100,000 | 105,252 | 2020/2/17 |
| 第11回政府保証日本政策投資銀行 | 1.0 | 179,000 | 188,556 | 2021/9/14 |
| 第17回政府保証日本政策投資銀行 | 0.257 | 200,000 | 201,222 | 2018/11/9 |
| 第22回政府保証日本政策投資銀行 | 0.693 | 20,000 | 21,045 | 2023/12/18 |
| 第27回政府保証日本政策投資銀行 | 0.11 | 200,000 | 200,988 | 2021/2/12 |
| 第53回政府保証関西国際空港債券 | 1.5 | 151,000 | 154,871 | 2018/1/24 |
| 第11回政府保証西日本高速道路債券 | 1.7 | 31,000 | 31,821 | 2017/11/28 |
| 第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債) | 1.69 | 50,000 | 51,558 | 2018/3/20 |
| 第7回道路債券(財投機関債) | 2.7 | 100,000 | 116,309 | 2022/6/20 |
| 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | 2.45 | 20,000 | 24,525 | 2026/3/19 |
| 第9回道路債券(財投機関債) | 2.9 | 100,000 | 140,278 | 2032/5/20 |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 第13回道路債券(財投機関債) | | 2.28 | 200,000 | 228,644 | 2022/9/20 |
| 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.87 | 30,000 | 47,873 | 2046/12/20 |
| 第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.75 | 100,000 | 156,430 | 2047/3/20 |
| 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.67 | 130,000 | 200,379 | 2047/3/20 |
| 第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.39 | 60,000 | 74,791 | 2027/7/20 |
| 第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.82 | 200,000 | 204,994 | 2017/9/20 |
| 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.34 | 100,000 | 124,568 | 2027/10/20 |
| 第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.61 | 100,000 | 102,956 | 2018/3/20 |
| 第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.42 | 300,000 | 379,848 | 2028/6/20 |
| 第42回道路債券(財投機関債) | | 2.22 | 130,000 | 154,186 | 2025/3/21 |
| 第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.63 | 100,000 | 104,169 | 2018/12/20 |
| 第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.41 | 150,000 | 191,812 | 2029/4/20 |
| 第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 2.14 | 50,000 | 62,980 | 2030/5/10 |
| 第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.17 | 100,000 | 105,862 | 2021/6/18 |
| 第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.14 | 100,000 | 105,709 | 2021/6/18 |
| 第78回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.08 | 100,000 | 105,907 | 2021/12/20 |
| 第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.9 | 50,000 | 62,296 | 2032/3/19 |
| 第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.711 | 100,000 | 121,765 | 2032/6/18 |
| 第92回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 0.834 | 110,000 | 115,425 | 2022/6/20 |
| 第96回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 0.796 | 300,000 | 314,700 | 2022/9/20 |
| 第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 0.784 | 100,000 | 104,972 | 2022/12/20 |
| 第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 0.781 | 100,000 | 104,952 | 2022/12/20 |
| 第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 0.94 | 300,000 | 319,131 | 2023/6/20 |
| 第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 0.85 | 200,000 | 211,478 | 2023/6/20 |
| 第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 0.77 | 100,000 | 105,416 | 2023/12/20 |
| 第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) | | 1.974 | 100,000 | 140,439 | 2055/3/19 |
| 第1回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.648 | 100,000 | 105,090 | 2019/6/28 |
| 第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | | 2.266 | 50,000 | 63,094 | 2029/6/28 |
| 第2回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.406 | 80,000 | 83,538 | 2019/7/26 |
| 第3回公営企業債券(20年)(財投機関債) | | 1.03 | 20,000 | 21,363 | 2023/3/22 |
| 第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債) | | 1.176 | 100,000 | 111,897 | 2029/1/26 |
| 第6回公営企業債券(20年)(財投機関債) | | 2.03 | 100,000 | 114,961 | 2023/12/20 |
| 第9回公営企業債券(20年)(財投機関債) | | 2.33 | 50,000 | 59,351 | 2024/9/24 |
| 第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | | 2.092 | 100,000 | 125,913 | 2030/12/27 |
| 第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | | 2.187 | 80,000 | 102,351 | 2031/4/28 |
| 第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.164 | 100,000 | 104,938 | 2020/9/28 |
| 第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | | 1.846 | 80,000 | 98,595 | 2031/8/28 |
| 第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | | 1.87 | 100,000 | 123,616 | 2031/9/26 |
| 第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.274 | 50,000 | 52,852 | 2020/12/28 |
| 第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.28 | 100,000 | 105,846 | 2021/1/28 |
| 第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | | 1.687 | 200,000 | 243,238 | 2032/6/28 |
| F23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.075 | 100,000 | 102,159 | 2018/5/29 |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.418 | 100,000 | 106,877 | 2021/4/28 |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | | 1.68 | 300,000 | 364,578 | 2032/7/28 |
| F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | | 1.681 | 70,000 | 77,872 | 2023/3/17 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.034 | 100,000 | 105,334 | 2021/8/27 |
| 第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債) | 1.785 | 50,000 | 61,772 | 2033/1/28 |
| 第28回公営企業債券(財投機関債) | 1.89 | 100,000 | 102,734 | 2017/10/25 |
| 第35回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.006 | 200,000 | 211,680 | 2022/4/28 |
| 第42回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.801 | 100,000 | 105,039 | 2022/11/28 |
| 第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.791 | 200,000 | 210,198 | 2023/1/27 |
| 第46回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.678 | 100,000 | 104,417 | 2023/3/28 |
| 第49回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.887 | 200,000 | 212,040 | 2023/6/28 |
| 第50回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.922 | 300,000 | 319,026 | 2023/7/28 |
| F 89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.602 | 300,000 | 348,126 | 2027/8/20 |
| F 110回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 0.562 | 100,000 | 101,590 | 2019/4/25 |
| F 123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.6 | 100,000 | 118,194 | 2030/3/19 |
| F 131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.546 | 100,000 | 118,743 | 2031/7/30 |
| F 147回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.291 | 150,000 | 168,373 | 2027/3/19 |
| F 226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.096 | 100,000 | 110,914 | 2029/2/28 |
| 第10回首都高速道路 | 0.336 | 400,000 | 401,884 | 2017/9/20 |
| 第13回首都高速道路(財投機関債) | 0.223 | 100,000 | 100,681 | 2019/9/20 |
| 第7回阪神高速道路債券(財投機関債) | 2.18 | 100,000 | 118,254 | 2025/3/21 |
| 第14回阪神高速道路 | 0.1 | 300,000 | 300,375 | 2019/12/20 |
| 第10回日本政策金融公庫(財投機関債) | 2.167 | 80,000 | 100,969 | 2030/3/19 |
| 第15回日本政策金融公庫(財投機関債) | 1.911 | 80,000 | 98,762 | 2030/10/29 |
| 第21回都市再生債券(財投機関債) | 1.72 | 100,000 | 103,996 | 2018/9/20 |
| 第68回都市再生債券(財投機関債) | 0.854 | 100,000 | 105,269 | 2022/9/20 |
| 第100回都市再生債券(財投機関債) | 0.569 | 100,000 | 104,184 | 2024/11/20 |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 26,476 | 28,389 | 2042/5/10 |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.08 | 22,792 | 24,547 | 2037/11/10 |
| 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.19 | 28,211 | 30,404 | 2042/6/10 |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.27 | 23,341 | 25,355 | 2037/11/10 |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.29 | 27,832 | 30,105 | 2042/8/10 |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 1.76 | 19,935 | 21,068 | 2036/11/10 |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.26 | 20,909 | 22,542 | 2037/5/10 |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.13 | 27,579 | 29,673 | 2042/10/10 |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.94 | 24,467 | 26,167 | 2038/11/10 |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.25 | 20,973 | 22,595 | 2037/5/10 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.67 | 15,357 | 15,883 | 2037/10/10 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.99 | 28,382 | 30,398 | 2042/12/10 |
| 第8回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.73 | 70,000 | 71,650 | 2017/9/20 |
| 第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.52 | 14,945 | 15,377 | 2037/12/10 |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.19 | 21,625 | 23,302 | 2037/5/10 |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 2.24 | 26,057 | 28,002 | 2039/5/10 |
| 第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.43 | 31,898 | 32,856 | 2038/2/10 |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 2.15 | 22,330 | 24,061 | 2037/5/10 |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.16 | 31,322 | 33,746 | 2043/5/10 |
| 第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 1.7 | 17,578 | 18,292 | 2039/1/10 |
| 第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 1.7 | 31,268 | 32,657 | 2032/5/10 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | | 1.64 | 33,743 | 35,326 | 2032/11/10 |
| 第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | | 1.71 | 34,640 | 36,368 | 2032/11/10 |
| 第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | | 1.57 | 103,716 | 108,350 | 2032/11/10 |
| 第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 1.8 | 19,211 | 20,124 | 2039/6/10 |
| 第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 2.12 | 20,163 | 21,359 | 2039/7/10 |
| 第21回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.92 | 100,000 | 104,468 | 2018/9/20 |
| 第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 1.67 | 24,293 | 25,519 | 2040/5/10 |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 1.7 | 53,618 | 56,605 | 2040/6/10 |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 1.69 | 29,093 | 30,730 | 2040/7/10 |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.88 | 49,627 | 53,407 | 2045/2/10 |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.87 | 54,543 | 58,581 | 2045/4/10 |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.81 | 56,528 | 60,561 | 2045/5/10 |
| 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 1.88 | 27,506 | 29,274 | 2040/12/10 |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.61 | 59,344 | 63,107 | 2045/7/10 |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 1.84 | 26,062 | 27,656 | 2041/2/10 |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.36 | 65,596 | 69,098 | 2045/9/10 |
| 第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 2.09 | 28,071 | 30,162 | 2041/4/10 |
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 2.34 | 26,132 | 28,331 | 2041/5/10 |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.6 | 71,444 | 76,374 | 2045/12/10 |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.77 | 71,660 | 77,275 | 2046/1/10 |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.79 | 66,485 | 71,562 | 2046/2/10 |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.92 | 63,447 | 68,618 | 2046/4/10 |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.89 | 192,858 | 208,768 | 2046/5/10 |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.76 | 64,274 | 69,136 | 2046/6/10 |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.67 | 64,107 | 68,668 | 2046/7/10 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | | 2.21 | 25,898 | 28,036 | 2042/2/10 |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.64 | 68,941 | 73,882 | 2046/8/10 |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.51 | 71,981 | 76,754 | 2046/9/10 |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.48 | 73,005 | 77,763 | 2046/10/10 |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.42 | 76,026 | 80,855 | 2047/1/10 |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.44 | 229,284 | 244,065 | 2047/2/10 |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.44 | 76,918 | 81,909 | 2047/4/10 |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.34 | 77,502 | 82,101 | 2047/5/10 |
| 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 78,949 | 83,290 | 2047/7/10 |
| 第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 2.13 | 50,000 | 63,146 | 2030/12/13 |
| 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.11 | 79,408 | 83,325 | 2047/8/10 |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.12 | 81,224 | 85,318 | 2047/11/10 |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.25 | 81,265 | 85,946 | 2048/3/10 |
| 第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.32 | 84,702 | 90,108 | 2048/7/10 |
| 第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 2.066 | 80,000 | 101,050 | 2031/6/13 |
| 第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 240,858 | 254,290 | 2048/9/10 |
| 第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | | 1.751 | 30,000 | 34,833 | 2026/6/19 |
| 第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.08 | 83,286 | 87,347 | 2048/11/10 |
| 第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.07 | 172,376 | 180,820 | 2049/1/10 |
| 第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | 1.07 | 85,891 | 90,232 | 2049/2/10 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|-------|------------|------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.04 | 87,869 | 92,178 | 2049/4/10 |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.01 | 176,722 | 185,105 | 2049/5/10 |
| 第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.02 | 179,296 | 187,957 | 2049/6/10 |
| 第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.863 | 100,000 | 123,667 | 2031/11/18 |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.95 | 92,290 | 96,385 | 2049/10/10 |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.87 | 277,212 | 288,250 | 2049/11/10 |
| 第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.84 | 187,136 | 194,220 | 2049/12/10 |
| 第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.74 | 93,706 | 96,615 | 2050/1/10 |
| 第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.6 | 188,382 | 192,366 | 2050/2/10 |
| 第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.9 | 289,818 | 302,445 | 2050/7/10 |
| 第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.88 | 193,764 | 201,933 | 2050/8/10 |
| 第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.892 | 100,000 | 124,488 | 2032/4/16 |
| 第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.441 | 200,000 | 226,976 | 2027/3/19 |
| 第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.86 | 490,020 | 510,850 | 2050/12/10 |
| 第105回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.472 | 100,000 | 114,067 | 2027/6/18 |
| 第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 2.227 | 130,000 | 179,354 | 2042/9/19 |
| 第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.801 | 100,000 | 123,405 | 2032/9/17 |
| 第144回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 0.748 | 300,000 | 315,747 | 2023/12/20 |
| 第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債) | 2.04 | 50,000 | 58,697 | 2025/6/20 |
| 第7回国際協力機構債券(財投機関債) | 1.991 | 70,000 | 88,039 | 2031/6/13 |
| 第11回国際協力機構債券(財投機関債) | 1.14 | 30,000 | 31,855 | 2021/12/20 |
| 第18回東日本高速道路 | 0.387 | 100,000 | 100,546 | 2017/9/20 |
| 第21回東日本高速道路 | 0.58 | 100,000 | 101,180 | 2018/6/20 |
| 第22回東日本高速道路 | 0.401 | 100,000 | 100,803 | 2018/6/20 |
| 第28回東日本高速道路 | 0.248 | 100,000 | 100,767 | 2019/12/20 |
| 第3回中日本高速道路 | 1.92 | 300,000 | 307,779 | 2017/9/20 |
| 第21回中日本高速道路 | 0.592 | 100,000 | 100,818 | 2017/9/20 |
| 第33回中日本高速道路 | 1.084 | 50,000 | 52,829 | 2021/9/17 |
| 第42回中日本高速道路 | 0.942 | 100,000 | 105,358 | 2022/3/18 |
| 第43回中日本高速道路 | 0.362 | 100,000 | 100,521 | 2017/9/20 |
| 第45回中日本高速道路 | 0.904 | 300,000 | 316,758 | 2022/9/20 |
| 第46回中日本高速道路 | 0.351 | 200,000 | 200,950 | 2017/9/20 |
| 第59回中日本高速道路 | 0.309 | 100,000 | 101,590 | 2021/12/20 |
| 第18回西日本高速道路 | 0.893 | 100,000 | 105,873 | 2023/3/20 |
| 第20回西日本高速道路 | 0.759 | 100,000 | 105,239 | 2023/9/20 |
| 第21回西日本高速道路 | 0.754 | 400,000 | 421,180 | 2023/12/20 |
| 第132回福岡北九州高速道路債券 | 0.704 | 100,000 | 104,909 | 2024/3/19 |
| 第21回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) | 1.86 | 200,000 | 208,652 | 2018/9/20 |
| 第43回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) | 1.026 | 100,000 | 105,348 | 2021/9/17 |
| 第64回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) | 0.193 | 100,000 | 100,365 | 2018/6/20 |
| 第5回東京都住宅供給公社債券 | 2.02 | 100,000 | 102,579 | 2017/9/20 |
| 小 計 | | 36,130,167 | 39,037,654 | |
| 金融債券 | | | | |
| い第745号商工債券 | 0.35 | 100,000 | 100,388 | 2017/6/27 |
| い第773号商工債券 | 0.2 | 100,000 | 100,562 | 2019/10/25 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 金融債券 | % | 千円 | 千円 | |
| い第775号商工債券 | 0.2 | 400,000 | 402,248 | 2019/12/27 |
| い第776号商工債券 | 0.17 | 100,000 | 100,471 | 2020/1/27 |
| い第752号農林債券 | 0.3 | 150,000 | 150,742 | 2018/1/26 |
| い第760号農林債券 | 0.4 | 400,000 | 403,372 | 2018/9/27 |
| い第761号農林債券 | 0.3 | 250,000 | 251,562 | 2018/10/26 |
| い第763号農林債券 | 0.3 | 340,000 | 342,227 | 2018/12/27 |
| い第765号農林債券 | 0.3 | 100,000 | 100,698 | 2019/2/27 |
| い第769号農林債券 | 0.3 | 100,000 | 100,811 | 2019/6/27 |
| い第774号農林債券 | 0.24 | 100,000 | 100,659 | 2019/11/27 |
| い第780号農林債券 | 0.28 | 300,000 | 302,796 | 2020/5/27 |
| 第271回信金中金債 | 0.35 | 100,000 | 100,388 | 2017/6/27 |
| 第279回信金中金債 | 0.25 | 300,000 | 301,293 | 2018/2/27 |
| 第286回信金中金債 | 0.35 | 100,000 | 100,748 | 2018/9/27 |
| 第288回信金中金債 | 0.3 | 200,000 | 201,346 | 2018/11/27 |
| 第291回信金中金債 | 0.25 | 100,000 | 100,586 | 2019/2/27 |
| 第293回信金中金債 | 0.25 | 100,000 | 100,640 | 2019/4/26 |
| 第304回信金中金債 | 0.225 | 200,000 | 201,466 | 2020/3/27 |
| 第8号商工債券（10年） | 1.66 | 100,000 | 104,221 | 2018/12/20 |
| 第11号商工債券（10年） | 0.66 | 100,000 | 104,338 | 2024/9/20 |
| 第179号商工債券（3年） | 0.14 | 300,000 | 300,657 | 2017/12/27 |
| 第184号商工債券（3年） | 0.15 | 300,000 | 300,762 | 2018/5/25 |
| 小 計 | | 4,340,000 | 4,372,982 | |
| 普通社債券 | | | | |
| 第459回東京電力 | 2.7 | 80,000 | 84,946 | 2019/1/29 |
| 第532回東京電力 | 1.75 | 120,000 | 122,343 | 2017/9/28 |
| 第534回東京電力 | 2.055 | 100,000 | 105,307 | 2019/10/29 |
| 第536回東京電力 | 1.672 | 100,000 | 102,283 | 2018/1/29 |
| 第544回東京電力 | 1.976 | 100,000 | 103,434 | 2018/6/25 |
| 第549回東京電力 | 1.699 | 150,000 | 154,881 | 2018/10/17 |
| 第559回東京電力 | 1.377 | 60,000 | 61,788 | 2019/10/29 |
| 第563回東京電力 | 1.39 | 100,000 | 103,512 | 2020/5/28 |
| 第567回東京電力 | 1.958 | 100,000 | 108,825 | 2030/7/29 |
| 第568回東京電力 | 1.155 | 100,000 | 102,730 | 2020/9/8 |
| 第490回中部電力 | 1.444 | 70,000 | 73,003 | 2019/7/25 |
| 第499回中部電力 | 1.194 | 50,000 | 53,392 | 2023/6/23 |
| 第500回中部電力 | 0.875 | 100,000 | 104,921 | 2024/5/24 |
| 第448回関西電力 | 2.16 | 100,000 | 104,233 | 2018/6/20 |
| 第456回関西電力 | 2.01 | 100,000 | 102,331 | 2017/7/25 |
| 第472回関西電力 | 1.79 | 100,000 | 104,096 | 2018/11/22 |
| 第473回関西電力 | 1.665 | 100,000 | 104,322 | 2019/4/25 |
| 第478回関西電力 | 1.448 | 200,000 | 209,038 | 2020/1/24 |
| 第485回関西電力 | 1.285 | 100,000 | 104,733 | 2020/12/18 |
| 第374回中国電力 | 0.814 | 100,000 | 102,595 | 2020/2/25 |
| 第379回中国電力 | 0.619 | 100,000 | 102,153 | 2021/1/25 |
| 第382回中国電力 | 0.517 | 100,000 | 101,759 | 2021/5/25 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第288回北陸電力 | 1.89 | 100,000 | 102,720 | 2017/10/25 |
| 第303回北陸電力 | 0.756 | 100,000 | 102,040 | 2019/6/25 |
| 第448回東北電力 | 1.608 | 100,000 | 104,523 | 2019/5/24 |
| 第456回東北電力 | 1.176 | 100,000 | 104,320 | 2020/11/25 |
| 第473回東北電力 | 0.597 | 100,000 | 101,846 | 2021/4/23 |
| 第245回四国電力 | 2.0 | 100,000 | 109,374 | 2021/6/25 |
| 第400回九州電力 | 1.777 | 100,000 | 106,090 | 2020/4/24 |
| 第408回九州電力 | 1.672 | 100,000 | 104,662 | 2019/6/25 |
| 第422回九州電力 | 1.164 | 100,000 | 103,770 | 2020/6/25 |
| 第423回九州電力 | 0.959 | 100,000 | 102,644 | 2019/9/25 |
| 第429回九州電力 | 0.909 | 100,000 | 104,039 | 2024/9/25 |
| 第430回九州電力 | 0.54 | 100,000 | 101,369 | 2021/10/25 |
| 第261回北海道電力 | 2.775 | 24,000 | 24,981 | 2017/11/24 |
| 第310回北海道電力 | 1.286 | 50,000 | 52,379 | 2020/12/25 |
| 第315回北海道電力 | 0.82 | 100,000 | 101,334 | 2018/4/25 |
| 第316回北海道電力 | 1.164 | 100,000 | 103,854 | 2020/6/25 |
| 第319回北海道電力 | 0.514 | 200,000 | 202,100 | 2019/9/25 |
| 第19回沖縄電力 | 1.452 | 80,000 | 84,532 | 2020/4/24 |
| 第344回東京交通債券 | 1.67 | 100,000 | 110,709 | 2023/2/17 |
| 第347回東京交通債券 | 2.05 | 100,000 | 115,310 | 2024/3/8 |
| 第25回関西国際空港 | 1.361 | 400,000 | 421,824 | 2020/6/19 |
| 第38回関西国際空港 | 1.112 | 50,000 | 53,043 | 2021/12/20 |
| 第10回成田国際空港 | 1.094 | 160,000 | 169,137 | 2021/9/17 |
| 第11回成田国際空港 | 1.067 | 100,000 | 106,007 | 2022/2/18 |
| 第12回成田国際空港 | 0.879 | 100,000 | 105,427 | 2022/9/20 |
| 第13回成田国際空港 | 0.802 | 100,000 | 105,164 | 2023/2/8 |
| 第17回成田国際空港 | 0.489 | 100,000 | 103,325 | 2025/2/20 |
| 第3回セブン&アイ・ホールディングス | 1.94 | 100,000 | 104,029 | 2018/6/20 |
| 第8回セブン&アイ・ホールディングス | 0.383 | 100,000 | 100,973 | 2019/6/20 |
| 第11回セブン&アイ・ホールディングス | 0.514 | 300,000 | 307,149 | 2022/6/20 |
| 第3回富士フイルムホールディングス | 0.882 | 100,000 | 105,160 | 2022/12/2 |
| 第19回豊田自動織機 | 1.109 | 100,000 | 105,453 | 2021/9/17 |
| 第10回小松製作所 | 0.275 | 100,000 | 100,541 | 2019/6/20 |
| 第1回日本電産 | 0.386 | 100,000 | 100,474 | 2017/9/20 |
| 第12回パナソニック | 0.387 | 300,000 | 303,033 | 2020/3/19 |
| 第1回B号日本生命2011基金 | 1.12 | 400,000 | 404,592 | 2017/8/5 |
| 第1回日本生命2012基金 | 0.87 | 100,000 | 101,584 | 2018/8/3 |
| 第1回明治安田生命2014基金 | 0.51 | 100,000 | 101,082 | 2019/8/7 |
| 第1回日本生命2015基金 | 0.406 | 100,000 | 100,811 | 2019/8/5 |
| 第53回日産自動車 | 1.744 | 100,000 | 106,558 | 2020/4/28 |
| 第5回凸版印刷 | 1.397 | 100,000 | 105,935 | 2020/12/16 |
| 第3回大日本印刷 | 1.358 | 100,000 | 105,897 | 2020/12/18 |
| 第78回三菱商事 | 1.155 | 100,000 | 105,825 | 2022/3/9 |
| 第7回みずほコーポレート銀行（同順位特約付） | 2.08 | 100,000 | 102,493 | 2017/7/27 |
| 第7回みずほコーポレート銀行（劣後特約付） | 2.5 | 300,000 | 321,141 | 2019/6/3 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付） | 1.62 | 100,000 | 107,406 | 2021/10/29 |
| 第9回みずほコーポレート銀行（劣後特約付） | 2.2 | 100,000 | 117,435 | 2026/10/30 |
| 第10回みずほコーポレート銀行 | 1.945 | 400,000 | 411,264 | 2017/10/27 |
| 第30回みずほコーポレート銀行 | 0.34 | 100,000 | 100,383 | 2017/7/25 |
| 第31回みずほコーポレート銀行 | 0.33 | 200,000 | 200,910 | 2017/10/25 |
| 第32回みずほコーポレート銀行 | 0.27 | 800,000 | 803,312 | 2018/1/24 |
| 第33回みずほコーポレート銀行 | 0.41 | 600,000 | 604,272 | 2018/4/20 |
| 第7回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付） | 2.11 | 400,000 | 428,364 | 2019/12/20 |
| 第9回三菱東京UFJ銀行 | 2.69 | 100,000 | 110,062 | 2020/2/27 |
| 第12回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付） | 2.16 | 100,000 | 102,523 | 2017/7/28 |
| 第28回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付） | 1.56 | 100,000 | 106,455 | 2021/1/20 |
| 第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付） | 2.46 | 100,000 | 127,012 | 2031/1/20 |
| 第93回三菱東京UFJ銀行 | 1.985 | 200,000 | 205,632 | 2017/10/17 |
| 第124回三菱東京UFJ銀行 | 1.51 | 100,000 | 107,020 | 2021/4/16 |
| 第6回りそな銀行（劣後特約付） | 2.084 | 400,000 | 428,204 | 2020/3/4 |
| 第1回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位） | 0.345 | 100,000 | 100,352 | 2017/6/7 |
| 第2回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位） | 0.26 | 100,000 | 100,391 | 2017/12/20 |
| 第5回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位） | 0.285 | 200,000 | 201,270 | 2018/11/28 |
| 第6回住友信託銀行（劣後特約付） | 2.78 | 100,000 | 122,963 | 2026/4/27 |
| 第13回住友信託銀行（劣後特約付） | 2.341 | 100,000 | 118,768 | 2026/6/15 |
| 第6回セブン銀行 | 0.398 | 100,000 | 100,439 | 2017/6/20 |
| 第22回三井住友銀行（劣後特約付） | 1.43 | 100,000 | 105,443 | 2020/9/28 |
| 第23回三井住友銀行（劣後特約付） | 1.61 | 100,000 | 106,536 | 2020/12/17 |
| 第25回三井住友銀行（劣後特約付） | 2.21 | 200,000 | 236,008 | 2026/6/1 |
| 第57回三井住友銀行 | 0.28 | 200,000 | 200,790 | 2017/10/20 |
| 第5回みずほ銀行（劣後特約付） | 2.49 | 100,000 | 119,382 | 2026/1/30 |
| 第9回みずほ銀行（劣後特約付） | 2.52 | 100,000 | 121,555 | 2027/4/27 |
| 第18回みずほ銀行（劣後特約付） | 2.14 | 100,000 | 116,686 | 2026/9/11 |
| 第8回芙蓉総合リース | 0.318 | 100,000 | 100,702 | 2019/7/30 |
| 第11回芙蓉総合リース | 0.21 | 100,000 | 99,990 | 2021/5/7 |
| 第4回興銀リース | 0.36 | 100,000 | 100,788 | 2019/5/23 |
| 第5回興銀リース | 0.272 | 100,000 | 100,581 | 2019/12/5 |
| 第28回日産フィナンシャルサービス | 0.253 | 100,000 | 100,446 | 2019/6/20 |
| 第10回東京センチュリーリース | 0.298 | 100,000 | 100,666 | 2019/11/21 |
| 第15回東京センチュリーリース | 0.11 | 100,000 | 100,031 | 2019/4/12 |
| 第29回ホンダファイナンス | 0.428 | 100,000 | 101,280 | 2021/3/19 |
| 第62回トヨタファイナンス | 0.203 | 100,000 | 100,496 | 2019/12/20 |
| 第69回トヨタファイナンス | 0.02 | 200,000 | 199,982 | 2019/4/26 |
| 第47回日立キャピタル | 0.874 | 100,000 | 104,591 | 2023/3/20 |
| 第52回日立キャピタル | 0.508 | 200,000 | 203,656 | 2021/6/18 |
| 第56回日立キャピタル | 0.197 | 100,000 | 100,390 | 2019/12/20 |
| 第9回三井住友ファイナンス&リース | 0.518 | 200,000 | 203,426 | 2021/1/29 |
| 第14回三井住友ファイナンス&リース | 0.321 | 200,000 | 201,674 | 2020/10/30 |
| 第36回三菱UFJリース | 0.355 | 100,000 | 100,979 | 2022/1/21 |
| 第37回三菱UFJリース | 0.07 | 100,000 | 99,959 | 2019/2/21 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第38回三菱UFJリース | 0.16 | 200,000 | 200,128 | 2021/4/21 |
| 第27回野村ホールディングス | 2.107 | 100,000 | 115,205 | 2025/9/24 |
| 第39回野村ホールディングス | 0.853 | 100,000 | 101,372 | 2018/2/26 |
| 第43回野村ホールディングス | 0.454 | 300,000 | 302,874 | 2019/2/25 |
| 第48回野村ホールディングス | 0.245 | 100,000 | 100,317 | 2018/6/8 |
| 第49回野村ホールディングス | 0.437 | 100,000 | 101,192 | 2020/6/10 |
| 第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回 | 1.98 | 100,000 | 103,754 | 2018/6/20 |
| 第98回三菱地所 | 1.165 | 100,000 | 104,297 | 2020/6/19 |
| 第105回三菱地所 | 1.178 | 100,000 | 105,998 | 2022/3/23 |
| 第112回三菱地所 | 0.577 | 200,000 | 204,178 | 2020/12/25 |
| 第116回三菱地所 | 0.643 | 100,000 | 103,301 | 2024/9/19 |
| 第11回エヌ・ティ・ティ都市開発 | 1.12 | 100,000 | 105,306 | 2021/9/17 |
| 第17回エヌ・ティ・ティ都市開発 | 0.61 | 100,000 | 102,948 | 2024/9/20 |
| 第15回東日本旅客鉄道 | 2.65 | 100,000 | 111,052 | 2020/8/25 |
| 第26回東日本旅客鉄道 | 1.19 | 100,000 | 107,436 | 2022/12/20 |
| 第29回東日本旅客鉄道 | 2.01 | 200,000 | 228,408 | 2023/9/20 |
| 第60回東日本旅客鉄道 | 1.449 | 100,000 | 104,469 | 2019/7/24 |
| 第62回東日本旅客鉄道 | 1.424 | 100,000 | 104,632 | 2019/9/27 |
| 第79回東日本旅客鉄道 | 1.131 | 100,000 | 105,774 | 2021/9/29 |
| 第83回東日本旅客鉄道 | 1.633 | 100,000 | 115,017 | 2026/12/22 |
| 第100回東日本旅客鉄道 | 1.981 | 100,000 | 133,127 | 2044/1/29 |
| 第9回西日本旅客鉄道 | 2.28 | 123,000 | 139,051 | 2022/3/25 |
| 第53回東海旅客鉄道 | 1.797 | 100,000 | 121,166 | 2030/10/25 |
| 第56回東海旅客鉄道 | 2.083 | 100,000 | 125,840 | 2031/5/26 |
| 第74回東海旅客鉄道 | 1.685 | 100,000 | 126,488 | 2045/3/6 |
| 第11回東京地下鉄 | 1.16 | 100,000 | 106,203 | 2021/12/9 |
| 第5回日本通運 | 1.818 | 100,000 | 105,391 | 2019/5/31 |
| 第5回関西高速鉄道 | 1.238 | 100,000 | 105,008 | 2020/9/10 |
| 第59回日本電信電話 | 1.69 | 100,000 | 105,119 | 2019/6/20 |
| 第63回日本電信電話 | 0.69 | 100,000 | 104,271 | 2023/3/20 |
| 第19回KDDI | 1.151 | 100,000 | 104,368 | 2020/6/19 |
| 第21回KDDI | 0.669 | 100,000 | 104,026 | 2024/9/20 |
| 第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 0.73 | 100,000 | 104,831 | 2023/9/20 |
| 第29回電源開発 | 1.405 | 100,000 | 104,645 | 2019/11/20 |
| 第38回電源開発 | 0.978 | 100,000 | 105,160 | 2023/12/20 |
| 第40回電源開発 | 0.889 | 200,000 | 209,240 | 2024/6/20 |
| 第23回東京ガス | 1.01 | 200,000 | 213,162 | 2023/6/9 |
| 第25回エヌ・ティ・ティ・データ | 1.47 | 100,000 | 105,519 | 2020/3/19 |
| 第2回ファーストリテイリング | 0.291 | 100,000 | 101,003 | 2020/12/18 |
| 第3回ファーストリテイリング | 0.491 | 100,000 | 102,191 | 2022/12/16 |
| 第4回ファーストリテイリング | 0.749 | 100,000 | 104,191 | 2025/12/18 |
| 第5回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー | 0.793 | 100,000 | 101,548 | 2018/12/13 |
| 第15回GEキャピタルコーポレーション | 2.215 | 100,000 | 108,615 | 2020/11/20 |
| 第23回GEキャピタルコーポレーション | 0.45 | 200,000 | 200,148 | 2016/9/20 |
| 第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー | 1.32 | 100,000 | 100,894 | 2017/2/9 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------|------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 第8回 | ナショナル・オーストラリア銀行 | 1.3 | 100,000 | 100,801 | 2017/1/20 |
| 第9回 | ナショナル・オーストラリア銀行 | 0.457 | 100,000 | 100,814 | 2019/1/17 |
| 第11回 | ナショナル・オーストラリア銀行 | 0.284 | 100,000 | 100,445 | 2020/1/16 |
| 第8回 | オーストラリア・コモンウェルス銀行 | 0.407 | 300,000 | 302,295 | 2019/5/2 |
| 第8回 | ウエストパック・バンキング・コーポレーション | 1.0 | 100,000 | 100,220 | 2016/8/12 |
| 第9回 | ラボバンク・ネダーランド | 1.81 | 100,000 | 107,163 | 2021/1/28 |
| 第18回 | ラボバンク・ネダーランド | 0.778 | 100,000 | 100,971 | 2017/11/2 |
| 第22回 | ラボバンク・ネダーランド | 0.377 | 100,000 | 100,164 | 2016/12/19 |
| 第23回 | ラボバンク・ネダーランド | 0.557 | 100,000 | 101,048 | 2018/12/19 |
| 第27回 | ラボバンク・ネダーランド | 0.38 | 100,000 | 100,559 | 2020/5/22 |
| 小 | 計 | | 21,917,000 | 22,919,698 | |
| 合 | 計 | | 470,889,347 | 527,302,626 | |

国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）

損益の状況、組入資産の明細は「国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）」の第1期（2014年11月14日～2015年11月2日）の決算資料から抜粋したものです。

■ 損益及び余剰金計算書

| 区 分 | 第 1 期 (自 平成26年11月14日 至 平成27年11月 2 日) |
|-----------------------------|--|
| | 金 額 (円) |
| 営 業 収 益 | |
| 有価証券売買等損益 | △59,468,539 |
| 営 業 収 益 合 計 | △59,468,539 |
| 営 業 費 用 | |
| 受 託 者 報 酬 | 295,692 |
| 委 託 者 報 酬 | 1,823,784 |
| そ の 他 費 用 | 259,200 |
| 営 業 費 用 合 計 | 2,378,676 |
| 営業損失 (△) | △61,847,215 |
| 経常損失 (△) | △61,847,215 |
| 当期純損失 (△) | △61,847,215 |
| 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 (△) | △793,732 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 (△) | — |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 61,210,466 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額 | 61,210,466 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,692,729 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額 | 1,692,729 |
| 分配金 | — |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) | △1,535,746 |

■ 組入資産の明細

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|-----------------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券 | ブラックロック国内リート・インデックス・マザーファンド | 1,201,351,342 | 1,470,814,448 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 1,201,351,342 | 1,470,814,448 | |
| 合計 | | 1,201,351,342 | 1,470,814,448 | |

(注)親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

下記は、ブラックロック国内リート・インデックス・マザーファンドの内容です。

(1)国内投資証券

| 銘 | 柄 | 期 首(前期末) 当 期 末 | | |
|-----------------------|------------|----------------|----------------|----------------------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | | 0.039 | 0.138 | 57,339 |
| MCUBS MidCity投資法人 | | 0.015 | 0.076 | 26,106 |
| 森ヒルズリート投資法人 | | 0.1 | 0.35 | 52,220 |
| 野村不動産レジデンシャル投資法人 | | 0.014 | - | - |
| 産業ファンド投資法人 | | 0.014 | 0.101 | 55,348 |
| 大和ハウスリート投資法人 | | 0.025 | 0.089 | 43,120 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | | 0.11 | 0.371 | 95,458 |
| ケネディクス・レジデンシャル投資法人 | | 0.023 | 0.1 | 30,200 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | | 0.019 | 0.144 | 73,008 |
| GLP投資法人 | | 0.201 | 0.738 | 87,748 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | | 0.032 | 0.123 | 27,687 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | | 0.146 | 0.493 | 105,649 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | 0.141 | - | - |
| 星野リゾート・リート投資法人 | | 0.004 | 0.022 | 29,128 |
| SIA不動産投資法人 | | 0.006 | 0.017 | 7,973 |
| イオンリート投資法人 | | 0.065 | 0.243 | 35,453 |
| ビューリックリート投資法人 | | 0.052 | 0.196 | 31,516 |
| 日本リート投資法人 | | 0.012 | 0.112 | 32,177 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | | 0.035 | 0.156 | 14,866 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | | - | 0.208 | 25,750 |
| ケネディクス商業リート投資法人 | | - | 0.1 | 23,310 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | | - | 0.044 | 3,832 |
| ジャパン・シニアリビング投資法人 | | - | 0.024 | 3,684 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | - | 1.061 | 158,754 |
| 日本ビルファンド投資法人 | | 0.119 | 0.402 | 226,728 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | | 0.106 | 0.373 | 202,912 |
| 日本リテールファンド投資法人 | | 0.205 | 0.693 | 158,073 |
| オリックス不動産投資法人 | | 0.179 | 0.638 | 103,356 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | | 0.07 | 0.249 | 96,363 |
| プレミアム投資法人 | | 0.016 | 0.32 | 37,120 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | | 0.079 | 0.265 | 38,266 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | | 0.016 | 0.052 | 20,540 |
| 野村不動産オフィスファンド投資法人 | | 0.032 | - | - |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | | 0.212 | 0.753 | 123,868 |
| 森トラスト総合リート投資法人 | | 0.087 | 0.291 | 61,459 |
| インヴィンシブル投資法人 | | 0.187 | 0.783 | 55,279 |
| フロンティア不動産投資法人 | | 0.039 | 0.141 | 68,737 |
| 平和不動産リート投資法人 | | 0.061 | 0.247 | 21,859 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | | 0.07 | 0.25 | 56,500 |
| 福岡リート投資法人 | | 0.051 | 0.194 | 37,907 |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | | 0.028 | 0.115 | 62,790 |
| 積水ハウス・SIAレジデンシャル投資法人 | | 0.086 | 0.29 | 32,045 |
| いちごオフィスリート投資法人 | | 0.087 | 0.404 | 33,451 |
| 大和証券オフィス投資法人 | | 0.024 | 0.093 | 57,102 |
| 阪急リート投資法人 | | 0.009 | 0.171 | 22,110 |
| スターアップロシード投資法人 | | 0.009 | 0.04 | 6,624 |
| トップリート投資法人 | | 0.015 | 0.05 | 22,375 |
| 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | | 0.032 | 0.192 | 46,540 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | | 0.236 | 0.897 | 75,527 |
| 日本賃貸住宅投資法人 | | 0.072 | 0.468 | 37,674 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | | 0.102 | 0.362 | 47,820 |
| 合 計 | 口 数 銘 柄 | 3,282 46銘柄 | 13,639 48銘柄 | 2,773,362 (98.1%) |

(注1) 合計欄の()内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | 当期 | |
|-----|--------|-----------|----------|
| | | 買建額 | 売建額 |
| 国内 | 東証REIT | 百万円 28 | 百万円 - |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

「iシェアーズ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF」は、名称を「iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF」に変更しました。

iシェアーズ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF

(iShares MSCI World Minimum Volatility UCITS ETF)

損益計算書、投資明細表は、入手可能なFinancial Statementsから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1. 損益計算書

| (2016年3月31日に終了する期間) | (2016年3月31日現在) |
|--|----------------|
| (米ドルで表示) | (千米ドル) |
| 営業収益 | 25,473 |
| 純損益を通じて公正価値で測定する金融資産および金融負債に係る実現損益（純額） | 54,338 |
| 収益合計 | 79,811 |
| 営業費用 | (2,723) |
| 営業純損益 | 77,088 |
| 金融費用： | |
| 支払利息 | (1) |
| 金融費用合計 | (1) |
| 税引前会計年度/当期純利益 | 77,087 |
| 還付請求不可能な源泉税 | (3,741) |
| (当) 会計年度/期間税引後純利益 | 73,346 |
| 目論見書に定められている評価法と整合させるための調整 | 287 |
| 事業活動による投資主に帰属する純資産の増加 | 73,633 |

(注) () 内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2016年3月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|--|---------------|-------------|
| Transferable Securities Admitted to an Official Stock Exchange Listing or traded on a Regulated Market (31 March 2015: 99.51%) | | | |
| Equities (31 March 2015: 99.51%) | | | |
| Australia (31 March 2015: 0.76%) | | | |
| Biotechnology | | | |
| 12,204 | CSL Ltd Com NPV | 952 | 0.08 |
| Commercial services | | | |
| 437,631 | Transurban Group Misc NPV | 3,814 | 0.31 |
| Gold mining | | | |
| 81,148 | Newcrest Mining Ltd Com NPV | 1,058 | 0.09 |
| Health care services | | | |
| 42,838 | Sonic Healthcare Ltd Com NPV | 617 | 0.05 |
| Insurance | | | |
| 673,663 | Medibank Pvt Ltd Com NPV | 1,508 | 0.12 |
| Telecommunications | | | |
| 873,275 | Telstra Corp Ltd Com NPV | 3,574 | 0.29 |
| | Total Australia | 11,523 | 0.94 |
| Belgium (31 March 2015: Nil) | | | |
| Pharmaceuticals | | | |
| 25,233 | UCB SA Com NPV | 1,933 | 0.16 |
| | Total Belgium | 1,933 | 0.16 |
| Bermuda (31 March 2015: 1.82%) | | | |
| Apparel retailers | | | |
| 514,000 | Yue Yuen Industrial Holdings Ltd Com HKD 0.25 | 1,766 | 0.14 |
| Engineering & construction | | | |
| 445,000 | Cheung Kong Infrastructure Holdings Ltd Com HKD 1.00 | 4,352 | 0.36 |
| Insurance | | | |
| 86,050 | Arch Capital Group Ltd Com USD 0.01 | 6,114 | 0.50 |
| 70,724 | Axis Capital Holdings Ltd Com USD 0.0125 | 3,922 | 0.32 |
| 30,638 | Everest Re Group Ltd Com USD 0.01 | 6,043 | 0.49 |
| 31,410 | RenaissanceRe Holdings Ltd Com USD 1.00 | 3,762 | 0.31 |
| | Total Bermuda | 25,959 | 2.12 |
| Canada (31 March 2015: 8.06%) | | | |
| Banks | | | |
| 45,878 | Bank of Montreal Com NPV | 2,795 | 0.23 |
| 114,557 | Bank of Nova Scotia Com NPV | 5,619 | 0.46 |
| 29,281 | Canadian Imperial Bank of Commerce Com NPV | 2,196 | 0.18 |
| 69,530 | Royal Bank of Canada Com NPV | 4,017 | 0.33 |
| 92,355 | Toronto-Dominion Bank Com NPV | 4,000 | 0.32 |
| Food | | | |
| 10,839 | Loblaw Cos Ltd Com NPV | 609 | 0.05 |
| Gold mining | | | |
| 155,741 | Agnico Eagle Mines Ltd Com NPV | 5,656 | 0.46 |
| 94,627 | Barrick Gold Corp Com NPV | 1,290 | 0.11 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--|---|---------------|-------------|
| Canada (31 March 2015: 8.06%) (cont) | | | |
| Gold mining (cont) | | | |
| 127,134 | Franco-Nevada Corp Com NPV | 7,830 | 0.64 |
| 496,683 | Goldcorp Inc Com NPV | 8,083 | 0.66 |
| Insurance | | | |
| 6,464 | Fairfax Financial Holdings Ltd Com NPV | 3,613 | 0.29 |
| 91,998 | Intact Financial Corp Com NPV | 6,460 | 0.53 |
| Media | | | |
| 194,899 | Shaw Communications Inc Com NPV | 3,776 | 0.31 |
| 91,992 | Thomson Reuters Corp Com NPV | 3,739 | 0.30 |
| Mining | | | |
| 278,588 | Silver Wheaton Corp Com NPV | 4,639 | 0.38 |
| Pipelines | | | |
| 23,359 | Enbridge Inc Com NPV | 912 | 0.08 |
| 27,977 | TransCanada Corp Com NPV | 1,104 | 0.09 |
| Real estate investment & services | | | |
| 67,452 | First Capital Realty Inc Com NPV | 1,075 | 0.09 |
| Real estate investment trusts | | | |
| 79,360 | RioCan Real Estate Investment Trust NPV | 1,627 | 0.13 |
| 44,473 | Smart Real Estate Investment Trust NPV | 1,161 | 0.10 |
| Retail | | | |
| 9,480 | Canadian Tire Corp Ltd Com NPV | 989 | 0.08 |
| 69,501 | Dollarama Inc Com NPV | 4,903 | 0.40 |
| Software | | | |
| 12,127 | Open Text Corp Com NPV | 630 | 0.05 |
| Telecommunications | | | |
| 106,801 | BCE Inc Com NPV | 4,883 | 0.40 |
| 106,200 | Rogers Communications Inc Com NPV | 4,266 | 0.35 |
| 137,317 | Telus Corp Com NPV | 4,485 | 0.36 |
| | Total Canada | 90,357 | 7.38 |
| Cayman Islands (31 March 2015: 0.17%) | | | |
| Electricity | | | |
| 1,843,000 | HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd Misc HKD 0.0005 | 1,620 | 0.13 |
| Telecommunications | | | |
| 1,842,360 | HKT Trust & HKT Ltd Misc HKD 0.0005 | 2,532 | 0.21 |
| | Total Cayman Islands | 4,152 | 0.34 |
| Denmark (31 March 2015: Nil) | | | |
| Healthcare products | | | |
| 17,038 | William Demant Holding A/S Com DKK 1.00 | 1,710 | 0.14 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 42,790 | Novo Nordisk A/S Com DKK 0.20 | 2,325 | 0.19 |
| | Total Denmark | 4,035 | 0.33 |
| France (31 March 2015: 0.36%) | | | |
| Software | | | |
| 12,310 | Dassault Systemes Com EUR 0.50 | 977 | 0.08 |
| | Total France | 977 | 0.08 |

(2016年3月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|---|---------------|-------------|
| Equities (31 March 2015: 99.51%) (cont) | | | |
| Germany (31 March 2015: 0.97%) | | | |
| Leisure time | | | |
| 67,938 | TUI AG Com NPV | 1,054 | 0.08 |
| Machinery - diversified | | | |
| 24,754 | MAN SE Com NPV | 2,685 | 0.22 |
| Media | | | |
| 7,274 | Kabel Deutschland Holding AG Com NPV | 813 | 0.07 |
| Total Germany | | 4,552 | 0.37 |
| Hong Kong (31 March 2015: 3.19%) | | | |
| Banks | | | |
| 502,300 | Hang Seng Bank Ltd Com NPV | 8,891 | 0.73 |
| Electricity | | | |
| 998,098 | CLP Holdings Ltd Com NPV | 9,039 | 0.74 |
| 349,500 | Power Assets Holdings Ltd Com NPV | 3,569 | 0.29 |
| Gas | | | |
| 1,343,500 | Hong Kong & China Gas Co Ltd Com NPV | 2,508 | 0.20 |
| Holding companies - diversified operations | | | |
| 77,500 | Swire Pacific Ltd Com HKD 0.60 | 832 | 0.07 |
| Real estate investment trusts | | | |
| 346,500 | Link REIT NPV | 2,050 | 0.17 |
| Transportation | | | |
| 1,011,000 | MTR Corp Ltd Com NPV | 4,986 | 0.41 |
| Total Hong Kong | | 31,875 | 2.61 |
| Ireland (31 March 2015: 0.85%) | | | |
| Airlines | | | |
| 56,712 | Ryanair Holdings Plc Com EUR 0.006 | 912 | 0.07 |
| Computers | | | |
| 35,656 | Accenture Plc Com USD 0.0000225 | 4,116 | 0.34 |
| Food | | | |
| 37,584 | Kerry Group Plc Com EUR 0.125 | 3,483 | 0.28 |
| Healthcare products | | | |
| 7,454 | Medtronic Plc Com USD 0.10 | 559 | 0.05 |
| Insurance | | | |
| 5,326 | Willis Towers Watson Plc Com USD 0.000304635 | 632 | 0.05 |
| Total Ireland | | 9,702 | 0.79 |
| Israel (31 March 2015: 0.69%) | | | |
| Banks | | | |
| 319,618 | Bank Hapoalim BM Com ILS 1.00 | 1,654 | 0.14 |
| 378,269 | Bank Leumi Le-Israel BM Com ILS 0.10 | 1,355 | 0.11 |
| 97,702 | Mizrahi Tefahot Bank Ltd Com ILS 0.10 | 1,139 | 0.09 |
| Investment services | | | |
| 2,478 | Delek Group Ltd Com ILS 1.00 | 425 | 0.04 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 47,439 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd Com ILS 0.10 | 2,555 | 0.21 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|---|--------------|-------------|
| Israel (31 March 2015: 0.69%) (cont) | | | |
| Telecommunications | | | |
| 467,950 | Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd Com ILS 1.00 | 1,055 | 0.08 |
| 8,700 | NICE-Systems Ltd Com ILS 1.00 | 570 | 0.05 |
| Total Israel | | 8,753 | 0.72 |
| Japan (31 March 2015: 14.50%) | | | |
| Airlines | | | |
| 817,000 | ANA Holdings Inc Com NPV | 2,304 | 0.19 |
| 83,500 | Japan Airlines Co Ltd Com NPV | 3,062 | 0.25 |
| Banks | | | |
| 657,000 | Aozora Bank Ltd Com NPV | 2,286 | 0.19 |
| Beverages | | | |
| 97,800 | Suntory Beverage & Food Ltd Com NPV | 4,412 | 0.36 |
| Chemicals | | | |
| 125,000 | Toray Industries Inc Com NPV | 1,065 | 0.09 |
| Commercial services | | | |
| 46,900 | Benesse Holdings Inc Com NPV | 1,350 | 0.11 |
| 66,500 | Park24 Co Ltd Com NPV | 1,858 | 0.15 |
| 98,000 | Recruit Holdings Co Ltd Com NPV | 2,995 | 0.25 |
| 78,800 | Secom Co Ltd Com NPV | 5,864 | 0.48 |
| Computers | | | |
| 33,000 | Itochu Techno-Solutions Corp Com NPV | 623 | 0.05 |
| 84,800 | Nomura Research Institute Ltd Com NPV | 2,860 | 0.23 |
| 35,800 | Otsuka Corp Com NPV | 1,892 | 0.16 |
| Cosmetics & personal care | | | |
| 34,600 | Unicharm Corp Com NPV | 754 | 0.06 |
| Entertainment | | | |
| 45,175 | Oriental Land Co Ltd Com NPV | 3,203 | 0.26 |
| 17,100 | Sankyo Co Ltd Com NPV | 637 | 0.05 |
| 30,600 | Toho Co Ltd Com NPV | 805 | 0.07 |
| Food | | | |
| 73,000 | Ajinomoto Co Inc Com NPV | 1,645 | 0.13 |
| 25,000 | NH Foods Ltd Com NPV | 551 | 0.05 |
| 44,200 | Nissin Foods Holdings Co Ltd Com NPV | 2,077 | 0.17 |
| 38,000 | Toyo Suisan Kaisha Ltd Com NPV | 1,364 | 0.11 |
| Health care services | | | |
| 36,400 | Miraca Holdings Inc Com NPV | 1,496 | 0.12 |
| Healthcare products | | | |
| 113,000 | Shimadzu Corp Com NPV | 1,772 | 0.14 |
| Internet | | | |
| 86,800 | Kakaku.com Inc Com NPV | 1,614 | 0.13 |
| 133,600 | M3 Inc Com NPV | 3,365 | 0.28 |
| Miscellaneous manufacturers | | | |
| 46,700 | FUJIFILM Holdings Corp Com NPV | 1,848 | 0.15 |
| Office & business equipment | | | |
| 368,100 | Canon Inc Com NPV | 10,968 | 0.90 |
| Oil & gas | | | |
| 101,900 | Showa Shell Sekiyu KK Com NPV | 915 | 0.07 |

(2016年3月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--|---|----------------|--------------|
| Equities (31 March 2015: 99.51%) (cont) | | | |
| Japan (31 March 2015: 14.50%) (cont) | | | |
| Oil & gas (cont) | | | |
| 190,000 | TonenGeneral Sekiyu KK Com NPV | 1,721 | 0.14 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 263,200 | Astellas Pharma Inc Com NPV | 3,500 | 0.29 |
| 22,700 | Chugai Pharmaceutical Co Ltd Com NPV | 702 | 0.06 |
| 19,800 | Eisai Co Ltd Com NPV | 1,192 | 0.10 |
| 108,897 | Kyowa Hakko Kirin Co Ltd Com NPV | 1,740 | 0.14 |
| 155,500 | Mitsubishi Tanabe Pharma Corp Com NPV | 2,703 | 0.22 |
| 181,500 | Otsuka Holdings Co Ltd Com NPV | 6,592 | 0.54 |
| 256,600 | Santen Pharmaceutical Co Ltd Com NPV | 3,863 | 0.32 |
| 27,300 | Shionogi & Co Ltd Com NPV | 1,286 | 0.10 |
| 20,900 | Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd Com NPV | 1,659 | 0.13 |
| 253,109 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd Com NPV | 11,564 | 0.94 |
| Real estate investment trusts | | | |
| 606 | Japan Prime Realty Investment Corp Reits NPV | 2,467 | 0.20 |
| 660 | Japan Real Estate Investment Corp Reits NPV | 3,811 | 0.31 |
| 1,809 | Japan Retail Fund Investment Corp Reits NPV | 4,349 | 0.36 |
| 666 | Nippon Building Fund Inc Reits NPV | 3,941 | 0.32 |
| 1,010 | Nippon Prologis REIT Inc NPV | 2,259 | 0.19 |
| 2,487 | Nomura Real Estate Master Fund Inc Reits NPV | 3,697 | 0.30 |
| 1,894 | United Urban Investment Corp Reits NPV | 3,057 | 0.25 |
| Restaurants & bars | | | |
| 48,400 | McDonald's Holdings Co Japan Ltd Com NPV | 1,148 | 0.09 |
| Retail | | | |
| 18,800 | ABC-Mart Inc Com NPV | 1,204 | 0.10 |
| 46,900 | Lawson Inc Com NPV | 3,931 | 0.32 |
| 48,400 | Nitori Holdings Co Ltd Com NPV | 4,440 | 0.36 |
| 16,000 | Shimamura Co Ltd Com NPV | 1,998 | 0.16 |
| 72,530 | USS Co Ltd Com NPV | 1,159 | 0.10 |
| Software | | | |
| 29,200 | Oracle Corp Japan Com NPV | 1,639 | 0.13 |
| Telecommunications | | | |
| 35,100 | KDDI Corp Com NPV | 938 | 0.08 |
| 189,400 | Nippon Telegraph & Telephone Corp Com NPV | 8,168 | 0.67 |
| 434,840 | NTT DoCoMo Inc Com NPV | 9,873 | 0.80 |
| Transportation | | | |
| 13,800 | East Japan Railway Co Com NPV | 1,191 | 0.10 |
| 440,000 | Nagoya Railroad Co Ltd Com NPV | 2,051 | 0.17 |
| 491,000 | Tobu Railway Co Ltd Com NPV | 2,446 | 0.20 |
| 70,500 | West Japan Railway Co Com NPV | 4,351 | 0.35 |
| 104,567 | Yamato Holdings Co Ltd Com NPV | 2,091 | 0.17 |
| | Total Japan | 170,316 | 13.91 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--|---|---------------|-------------|
| Jersey (31 March 2015: 0.36%) | | | |
| Gold mining | | | |
| 64,665 | Randgold Resources Ltd Com USD 0.05 | 5,916 | 0.48 |
| | Total Jersey | 5,916 | 0.48 |
| Luxembourg (31 March 2015: 0.09%) | | | |
| New Zealand (31 March 2015: 0.18%) | | | |
| Engineering & construction | | | |
| 543,075 | Auckland International Airport Ltd Com NPV | 2,425 | 0.20 |
| | Total New Zealand | 2,425 | 0.20 |
| Portugal (31 March 2015: 0.06%) | | | |
| Singapore (31 March 2015: 1.57%) | | | |
| Airlines | | | |
| 300,172 | Singapore Airlines Ltd Com NPV | 2,539 | 0.21 |
| Banks | | | |
| 396,376 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd Com NPV | 2,602 | 0.21 |
| Fixed line telecommunications | | | |
| 2,936,600 | Singapore Telecommunications Ltd Com NPV | 8,309 | 0.68 |
| Media | | | |
| 652,455 | Singapore Press Holdings Ltd Com NPV | 1,938 | 0.16 |
| Telecommunications | | | |
| 417,600 | StarHub Ltd Com NPV | 1,036 | 0.08 |
| | Total Singapore | 16,424 | 1.34 |
| Switzerland (31 March 2015: 6.64%) | | | |
| Chemicals | | | |
| 650 | Givaudan SA Com CHF 10.00 | 1,280 | 0.11 |
| Food | | | |
| 138 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG Com CHF 10.00 | 857 | 0.07 |
| 68 | Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG Com CHF 100.00 | 5,112 | 0.42 |
| 186,403 | Nestle SA Com CHF 0.10 | 13,985 | 1.14 |
| Hand & machine tools | | | |
| 14,111 | Schindler Holding AG Com CHF 0.10 | 2,589 | 0.21 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 104,942 | Novartis AG Com CHF 0.50 | 7,638 | 0.62 |
| 25,015 | Roche Holding AG Com NPV | 6,183 | 0.51 |
| Real estate investment & services | | | |
| 25,114 | Swiss Prime Site AG Com CHF 15.30 | 2,221 | 0.18 |
| Telecommunications | | | |
| 15,650 | Swisscom AG Com CHF 1.00 | 8,522 | 0.70 |
| Transportation | | | |
| 37,212 | Kuehne & Nagel International AG Com CHF 1.00 | 5,308 | 0.43 |
| | Total Switzerland | 53,695 | 4.39 |

(2016年3月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--|--|---------------|-------------|
| Equities (31 March 2015: 99.51%) (cont) | | | |
| United Kingdom (31 March 2015: 3.52%) | | | |
| Commercial services | | | |
| 60,424 | Capita Plc Com GBP 0.020667 | 904 | 0.07 |
| Entertainment | | | |
| 230,606 | Merlin Entertainments Plc Com GBP 0.01 | 1,536 | 0.13 |
| Gas distribution | | | |
| 202,270 | National Grid Plc Com GBP 0.1139535 | 2,869 | 0.24 |
| Household products | | | |
| 51,071 | Reckitt Benckiser Group Plc Com GBP 0.10 | 4,940 | 0.40 |
| Internet | | | |
| 672,311 | Auto Trader Group Plc Com GBP 0.01 | 3,769 | 0.31 |
| Media | | | |
| 163,277 | Sky Plc Com GBP 0.50 | 2,401 | 0.20 |
| Mining | | | |
| 154,433 | Fresnillo Plc Com USD 0.50 | 2,112 | 0.17 |
| Oil & gas | | | |
| 35,717 | Royal Dutch Shell Plc Com EUR 0.07 | 864 | 0.07 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 40,124 | AstraZeneca Plc Com USD 0.25 | 2,251 | 0.19 |
| 267,818 | GlaxoSmithKline Plc Com GBP 0.25 | 5,431 | 0.44 |
| Restaurants & bars | | | |
| 229,420 | Compass Group Plc Com GBP 0.10625 | 4,049 | 0.33 |
| Retail | | | |
| 28,628 | Next Plc Com GBP 0.10 | 2,220 | 0.18 |
| Telecommunications | | | |
| 294,983 | Inmarsat Plc Com EUR 0.0005 | 4,174 | 0.34 |
| Transportation | | | |
| 198,840 | Royal Mail Plc Com GBP 0.01 | 1,374 | 0.11 |
| Total United Kingdom | | 38,894 | 3.18 |
| United States (31 March 2015: 55.72%) | | | |
| Apparel retailers | | | |
| 31,373 | VF Corp Com NPV | 2,031 | 0.17 |
| Banks | | | |
| 33,584 | US Bancorp Com USD 0.01 | 1,362 | 0.11 |
| 82,020 | Wells Fargo & Co Com USD 1.666 | 3,966 | 0.32 |
| Beverages | | | |
| 202,489 | Coca-Cola Co Com USD 0.25 | 9,389 | 0.77 |
| 136,437 | PepsiCo Inc Com USD 0.017 | 13,984 | 1.14 |
| Chemicals | | | |
| 4,829 | Ecolab Inc Com USD 1.00 | 538 | 0.04 |
| Commercial services | | | |
| 162,867 | Automatic Data Processing Inc Com USD 0.10 | 14,608 | 1.19 |
| 46,297 | Gartner Inc Com USD 0.0005 | 4,134 | 0.34 |
| 54,351 | PayPal Holdings Inc Com USD 0.0001 | 2,098 | 0.17 |
| Computers | | | |
| 4,500 | Apple Inc Com USD 0.00001 | 490 | 0.04 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|---|--------------|------------|
| United States (31 March 2015: 55.72%) (cont) | | | |
| Computers (cont) | | | |
| 31,006 | International Business Machines Corp Com USD 0.20 | 4,696 | 0.38 |
| 105,526 | Synopsys Inc Com USD 0.01 | 5,108 | 0.42 |
| Cosmetics & personal care | | | |
| 115,752 | Colgate-Palmolive Co Com USD 1.00 | 8,179 | 0.67 |
| 199,186 | Procter & Gamble Co Com NPV | 16,395 | 1.34 |
| Distribution & wholesale | | | |
| 14,684 | Genuine Parts Co Com USD 1.00 | 1,459 | 0.12 |
| Diversified financial services | | | |
| 65,032 | Visa Inc Com USD 0.0001 | 4,975 | 0.41 |
| Electricity | | | |
| 14,915 | American Electric Power Co Inc Com USD 6.50 | 990 | 0.08 |
| 199,923 | Consolidated Edison Inc Com USD 0.10 | 15,322 | 1.25 |
| 131,894 | Dominion Resources Inc Com NPV | 9,905 | 0.81 |
| 113,084 | Duke Energy Corp Com USD 0.001 | 9,123 | 0.75 |
| 29,975 | Eversource Energy Com USD 5.00 | 1,749 | 0.14 |
| 38,348 | NextEra Energy Inc Com USD 0.01 | 4,537 | 0.37 |
| 137,226 | PG&E Corp Com NPV | 8,197 | 0.67 |
| 346,404 | Southern Co Com USD 5.00 | 17,913 | 1.46 |
| 91,179 | WEC Energy Group Inc Com USD 0.01 | 5,475 | 0.45 |
| 169,152 | Xcel Energy Inc Com USD 2.50 | 7,072 | 0.58 |
| Electronics | | | |
| 9,276 | Waters Corp Com USD 0.01 | 1,223 | 0.10 |
| Engineering & construction | | | |
| 61,978 | SBA Communications Corp Com USD 0.01 | 6,208 | 0.51 |
| Environmental control | | | |
| 151,393 | Republic Services Inc Com USD 0.01 | 7,217 | 0.59 |
| 25,252 | Stericycle Inc Com USD 0.01 | 3,186 | 0.26 |
| 166,583 | Waste Management Inc Com USD 0.01 | 9,825 | 0.80 |
| Food | | | |
| 50,321 | Campbell Soup Co Com USD 0.0375 | 3,210 | 0.26 |
| 260,956 | General Mills Inc Com USD 0.10 | 16,532 | 1.35 |
| 46,372 | Hershey Co Com USD 1.00 | 4,269 | 0.35 |
| 26,162 | JM Smucker Co Com NPV | 3,397 | 0.28 |
| 150,287 | Kellogg Co Com USD 0.25 | 11,504 | 0.94 |
| 74,805 | McCormick & Co Inc Com NPV | 7,440 | 0.61 |
| 16,913 | Mondelez International Inc Com NPV | 679 | 0.05 |
| 36,398 | Sysco Corp Com USD 1.00 | 1,701 | 0.14 |
| Gas | | | |
| 5,683 | Sempra Energy Com NPV | 591 | 0.05 |
| Gold mining | | | |
| 277,515 | Newmont Mining Corp Com USD 1.60 | 7,371 | 0.60 |
| Health care services | | | |
| 6,536 | Anthem Inc Com USD 0.01 | 909 | 0.07 |
| 78,521 | DaVita HealthCare Partners Inc Com USD 0.001 | 5,761 | 0.47 |

(2016年3月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|--|--------------|------------|
| Equities (31 March 2015: 99.51%) (cont) | | | |
| United States (31 March 2015: 55.72%) (cont) | | | |
| Health care services (cont) | | | |
| 35,595 | Laboratory Corp of America Holdings Com USD 0.10 | 4,168 | 0.34 |
| 46,566 | UnitedHealth Group Inc Com USD 0.01 | 6,001 | 0.49 |
| Healthcare products | | | |
| 157,511 | Abbott Laboratories Com NPV | 6,587 | 0.54 |
| 98,471 | Baxter International Inc Com USD 1.00 | 4,046 | 0.33 |
| 64,717 | Becton Dickinson and Co Com USD 1.00 | 9,826 | 0.80 |
| 33,648 | CR Bard Inc Com USD 0.25 | 6,816 | 0.56 |
| 57,637 | Henry Schein Inc Com USD 0.01 | 9,941 | 0.81 |
| 57,630 | Patterson Cos Inc Com USD 0.01 | 2,681 | 0.22 |
| 52,179 | Stryker Corp Com USD 0.10 | 5,596 | 0.46 |
| 4,381 | Thermo Fisher Scientific Inc Com USD 1.00 | 620 | 0.05 |
| 68,784 | Varian Medical Systems Inc Com USD 1.00 | 5,503 | 0.45 |
| Household goods & home construction | | | |
| 89,688 | Kimberly-Clark Corp Com USD 1.25 | 12,067 | 0.99 |
| Insurance | | | |
| 9,011 | Alleghany Corp Com USD 1.00 | 4,461 | 0.36 |
| 72,924 | Berkshire Hathaway Inc Com USD 0.0033 | 10,342 | 0.84 |
| 641 | Markel Corp Com NPV | 571 | 0.05 |
| 74,033 | Marsh & McLennan Cos Inc Com USD 1.00 | 4,499 | 0.37 |
| 52,568 | Travelers Cos Inc Com NPV | 6,136 | 0.50 |
| 69,784 | WR Berkley Corp Com USD 0.20 | 3,917 | 0.32 |
| Internet | | | |
| 2,149 | Alphabet Inc Com USD 0.001 | 1,639 | 0.13 |
| 54,906 | eBay Inc Com USD 0.001 | 1,309 | 0.11 |
| 64,088 | Facebook Inc Com USD 0.000006 | 7,312 | 0.60 |
| Nondurable household products | | | |
| 90,899 | Church & Dwight Co Inc Com USD 1.00 | 8,377 | 0.69 |
| 76,967 | Clorox Co Com USD 1.00 | 9,700 | 0.79 |
| Oil & gas | | | |
| 149,127 | Exxon Mobil Corp Com NPV | 12,467 | 1.02 |
| 14,247 | Occidental Petroleum Corp Com USD 0.20 | 975 | 0.08 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 95,680 | AmerisourceBergen Corp Com USD 0.01 | 8,282 | 0.68 |
| 109,416 | Bristol-Myers Squibb Co Com USD 0.10 | 6,987 | 0.57 |
| 32,343 | Cardinal Health Inc Com NPV | 2,650 | 0.22 |
| 99,693 | Eli Lilly & Co Com NPV | 7,177 | 0.59 |
| 68,673 | Express Scripts Holding Co Com USD 0.01 | 4,714 | 0.38 |
| 160,115 | Johnson & Johnson Com USD 1.00 | 17,320 | 1.41 |
| 22,473 | McKesson Corp Com USD 0.01 | 3,534 | 0.29 |
| 152,714 | Merck & Co Inc Com USD 0.50 | 8,080 | 0.66 |
| 158,665 | Pfizer Inc Com USD 0.05 | 4,700 | 0.38 |
| Real estate investment trusts | | | |
| 243,672 | American Capital Agency Corp Reits USD 0.01 | 4,535 | 0.37 |
| 49,487 | American Tower Corp Reits USD 0.01 | 5,067 | 0.41 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|---|--------------|------------|
| United States (31 March 2015: 55.72%) (cont) | | | |
| Real estate investment trusts (cont) | | | |
| 666,053 | Annaly Capital Management Inc Reits USD 0.01 | 6,834 | 0.56 |
| 58,639 | AvalonBay Communities Inc Reits USD 0.01 | 11,145 | 0.91 |
| 38,703 | Brixmor Property Group Inc Reits USD 0.01 | 991 | 0.08 |
| 8,884 | Camden Property Trust Reits USD 0.01 | 747 | 0.06 |
| 62,867 | Crown Castle International Corp Reits USD 0.01 | 5,438 | 0.44 |
| 56,778 | Equity Residential Reits USD 0.01 | 4,260 | 0.35 |
| 5,298 | Essex Property Trust Inc Reits USD 0.0001 | 1,239 | 0.10 |
| 44,978 | Federal Realty Investment Trust Reits USD 0.01 | 7,015 | 0.57 |
| 96,680 | HCP Inc Reits USD 1.00 | 3,149 | 0.26 |
| 39,662 | Public Storage Reits USD 0.10 | 10,933 | 0.89 |
| 52,885 | Realty Income Corp Reits USD 1.00 | 3,305 | 0.27 |
| 12,083 | Simon Property Group Inc Reits USD 0.0001 | 2,511 | 0.21 |
| 92,452 | UDR Inc Reits USD 0.01 | 3,562 | 0.29 |
| 65,566 | Ventas Inc Reits USD 0.25 | 4,128 | 0.34 |
| 115,650 | Welltower Inc Reits USD 1.00 | 8,018 | 0.66 |
| Restaurants & bars | | | |
| 57,768 | Starbucks Corp Com USD 0.001 | 3,448 | 0.28 |
| Retail | | | |
| 15,624 | AutoZone Inc Com USD 0.01 | 12,434 | 1.01 |
| 7,010 | Chipotle Mexican Grill Inc Com USD 0.01 | 3,302 | 0.27 |
| 15,006 | Costco Wholesale Corp Com USD 0.005 | 2,365 | 0.19 |
| 26,426 | CVS Health Corp Com USD 0.01 | 2,740 | 0.22 |
| 41,257 | Dollar General Corp Com USD 0.875 | 3,532 | 0.29 |
| 31,635 | Dollar Tree Inc Com USD 0.01 | 2,608 | 0.21 |
| 29,216 | Home Depot Inc Com USD 0.05 | 3,898 | 0.32 |
| 16,320 | L Brands Inc Com USD 0.50 | 1,433 | 0.12 |
| 34,096 | Lowe's Cos Inc Com USD 0.50 | 2,582 | 0.21 |
| 119,973 | McDonald's Corp Com USD 0.01 | 15,100 | 1.23 |
| 29,133 | Nordstrom Inc Com NPV | 1,666 | 0.14 |
| 11,020 | O'Reilly Automotive Inc Com USD 0.01 | 3,014 | 0.25 |
| 27,741 | Ross Stores Inc Com USD 0.01 | 1,606 | 0.13 |
| 99,094 | Target Corp Com USD 0.0833 | 8,161 | 0.67 |
| 126,469 | TJX Cos Inc Com USD 1.00 | 9,908 | 0.81 |
| 11,914 | Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc Com USD 0.01 | 2,308 | 0.19 |
| 76,150 | Wal-Mart Stores Inc Com USD 0.10 | 5,216 | 0.43 |
| Savings & loans | | | |
| 207,334 | People's United Financial Inc Com USD 0.01 | 3,301 | 0.27 |
| Semiconductors | | | |
| 48,956 | Intel Corp Com USD 0.001 | 1,583 | 0.13 |
| 25,408 | Qualcomm Inc Com USD 0.0001 | 1,299 | 0.10 |
| Software | | | |
| 14,784 | Adobe Systems Inc Com USD 0.0001 | 1,387 | 0.11 |
| 25,232 | Fidelity National Information Services Inc Com USD 0.01 | 1,597 | 0.13 |

(2016年3月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|--|------------------|--------------|
| Equities (31 March 2015: 99.51%) (cont) | | | |
| United States (31 March 2015: 55.72%) (cont) | | | |
| Software (cont) | | | |
| 58,987 | Microsoft Corp Com USD 0.00000625 | 3,257 | 0.27 |
| 219,747 | Paychex Inc Com USD 0.01 | 11,864 | 0.97 |
| Telecommunications | | | |
| 519,040 | AT&T Inc Com USD 1.00 | 20,331 | 1.66 |
| 104,166 | Cisco Systems Inc Com USD 0.001 | 2,966 | 0.25 |
| 66,594 | Motorola Solutions Inc Com USD 0.01 | 5,040 | 0.41 |
| 330,907 | Verizon Communications Inc Com USD 0.10 | 17,892 | 1.46 |
| Tobacco | | | |
| 125,889 | Altria Group Inc Com USD 0.333 | 7,887 | 0.65 |
| 13,858 | Philip Morris International Inc Com NPV | 1,359 | 0.11 |
| 24,406 | Reynolds American Inc Com USD 0.0001 | 1,228 | 0.10 |
| Transportation | | | |
| 72,262 | United Parcel Service Inc Com USD 0.01 | 7,621 | 0.62 |
| Water | | | |
| 41,251 | American Water Works Co Inc Com USD 0.01 | 2,843 | 0.23 |
| Total United States | | 733,372 | 59.91 |
| Total equities | | 1,214,860 | 99.25 |

| 契約数 | 原資産 エクスポージャー 千米ドル | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% | |
|--|--|--------------|-------------|------|
| Financial derivative instruments (31 March 2015: 0.00%) | | | | |
| Futures contracts (31 March 2015: 0.00%) | | | | |
| 33 | Mini MSCI EAFE Index Futures June 2016 | 2,694 | (12) | 0.00 |
| 30 | MSCI Singapore ETS Index Futures April 2016 | 703 | 8 | 0.00 |
| 26 | S&P500 E Mini Index Futures June 2016 | 2,632 | 35 | 0.00 |
| Total unrealised gains on futures contracts | | 43 | 0.00 | |
| Total unrealised losses on futures contracts | | (12) | 0.00 | |
| Net unrealised gains on futures contracts | | 31 | 0.00 | |
| Total financial derivative instruments | | 31 | 0.00 | |

| | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|-----------------------------------|------------------|---------------|
| Total value of investments | 1,214,891 | 99.25 |
| Cash[†] | 19,642 | 1.60 |
| Other net liabilities | (11,059) | (0.90) |

| | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|------------------|---------------|
| Net assets attributable to redeemable participating shareholders | 1,223,474 | 99.95 |
| Adjustment to align to the valuation methodology as set out in the prospectus | 589 | 0.05 |
| Net asset value attributable to redeemable participating shareholders at the end of the year | 1,224,063 | 100.00 |

[†] Cash holdings of \$19,426,600 are held with State Street Bank and Trust Company. \$215,273 is held as security for futures contracts with Barclays Bank Plc.

Equities are primarily classified by country of incorporation of the entity in which the Fund holds shares.

Underlying exposure has been calculated according to the guidelines issued by the European Securities and Market Authority ("ESMA") and represents the market value of an equivalent position in the assets underlying each financial derivative instrument.

| 全負債を含めた流動資産合計の分析 | 公正価値 千米ドル | 全流動資 産に占め る比率% |
|---|------------------|----------------------|
| Transferable securities admitted to an official stock exchange listing or traded on a regulated market | 1,214,860 | 98.12 |
| Exchange traded financial derivative instruments | 43 | 0.00 |
| Other assets | 23,231 | 1.88 |
| Total current assets | 1,238,134 | 100.00 |

「iシェアーズ MSCI ワールド クオリティ・ファクター UCITS ETF」は、名称を「iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・クオリティ・ファクター UCITS ETF」に変更しました。

iシェアーズ MSCI ワールド クオリティ・ファクター UCITS ETF

(iShares MSCI World Quality Factor UCITS ETF)

損益計算書、投資明細表は、入手可能なANNUAL REPORT AND AUDITED FINANCIAL STATEMENTSから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1. 損益計算書

(2014年10月6日～2015年5月31日)

(2015年5月31日現在)

(米ドルで表示)

(千米ドル)

| | |
|--|------------|
| 営業収益 | 232 |
| 純損益を通じて公正価値で測定する金融資産および金融負債に係る実現損益（純額） | 626 |
| 損益合計 | 858 |
| 営業費用 | (26) |
| 営業純損益 | 832 |
| 税引前会計期間/当期純損益 | 832 |
| 還付請求不可能な源泉税 | (26) |
| (当) 会計年度/期間税引後純損益 | 806 |
| 目論見書に定められている評価法と整合させるための調整 | 4 |
| 事業活動による投資主に帰属する純資産の増減 | 810 |

(注) ()内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2015年5月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|--|--------------|-------------|
| Transferable Securities Admitted to an Official Stock Exchange Listing or traded on a Regulated Market | | | |
| Equities | | | |
| Australia | | | |
| Banks | | | |
| 1,684 | Bendigo & Adelaide Bank Ltd Com NPV | 16 | 0.07 |
| Biotechnology | | | |
| 1,644 | CSL Ltd Com NPV | 117 | 0.54 |
| Containers & packaging | | | |
| 1,353 | Amcor Ltd Com NPV | 15 | 0.07 |
| Diversified financial services | | | |
| 897 | ASX Ltd Com NPV | 29 | 0.13 |
| 1,693 | Platinum Asset Management Ltd Com NPV | 10 | 0.05 |
| Engineering & construction | | | |
| 1,977 | Lend Lease Group Misc NPV | 25 | 0.12 |
| Food | | | |
| 2,793 | Woolworths Ltd Com NPV | 60 | 0.28 |
| Healthcare products | | | |
| 131 | Cochlear Ltd Com NPV | 9 | 0.04 |
| Internet | | | |
| 717 | Seek Ltd Com NPV | 9 | 0.04 |
| Mining | | | |
| 857 | Rio Tinto Ltd Com NPV | 38 | 0.18 |
| Oil & gas | | | |
| 945 | Woodside Petroleum Ltd Com NPV | 26 | 0.12 |
| Real estate investment & services | | | |
| 156 | REA Group Ltd Com NPV | 5 | 0.02 |
| Telecommunications | | | |
| 25,980 | Telstra Corp Ltd Com NPV | 124 | 0.57 |
| 1,432 | TPG Telecom Ltd Com NPV | 10 | 0.04 |
| | Total Australia | 493 | 2.27 |
| Belgium | | | |
| Food | | | |
| 164 | Colruyt SA Com NPV | 7 | 0.03 |
| Telecommunications | | | |
| 723 | Belgacom SA Com NPV | 25 | 0.12 |
| | Total Belgium | 32 | 0.15 |
| Bermuda | | | |
| Diversified financial services | | | |
| 1,425 | Invesco Ltd Com USD 0.20 | 57 | 0.26 |
| Engineering & construction | | | |
| 7,000 | Cheung Kong Infrastructure Holdings Ltd Com HKD 1.00 | 57 | 0.27 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--|--|--------------|-------------|
| Bermuda (cont) | | | |
| Insurance | | | |
| 451 | Arch Capital Group Ltd Com USD 0.01 | 29 | 0.13 |
| 235 | Axis Capital Holdings Ltd Com USD 0.0125 | 13 | 0.06 |
| | Total Bermuda | 156 | 0.72 |
| British Virgin Islands | | | |
| Apparel retailers | | | |
| 587 | Michael Kors Holdings Ltd Com NPV | 27 | 0.12 |
| | Total British Virgin Islands | 27 | 0.12 |
| Canada | | | |
| Banks | | | |
| 1,321 | Canadian Imperial Bank of Commerce Com NPV | 100 | 0.46 |
| Chemicals | | | |
| 1,592 | Potash Corp of Saskatchewan Inc Com NPV | 50 | 0.23 |
| Diversified financial services | | | |
| 1,021 | CI Financial Corp Com NPV | 29 | 0.13 |
| Insurance | | | |
| 1,080 | Great-West Lifeco Inc Com NPV | 31 | 0.14 |
| 383 | Intact Financial Corp Com NPV | 28 | 0.13 |
| 669 | Power Financial Corp Com NPV | 19 | 0.09 |
| Oil & gas | | | |
| 747 | Canadian Oil Sands Ltd Com NPV | 6 | 0.03 |
| 427 | Imperial Oil Ltd Com NPV | 17 | 0.07 |
| 144 | Vermilion Energy Inc Com NPV | 6 | 0.03 |
| Retail | | | |
| 391 | Dollarama Inc Com NPV | 22 | 0.10 |
| 503 | Restaurant Brands International Inc Com NPV | 19 | 0.09 |
| Telecommunications | | | |
| 508 | Telus Corp Com NPV | 17 | 0.08 |
| Transportation | | | |
| 1,730 | Canadian National Railway Co Com NPV | 102 | 0.47 |
| | Total Canada | 446 | 2.05 |
| Cayman Islands | | | |
| Diversified financial services | | | |
| 6,916 | CK Hutchison Holdings Ltd Com HKD 1.00 | 107 | 0.50 |
| Hotels | | | |
| 5,225 | MGM China Holdings Ltd Com HKD 1.00 | 10 | 0.04 |
| 6,000 | Sands China Ltd Com USD 0.01 | 23 | 0.11 |
| Real estate investment & services | | | |
| 8,916 | Cheung Kong Property Holdings Ltd Com HKD 1.00 | 55 | 0.25 |
| | Total Cayman Islands | 195 | 0.90 |

(2015年5月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--------------------------------------|---|--------------|-------------|
| Equities (cont) | | | |
| Curacao | | | |
| Oil & gas services | | | |
| 1,839 | Schlumberger Ltd Com USD 0.01 | 167 | 0.77 |
| Total Curacao | | 167 | 0.77 |
| Denmark | | | |
| Chemicals | | | |
| 625 | Novozymes A/S Com DKK 2.00 | 30 | 0.14 |
| Healthcare products | | | |
| 464 | Coloplast A/S Com DKK 1.00 | 35 | 0.16 |
| 60 | William Demant Holding A/S Com DKK 1.00 | 5 | 0.02 |
| Insurance | | | |
| 500 | Tryg A/S Com DKK 5.00 | 10 | 0.05 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 6,483 | Novo Nordisk A/S Com DKK 0.20 | 361 | 1.66 |
| Retail | | | |
| 312 | Pandora A/S Com DKK 1.00 | 31 | 0.14 |
| Total Denmark | | 472 | 2.17 |
| Finland | | | |
| Electricity | | | |
| 2,192 | Fortum Oyj Com EUR 3.40 | 42 | 0.19 |
| Insurance | | | |
| 1,566 | Sampo Oyj Com NPV | 74 | 0.34 |
| Machinery - diversified | | | |
| 1,182 | Kone Oyj Com NPV | 49 | 0.23 |
| Miscellaneous manufacturers | | | |
| 332 | Wartsila Oyj Abp Com NPV | 15 | 0.07 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 376 | Orion Oyj Com EUR 0.65 | 12 | 0.06 |
| Telecommunications | | | |
| 613 | Elisa Oyj Com NPV | 19 | 0.08 |
| Total Finland | | 211 | 0.97 |
| France | | | |
| Apparel retailers | | | |
| 57 | Hermes International Com NPV | 22 | 0.10 |
| Insurance | | | |
| 6,326 | AXA SA Com EUR 2.29 | 159 | 0.73 |
| 601 | SCOR SE Com EUR 7.876972 | 21 | 0.10 |
| Nondurable household products | | | |
| 60 | Societe BIC SA Com EUR 3.82 | 10 | 0.05 |
| Total France | | 212 | 0.98 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--|--|--------------|-------------|
| Germany | | | |
| Chemicals | | | |
| 1,425 | BASF SE Com NPV | 131 | 0.61 |
| 155 | Fuchs Petrolub SE Pref NPV | 7 | 0.03 |
| Diversified financial services | | | |
| 823 | Deutsche Boerse AG Com NPV | 66 | 0.30 |
| Insurance | | | |
| 264 | Hannover Rueck SE Com NPV | 26 | 0.12 |
| Retail | | | |
| 143 | Hugo Boss AG Com NPV | 16 | 0.07 |
| Total Germany | | 246 | 1.13 |
| Hong Kong | | | |
| Banks | | | |
| 2,800 | Hang Seng Bank Ltd Com NPV | 56 | 0.26 |
| Diversified financial services | | | |
| 2,600 | Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd Com NPV | 100 | 0.46 |
| Electricity | | | |
| 9,031 | Power Assets Holdings Ltd Com NPV | 86 | 0.40 |
| Gas | | | |
| 35,146 | Hong Kong & China Gas Co Ltd Com NPV | 84 | 0.39 |
| Hotels | | | |
| 7,000 | Galaxy Entertainment Group Ltd Com NPV | 34 | 0.16 |
| 4,000 | SJM Holdings Ltd Com NPV | 5 | 0.02 |
| Insurance | | | |
| 39,059 | AIA Group Ltd Com NPV | 257 | 1.18 |
| Real estate investment & services | | | |
| 4,000 | Henderson Land Development Co Ltd Com NPV | 32 | 0.15 |
| 8,000 | Sino Land Co Ltd Com NPV | 14 | 0.06 |
| Total Hong Kong | | 668 | 3.08 |
| Ireland | | | |
| Computers | | | |
| 1,484 | Accenture Plc Com USD 0.0000225 | 143 | 0.66 |
| Food | | | |
| 323 | Kerry Group Plc Com EUR 0.125 | 24 | 0.11 |
| Total Ireland | | 167 | 0.77 |
| Japan | | | |
| Airlines | | | |
| 400 | Japan Airlines Co Ltd Com NPV | 14 | 0.06 |
| Diversified financial services | | | |
| 1,129 | Japan Exchange Group Inc Com NPV | 34 | 0.16 |
| Home builders | | | |
| 1,900 | Daiwa House Industry Co Ltd Com NPV | 46 | 0.21 |
| Insurance | | | |
| 800 | Sony Financial Holdings Inc Com NPV | 14 | 0.07 |

(2015年5月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--|---|--------------|-------------|
| Equities (cont) | | | |
| Japan (cont) | | | |
| Internet | | | |
| 400 | Kakaku.com Inc Com NPV | 6 | 0.03 |
| 700 | M3 Inc Com NPV | 14 | 0.06 |
| 2,000 | Yahoo Japan Corp Com NPV | 9 | 0.04 |
| Real estate investment & services | | | |
| 400 | Daito Trust Construction Co Ltd Com NPV | 45 | 0.21 |
| Software | | | |
| 300 | Colopl Inc Com NPV | 6 | 0.03 |
| 300 | Oracle Corp Japan Com NPV | 13 | 0.06 |
| Telecommunications | | | |
| 7,476 | KDDI Corp Com NPV | 169 | 0.78 |
| 6,055 | NTT DoCoMo Inc Com NPV | 109 | 0.50 |
| Total Japan | | 479 | 2.21 |
| Jersey | | | |
| Auto parts & equipment | | | |
| 972 | Delphi Automotive Plc Com USD 0.01 | 85 | 0.39 |
| Distribution & wholesale | | | |
| 541 | Wolseley Plc Com GBP 0.1080303 | 33 | 0.15 |
| Oil & gas services | | | |
| 567 | Petrofac Ltd Com USD 0.02 | 8 | 0.04 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 1,680 | Shire Plc Com GBP 0.05 | 144 | 0.66 |
| Total Jersey | | 270 | 1.24 |
| Luxembourg | | | |
| Media | | | |
| 92 | RTL Group SA Com NPV | 8 | 0.04 |
| Metal fabricate/ hardware | | | |
| 711 | Tenaris SA Com USD 1.00 | 10 | 0.04 |
| Total Luxembourg | | 18 | 0.08 |
| Netherlands | | | |
| Aerospace | | | |
| 1,155 | Airbus Group SE Com EUR 1.00 | 78 | 0.36 |
| Chemicals | | | |
| 1,449 | LyondellBasell Industries NV Com USD 0.01 | 147 | 0.68 |
| Engineering & construction | | | |
| 200 | Chicago Bridge & Iron Co NV Com EUR 0.01 | 11 | 0.05 |
| Media | | | |
| 2,447 | Reed Elsevier NV Com EUR 0.07 | 59 | 0.27 |
| Oil & gas services | | | |
| 91 | Core Laboratories NV Com EUR 0.02 | 11 | 0.05 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---------------------------------------|---|--------------|-------------|
| Netherlands (cont) | | | |
| Personal products | | | |
| 5,320 | Unilever NV CVS EUR 0.16 | 226 | 1.04 |
| Total Netherlands | | 532 | 2.45 |
| New Zealand | | | |
| Health care services | | | |
| 1,790 | Ryman Healthcare Ltd Com NPV | 10 | 0.05 |
| Total New Zealand | | 10 | 0.05 |
| Norway | | | |
| Insurance | | | |
| 857 | Gjensidige Forsikring ASA Com NOK 2.00 | 13 | 0.06 |
| Total Norway | | 13 | 0.06 |
| Portugal | | | |
| Food | | | |
| 639 | Jeronimo Martins SGPS SA Com EUR 1.00 | 9 | 0.04 |
| Total Portugal | | 9 | 0.04 |
| Singapore | | | |
| Diversified financial services | | | |
| 4,000 | Singapore Exchange Ltd Com NPV | 25 | 0.11 |
| Engineering & construction | | | |
| 4,000 | Singapore Technologies Engineering Ltd Com NPV | 10 | 0.05 |
| Fixed line telecommunications | | | |
| 37,358 | Singapore Telecommunications Ltd Com NPV | 114 | 0.53 |
| Marine transportation | | | |
| 2,000 | Sembcorp Marine Ltd Com NPV | 5 | 0.02 |
| Total Singapore | | 154 | 0.71 |
| Spain | | | |
| Electricity | | | |
| 2,904 | Endesa SA Com EUR 1.20 | 54 | 0.25 |
| Food | | | |
| 1,832 | Distribuidora Internacional de Alimentacion SA Com EUR 0.10 | 15 | 0.07 |
| Insurance | | | |
| 3,781 | Mapfre SA Com EUR 0.10 | 13 | 0.06 |
| Machinery - diversified | | | |
| 617 | Zardoya Otis SA Com EUR 0.10 | 8 | 0.04 |
| Retail | | | |
| 2,907 | Inditex SA Com EUR 0.03 | 96 | 0.44 |
| Total Spain | | 186 | 0.86 |

(2015年5月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|--|--------------|-------------|
| Equities (cont) | | | |
| Sweden | | | |
| Machinery, construction & mining | | | |
| 1,028 | Atlas Copco AB Class 'B' Com NPV | 1 | 0.00 |
| 1,028 | Atlas Copco AB Class 'B' Com SEK 0.64 | 28 | 0.13 |
| 1,768 | Atlas Copco AB Com NPV | 1 | 0.00 |
| 1,768 | Atlas Copco AB Com SEK 0.64 | 53 | 0.25 |
| Retail | | | |
| 3,026 | Hennes & Mauritz AB Com NPV | 119 | 0.55 |
| Specialty finance | | | |
| 1,060 | Investment AB Kinnevik Com SEK 0.10 | 35 | 0.16 |
| 1,414 | Investor AB Com SEK 6.25 | 56 | 0.26 |
| Total Sweden | | 293 | 1.35 |
| Switzerland | | | |
| Building materials and fixtures | | | |
| 108 | Geberit AG Com CHF 0.10 | 39 | 0.18 |
| 3 | Sika AG Com CHF 0.60 | 10 | 0.05 |
| Chemicals | | | |
| 35 | EMS-Chemie Holding AG Com CHF 0.01 | 15 | 0.07 |
| 10 | Givaudan SA Com CHF 10.00 | 18 | 0.08 |
| 176 | Syngenta AG Com CHF 0.10 | 79 | 0.37 |
| Commercial services | | | |
| 15 | SGS SA Com CHF 1.00 | 29 | 0.13 |
| Diversified financial services | | | |
| 95 | Partners Group Holding AG Com CHF 0.01 | 30 | 0.14 |
| Hand & machine tools | | | |
| 107 | Schindler Holding AG Com CHF 0.10 | 19 | 0.08 |
| 48 | Schindler Holding AG (voting) Com CHF 0.10 | 8 | 0.04 |
| Insurance | | | |
| 1,076 | ACE Ltd Com CHF 24.77 | 114 | 0.53 |
| 503 | Zurich Insurance Group AG Com CHF 0.10 | 160 | 0.73 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 339 | Actelion Ltd Com CHF 0.50 | 47 | 0.22 |
| 1,796 | Roche Holding AG Com NPV | 526 | 2.42 |
| Telecommunications | | | |
| 99 | Swisscom AG Com CHF 1.00 | 57 | 0.26 |
| Transportation | | | |
| 143 | Kuehne & Nagel International AG Com CHF 1.00 | 20 | 0.09 |
| Total Switzerland | | 1,171 | 5.39 |
| United Kingdom | | | |
| Aerospace & defence | | | |
| 6,915 | BAE Systems Plc Com GBP 0.025 | 54 | 0.25 |
| 2,963 | Rolls-Royce Holdings Plc Com GBP 0.20 | 45 | 0.21 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---------------------------------------|--|--------------|------------|
| United Kingdom (cont) | | | |
| Airlines | | | |
| 340 | easyJet Plc Com GBP 0.2728571 | 8 | 0.04 |
| Apparel retailers | | | |
| 1,153 | Burberry Group Plc Com GBP 0.0005 | 30 | 0.14 |
| Auto parts & equipment | | | |
| 2,868 | GKN Plc Com GBP 0.10 | 16 | 0.07 |
| Beverages | | | |
| 4,747 | Diageo Plc Com GBP 0.2893518 | 131 | 0.60 |
| Chemicals | | | |
| 539 | Croda International Plc Com GBP 0.10 | 24 | 0.11 |
| 423 | Johnson Matthey Plc Com GBP 1.047619 | 23 | 0.11 |
| Commercial services | | | |
| 591 | Aggreko Plc Com GBP 0.04832911 | 14 | 0.07 |
| 799 | Bunzl Plc Com GBP 0.3214286 | 23 | 0.11 |
| 1,396 | Capita Plc Com GBP 0.020667 | 27 | 0.12 |
| 408 | Intertek Group Plc Com GBP 0.01 | 16 | 0.07 |
| 3,678 | Reed Elsevier Plc Com GBP 0.144397 | 61 | 0.28 |
| Containers & packaging | | | |
| 1,268 | Rexam Plc Com GBP 0.8035714 | 11 | 0.05 |
| Diversified financial services | | | |
| 4,261 | Aberdeen Asset Management Plc Com GBP 0.10 | 29 | 0.13 |
| 1,728 | Hargreaves Lansdown Plc Com GBP 0.004 | 33 | 0.16 |
| 2,133 | ICAP Plc Com GBP 0.10 | 18 | 0.08 |
| 1,079 | London Stock Exchange Group Plc Com GBP 0.06918605 | 41 | 0.19 |
| 507 | Schroders Plc Com GBP 1.00 | 26 | 0.12 |
| Food | | | |
| 3,856 | Unilever Plc Com GBP 0.0311 | 170 | 0.78 |
| Forest products & paper | | | |
| 433 | Mondi Plc Com EUR 0.20 | 10 | 0.05 |
| Gas distribution | | | |
| 31,429 | Centrica Plc Com GBP 0.061728 | 133 | 0.61 |
| Insurance | | | |
| 1,224 | Admiral Group Plc Com GBP 0.001 | 28 | 0.13 |
| 969 | Aon Plc Com USD 0.01 | 98 | 0.45 |
| 20,337 | Legal & General Group Plc Com GBP 0.025 | 82 | 0.38 |
| 9,090 | Prudential Plc Com GBP 0.05 | 226 | 1.04 |
| Machinery - diversified | | | |
| 443 | Weir Group Plc Com GBP 0.125 | 14 | 0.06 |
| Media | | | |
| 11,761 | ITV Plc Com GBP 0.10 | 49 | 0.22 |
| Mining | | | |
| 2,425 | Rio Tinto Plc Com GBP 0.10 | 106 | 0.49 |

(2015年5月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--------------------------------------|--|--------------|--------------|
| Equities (cont) | | | |
| United Kingdom (cont) | | | |
| Miscellaneous manufacturers | | | |
| 797 | IMI Plc Com GBP 0.2857 | 15 | 0.07 |
| 1,028 | Smiths Group Plc Com GBP 0.375 | 19 | 0.09 |
| Nondurable household products | | | |
| 1,867 | Reckitt Benckiser Group Plc Com GBP 0.10 | 168 | 0.77 |
| Oil & gas | | | |
| 4,656 | BG Group Plc Com GBP 0.10 | 81 | 0.37 |
| Oil & gas services | | | |
| 496 | Amecc Plc Com GBP 0.50 | 7 | 0.03 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 2,600 | AstraZeneca Plc Com USD 0.25 | 173 | 0.80 |
| Restaurants & bars | | | |
| 4,660 | Compass Group Plc Com GBP 0.10625 | 81 | 0.37 |
| Software | | | |
| 1,682 | Sage Group Plc Com GBP 0.01051948 | 15 | 0.07 |
| Tobacco | | | |
| 4,261 | British American Tobacco Plc Com GBP 0.25 | 234 | 1.08 |
| 2,329 | Imperial Tobacco Group Plc Com GBP 0.10 | 120 | 0.55 |
| Total United Kingdom | | 2,459 | 11.32 |
| United States | | | |
| Aerospace & defence | | | |
| 1,851 | Boeing Co Com USD 5.00 | 260 | 1.20 |
| 577 | General Dynamics Corp Com USD 1.00 | 81 | 0.37 |
| 801 | Lockheed Martin Corp Com USD 1.00 | 151 | 0.70 |
| 619 | Raytheon Co Com USD 0.01 | 64 | 0.29 |
| 384 | Rockwell Collins Inc Com USD 0.01 | 36 | 0.17 |
| Apparel retailers | | | |
| 1,570 | Nike Inc Com NPV | 160 | 0.73 |
| Banks | | | |
| 355 | M&T Bank Corp Com USD 0.50 | 43 | 0.20 |
| Beverages | | | |
| 364 | Brown-Forman Corp Com USD 0.15 | 35 | 0.16 |
| 539 | Coca-Cola Enterprises Inc Com USD 0.01 | 24 | 0.11 |
| 472 | Dr Pepper Snapple Group Inc Com USD 0.01 | 36 | 0.17 |
| 503 | Monster Beverage Corp Com USD 0.005 | 64 | 0.29 |
| 3,134 | PepsiCo Inc Com USD 0.017 | 302 | 1.39 |
| Biotechnology | | | |
| 593 | Biogen Inc Com USD 0.0005 | 235 | 1.08 |
| 2,328 | Celgene Corp Com USD 0.01 | 267 | 1.23 |
| 5,384 | Gilead Sciences Inc Com USD 0.001 | 605 | 2.79 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---------------------------------------|---|--------------|------------|
| United States (cont) | | | |
| Chemicals | | | |
| 252 | Albemarle Corp Com USD 0.01 | 15 | 0.07 |
| 339 | Celanese Corp Com USD 0.0001 | 23 | 0.11 |
| 111 | CF Industries Holdings Inc Com USD 0.01 | 35 | 0.16 |
| 279 | Eastman Chemical Co Com USD 0.01 | 21 | 0.10 |
| 251 | FMC Corp Com USD 0.10 | 14 | 0.06 |
| 148 | International Flavors & Fragrances Inc Com USD 0.125 | 18 | 0.08 |
| 220 | PPG Industries Inc Com USD 1.67 | 50 | 0.23 |
| 549 | Praxair Inc Com USD 0.01 | 68 | 0.31 |
| 235 | Sherwin-Williams Co Com USD 1.00 | 68 | 0.31 |
| 271 | Sigma-Aldrich Corp Com USD 1.00 | 38 | 0.18 |
| 79 | Westlake Chemical Corp Com USD 0.01 | 6 | 0.03 |
| Commercial services | | | |
| 731 | Automatic Data Processing Inc Com USD 0.10 | 62 | 0.29 |
| 711 | H&R Block Inc Com NPV | 22 | 0.11 |
| 2,380 | MasterCard Inc Com USD 0.0001 | 220 | 1.01 |
| 383 | Robert Half International Inc Com USD 0.001 | 22 | 0.10 |
| 651 | SEI Investments Co Com USD 0.01 | 31 | 0.14 |
| 299 | Verisk Analytics Inc Com USD 0.001 | 22 | 0.10 |
| Computers | | | |
| 5,854 | Apple Inc Com USD 0.00001 | 763 | 3.51 |
| 1,556 | International Business Machines Corp Com USD 0.20 | 264 | 1.22 |
| 207 | Teradata Corp Com USD 0.01 | 8 | 0.04 |
| Cosmetics & personal care | | | |
| 677 | Estee Lauder Cos Inc Com USD 0.01 | 59 | 0.27 |
| Distribution & wholesale | | | |
| 771 | Fastenal Co Com USD 0.01 | 32 | 0.15 |
| 123 | Fossil Group Inc Com USD 0.01 | 9 | 0.04 |
| 160 | WW Grainger Inc Com USD 0.50 | 38 | 0.17 |
| Diversified financial services | | | |
| 183 | Affiliated Managers Group Inc Com USD 0.01 | 41 | 0.19 |
| 581 | Ameriprise Financial Inc Com USD 0.01 | 72 | 0.33 |
| 440 | BlackRock Inc Com USD 0.01* | 161 | 0.74 |
| 3,841 | Charles Schwab Corp Com USD 0.01 | 122 | 0.56 |
| 663 | Eaton Vance Corp Com USD 0.00390625 | 27 | 0.13 |
| 1,646 | Franklin Resources Inc Com USD 0.10 | 84 | 0.39 |
| 420 | Raymond James Financial Inc Com USD 0.01 | 24 | 0.11 |
| 1,181 | T Rowe Price Group Inc Com USD 0.20 | 95 | 0.44 |
| 1,049 | TD Ameritrade Holding Corp Com USD 0.01 | 39 | 0.18 |
| 3,326 | Visa Inc Com USD 0.0001 | 229 | 1.05 |

(2015年5月31日現在)

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--|---|--------------|------------|
| Equities (cont) | | | |
| United States (cont) | | | |
| Electricity | | | |
| 607 | MDU Resources Group Inc Com USD 1.00 | 13 | 0.06 |
| 1,901 | NextEra Energy Inc Com USD 0.01 | 194 | 0.89 |
| 893 | OGE Energy Corp Com USD 0.01 | 28 | 0.13 |
| 2,131 | Public Service Enterprise Group Inc Com NPV | 91 | 0.42 |
| Electronics | | | |
| 1,549 | Honeywell International Inc Com USD 1.00 | 161 | 0.74 |
| 103 | Mettler-Toledo International Inc Com USD 0.01 | 34 | 0.16 |
| Financial services | | | |
| 1,489 | McGraw Hill Financial Inc Com USD 1.00 | 154 | 0.71 |
| Food | | | |
| 435 | Hershey Co Com USD 1.00 | 41 | 0.19 |
| 579 | Kellogg Co Com USD 0.25 | 36 | 0.17 |
| 1,401 | Kraft Foods Group Inc Com NPV | 118 | 0.54 |
| Healthcare products | | | |
| 255 | CR Bard Inc Com USD 0.25 | 44 | 0.20 |
| 347 | ResMed Inc Com USD 0.004 | 20 | 0.09 |
| 300 | Varian Medical Systems Inc Com USD 1.00 | 26 | 0.12 |
| Household goods & home construction | | | |
| 1,092 | Kimberly-Clark Corp Com USD 1.25 | 119 | 0.55 |
| Insurance | | | |
| 1,648 | Aflac Inc Com USD 0.10 | 102 | 0.47 |
| 283 | Assurant Inc Com USD 0.01 | 19 | 0.09 |
| 3,593 | Berkshire Hathaway Inc Com USD 0.0033 | 514 | 2.37 |
| 809 | Chubb Corp Com USD 1.00 | 79 | 0.36 |
| 1,997 | Marsh & McLennan Cos Inc Com USD 1.00 | 116 | 0.53 |
| 933 | Principal Financial Group Inc Com USD 0.01 | 48 | 0.22 |
| 2,105 | Progressive Corp Com USD 1.00 | 57 | 0.26 |
| 440 | Torchmark Corp Com USD 1.00 | 25 | 0.12 |
| 1,113 | Travelers Cos Inc Com NPV | 113 | 0.52 |
| 420 | WR Berkley Corp Com USD 0.20 | 21 | 0.10 |
| Internet | | | |
| 96 | F5 Networks Inc Com NPV | 12 | 0.06 |
| 115 | Priceline Group Inc Com USD 0.008 | 135 | 0.62 |
| Leisure time | | | |
| 172 | Polaris Industries Inc Com USD 0.01 | 25 | 0.11 |
| Machinery - diversified | | | |
| 360 | Cummins Inc Com USD 2.50 | 49 | 0.23 |
| 324 | Flowserve Corp Com USD 1.25 | 18 | 0.08 |
| 364 | Rockwell Automation Inc Com USD 1.00 | 44 | 0.20 |
| 199 | Wabtec Corp Com USD 0.01 | 20 | 0.09 |

| 保有数 | 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|--------------------------------------|--|--------------|------------|
| United States (cont) | | | |
| Miscellaneous manufacturers | | | |
| 1,640 | 3M Co Com USD 0.01 | 261 | 1.20 |
| 227 | Pall Corp Com USD 0.10 | 28 | 0.13 |
| 79 | SPX Corp Com USD 0.01 | 6 | 0.03 |
| Oil & gas | | | |
| 2,493 | Chevron Corp Com USD 0.75 | 257 | 1.18 |
| 127 | Cimarex Energy Co Com USD 0.01 | 15 | 0.07 |
| 1,497 | ConocoPhillips Com USD 0.01 | 95 | 0.44 |
| 6,729 | Exxon Mobil Corp Com NPV | 573 | 2.64 |
| 180 | Helmerich & Payne Inc Com USD 0.10 | 13 | 0.06 |
| 407 | Marathon Petroleum Corp Com USD 0.01 | 42 | 0.19 |
| 1,100 | Occidental Petroleum Corp Com USD 0.20 | 86 | 0.40 |
| 773 | Phillips 66 Com USD 0.01 | 61 | 0.28 |
| 531 | Southwestern Energy Co Com USD 0.01 | 14 | 0.06 |
| Oil & gas services | | | |
| 404 | FMC Technologies Inc Com USD 0.01 | 17 | 0.08 |
| 1,196 | Halliburton Co Com USD 2.50 | 54 | 0.25 |
| 595 | National Oilwell Varco Inc Com USD 0.01 | 29 | 0.13 |
| 199 | Oceaneering International Inc Com USD 0.25 | 10 | 0.05 |
| Pharmaceuticals | | | |
| 2,167 | Eli Lilly & Co Com NPV | 171 | 0.79 |
| Real estate investment trusts | | | |
| 561 | Public Storage Reits USD 0.10 | 108 | 0.50 |
| Restaurants & bars | | | |
| 2,321 | McDonald's Corp Com USD 0.01 | 223 | 1.03 |
| 4,297 | Starbucks Corp Com USD 0.001 | 223 | 1.03 |
| 1,072 | Yum! Brands Inc Com NPV | 97 | 0.44 |
| Retail | | | |
| 484 | Bed Bath & Beyond Inc Com USD 0.01 | 35 | 0.16 |
| 71 | Chipotle Mexican Grill Inc Com USD 0.01 | 44 | 0.20 |
| 833 | Coach Inc Com USD 0.01 | 29 | 0.14 |
| 553 | Dollar Tree Inc Com USD 0.01 | 41 | 0.19 |
| 219 | Family Dollar Stores Inc Com USD 0.10 | 17 | 0.08 |
| 673 | Gap Inc Com USD 0.05 | 26 | 0.12 |
| 3,478 | Home Depot Inc Com USD 0.05 | 387 | 1.78 |
| 248 | Lululemon Athletica Inc Com USD 0.005 | 15 | 0.07 |
| 296 | Nordstrom Inc Com NPV | 22 | 0.10 |
| 260 | O'Reilly Automotive Inc Com USD 0.01 | 57 | 0.26 |
| 639 | Ross Stores Inc Com USD 0.01 | 62 | 0.29 |
| 2,161 | TJX Cos Inc Com USD 1.00 | 139 | 0.64 |
| 336 | Tractor Supply Co Com USD 0.008 | 29 | 0.13 |
| Semiconductors | | | |
| 403 | Linear Technology Corp Com USD 0.001 | 19 | 0.09 |
| 2,345 | Qualcomm Inc Com USD 0.0001 | 164 | 0.76 |
| 343 | Xilinx Inc Com USD 0.01 | 16 | 0.07 |

(2015年5月31日現在)

| 保有数 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|---------------|--------------|
| Equities (cont) | | |
| United States (cont) | | |
| Software | | |
| 475 Intuit Inc Com USD 0.01 | 49 | 0.23 |
| 12,210 Microsoft Corp Com USD 0.00000625 | 572 | 2.63 |
| 4,941 Oracle Corp Com USD 0.01 | 215 | 0.99 |
| 645 Paychex Inc Com USD 0.01 | 32 | 0.15 |
| Telecommunications | | |
| 128 Harris Corp Com USD 1.00 | 10 | 0.05 |
| Tobacco | | |
| 884 Reynolds American Inc Com USD 0.0001 | 68 | 0.31 |
| Toys | | |
| 757 Mattel Inc Com USD 1.00 | 20 | 0.09 |
| Transportation | | |
| 424 CH Robinson Worldwide Inc Com USD 0.10 | 26 | 0.12 |
| 423 Expeditors International of Washington Inc Com USD 0.01 | 19 | 0.09 |
| 271 JB Hunt Transport Services Inc Com USD 0.01 | 23 | 0.10 |
| 2,001 Union Pacific Corp Com USD 2.50 | 202 | 0.93 |
| Total United States | 12,362 | 56.94 |
| Total equities | 21,448 | 98.78 |

| 契約数 | 原資産 エクスポージャー 千米ドル | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|-------------------------|--------------|---------------|
| Financial derivative instruments | | | |
| Futures contracts | | | |
| 3 Ibx Mini Index Futures June 2015 | 37 | (1) | 0.00 |
| 2 Mini Hang Seng Index Futures June 2015 | 72 | (2) | (0.01) |
| Total unrealised losses on futures contracts | | (3) | (0.01) |
| Total financial derivative instruments | | (3) | (0.01) |

| | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|-----------------------------------|---------------|--------------|
| Total value of investments | 21,445 | 98.77 |
| Cash[†] | 108 | 0.50 |
| Other net assets | 155 | 0.71 |

| 保有数 銘柄 | 公正価値 千米ドル | 純資産 比率% |
|---|---------------|---------------|
| Net assets attributable to redeemable participating shareholders | 21,708 | 99.98 |
| Adjustment to align to the valuation methodology as set out in the prospectus | 4 | 0.02 |
| Net asset value attributable to redeemable participating shareholders at the end of the period | 21,712 | 100.00 |

[†] Cash holdings of \$91,137 are held with State Street Bank and Trust Company. \$17,058 is held as security for futures contracts with Barclays Plc.
* Investment in related party.

Equities are primarily classified by the country of incorporation of the entity in which the Fund holds shares.

Underlying exposure has been calculated according to the guidelines issued by the European Securities and Market Authority ("ESMA") and represents the market value of an equivalent position in the assets underlying each financial derivative instrument.

| 全負債を含めた流動資産合計の分析 | 公正価値 千米ドル | 全流動資産に占める比率% |
|--|---------------|---------------|
| Transferable securities admitted to an official stock exchange listing or traded on a regulated market | 21,448 | 94.61 |
| Other assets | 1,222 | 5.39 |
| Total current assets | 22,670 | 100.00 |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

損益の状況、組入資産の明細は「MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）」の第9期（2015年5月13日～2016年5月12日）の運用報告書から抜粋したものです。

○損益の状況 （2015年5月13日～2016年5月12日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 6,259 |
| 受取利息 | 9,525 |
| 支払利息 | △ 3,266 |
| (B) 有価証券売買損益 | △1,565,383,975 |
| 売買益 | 78,311,458 |
| 売買損 | △1,643,695,433 |
| (C) 信託報酬等 | △ 46,045,898 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △1,611,423,614 |
| (E) 前期繰越損益金 | 2,613,259,158 |
| (F) 追加信託差損益金 | 5,084,818,435 |
| (配当等相当額) | (6,233,586,359) |
| (売買損益相当額) | (△1,148,767,924) |
| (G) 計(D+E+F) | 6,086,653,979 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 6,086,653,979 |
| 追加信託差損益金 | 5,084,818,435 |
| (配当等相当額) | (6,255,645,516) |
| (売買損益相当額) | (△1,170,827,081) |
| 分配準備積立金 | 3,141,282,114 |
| 繰越損益金 | △2,139,446,570 |

- (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) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○組入資産の明細

(2016年5月12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 |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 千口 9,333,697 | 千口 13,634,758 | 千円 26,825,024 |

下記は、外国債券インデックスマザーファンド全体の内容です。
 外国（外貨建）公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 銘柄 | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------|---------------------|---------|-------|-------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | | |
| アメリカ | 国債証券 | 0.5 | 2,800 | 2,795 | 302,985 | 2017/7/31 |
| | 0.625 T-NOTE 170531 | 0.625 | 3,800 | 3,801 | 411,982 | 2017/5/31 |
| | 0.625 T-NOTE 170630 | 0.625 | 2,100 | 2,100 | 227,639 | 2017/6/30 |
| | 0.625 T-NOTE 170731 | 0.625 | 3,500 | 3,500 | 379,295 | 2017/7/31 |
| | 0.625 T-NOTE 170831 | 0.625 | 6,400 | 6,398 | 693,378 | 2017/8/31 |
| | 0.625 T-NOTE 170930 | 0.625 | 5,400 | 5,397 | 584,900 | 2017/9/30 |
| | 0.625 T-NOTE 171130 | 0.625 | 2,800 | 2,797 | 303,151 | 2017/11/30 |
| | 0.625 T-NOTE 180430 | 0.625 | 2,400 | 2,395 | 259,580 | 2018/4/30 |
| | 0.75 T-NOTE 170630 | 0.75 | 2,700 | 2,704 | 293,079 | 2017/6/30 |
| | 0.75 T-NOTE 171031 | 0.75 | 5,500 | 5,505 | 596,663 | 2017/10/31 |
| | 0.75 T-NOTE 171231 | 0.75 | 3,100 | 3,101 | 336,156 | 2017/12/31 |
| | 0.75 T-NOTE 180131 | 0.75 | 2,000 | 2,001 | 216,900 | 2018/1/31 |
| | 0.75 T-NOTE 180228 | 0.75 | 4,000 | 4,002 | 433,767 | 2018/2/28 |
| | 0.75 T-NOTE 180331 | 0.75 | 2,900 | 2,901 | 314,481 | 2018/3/31 |
| | 0.75 T-NOTE 180415 | 0.75 | 1,800 | 1,800 | 195,165 | 2018/4/15 |
| | 0.75 T-NOTE 190215 | 0.75 | 3,000 | 2,992 | 324,309 | 2019/2/15 |
| | 0.875 T-NOTE 170430 | 0.875 | 3,800 | 3,812 | 413,141 | 2017/4/30 |
| | 0.875 T-NOTE 170515 | 0.875 | 2,800 | 2,809 | 304,419 | 2017/5/15 |
| | 0.875 T-NOTE 170615 | 0.875 | 2,700 | 2,708 | 293,501 | 2017/6/15 |
| | 0.875 T-NOTE 170715 | 0.875 | 1,800 | 1,805 | 195,660 | 2017/7/15 |
| | 0.875 T-NOTE 170815 | 0.875 | 1,600 | 1,604 | 173,913 | 2017/8/15 |
| | 0.875 T-NOTE 171015 | 0.875 | 1,800 | 1,805 | 195,637 | 2017/10/15 |
| | 0.875 T-NOTE 171115 | 0.875 | 2,300 | 2,306 | 249,961 | 2017/11/15 |
| | 0.875 T-NOTE 171130 | 0.875 | 2,100 | 2,105 | 228,190 | 2017/11/30 |
| | 0.875 T-NOTE 180115 | 0.875 | 1,400 | 1,403 | 152,138 | 2018/1/15 |
| | 0.875 T-NOTE 180131 | 0.875 | 2,300 | 2,306 | 249,981 | 2018/1/31 |
| | 0.875 T-NOTE 180331 | 0.875 | 400 | 401 | 43,474 | 2018/3/31 |
| | 0.875 T-NOTE 180715 | 0.875 | 2,200 | 2,205 | 239,000 | 2018/7/15 |
| | 0.875 T-NOTE 181015 | 0.875 | 3,600 | 3,606 | 390,878 | 2018/10/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190415 | 0.875 | 2,800 | 2,800 | 303,518 | 2019/4/15 |
| | 0.875 T-NOTE 190731 | 0.875 | 900 | 899 | 97,456 | 2019/7/31 |
| | 1 T-NOTE 170915 | 1.0 | 3,600 | 3,616 | 391,945 | 2017/9/15 |
| | 1 T-NOTE 171215 | 1.0 | 3,600 | 3,617 | 391,975 | 2017/12/15 |
| | 1 T-NOTE 171231 | 1.0 | 2,200 | 2,210 | 239,559 | 2017/12/31 |
| | 1 T-NOTE 180215 | 1.0 | 1,600 | 1,608 | 174,265 | 2018/2/15 |
| | 1 T-NOTE 180315 | 1.0 | 2,100 | 2,111 | 228,777 | 2018/3/15 |
| | 1 T-NOTE 180515 | 1.0 | 2,200 | 2,211 | 239,652 | 2018/5/15 |
| | 1 T-NOTE 180531 | 1.0 | 2,700 | 2,714 | 294,153 | 2018/5/31 |
| | 1 T-NOTE 180815 | 1.0 | 3,000 | 3,015 | 326,773 | 2018/8/15 |
| | 1 T-NOTE 180915 | 1.0 | 2,600 | 2,613 | 283,225 | 2018/9/15 |
| | 1 T-NOTE 190315 | 1.0 | 1,500 | 1,506 | 163,221 | 2019/3/15 |
| | 1 T-NOTE 190630 | 1.0 | 2,000 | 2,007 | 217,527 | 2019/6/30 |
| | 1 T-NOTE 190831 | 1.0 | 1,000 | 1,002 | 108,628 | 2019/8/31 |
| | 1 T-NOTE 190930 | 1.0 | 1,800 | 1,803 | 195,492 | 2019/9/30 |
| | 1 T-NOTE 191130 | 1.0 | 1,800 | 1,801 | 195,233 | 2019/11/30 |
| | 1.125 T-NOTE 180615 | 1.125 | 2,200 | 2,217 | 240,304 | 2018/6/15 |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|---------------------|-------|---------------------|---------|---------|-----------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | |
| アメリカ | 国債証券 | 1.125 T-NOTE 190115 | 1.125 | 1,800 | 1,814 | 196,597 | 2019/1/15 |
| | | 1.125 T-NOTE 190531 | 1.125 | 1,600 | 1,612 | 174,733 | 2019/5/31 |
| | | 1.125 T-NOTE 191231 | 1.125 | 2,600 | 2,612 | 283,104 | 2019/12/31 |
| | | 1.125 T-NOTE 200331 | 1.125 | 2,000 | 2,007 | 217,501 | 2020/3/31 |
| | | 1.125 T-NOTE 200430 | 1.125 | 2,700 | 2,708 | 293,490 | 2020/4/30 |
| | | 1.125 T-NOTE 210228 | 1.125 | 3,300 | 3,292 | 356,754 | 2021/2/28 |
| | | 1.25 T-NOTE 181031 | 1.25 | 2,400 | 2,426 | 262,953 | 2018/10/31 |
| | | 1.25 T-NOTE 181115 | 1.25 | 3,100 | 3,134 | 339,634 | 2018/11/15 |
| | | 1.25 T-NOTE 181130 | 1.25 | 2,500 | 2,527 | 273,909 | 2018/11/30 |
| | | 1.25 T-NOTE 181215 | 1.25 | 2,000 | 2,022 | 219,169 | 2018/12/15 |
| | | 1.25 T-NOTE 190131 | 1.25 | 2,400 | 2,426 | 262,993 | 2019/1/31 |
| | | 1.25 T-NOTE 190430 | 1.25 | 1,500 | 1,517 | 164,421 | 2019/4/30 |
| | | 1.25 T-NOTE 191031 | 1.25 | 2,800 | 2,828 | 306,529 | 2019/10/31 |
| | | 1.25 T-NOTE 200131 | 1.25 | 3,500 | 3,530 | 382,554 | 2020/1/31 |
| | | 1.25 T-NOTE 200229 | 1.25 | 1,800 | 1,814 | 196,673 | 2020/2/29 |
| | | 1.25 T-NOTE 210331 | 1.25 | 2,300 | 2,305 | 249,854 | 2021/3/31 |
| | | 1.375 T-NOTE 180630 | 1.375 | 1,600 | 1,621 | 175,728 | 2018/6/30 |
| | | 1.375 T-NOTE 180731 | 1.375 | 2,000 | 2,027 | 219,669 | 2018/7/31 |
| | | 1.375 T-NOTE 180930 | 1.375 | 2,500 | 2,535 | 274,777 | 2018/9/30 |
| | | 1.375 T-NOTE 181130 | 1.375 | 1,200 | 1,217 | 131,898 | 2018/11/30 |
| | | 1.375 T-NOTE 181231 | 1.375 | 2,000 | 2,029 | 219,931 | 2018/12/31 |
| | | 1.375 T-NOTE 190228 | 1.375 | 2,100 | 2,131 | 230,963 | 2019/2/28 |
| | | 1.375 T-NOTE 200131 | 1.375 | 2,300 | 2,330 | 252,600 | 2020/1/31 |
| | | 1.375 T-NOTE 200229 | 1.375 | 2,800 | 2,835 | 307,252 | 2020/2/29 |
| | | 1.375 T-NOTE 200331 | 1.375 | 2,800 | 2,834 | 307,205 | 2020/3/31 |
| | | 1.375 T-NOTE 200430 | 1.375 | 3,700 | 3,744 | 405,793 | 2020/4/30 |
| | | 1.375 T-NOTE 200531 | 1.375 | 2,400 | 2,428 | 263,196 | 2020/5/31 |
| | | 1.375 T-NOTE 200831 | 1.375 | 3,100 | 3,132 | 339,463 | 2020/8/31 |
| | | 1.375 T-NOTE 200930 | 1.375 | 3,500 | 3,534 | 383,058 | 2020/9/30 |
| | | 1.375 T-NOTE 201031 | 1.375 | 2,500 | 2,524 | 273,528 | 2020/10/31 |
| | | 1.375 T-NOTE 210131 | 1.375 | 3,500 | 3,530 | 382,584 | 2021/1/31 |
| | | 1.5 T-NOTE 180831 | 1.5 | 3,600 | 3,660 | 396,715 | 2018/8/31 |
| | | 1.5 T-NOTE 181231 | 1.5 | 2,900 | 2,951 | 319,846 | 2018/12/31 |
| | | 1.5 T-NOTE 190131 | 1.5 | 2,900 | 2,952 | 319,920 | 2019/1/31 |
| | | 1.5 T-NOTE 190228 | 1.5 | 2,600 | 2,647 | 286,890 | 2019/2/28 |
| | | 1.5 T-NOTE 190331 | 1.5 | 1,000 | 1,018 | 110,389 | 2019/3/31 |
| | | 1.5 T-NOTE 190531 | 1.5 | 2,800 | 2,852 | 309,137 | 2019/5/31 |
| | | 1.5 T-NOTE 191031 | 1.5 | 3,100 | 3,156 | 342,062 | 2019/10/31 |
| | | 1.5 T-NOTE 191130 | 1.5 | 3,100 | 3,155 | 342,009 | 2019/11/30 |
| | | 1.5 T-NOTE 200531 | 1.5 | 3,200 | 3,252 | 352,473 | 2020/5/31 |
| | | 1.5 T-NOTE 220131 | 1.5 | 3,500 | 3,530 | 382,643 | 2022/1/31 |
| 1.5 T-NOTE 230228 | 1.5 | 2,400 | 2,400 | 260,169 | 2023/2/28 | | |
| 1.5 T-NOTE 230331 | 1.5 | 2,200 | 2,199 | 238,376 | 2023/3/31 | | |
| 1.625 T-NOTE 190331 | 1.625 | 3,000 | 3,065 | 332,247 | 2019/3/31 | | |
| 1.625 T-NOTE 190430 | 1.625 | 2,100 | 2,146 | 232,626 | 2019/4/30 | | |
| 1.625 T-NOTE 190630 | 1.625 | 2,600 | 2,659 | 288,189 | 2019/6/30 | | |
| 1.625 T-NOTE 190731 | 1.625 | 1,700 | 1,738 | 188,431 | 2019/7/31 | | |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 当 | 期 | 末 | | 償還年月日 | | |
|------|---------------------|---------|---------|-------|---------|------------|--------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | | 評 価 額 | |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | | |
| アメリカ | | | | | | | |
| 国債証券 | 1.625 T-NOTE 190831 | 1.625 | 3,100 | 3,170 | 343,584 | 2019/8/31 | |
| | 1.625 T-NOTE 191231 | 1.625 | 2,700 | 2,759 | 299,091 | 2019/12/31 | |
| | 1.625 T-NOTE 200630 | 1.625 | 3,000 | 3,063 | 331,967 | 2020/6/30 | |
| | 1.625 T-NOTE 200731 | 1.625 | 3,800 | 3,879 | 420,460 | 2020/7/31 | |
| | 1.625 T-NOTE 201130 | 1.625 | 3,700 | 3,777 | 409,395 | 2020/11/30 | |
| | 1.625 T-NOTE 220815 | 1.625 | 1,700 | 1,721 | 186,546 | 2022/8/15 | |
| | 1.625 T-NOTE 221115 | 1.625 | 2,900 | 2,931 | 317,661 | 2022/11/15 | |
| | 1.625 T-NOTE 260215 | 1.625 | 5,500 | 5,445 | 590,074 | 2026/2/15 | |
| | 1.75 T-NOTE 181031 | 1.75 | 500 | 511 | 55,465 | 2018/10/31 | |
| | 1.75 T-NOTE 190930 | 1.75 | 2,800 | 2,875 | 311,590 | 2019/9/30 | |
| | 1.75 T-NOTE 201031 | 1.75 | 3,500 | 3,590 | 389,103 | 2020/10/31 | |
| | 1.75 T-NOTE 201231 | 1.75 | 2,700 | 2,769 | 300,165 | 2020/12/31 | |
| | 1.75 T-NOTE 220228 | 1.75 | 2,700 | 2,758 | 298,976 | 2022/2/28 | |
| | 1.75 T-NOTE 220331 | 1.75 | 2,600 | 2,655 | 287,793 | 2022/3/31 | |
| | 1.75 T-NOTE 220430 | 1.75 | 2,800 | 2,858 | 309,765 | 2022/4/30 | |
| | 1.75 T-NOTE 220515 | 1.75 | 2,500 | 2,551 | 276,555 | 2022/5/15 | |
| | 1.75 T-NOTE 220930 | 1.75 | 2,300 | 2,342 | 253,827 | 2022/9/30 | |
| | 1.75 T-NOTE 230131 | 1.75 | 2,500 | 2,541 | 275,475 | 2023/1/31 | |
| | 1.75 T-NOTE 230515 | 1.75 | 4,300 | 4,372 | 473,891 | 2023/5/15 | |
| | 1.875 T-NOTE 170831 | 1.875 | 1,900 | 1,930 | 209,176 | 2017/8/31 | |
| | 1.875 T-NOTE 170930 | 1.875 | 1,700 | 1,728 | 187,294 | 2017/9/30 | |
| | 1.875 T-NOTE 171031 | 1.875 | 2,500 | 2,543 | 275,655 | 2017/10/31 | |
| | 1.875 T-NOTE 200630 | 1.875 | 1,800 | 1,857 | 201,245 | 2020/6/30 | |
| | 1.875 T-NOTE 211130 | 1.875 | 2,800 | 2,885 | 312,657 | 2021/11/30 | |
| | 1.875 T-NOTE 220531 | 1.875 | 2,900 | 2,980 | 323,013 | 2022/5/31 | |
| | 1.875 T-NOTE 220831 | 1.875 | 2,200 | 2,257 | 244,690 | 2022/8/31 | |
| | 1.875 T-NOTE 221031 | 1.875 | 3,700 | 3,795 | 411,337 | 2022/10/31 | |
| | 2 T-NOTE 200731 | 2.0 | 1,400 | 1,450 | 157,229 | 2020/7/31 | |
| | 2 T-NOTE 200930 | 2.0 | 1,600 | 1,659 | 179,840 | 2020/9/30 | |
| | 2 T-NOTE 201130 | 2.0 | 1,300 | 1,348 | 146,097 | 2020/11/30 | |
| | 2 T-NOTE 210228 | 2.0 | 2,400 | 2,489 | 269,800 | 2021/2/28 | |
| | 2 T-NOTE 210531 | 2.0 | 2,200 | 2,282 | 247,391 | 2021/5/31 | |
| | 2 T-NOTE 210831 | 2.0 | 2,400 | 2,489 | 269,800 | 2021/8/31 | |
| | 2 T-NOTE 211031 | 2.0 | 2,500 | 2,592 | 280,915 | 2021/10/31 | |
| | 2 T-NOTE 211115 | 2.0 | 3,900 | 4,044 | 438,327 | 2021/11/15 | |
| | 2 T-NOTE 220215 | 2.0 | 2,900 | 3,006 | 325,812 | 2022/2/15 | |
| | 2 T-NOTE 220731 | 2.0 | 2,100 | 2,172 | 235,399 | 2022/7/31 | |
| | 2 T-NOTE 221130 | 2.0 | 2,500 | 2,583 | 279,920 | 2022/11/30 | |
| | 2 T-NOTE 230215 | 2.0 | 4,400 | 4,548 | 492,958 | 2023/2/15 | |
| | 2 T-NOTE 250215 | 2.0 | 5,700 | 5,849 | 633,923 | 2025/2/15 | |
| | 2 T-NOTE 250815 | 2.0 | 5,900 | 6,045 | 655,167 | 2025/8/15 | |
| | 2.125 T-NOTE 200831 | 2.125 | 3,000 | 3,124 | 338,647 | 2020/8/31 | |
| | 2.125 T-NOTE 210131 | 2.125 | 2,300 | 2,398 | 259,961 | 2021/1/31 | |
| | 2.125 T-NOTE 210630 | 2.125 | 2,300 | 2,401 | 260,233 | 2021/6/30 | |
| | 2.125 T-NOTE 210815 | 2.125 | 3,300 | 3,444 | 373,322 | 2021/8/15 | |
| | 2.125 T-NOTE 210930 | 2.125 | 2,500 | 2,608 | 282,735 | 2021/9/30 | |
| | 2.125 T-NOTE 211231 | 2.125 | 2,800 | 2,921 | 316,640 | 2021/12/31 | |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | | 償還年月日 | |
|------|---------------------|---------|---------|-------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | |
| アメリカ | | | | | | |
| 国債証券 | 2.125 T-NOTE 220630 | 2.125 | 2,600 | 2,708 | 293,538 | 2022/6/30 |
| | 2.125 T-NOTE 221231 | 2.125 | 2,700 | 2,811 | 304,668 | 2022/12/31 |
| | 2.125 T-NOTE 250515 | 2.125 | 5,800 | 6,008 | 651,134 | 2025/5/15 |
| | 2.25 T-NOTE 171130 | 2.25 | 2,600 | 2,663 | 288,596 | 2017/11/30 |
| | 2.25 T-NOTE 180731 | 2.25 | 800 | 826 | 89,547 | 2018/7/31 |
| | 2.25 T-NOTE 210331 | 2.25 | 2,000 | 2,099 | 227,509 | 2021/3/31 |
| | 2.25 T-NOTE 210430 | 2.25 | 2,800 | 2,939 | 318,536 | 2021/4/30 |
| | 2.25 T-NOTE 210731 | 2.25 | 2,300 | 2,415 | 261,733 | 2021/7/31 |
| | 2.25 T-NOTE 241115 | 2.25 | 5,900 | 6,179 | 669,703 | 2024/11/15 |
| | 2.25 T-NOTE 251115 | 2.25 | 6,300 | 6,588 | 714,040 | 2025/11/15 |
| | 2.375 T-NOTE 170731 | 2.375 | 2,900 | 2,961 | 320,914 | 2017/7/31 |
| | 2.375 T-NOTE 180531 | 2.375 | 1,300 | 1,343 | 145,553 | 2018/5/31 |
| | 2.375 T-NOTE 180630 | 2.375 | 1,000 | 1,034 | 112,120 | 2018/6/30 |
| | 2.375 T-NOTE 201231 | 2.375 | 1,500 | 1,580 | 171,305 | 2020/12/31 |
| | 2.375 T-NOTE 240815 | 2.375 | 5,900 | 6,239 | 676,197 | 2024/8/15 |
| | 2.5 T-BOND 450215 | 2.5 | 3,400 | 3,343 | 362,297 | 2045/2/15 |
| | 2.5 T-BOND 460215 | 2.5 | 3,400 | 3,343 | 362,355 | 2046/2/15 |
| | 2.5 T-NOTE 170630 | 2.5 | 2,400 | 2,451 | 265,645 | 2017/6/30 |
| | 2.5 T-NOTE 230815 | 2.5 | 3,700 | 3,952 | 428,347 | 2023/8/15 |
| | 2.5 T-NOTE 240515 | 2.5 | 5,800 | 6,195 | 671,365 | 2024/5/15 |
| | 2.625 T-NOTE 180131 | 2.625 | 1,500 | 1,549 | 167,882 | 2018/1/31 |
| | 2.625 T-NOTE 180430 | 2.625 | 1,500 | 1,556 | 168,638 | 2018/4/30 |
| | 2.625 T-NOTE 200815 | 2.625 | 2,500 | 2,655 | 287,815 | 2020/8/15 |
| | 2.625 T-NOTE 201115 | 2.625 | 4,200 | 4,469 | 484,330 | 2020/11/15 |
| | 2.75 T-BOND 420815 | 2.75 | 2,100 | 2,192 | 237,604 | 2042/8/15 |
| | 2.75 T-BOND 421115 | 2.75 | 3,400 | 3,543 | 384,031 | 2042/11/15 |
| | 2.75 T-NOTE 170531 | 2.75 | 1,100 | 1,124 | 121,898 | 2017/5/31 |
| | 2.75 T-NOTE 171231 | 2.75 | 1,700 | 1,756 | 190,374 | 2017/12/31 |
| | 2.75 T-NOTE 180228 | 2.75 | 1,500 | 1,554 | 168,441 | 2018/2/28 |
| | 2.75 T-NOTE 190215 | 2.75 | 1,300 | 1,368 | 148,337 | 2019/2/15 |
| | 2.75 T-NOTE 231115 | 2.75 | 5,800 | 6,302 | 683,052 | 2023/11/15 |
| | 2.75 T-NOTE 240215 | 2.75 | 4,400 | 4,781 | 518,215 | 2024/2/15 |
| | 2.875 T-BOND 430515 | 2.875 | 4,200 | 4,472 | 484,667 | 2043/5/15 |
| | 2.875 T-BOND 450815 | 2.875 | 3,400 | 3,609 | 391,141 | 2045/8/15 |
| | 2.875 T-NOTE 180331 | 2.875 | 1,400 | 1,456 | 157,863 | 2018/3/31 |
| | 3 T-BOND 420515 | 3.0 | 1,500 | 1,642 | 178,010 | 2042/5/15 |
| | 3 T-BOND 441115 | 3.0 | 3,300 | 3,592 | 389,359 | 2044/11/15 |
| | 3 T-BOND 450515 | 3.0 | 3,900 | 4,244 | 459,987 | 2045/5/15 |
| | 3 T-BOND 451115 | 3.0 | 3,200 | 3,481 | 377,317 | 2045/11/15 |
| | 3.125 T-BOND 411115 | 3.125 | 1,100 | 1,234 | 133,828 | 2041/11/15 |
| | 3.125 T-BOND 420215 | 3.125 | 1,500 | 1,683 | 182,391 | 2042/2/15 |
| | 3.125 T-BOND 430215 | 3.125 | 3,500 | 3,914 | 424,188 | 2043/2/15 |
| | 3.125 T-BOND 440815 | 3.125 | 3,200 | 3,571 | 386,989 | 2044/8/15 |
| | 3.125 T-NOTE 170430 | 3.125 | 2,100 | 2,151 | 233,204 | 2017/4/30 |
| | 3.125 T-NOTE 190515 | 3.125 | 2,700 | 2,882 | 312,406 | 2019/5/15 |
| | 3.125 T-NOTE 210515 | 3.125 | 2,200 | 2,402 | 260,392 | 2021/5/15 |
| | 3.375 T-BOND 440515 | 3.375 | 3,900 | 4,559 | 494,063 | 2044/5/15 |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|----------------------|--|-------|---------|---------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| 国債証券 | 3.375 T-NOTE 191115 | | 3.375 | 3,300 | 3,575 | 387,460 | 2019/11/15 |
| | 3.5 T-BOND 390215 | | 3.5 | 1,000 | 1,201 | 130,255 | 2039/2/15 |
| | 3.5 T-NOTE 180215 | | 3.5 | 1,600 | 1,678 | 181,865 | 2018/2/15 |
| | 3.5 T-NOTE 200515 | | 3.5 | 2,400 | 2,629 | 284,918 | 2020/5/15 |
| | 3.625 T-BOND 430815 | | 3.625 | 4,500 | 5,512 | 597,427 | 2043/8/15 |
| | 3.625 T-BOND 440215 | | 3.625 | 3,600 | 4,404 | 477,363 | 2044/2/15 |
| | 3.625 T-NOTE 190815 | | 3.625 | 1,700 | 1,848 | 200,363 | 2019/8/15 |
| | 3.625 T-NOTE 200215 | | 3.625 | 4,700 | 5,158 | 558,999 | 2020/2/15 |
| | 3.625 T-NOTE 210215 | | 3.625 | 3,700 | 4,115 | 445,984 | 2021/2/15 |
| | 3.75 T-BOND 410815 | | 3.75 | 1,300 | 1,615 | 175,066 | 2041/8/15 |
| | 3.75 T-BOND 431115 | | 3.75 | 3,600 | 4,510 | 488,823 | 2043/11/15 |
| | 3.75 T-NOTE 181115 | | 3.75 | 2,800 | 3,006 | 325,790 | 2018/11/15 |
| | 3.875 T-BOND 400815 | | 3.875 | 1,400 | 1,771 | 191,958 | 2040/8/15 |
| | 3.875 T-NOTE 180515 | | 3.875 | 1,400 | 1,489 | 161,419 | 2018/5/15 |
| | 4 T-NOTE 180815 | | 4.0 | 900 | 967 | 104,855 | 2018/8/15 |
| | 4.25 T-BOND 390515 | | 4.25 | 800 | 1,068 | 115,820 | 2039/5/15 |
| | 4.25 T-BOND 401115 | | 4.25 | 1,400 | 1,870 | 202,745 | 2040/11/15 |
| | 4.25 T-NOTE 171115 | | 4.25 | 1,500 | 1,580 | 171,273 | 2017/11/15 |
| | 4.375 T-BOND 380215 | | 4.375 | 500 | 681 | 73,860 | 2038/2/15 |
| | 4.375 T-BOND 391115 | | 4.375 | 1,300 | 1,765 | 191,323 | 2039/11/15 |
| | 4.375 T-BOND 400515 | | 4.375 | 1,300 | 1,765 | 191,367 | 2040/5/15 |
| | 4.375 T-BOND 410515 | | 4.375 | 1,700 | 2,316 | 251,055 | 2041/5/15 |
| | 4.5 T-BOND 360215 | | 4.5 | 1,300 | 1,797 | 194,845 | 2036/2/15 |
| | 4.5 T-BOND 380515 | | 4.5 | 800 | 1,108 | 120,134 | 2038/5/15 |
| | 4.5 T-BOND 390815 | | 4.5 | 1,100 | 1,520 | 164,775 | 2039/8/15 |
| | 4.5 T-NOTE 170515 | | 4.5 | 1,100 | 1,143 | 123,900 | 2017/5/15 |
| | 4.625 T-BOND 400215 | | 4.625 | 1,800 | 2,529 | 274,159 | 2040/2/15 |
| | 4.75 T-BOND 410215 | | 4.75 | 1,600 | 2,292 | 248,478 | 2041/2/15 |
| | 4.75 T-NOTE 170815 | | 4.75 | 2,400 | 2,524 | 273,569 | 2017/8/15 |
| | 5 T-BOND 370515 | | 5.0 | 600 | 884 | 95,856 | 2037/5/15 |
| | 5.25 T-BOND 281115 | | 5.25 | 900 | 1,235 | 133,925 | 2028/11/15 |
| | 5.25 T-BOND 290215 | | 5.25 | 700 | 964 | 104,560 | 2029/2/15 |
| | 5.375 T-BOND 310215 | | 5.375 | 1,100 | 1,582 | 171,443 | 2031/2/15 |
| | 5.5 T-BOND 280815 | | 5.5 | 600 | 837 | 90,751 | 2028/8/15 |
| | 6 T-BOND 260215 | | 6.0 | 700 | 971 | 105,319 | 2026/2/15 |
| | 6.125 T-BOND 271115 | | 6.125 | 650 | 939 | 101,800 | 2027/11/15 |
| | 6.25 T-BOND 230815 | | 6.25 | 600 | 797 | 86,403 | 2023/8/15 |
| | 6.25 T-BOND 300515 | | 6.25 | 700 | 1,070 | 116,040 | 2030/5/15 |
| | 6.5 T-BOND 261115 | | 6.5 | 500 | 728 | 78,902 | 2026/11/15 |
| | 8 T-BOND 211115 | | 8.0 | 1,200 | 1,629 | 176,616 | 2021/11/15 |
| | 8.125 T-BOND 190815 | | 8.125 | 600 | 738 | 80,053 | 2019/8/15 |
| | 8.75 T-BOND 170515 | | 8.75 | 1,500 | 1,624 | 176,041 | 2017/5/15 |
| | 8.75 T-BOND 200815 | | 8.75 | 700 | 922 | 99,997 | 2020/8/15 |
| | 8.875 T-BOND 190215 | | 8.875 | 1,000 | 1,221 | 132,325 | 2019/2/15 |
| 小 計 | | | | | | 65,707,749 | |
| カナダ | | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 170501 | | 0.25 | 800 | 797 | 67,281 | 2017/5/1 |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 当期末 | | | | | | |
|------|--------------------------|------|---------|---------|-----------|------------|--|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| カナダ | | % | 千カナダドル | 千カナダドル | 千円 | | |
| 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 171101 | 0.25 | 1,100 | 1,095 | 92,378 | 2017/11/1 | |
| | 0.25 CAN GOVT 180501 | 0.25 | 800 | 795 | 67,092 | 2018/5/1 | |
| | 0.75 CAN GOVT 200901 | 0.75 | 1,300 | 1,307 | 110,228 | 2020/9/1 | |
| | 0.75 CAN GOVT 210301 | 0.75 | 1,300 | 1,304 | 110,023 | 2021/3/1 | |
| | 0.75 CAN GOVT 210901 | 0.75 | 400 | 400 | 33,735 | 2021/9/1 | |
| | 1.25 CAN GOVT 170801 | 1.25 | 1,500 | 1,513 | 127,592 | 2017/8/1 | |
| | 1.25 CAN GOVT 180201 | 1.25 | 1,600 | 1,619 | 136,580 | 2018/2/1 | |
| | 1.25 CAN GOVT 180301 | 1.25 | 900 | 911 | 76,891 | 2018/3/1 | |
| | 1.25 CAN GOVT 180901 | 1.25 | 1,100 | 1,118 | 94,311 | 2018/9/1 | |
| | 1.5 CAN GOVT 170901 | 1.5 | 1,100 | 1,113 | 93,924 | 2017/9/1 | |
| | 1.5 CAN GOVT 200301 | 1.5 | 700 | 723 | 61,043 | 2020/3/1 | |
| | 1.5 CAN GOVT 230601 | 1.5 | 1,200 | 1,243 | 104,873 | 2023/6/1 | |
| | 1.5 CAN GOVT 260601 | 1.5 | 1,100 | 1,120 | 94,530 | 2026/6/1 | |
| | 1.75 CAN GOVT 190301 | 1.75 | 900 | 930 | 78,492 | 2019/3/1 | |
| | 1.75 CAN GOVT 190901 | 1.75 | 900 | 934 | 78,833 | 2019/9/1 | |
| | 2.25 CAN GOVT 250601 | 2.25 | 1,100 | 1,199 | 101,154 | 2025/6/1 | |
| | 2.5 CAN GOVT 240601 | 2.5 | 1,350 | 1,496 | 126,196 | 2024/6/1 | |
| | 2.75 CAN GOVT 220601 | 2.75 | 1,200 | 1,334 | 112,507 | 2022/6/1 | |
| | 2.75 CAN GOVT 481201 | 2.75 | 650 | 769 | 64,888 | 2048/12/1 | |
| | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 2.75 | 350 | 439 | 37,051 | 2064/12/1 | |
| | 3.25 CAN GOVT 210601 | 3.25 | 1,000 | 1,126 | 94,968 | 2021/6/1 | |
| | 3.5 CAN GOVT 200601 | 3.5 | 1,200 | 1,338 | 112,863 | 2020/6/1 | |
| | 3.5 CAN GOVT 451201 | 3.5 | 1,400 | 1,882 | 158,734 | 2045/12/1 | |
| | 3.75 CAN GOVT 190601 | 3.75 | 1,600 | 1,753 | 147,889 | 2019/6/1 | |
| | 4 CAN GOVT 170601 | 4.0 | 950 | 984 | 83,025 | 2017/6/1 | |
| | 4 CAN GOVT 410601 | 4.0 | 1,500 | 2,096 | 176,821 | 2041/6/1 | |
| | 4.25 CAN GOVT 180601 | 4.25 | 1,100 | 1,183 | 99,808 | 2018/6/1 | |
| | 5 CAN GOVT 370601 | 5.0 | 1,150 | 1,754 | 147,985 | 2037/6/1 | |
| | 5.75 CAN GOVT 290601 | 5.75 | 950 | 1,413 | 119,164 | 2029/6/1 | |
| | 5.75 CAN GOVT 330601 | 5.75 | 1,200 | 1,887 | 159,180 | 2033/6/1 | |
| | 8 CAN GOVT 270601 | 8.0 | 300 | 502 | 42,355 | 2027/6/1 | |
| 小計 | | | | | 3,212,411 | | |
| メキシコ | | | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | |
| 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 241205 | 10.0 | 22,400 | 28,726 | 173,220 | 2024/12/5 | |
| | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 10.0 | 5,200 | 7,219 | 43,533 | 2036/11/20 | |
| | 4.75 MEXICAN BONO 180614 | 4.75 | 17,700 | 17,787 | 107,258 | 2018/6/14 | |
| | 5 MEXICAN BONOS 170615 | 5.0 | 9,700 | 9,794 | 59,061 | 2017/6/15 | |
| | 5 MEXICAN BONOS 191211 | 5.0 | 12,700 | 12,658 | 76,330 | 2019/12/11 | |
| | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 5.75 | 5,200 | 5,134 | 30,962 | 2026/3/5 | |
| | 6.5 MEXICAN BONOS 210610 | 6.5 | 20,900 | 21,925 | 132,209 | 2021/6/10 | |
| | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 6.5 | 9,700 | 10,160 | 61,265 | 2022/6/9 | |
| | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 7.5 | 7,700 | 8,575 | 51,707 | 2027/6/3 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 171214 | 7.75 | 14,300 | 15,120 | 91,179 | 2017/12/14 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 7.75 | 12,200 | 13,782 | 83,108 | 2031/5/29 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 7.75 | 7,400 | 8,367 | 50,453 | 2034/11/23 | |
| | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 7.75 | 12,800 | 14,575 | 87,888 | 2042/11/13 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 200611 | 8.0 | 10,900 | 12,025 | 72,513 | 2020/6/11 | |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 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 | | | |
| メキシコ | | % | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円 | | |
| 国債証券 | 8 MEXICAN BONOS 231207 | 8.0 | 8,200 | 9,328 | 56,252 | 2023/12/7 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 181213 | 8.5 | 23,400 | 25,565 | 154,162 | 2018/12/13 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5 | 9,100 | 10,924 | 65,875 | 2029/5/31 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 8.5 | 10,100 | 12,326 | 74,331 | 2038/11/18 | |
| 小計 | | | | | 1,471,314 | | |
| ユーロ | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| ドイツ | 国債証券 | 0 OBL 200417 | — | 1,700 | 1,732 | 214,455 | 2020/4/17 |
| | | 0 OBL 210409 | — | 1,200 | 1,222 | 151,409 | 2021/4/9 |
| | | 0 SCHATS 170616 | — | 1,400 | 1,407 | 174,287 | 2017/6/16 |
| | | 0 SCHATS 170915 | — | 1,300 | 1,309 | 162,071 | 2017/9/15 |
| | | 0 SCHATS 171215 | — | 1,100 | 1,108 | 137,294 | 2017/12/15 |
| | | 0 SCHATS 180316 | — | 900 | 908 | 112,482 | 2018/3/16 |
| | | 0.25 OBL 180413 | 0.25 | 1,500 | 1,522 | 188,491 | 2018/4/13 |
| | | 0.25 OBL 191011 | 0.25 | 1,800 | 1,847 | 228,696 | 2019/10/11 |
| | | 0.25 OBL 201016 | 0.25 | 1,600 | 1,649 | 204,236 | 2020/10/16 |
| | | 0.5 BUND 250215 | 0.5 | 2,200 | 2,298 | 284,543 | 2025/2/15 |
| | | 0.5 BUND 260215 | 0.5 | 1,500 | 1,554 | 192,447 | 2026/2/15 |
| | | 0.5 OBL 171013 | 0.5 | 1,300 | 1,318 | 163,262 | 2017/10/13 |
| | | 0.5 OBL 180223 | 0.5 | 1,900 | 1,934 | 239,532 | 2018/2/23 |
| | | 0.5 OBL 190412 | 0.5 | 1,400 | 1,442 | 178,560 | 2019/4/12 |
| | | 1 BUND 240815 | 1.0 | 1,700 | 1,852 | 229,314 | 2024/8/15 |
| | | 1 BUND 250815 | 1.0 | 2,000 | 2,174 | 269,212 | 2025/8/15 |
| | | 1 OBL 181012 | 1.0 | 1,300 | 1,348 | 166,940 | 2018/10/12 |
| | | 1 OBL 190222 | 1.0 | 1,400 | 1,460 | 180,778 | 2019/2/22 |
| | | 1.5 BUND 220904 | 1.5 | 1,500 | 1,671 | 206,988 | 2022/9/4 |
| | | 1.5 BUND 230215 | 1.5 | 1,600 | 1,790 | 221,709 | 2023/2/15 |
| | | 1.5 BUND 230515 | 1.5 | 1,500 | 1,683 | 208,427 | 2023/5/15 |
| | | 1.5 BUND 240515 | 1.5 | 1,700 | 1,921 | 237,902 | 2024/5/15 |
| | | 1.75 BUND 220704 | 1.75 | 2,100 | 2,367 | 293,112 | 2022/7/4 |
| | | 1.75 BUND 240215 | 1.75 | 1,600 | 1,837 | 227,453 | 2024/2/15 |
| | | 2 BUND 220104 | 2.0 | 2,100 | 2,380 | 294,698 | 2022/1/4 |
| | | 2 BUND 230815 | 2.0 | 1,600 | 1,859 | 230,187 | 2023/8/15 |
| | | 2.25 BUND 200904 | 2.25 | 1,400 | 1,566 | 193,908 | 2020/9/4 |
| | | 2.25 BUND 210904 | 2.25 | 1,300 | 1,483 | 183,647 | 2021/9/4 |
| | | 2.5 BUND 210104 | 2.5 | 1,700 | 1,933 | 239,428 | 2021/1/4 |
| | | 2.5 BUND 440704 | 2.5 | 1,550 | 2,208 | 273,436 | 2044/7/4 |
| | | 2.5 BUND 460815 | 2.5 | 1,300 | 1,876 | 232,319 | 2046/8/15 |
| | | 3 BUND 200704 | 3.0 | 1,800 | 2,061 | 255,216 | 2020/7/4 |
| | | 3.25 BUND 200104 | 3.25 | 2,100 | 2,390 | 295,920 | 2020/1/4 |
| | | 3.25 BUND 210704 | 3.25 | 1,700 | 2,021 | 250,257 | 2021/7/4 |
| | | 3.25 BUND 420704 | 3.25 | 1,300 | 2,056 | 254,635 | 2042/7/4 |
| | | 3.5 BUND 190704 | 3.5 | 2,000 | 2,254 | 279,092 | 2019/7/4 |
| | | 3.75 BUND 190104 | 3.75 | 2,300 | 2,562 | 317,254 | 2019/1/4 |
| | | 4 BUND 180104 | 4.0 | 1,700 | 1,827 | 226,273 | 2018/1/4 |
| | | 4 BUND 370104 | 4.0 | 2,200 | 3,620 | 448,272 | 2037/1/4 |
| | | 4.25 BUND 170704 | 4.25 | 1,500 | 1,581 | 195,855 | 2017/7/4 |
| | | 4.25 BUND 180704 | 4.25 | 1,900 | 2,095 | 259,445 | 2018/7/4 |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|-----------------------|------|------------------------|-------|---------|----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ドイツ | 国債証券 | 4.25 BUND 390704 | 4.25 | 1,000 | 1,752 | 216,933 | 2039/7/4 |
| | | 4.75 BUND 280704 | 4.75 | 1,150 | 1,773 | 219,538 | 2028/7/4 |
| | | 4.75 BUND 340704 | 4.75 | 1,850 | 3,190 | 394,971 | 2034/7/4 |
| | | 4.75 BUND 400704 | 4.75 | 1,600 | 3,016 | 373,430 | 2040/7/4 |
| | | 5.5 BUND 310104 | 5.5 | 1,400 | 2,414 | 298,914 | 2031/1/4 |
| | | 5.625 BUND 280104 | 5.625 | 1,350 | 2,194 | 271,708 | 2028/1/4 |
| | | 6.25 BUND 240104 | 6.25 | 900 | 1,345 | 166,608 | 2024/1/4 |
| | | 6.25 BUND 300104 | 6.25 | 900 | 1,617 | 200,237 | 2030/1/4 |
| | | 6.5 BUND 270704 | 6.5 | 900 | 1,532 | 189,758 | 2027/7/4 |
| イタリア | 国債証券 | 0.25 ITALY GOVT 180515 | 0.25 | 1,900 | 1,911 | 236,638 | 2018/5/15 |
| | | 0.3 ITALY GOVT 181015 | 0.3 | 700 | 705 | 87,299 | 2018/10/15 |
| | | 0.65 ITALY GOVT 201101 | 0.65 | 900 | 912 | 112,961 | 2020/11/1 |
| | | 0.7 ITALY GOVT 200501 | 0.7 | 1,200 | 1,222 | 151,313 | 2020/5/1 |
| | | 0.75 ITALY GOVT 180115 | 0.75 | 1,500 | 1,520 | 188,259 | 2018/1/15 |
| | | 0.95 ITALY GOVT 230315 | 0.95 | 600 | 601 | 74,468 | 2023/3/15 |
| | | 1.05 ITALY GOVT 191201 | 1.05 | 1,900 | 1,961 | 242,848 | 2019/12/1 |
| | | 1.15 ITALY GOVT 170515 | 1.15 | 1,200 | 1,215 | 150,436 | 2017/5/15 |
| | | 1.35 ITALY GOVT 220415 | 1.35 | 1,800 | 1,869 | 231,404 | 2022/4/15 |
| | | 1.45 ITALY GOVT 220915 | 1.45 | 1,500 | 1,561 | 193,329 | 2022/9/15 |
| | | 1.5 ITALY GOVT 190801 | 1.5 | 1,300 | 1,358 | 168,220 | 2019/8/1 |
| | | 1.5 ITALY GOVT 250601 | 1.5 | 1,900 | 1,920 | 237,732 | 2025/6/1 |
| | | 1.65 ITALY GOVT 320301 | 1.65 | 1,300 | 1,238 | 153,339 | 2032/3/1 |
| | | 2 ITALY GOVT 251201 | 2.0 | 1,300 | 1,361 | 168,558 | 2025/12/1 |
| | | 2.15 ITALY GOVT 211215 | 2.15 | 1,500 | 1,627 | 201,491 | 2021/12/15 |
| | | 2.25 ITALY GOVT 360901 | 2.25 | 550 | 541 | 67,016 | 2036/9/1 |
| | | 2.5 ITALY GOVT 190501 | 2.5 | 1,200 | 1,286 | 159,254 | 2019/5/1 |
| | | 2.5 ITALY GOVT 241201 | 2.5 | 2,200 | 2,411 | 298,557 | 2024/12/1 |
| | | 2.7 ITALY GOVT 470301 | 2.7 | 900 | 897 | 111,089 | 2047/3/1 |
| | | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25 | 1,200 | 1,340 | 165,954 | 2046/9/1 |
| | | 3.5 ITALY GOVT 171101 | 3.5 | 1,500 | 1,578 | 195,465 | 2017/11/1 |
| | | 3.5 ITALY GOVT 180601 | 3.5 | 2,300 | 2,466 | 305,365 | 2018/6/1 |
| | | 3.5 ITALY GOVT 181201 | 3.5 | 1,600 | 1,742 | 215,776 | 2018/12/1 |
| | | 3.5 ITALY GOVT 300301 | 3.5 | 2,000 | 2,381 | 294,865 | 2030/3/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 210301 | 3.75 | 2,000 | 2,317 | 286,892 | 2021/3/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 210501 | 3.75 | 1,400 | 1,625 | 201,258 | 2021/5/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 210801 | 3.75 | 2,600 | 3,034 | 375,648 | 2021/8/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 240901 | 3.75 | 1,800 | 2,149 | 266,148 | 2024/9/1 |
| | | 4 ITALY GOVT 200901 | 4.0 | 2,000 | 2,316 | 286,843 | 2020/9/1 |
| | | 4 ITALY GOVT 370201 | 4.0 | 2,300 | 2,894 | 358,359 | 2037/2/1 |
| | | 4.25 ITALY GOVT 190201 | 4.25 | 2,300 | 2,565 | 317,596 | 2019/2/1 |
| | | 4.25 ITALY GOVT 190901 | 4.25 | 2,600 | 2,953 | 365,685 | 2019/9/1 |
| | | 4.25 ITALY GOVT 200301 | 4.25 | 2,400 | 2,770 | 342,978 | 2020/3/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 180201 | 4.5 | 2,200 | 2,372 | 293,736 | 2018/2/1 |
| 4.5 ITALY GOVT 180801 | 4.5 | 2,200 | 2,420 | 299,661 | 2018/8/1 | | |
| 4.5 ITALY GOVT 190301 | 4.5 | 2,000 | 2,250 | 278,646 | 2019/3/1 | | |
| 4.5 ITALY GOVT 200201 | 4.5 | 2,400 | 2,785 | 344,835 | 2020/2/1 | | |
| 4.5 ITALY GOVT 230501 | 4.5 | 1,400 | 1,737 | 215,081 | 2023/5/1 | | |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------------------------|------|------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ユーロ | | | | | | | |
| イタリア | 国債証券 | 4.5 ITALY GOVT 240301 | 4.5 | 2,200 | 2,746 | 340,055 | 2024/3/1 |
| | | 4.5 ITALY GOVT 260301 | 4.5 | 1,600 | 2,036 | 252,186 | 2026/3/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 170501 | 4.75 | 1,300 | 1,361 | 168,558 | 2017/5/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 170601 | 4.75 | 1,200 | 1,261 | 156,134 | 2017/6/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 210901 | 4.75 | 2,300 | 2,807 | 347,624 | 2021/9/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 230801 | 4.75 | 2,100 | 2,652 | 328,368 | 2023/8/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 280901 | 4.75 | 2,000 | 2,642 | 327,192 | 2028/9/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 440901 | 4.75 | 1,400 | 1,977 | 244,868 | 2044/9/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 220301 | 5.0 | 1,800 | 2,242 | 277,681 | 2022/3/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 250301 | 5.0 | 2,400 | 3,122 | 386,614 | 2025/3/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 340801 | 5.0 | 2,100 | 2,956 | 366,055 | 2034/8/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 390801 | 5.0 | 1,700 | 2,437 | 301,845 | 2039/8/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 400901 | 5.0 | 2,000 | 2,862 | 354,418 | 2040/9/1 |
| | | 5.25 ITALY GOVT 170801 | 5.25 | 1,800 | 1,917 | 237,366 | 2017/8/1 |
| | | 5.25 ITALY GOVT 291101 | 5.25 | 2,500 | 3,486 | 431,632 | 2029/11/1 |
| | | 5.5 ITALY GOVT 220901 | 5.5 | 2,100 | 2,709 | 335,466 | 2022/9/1 |
| | | 5.5 ITALY GOVT 221101 | 5.5 | 2,000 | 2,587 | 320,321 | 2022/11/1 |
| | | 5.75 ITALY GOVT 330201 | 5.75 | 1,350 | 2,027 | 250,991 | 2033/2/1 |
| | | 6 ITALY GOVT 310501 | 6.0 | 2,650 | 3,997 | 494,949 | 2031/5/1 |
| 6.5 ITALY GOVT 271101 | 6.5 | 2,450 | 3,653 | 452,347 | 2027/11/1 | | |
| 7.25 ITALY GOVT 261101 | 7.25 | 1,000 | 1,544 | 191,162 | 2026/11/1 | | |
| 9 ITALY GOVT 231101 | 9.0 | 1,100 | 1,725 | 213,595 | 2023/11/1 | | |
| フランス | 国債証券 | 0 O. A. T 180225 | — | 2,300 | 2,318 | 287,055 | 2018/2/25 |
| | | 0 O. A. T 190225 | — | 500 | 505 | 62,597 | 2019/2/25 |
| | | 0 O. A. T 200525 | — | 2,100 | 2,125 | 263,147 | 2020/5/25 |
| | | 0.25 O. A. T 201125 | 0.25 | 2,000 | 2,044 | 253,129 | 2020/11/25 |
| | | 0.5 O. A. T 191125 | 0.5 | 2,900 | 2,987 | 369,892 | 2019/11/25 |
| | | 0.5 O. A. T 250525 | 0.5 | 3,000 | 3,044 | 376,964 | 2025/5/25 |
| | | 0.5 O. A. T 260525 | 0.5 | 400 | 400 | 49,628 | 2026/5/25 |
| | | 1 BTAN 170725 | 1.0 | 1,600 | 1,628 | 201,612 | 2017/7/25 |
| | | 1 O. A. T 180525 | 1.0 | 2,000 | 2,058 | 254,875 | 2018/5/25 |
| | | 1 O. A. T 181125 | 1.0 | 1,900 | 1,968 | 243,766 | 2018/11/25 |
| | | 1 O. A. T 190525 | 1.0 | 2,000 | 2,085 | 258,143 | 2019/5/25 |
| | | 1 O. A. T 251125 | 1.0 | 2,100 | 2,217 | 274,535 | 2025/11/25 |
| | | 1.25 O. A. T 360525 | 1.25 | 600 | 601 | 74,494 | 2036/5/25 |
| | | 1.5 O. A. T 310525 | 1.5 | 900 | 970 | 120,103 | 2031/5/25 |
| | | 1.75 O. A. T 230525 | 1.75 | 2,700 | 3,028 | 375,003 | 2023/5/25 |
| | | 1.75 O. A. T 241125 | 1.75 | 2,500 | 2,818 | 348,927 | 2024/11/25 |
| | | 1.75 O. A. T 660525 | 1.75 | 250 | 244 | 30,282 | 2066/5/25 |
| | | 2.25 O. A. T 221025 | 2.25 | 2,600 | 2,985 | 369,676 | 2022/10/25 |
| | | 2.25 O. A. T 240525 | 2.25 | 3,300 | 3,850 | 476,784 | 2024/5/25 |
| | | 2.5 O. A. T 201025 | 2.5 | 3,300 | 3,708 | 459,154 | 2020/10/25 |
| | | 2.5 O. A. T 300525 | 2.5 | 2,500 | 3,045 | 377,063 | 2030/5/25 |
| | | 2.75 O. A. T 271025 | 2.75 | 3,900 | 4,818 | 596,596 | 2027/10/25 |
| | | 3 O. A. T 220425 | 3.0 | 3,700 | 4,386 | 543,119 | 2022/4/25 |
| | | 3.25 O. A. T 211025 | 3.25 | 4,000 | 4,745 | 587,527 | 2021/10/25 |
| 3.25 O. A. T 450525 | 3.25 | 1,650 | 2,352 | 291,322 | 2045/5/25 | | |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|----------------------|------|------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フランス | 国債証券 | 3.5 O.A.T 200425 | 3.5 | 3,200 | 3,685 | 456,254 | 2020/4/25 |
| | | 3.5 O.A.T 260425 | 3.5 | 3,300 | 4,288 | 530,940 | 2026/4/25 |
| | | 3.75 O.A.T 191025 | 3.75 | 3,000 | 3,429 | 424,581 | 2019/10/25 |
| | | 3.75 O.A.T 210425 | 3.75 | 3,100 | 3,711 | 459,556 | 2021/4/25 |
| | | 4 O.A.T 180425 | 4.0 | 3,200 | 3,479 | 430,739 | 2018/4/25 |
| | | 4 O.A.T 381025 | 4.0 | 2,450 | 3,755 | 464,996 | 2038/10/25 |
| | | 4 O.A.T 550425 | 4.0 | 1,400 | 2,362 | 292,466 | 2055/4/25 |
| | | 4 O.A.T 600425 | 4.0 | 1,050 | 1,799 | 222,742 | 2060/4/25 |
| | | 4.25 O.A.T 171025 | 4.25 | 3,400 | 3,634 | 449,957 | 2017/10/25 |
| | | 4.25 O.A.T 181025 | 4.25 | 2,700 | 3,011 | 372,880 | 2018/10/25 |
| | | 4.25 O.A.T 190425 | 4.25 | 2,500 | 2,845 | 352,347 | 2019/4/25 |
| | | 4.25 O.A.T 231025 | 4.25 | 3,700 | 4,855 | 601,160 | 2023/10/25 |
| | | 4.5 O.A.T 410425 | 4.5 | 2,300 | 3,850 | 476,764 | 2041/4/25 |
| | | 4.75 O.A.T 350425 | 4.75 | 2,300 | 3,736 | 462,554 | 2035/4/25 |
| | | 5.5 O.A.T 290425 | 5.5 | 2,500 | 3,977 | 492,392 | 2029/4/25 |
| | | 5.75 O.A.T 321025 | 5.75 | 2,700 | 4,673 | 578,650 | 2032/10/25 |
| | | 6 O.A.T 251025 | 6.0 | 2,100 | 3,210 | 397,541 | 2025/10/25 |
| | | 8.5 O.A.T 191025 | 8.5 | 1,000 | 1,308 | 161,993 | 2019/10/25 |
| 8.5 O.A.T 230425 | 8.5 | 900 | 1,433 | 177,472 | 2023/4/25 | | |
| オランダ | 国債証券 | 0 NETH GOVT 180415 | — | 900 | 908 | 112,437 | 2018/4/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 200115 | 0.25 | 1,400 | 1,436 | 177,814 | 2020/1/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 250715 | 0.25 | 1,400 | 1,405 | 173,957 | 2025/7/15 |
| | | 0.5 NETH GOVT 260715 | 0.5 | 500 | 507 | 62,876 | 2026/7/15 |
| | | 1.25 NETH GOVT 180115 | 1.25 | 1,500 | 1,543 | 191,147 | 2018/1/15 |
| | | 1.25 NETH GOVT 190115 | 1.25 | 1,500 | 1,569 | 194,350 | 2019/1/15 |
| | | 1.75 NETH GOVT 230715 | 1.75 | 1,400 | 1,582 | 195,954 | 2023/7/15 |
| | | 2 NETH GOVT 240715 | 2.0 | 1,400 | 1,620 | 200,573 | 2024/7/15 |
| | | 2.25 NETH GOVT 220715 | 2.25 | 1,400 | 1,611 | 199,516 | 2022/7/15 |
| | | 2.5 NETH GOVT 330115 | 2.5 | 1,100 | 1,413 | 174,991 | 2033/1/15 |
| | | 2.75 NETH GOVT 470115 | 2.75 | 1,000 | 1,468 | 181,852 | 2047/1/15 |
| | | 3.25 NETH GOVT 210715 | 3.25 | 1,500 | 1,776 | 219,951 | 2021/7/15 |
| | | 3.5 NETH GOVT 200715 | 3.5 | 1,300 | 1,513 | 187,389 | 2020/7/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 230115 | 3.75 | 400 | 504 | 62,412 | 2023/1/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 420115 | 3.75 | 1,300 | 2,158 | 267,222 | 2042/1/15 |
| | | 4 NETH GOVT 180715 | 4.0 | 1,300 | 1,427 | 176,726 | 2018/7/15 |
| | | 4 NETH GOVT 190715 | 4.0 | 1,300 | 1,485 | 183,945 | 2019/7/15 |
| | | 4 NETH GOVT 370115 | 4.0 | 1,300 | 2,099 | 259,914 | 2037/1/15 |
| 4.5 NETH GOVT 170715 | 4.5 | 1,300 | 1,376 | 170,417 | 2017/7/15 | | |
| 5.5 NETH GOVT 280115 | 5.5 | 1,200 | 1,897 | 234,974 | 2028/1/15 | | |
| 7.5 NETH GOVT 230115 | 7.5 | 700 | 1,058 | 131,036 | 2023/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | 0.25 SPAIN GOVT 180430 | 0.25 | 1,600 | 1,610 | 199,344 | 2018/4/30 |
| | | 0.25 SPAIN GOVT 190131 | 0.25 | 400 | 402 | 49,860 | 2019/1/31 |
| | | 0.5 SPAIN GOVT 171031 | 0.5 | 1,600 | 1,613 | 199,809 | 2017/10/31 |
| | | 0.75 SPAIN GOVT 210730 | 0.75 | 200 | 202 | 25,019 | 2021/7/30 |
| | | 1.15 SPAIN GOVT 200730 | 1.15 | 1,600 | 1,654 | 204,860 | 2020/7/30 |
| | | 1.4 SPAIN GOVT 200131 | 1.4 | 2,200 | 2,296 | 284,339 | 2020/1/31 |
| | | 1.6 SPAIN GOVT 250430 | 1.6 | 1,800 | 1,825 | 226,033 | 2025/4/30 |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------------------------|------|------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ユーロ | | | | | | | |
| スペイン | 国債証券 | 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95 | 1,100 | 1,135 | 140,535 | 2026/4/30 |
| | | 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 1.95 | 750 | 740 | 91,682 | 2030/7/30 |
| | | 2.1 SPAIN GOVT 170430 | 2.1 | 1,400 | 1,430 | 177,104 | 2017/4/30 |
| | | 2.15 SPAIN GOVT 251031 | 2.15 | 1,900 | 2,004 | 248,141 | 2025/10/31 |
| | | 2.75 SPAIN GOVT 190430 | 2.75 | 1,900 | 2,051 | 253,975 | 2019/4/30 |
| | | 2.75 SPAIN GOVT 241031 | 2.75 | 2,500 | 2,774 | 343,448 | 2024/10/31 |
| | | 2.9 SPAIN GOVT 461031 | 2.9 | 500 | 503 | 62,285 | 2046/10/31 |
| | | 3.75 SPAIN GOVT 181031 | 3.75 | 1,700 | 1,859 | 230,177 | 2018/10/31 |
| | | 3.8 SPAIN GOVT 240430 | 3.8 | 1,900 | 2,261 | 279,969 | 2024/4/30 |
| | | 4 SPAIN GOVT 200430 | 4.0 | 2,000 | 2,292 | 283,834 | 2020/4/30 |
| | | 4.1 SPAIN GOVT 180730 | 4.1 | 1,800 | 1,966 | 243,416 | 2018/7/30 |
| | | 4.2 SPAIN GOVT 370131 | 4.2 | 1,500 | 1,901 | 235,412 | 2037/1/31 |
| | | 4.3 SPAIN GOVT 191031 | 4.3 | 2,000 | 2,286 | 283,042 | 2019/10/31 |
| | | 4.4 SPAIN GOVT 231031 | 4.4 | 1,600 | 1,978 | 244,985 | 2023/10/31 |
| | | 4.5 SPAIN GOVT 180131 | 4.5 | 2,200 | 2,372 | 293,777 | 2018/1/31 |
| | | 4.6 SPAIN GOVT 190730 | 4.6 | 1,700 | 1,944 | 240,733 | 2019/7/30 |
| | | 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 4.65 | 1,700 | 2,161 | 267,642 | 2025/7/30 |
| | | 4.7 SPAIN GOVT 410730 | 4.7 | 1,250 | 1,702 | 210,794 | 2041/7/30 |
| | | 4.8 SPAIN GOVT 240131 | 4.8 | 1,500 | 1,901 | 235,440 | 2024/1/31 |
| | | 4.85 SPAIN GOVT 201031 | 4.85 | 1,600 | 1,914 | 237,091 | 2020/10/31 |
| | | 4.9 SPAIN GOVT 400730 | 4.9 | 1,200 | 1,672 | 207,079 | 2040/7/30 |
| | | 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 5.15 | 1,500 | 2,034 | 251,922 | 2028/10/31 |
| | | 5.15 SPAIN GOVT 441031 | 5.15 | 1,150 | 1,680 | 208,104 | 2044/10/31 |
| | | 5.4 SPAIN GOVT 230131 | 5.4 | 2,000 | 2,587 | 320,407 | 2023/1/31 |
| 5.5 SPAIN GOVT 170730 | 5.5 | 1,900 | 2,029 | 251,329 | 2017/7/30 | | |
| 5.5 SPAIN GOVT 210430 | 5.5 | 2,100 | 2,617 | 324,078 | 2021/4/30 | | |
| 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 5.75 | 1,650 | 2,454 | 303,865 | 2032/7/30 | | |
| 5.85 SPAIN GOVT 220131 | 5.85 | 2,100 | 2,716 | 336,363 | 2022/1/31 | | |
| 5.9 SPAIN GOVT 260730 | 5.9 | 1,200 | 1,678 | 207,829 | 2026/7/30 | | |
| 6 SPAIN GOVT 290131 | 6.0 | 2,000 | 2,917 | 361,228 | 2029/1/31 | | |
| ベルギー | 国債証券 | 0.8 BEL GOVT 250622 | 0.8 | 1,500 | 1,556 | 192,688 | 2025/6/22 |
| | | 1 BEL GOVT 260622 | 1.0 | 600 | 627 | 77,740 | 2026/6/22 |
| | | 1 BEL GOVT 310622 | 1.0 | 100 | 99 | 12,365 | 2031/6/22 |
| | | 1.25 BEL GOVT 180622 | 1.25 | 1,100 | 1,140 | 141,202 | 2018/6/22 |
| | | 1.6 BEL GOVT 470622 | 1.6 | 350 | 349 | 43,294 | 2047/6/22 |
| | | 1.9 BEL GOVT 380622 | 1.9 | 250 | 276 | 34,208 | 2038/6/22 |
| | | 2.25 BEL GOVT 230622 | 2.25 | 1,200 | 1,388 | 171,957 | 2023/6/22 |
| | | 2.6 BEL GOVT 240622 | 2.6 | 1,400 | 1,668 | 206,588 | 2024/6/22 |
| | | 3 BEL GOVT 190928 | 3.0 | 1,300 | 1,450 | 179,551 | 2019/9/28 |
| | | 3 BEL GOVT 340622 | 3.0 | 750 | 978 | 121,151 | 2034/6/22 |
| | | 3.5 BEL GOVT 170628 | 3.5 | 1,300 | 1,358 | 168,203 | 2017/6/28 |
| | | 3.75 BEL GOVT 200928 | 3.75 | 1,600 | 1,887 | 233,634 | 2020/9/28 |
| | | 3.75 BEL GOVT 450622 | 3.75 | 800 | 1,229 | 152,212 | 2045/6/22 |
| | | 4 BEL GOVT 180328 | 4.0 | 1,000 | 1,084 | 134,271 | 2018/3/28 |
| | | 4 BEL GOVT 190328 | 4.0 | 1,100 | 1,242 | 153,780 | 2019/3/28 |
| | | 4 BEL GOVT 220328 | 4.0 | 1,300 | 1,619 | 200,450 | 2022/3/28 |
| | | 4 BEL GOVT 320328 | 4.0 | 800 | 1,152 | 142,718 | 2032/3/28 |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | | 当 期 末 | | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|-------|--------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| ユーロ | | | | | | | |
| ベルギー | 国債証券 | 4.25 BEL GOVT 210928 | 4.25 | 1,500 | 1,860 | 230,388 | 2021/9/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 220928 | 4.25 | 1,500 | 1,915 | 237,167 | 2022/9/28 |
| | | 4.25 BEL GOVT 410328 | 4.25 | 1,450 | 2,333 | 288,908 | 2041/3/28 |
| | | 4.5 BEL GOVT 260328 | 4.5 | 900 | 1,256 | 155,532 | 2026/3/28 |
| | | 5 BEL GOVT 350328 | 5.0 | 1,800 | 2,978 | 368,718 | 2035/3/28 |
| | | 5.5 BEL GOVT 170928 | 5.5 | 600 | 649 | 80,436 | 2017/9/28 |
| | | 5.5 BEL GOVT 280328 | 5.5 | 1,700 | 2,636 | 326,439 | 2028/3/28 |
| オーストリア | 国債証券 | 0.25 AUSTRIA GOVT 191018 | 0.25 | 700 | 715 | 88,595 | 2019/10/18 |
| | | 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 0.75 | 300 | 307 | 38,032 | 2026/10/20 |
| | | 1.15 AUSTRIA GOVT 181019 | 1.15 | 600 | 623 | 77,186 | 2018/10/19 |
| | | 1.2 AUSTRIA GOVT 251020 | 1.2 | 800 | 863 | 106,947 | 2025/10/20 |
| | | 1.65 AUSTRIA GOVT 241021 | 1.65 | 1,000 | 1,124 | 139,205 | 2024/10/21 |
| | | 1.75 AUSTRIA GOVT 231020 | 1.75 | 800 | 904 | 111,934 | 2023/10/20 |
| | | 1.95 AUSTRIA GOVT 190618 | 1.95 | 600 | 643 | 79,731 | 2019/6/18 |
| | | 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 2.4 | 500 | 618 | 76,539 | 2034/5/23 |
| | | 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 3.15 | 650 | 946 | 117,201 | 2044/6/20 |
| | | 3.4 AUSTRIA GOVT 221122 | 3.4 | 900 | 1,106 | 137,013 | 2022/11/22 |
| | | 3.5 AUSTRIA GOVT 210915 | 3.5 | 1,350 | 1,620 | 200,588 | 2021/9/15 |
| | | 3.65 AUSTRIA GOVT 220420 | 3.65 | 800 | 981 | 121,576 | 2022/4/20 |
| | | 3.8 AUSTRIA GOVT 620126 | 3.8 | 300 | 539 | 66,747 | 2062/1/26 |
| | | 3.9 AUSTRIA GOVT 200715 | 3.9 | 1,200 | 1,414 | 175,166 | 2020/7/15 |
| | | 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 4.15 | 1,050 | 1,655 | 204,906 | 2037/3/15 |
| | | 4.3 AUSTRIA GOVT 170915 | 4.3 | 700 | 744 | 92,235 | 2017/9/15 |
| | | 4.35 AUSTRIA GOVT 190315 | 4.35 | 1,000 | 1,136 | 140,672 | 2019/3/15 |
| 4.65 AUSTRIA GOVT 180115 | 4.65 | 1,200 | 1,303 | 161,408 | 2018/1/15 | | |
| 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 4.85 | 800 | 1,147 | 142,054 | 2026/3/15 | | |
| 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 6.25 | 700 | 1,143 | 141,613 | 2027/7/15 | | |
| フィンランド | 国債証券 | 0.375 FINNISH GOV 200915 | 0.375 | 500 | 514 | 63,703 | 2020/9/15 |
| | | 0.5 FINNISH GOVT 260415 | 0.5 | 400 | 403 | 49,947 | 2026/4/15 |
| | | 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 0.75 | 300 | 297 | 36,881 | 2031/4/15 |
| | | 0.875 FINNISH GOV 250915 | 0.875 | 300 | 314 | 38,998 | 2025/9/15 |
| | | 1.125 FINNISH GOV 180915 | 1.125 | 300 | 311 | 38,532 | 2018/9/15 |
| | | 1.5 FINNISH GOVT 230415 | 1.5 | 400 | 441 | 54,696 | 2023/4/15 |
| | | 1.625 FINNISH GOV 220915 | 1.625 | 500 | 554 | 68,615 | 2022/9/15 |
| | | 2 FINNISH GOVT 240415 | 2.0 | 400 | 458 | 56,813 | 2024/4/15 |
| | | 2.625 FINNISH GOV 420704 | 2.625 | 400 | 547 | 67,825 | 2042/7/4 |
| | | 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75 | 500 | 626 | 77,622 | 2028/7/4 |
| | | 3.375 FINNISH GOV 200415 | 3.375 | 500 | 573 | 70,967 | 2020/4/15 |
| | | 3.5 FINNISH GOVT 210415 | 3.5 | 500 | 592 | 73,363 | 2021/4/15 |
| | | 3.875 FINNISH GOVT170915 | 3.875 | 600 | 635 | 78,672 | 2017/9/15 |
| | | 4 FINNISH GOVT 250704 | 4.0 | 600 | 803 | 99,520 | 2025/7/4 |
| 4.375 FINNISH GOV 190704 | 4.375 | 600 | 691 | 85,596 | 2019/7/4 | | |
| アイルランド | 国債証券 | 0.8 IRISH GOVT 220315 | 0.8 | 500 | 517 | 64,059 | 2022/3/15 |
| | | 1 IRISH GOVT 260515 | 1.0 | 400 | 405 | 50,172 | 2026/5/15 |
| | | 2 IRISH GOVT 450218 | 2.0 | 450 | 467 | 57,884 | 2045/2/18 |
| | | 2.4 IRISH GOVT 300515 | 2.4 | 700 | 799 | 98,956 | 2030/5/15 |
| | | 3.4 IRISH GOVT 240318 | 3.4 | 700 | 849 | 105,161 | 2024/3/18 |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------------------|------------------|-----------------------|-------|----------|-----------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| アイルランド | 国債証券 | 3.9 IRISH GOVT 230320 | 3.9 | 500 | 617 | 76,502 | 2023/3/20 |
| | | 4.4 IRISH GOVT 190618 | 4.4 | 700 | 800 | 99,138 | 2019/6/18 |
| | | 4.5 IRISH GOVT 181018 | 4.5 | 750 | 838 | 103,763 | 2018/10/18 |
| | | 4.5 IRISH GOVT 200418 | 4.5 | 1,000 | 1,180 | 146,139 | 2020/4/18 |
| | | 5 IRISH GOVT 201018 | 5.0 | 800 | 977 | 121,051 | 2020/10/18 |
| | | 5.4 IRISH GOVT 250313 | 5.4 | 1,100 | 1,533 | 189,897 | 2025/3/13 |
| | | 5.5 IRISH GOVT 171018 | 5.5 | 500 | 542 | 67,120 | 2017/10/18 |
| | | 5.9 IRISH GOVT 191018 | 5.9 | 600 | 724 | 89,737 | 2019/10/18 |
| 小 計 | | | | | | 63,440,158 | |
| イギリス | | | | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド | | |
| 国債証券 | 1 GILT 170907 | 1.0 | 2,600 | 2,621 | 410,329 | 2017/9/7 | |
| | 1.25 GILT 180722 | 1.25 | 2,600 | 2,649 | 414,724 | 2018/7/22 | |
| | 1.5 GILT 210122 | 1.5 | 1,900 | 1,960 | 306,874 | 2021/1/22 | |
| | 1.5 GILT 260722 | 1.5 | 500 | 498 | 78,083 | 2026/7/22 | |
| | 1.75 GILT 190722 | 1.75 | 2,100 | 2,180 | 341,231 | 2019/7/22 | |
| | 1.75 GILT 220907 | 1.75 | 2,200 | 2,301 | 360,218 | 2022/9/7 | |
| | 2 GILT 200722 | 2.0 | 2,500 | 2,633 | 412,156 | 2020/7/22 | |
| | 2 GILT 250907 | 2.0 | 2,000 | 2,105 | 329,615 | 2025/9/7 | |
| | 2.25 GILT 230907 | 2.25 | 2,000 | 2,153 | 337,003 | 2023/9/7 | |
| | 2.5 GILT 650722 | 2.5 | 350 | 392 | 61,492 | 2065/7/22 | |
| | 2.75 GILT 240907 | 2.75 | 2,100 | 2,341 | 366,475 | 2024/9/7 | |
| | 3.25 GILT 440122 | 3.25 | 2,200 | 2,642 | 413,539 | 2044/1/22 | |
| | 3.5 GILT 450122 | 3.5 | 2,150 | 2,705 | 423,491 | 2045/1/22 | |
| | 3.5 GILT 680722 | 3.5 | 1,750 | 2,524 | 395,128 | 2068/7/22 | |
| | 3.75 GILT 190907 | 3.75 | 1,800 | 1,994 | 312,149 | 2019/9/7 | |
| | 3.75 GILT 200907 | 3.75 | 1,500 | 1,698 | 265,794 | 2020/9/7 | |
| | 3.75 GILT 210907 | 3.75 | 1,700 | 1,958 | 306,555 | 2021/9/7 | |
| | 3.75 GILT 520722 | 3.75 | 1,300 | 1,821 | 285,110 | 2052/7/22 | |
| | 4 GILT 220307 | 4.0 | 1,300 | 1,532 | 239,857 | 2022/3/7 | |
| | 4 GILT 600122 | 4.0 | 1,150 | 1,775 | 277,934 | 2060/1/22 | |
| | 4.25 GILT 271207 | 4.25 | 1,100 | 1,410 | 220,733 | 2027/12/7 | |
| | 4.25 GILT 320607 | 4.25 | 1,800 | 2,368 | 370,708 | 2032/6/7 | |
| | 4.25 GILT 360307 | 4.25 | 1,885 | 2,527 | 395,589 | 2036/3/7 | |
| | 4.25 GILT 390907 | 4.25 | 1,300 | 1,780 | 278,741 | 2039/9/7 | |
| | 4.25 GILT 401207 | 4.25 | 1,750 | 2,422 | 379,132 | 2040/12/7 | |
| | 4.25 GILT 461207 | 4.25 | 1,550 | 2,238 | 350,310 | 2046/12/7 | |
| | 4.25 GILT 491207 | 4.25 | 1,250 | 1,862 | 291,557 | 2049/12/7 | |
| | 4.25 GILT 551207 | 4.25 | 1,600 | 2,524 | 395,144 | 2055/12/7 | |
| | 4.5 GILT 190307 | 4.5 | 1,500 | 1,673 | 261,967 | 2019/3/7 | |
| | 4.5 GILT 340907 | 4.5 | 2,000 | 2,740 | 428,864 | 2034/9/7 | |
| | 4.5 GILT 421207 | 4.5 | 1,700 | 2,470 | 386,753 | 2042/12/7 | |
| | 4.75 GILT 200307 | 4.75 | 1,800 | 2,083 | 326,095 | 2020/3/7 | |
| 4.75 GILT 301207 | 4.75 | 1,600 | 2,192 | 343,242 | 2030/12/7 | | |
| 4.75 GILT 381207 | 4.75 | 1,350 | 1,963 | 307,307 | 2038/12/7 | | |
| 5 GILT 180307 | 5.0 | 1,900 | 2,063 | 323,052 | 2018/3/7 | | |
| 5 GILT 250307 | 5.0 | 1,550 | 2,030 | 317,777 | 2025/3/7 | | |
| 6 GILT 281207 | 6.0 | 1,100 | 1,652 | 258,662 | 2028/12/7 | | |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | | | |
|------------------------|------|------------------------|------|-----------------------|--------|------------|------------|---------|-----------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | | |
| イギリス | 国債証券 | 8 GILT 210607 | 8.0 | 1,100 | 1,494 | 233,912 | 2021/6/7 | | |
| | | 8.75 GILT 170825 | 8.75 | 350 | 388 | 60,769 | 2017/8/25 | | |
| 小 計 | | | | | | 12,268,091 | | | |
| スイス | 国債証券 | 2 SWISS GOVT 210428 | 2.0 | 320 | 364 | 40,708 | 2021/4/28 | | |
| | | 2.25 SWISS GOVT 200706 | 2.25 | 450 | 508 | 56,751 | 2020/7/6 | | |
| | | 3 SWISS GOVT 180108 | 3.0 | 550 | 584 | 65,270 | 2018/1/8 | | |
| | | 3 SWISS GOVT 190512 | 3.0 | 490 | 548 | 61,180 | 2019/5/12 | | |
| | | 4 SWISS GOVT 230211 | 4.0 | 440 | 578 | 64,623 | 2023/2/11 | | |
| | | 4 SWISS GOVT 280408 | 4.0 | 500 | 754 | 84,194 | 2028/4/8 | | |
| | | 4.25 SWISS GOVT 170605 | 4.25 | 450 | 474 | 52,920 | 2017/6/5 | | |
| | | 小 計 | | | | | | 425,649 | |
| スウェーデン | 国債証券 | 1 SWD GOVT 261112 | 1.0 | 4,300 | 4,419 | 58,918 | 2026/11/12 | | |
| | | 1.5 SWD GOVT 231113 | 1.5 | 6,800 | 7,382 | 98,409 | 2023/11/13 | | |
| | | 2.5 SWD GOVT 250512 | 2.5 | 5,500 | 6,469 | 86,240 | 2025/5/12 | | |
| | | 3.5 SWD GOVT 220601 | 3.5 | 7,700 | 9,265 | 123,506 | 2022/6/1 | | |
| | | 3.5 SWD GOVT 390330 | 3.5 | 4,000 | 5,400 | 71,990 | 2039/3/30 | | |
| | | 3.75 SWD GOVT 170812 | 3.75 | 5,700 | 6,011 | 80,135 | 2017/8/12 | | |
| | | 4.25 SWD GOVT 190312 | 4.25 | 8,100 | 9,185 | 122,437 | 2019/3/12 | | |
| | | 5 SWD GOVT 201201 | 5.0 | 8,200 | 10,151 | 135,318 | 2020/12/1 | | |
| | | 小 計 | | | | | | 776,956 | |
| | | ノルウェー | 国債証券 | 1.5 NORWE GOVT 260219 | 1.5 | 2,000 | 2,030 | 26,959 | 2026/2/19 |
| 1.75 NORWE GOVT 250313 | 1.75 | | | 3,400 | 3,540 | 47,023 | 2025/3/13 | | |
| 2 NORWE GOVT 230524 | 2.0 | | | 4,600 | 4,887 | 64,912 | 2023/5/24 | | |
| 3 NORWE GOVT 240314 | 3.0 | | | 4,200 | 4,779 | 63,467 | 2024/3/14 | | |
| 3.75 NORWE GOVT 210525 | 3.75 | | | 6,600 | 7,532 | 100,028 | 2021/5/25 | | |
| 4.25 NORWE GOVT 170519 | 4.25 | | | 5,800 | 6,015 | 79,889 | 2017/5/19 | | |
| 4.5 NORWE GOVT 190522 | 4.5 | | | 6,400 | 7,149 | 94,940 | 2019/5/22 | | |
| 小 計 | | | | | | | | 477,220 | |
| デンマーク | 国債証券 | 0.25 DMK GOVT 181115 | 0.25 | 3,000 | 3,048 | 50,728 | 2018/11/15 | | |
| | | 1.5 DMK GOVT 231115 | 1.5 | 5,200 | 5,743 | 95,565 | 2023/11/15 | | |
| | | 1.75 DMK GOVT 251115 | 1.75 | 6,500 | 7,321 | 121,826 | 2025/11/15 | | |
| | | 3 DMK GOVT 211115 | 3.0 | 8,200 | 9,609 | 159,910 | 2021/11/15 | | |
| | | 4 DMK GOVT 171115 | 4.0 | 4,700 | 5,020 | 83,533 | 2017/11/15 | | |
| | | 4 DMK GOVT 191115 | 4.0 | 8,400 | 9,685 | 161,161 | 2019/11/15 | | |
| | | 4.5 DMK GOVT 391115 | 4.5 | 11,400 | 20,004 | 332,878 | 2039/11/15 | | |
| | | 7 DMK GOVT 241110 | 7.0 | 2,100 | 3,324 | 55,316 | 2024/11/10 | | |
| 小 計 | | | | | | 1,060,921 | | | |
| ポーランド | 国債証券 | 1.5 POLAND 200425 | 1.5 | 2,600 | 2,553 | 71,416 | 2020/4/25 | | |
| | | 1.75 POLAND 210725 | 1.75 | 1,100 | 1,069 | 29,917 | 2021/7/25 | | |
| | | 2 POLAND 210425 | 2.0 | 2,400 | 2,377 | 66,486 | 2021/4/25 | | |
| | | 2.5 POLAND 180725 | 2.5 | 2,200 | 2,241 | 62,681 | 2018/7/25 | | |
| | | 2.5 POLAND 260725 | 2.5 | 2,000 | 1,909 | 53,403 | 2026/7/25 | | |
| | | 小 計 | | | | | | | |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 当期末 | | | | | | 償還年月日 |
|---------|--------------------------|-------|------------|------------|-----------|------------|-------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 債 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| ポーランド | | % | 千ポーランドズロチ | 千ポーランドズロチ | 千円 | | |
| 国債証券 | 3.25 POLAND 190725 | 3.25 | 1,900 | 1,985 | 55,542 | 2019/7/25 | |
| | 3.25 POLAND 250725 | 3.25 | 2,600 | 2,674 | 74,812 | 2025/7/25 | |
| | 3.75 POLAND 180425 | 3.75 | 1,700 | 1,771 | 49,546 | 2018/4/25 | |
| | 4 POLAND 231025 | 4.0 | 2,400 | 2,610 | 73,015 | 2023/10/25 | |
| | 5.25 POLAND 171025 | 5.25 | 2,100 | 2,212 | 61,882 | 2017/10/25 | |
| | 5.25 POLAND 201025 | 5.25 | 1,500 | 1,706 | 47,732 | 2020/10/25 | |
| | 5.5 POLAND 191025 | 5.5 | 1,800 | 2,020 | 56,508 | 2019/10/25 | |
| | 5.75 POLAND 211025 | 5.75 | 1,400 | 1,647 | 46,081 | 2021/10/25 | |
| | 5.75 POLAND 220923 | 5.75 | 2,000 | 2,383 | 66,674 | 2022/9/23 | |
| | 5.75 POLAND 290425 | 5.75 | 800 | 1,003 | 28,076 | 2029/4/25 | |
| | POLAND 170725 | — | 1,200 | 1,179 | 32,991 | 2017/7/25 | |
| | POLAND 181025 | — | 1,200 | 1,152 | 32,241 | 2018/10/25 | |
| 小計 | | | | | 909,011 | | |
| オーストラリア | | | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | | | |
| 国債証券 | 1.75 AUST GOVT 201121 | 1.75 | 1,100 | 1,100 | 87,904 | 2020/11/21 | |
| | 2.75 AUST GOVT 191021 | 2.75 | 1,700 | 1,764 | 140,980 | 2019/10/21 | |
| | 2.75 AUST GOVT 240421 | 2.75 | 2,200 | 2,291 | 183,096 | 2024/4/21 | |
| | 2.75 AUST GOVT 271121 | 2.75 | 800 | 825 | 65,998 | 2027/11/21 | |
| | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2.75 | 500 | 486 | 38,890 | 2035/6/21 | |
| | 3.25 AUST GOVT 181021 | 3.25 | 1,300 | 1,351 | 107,968 | 2018/10/21 | |
| | 3.25 AUST GOVT 250421 | 3.25 | 2,300 | 2,484 | 198,553 | 2025/4/21 | |
| | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3.25 | 800 | 862 | 68,913 | 2029/4/21 | |
| | 3.25 AUST GOVT 390621 | 3.25 | 400 | 411 | 32,883 | 2039/6/21 | |
| | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3.75 | 750 | 839 | 67,052 | 2037/4/21 | |
| | 4.25 AUST GOVT 170721 | 4.25 | 1,550 | 1,596 | 127,603 | 2017/7/21 | |
| | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4.25 | 2,500 | 2,929 | 234,096 | 2026/4/21 | |
| | 4.5 AUST GOVT 200415 | 4.5 | 2,100 | 2,326 | 185,907 | 2020/4/15 | |
| | 4.5 AUST GOVT 330421 | 4.5 | 950 | 1,173 | 93,772 | 2033/4/21 | |
| | 4.75 AUST GOVT 270421 | 4.75 | 2,300 | 2,825 | 225,824 | 2027/4/21 | |
| | 5.25 AUST GOVT 190315 | 5.25 | 2,200 | 2,422 | 193,582 | 2019/3/15 | |
| | 5.5 AUST GOVT 180121 | 5.5 | 2,100 | 2,235 | 178,656 | 2018/1/21 | |
| | 5.5 AUST GOVT 230421 | 5.5 | 1,900 | 2,321 | 185,483 | 2023/4/21 | |
| | 5.75 AUST GOVT 210515 | 5.75 | 1,900 | 2,256 | 180,318 | 2021/5/15 | |
| | 5.75 AUST GOVT 220715 | 5.75 | 2,000 | 2,438 | 194,850 | 2022/7/15 | |
| 小計 | | | | | 2,792,339 | | |
| シンガポール | | | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | | |
| 国債証券 | 0.5 SINGAPORGOVT 180401 | 0.5 | 600 | 594 | 47,129 | 2018/4/1 | |
| | 1.375 SINGAPORGOV 171001 | 1.375 | 100 | 100 | 7,985 | 2017/10/1 | |
| | 1.625 SINGAPORGOV 191001 | 1.625 | 150 | 152 | 12,057 | 2019/10/1 | |
| | 2 SINGAPORGOVT 200701 | 2.0 | 250 | 256 | 20,343 | 2020/7/1 | |
| | 2.25 SINGAPORGOVT 210601 | 2.25 | 600 | 618 | 49,091 | 2021/6/1 | |
| | 2.375 SINGAPORGOV 250601 | 2.375 | 150 | 154 | 12,283 | 2025/6/1 | |
| | 2.5 SINGAPORGOVT 190601 | 2.5 | 600 | 624 | 49,498 | 2019/6/1 | |
| | 2.75 SINGAPORGOVT 230701 | 2.75 | 400 | 422 | 33,516 | 2023/7/1 | |
| | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 2.75 | 450 | 475 | 37,723 | 2042/4/1 | |
| | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 2.75 | 150 | 157 | 12,462 | 2046/3/1 | |
| | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 2.875 | 150 | 160 | 12,722 | 2029/7/1 | |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------|------|---------------------------|-------------|-------------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| シンガポール | | % | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | 千円 | |
| | 国債証券 | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 400 | 425 | 33,779 | 2030/9/1 |
| | | 3.SINGAPORGOVT 240901 | 600 | 646 | 51,259 | 2024/9/1 |
| | | 3.125SINGAPORGOVT 220901 | 470 | 508 | 40,306 | 2022/9/1 |
| | | 3.25.SINGAPORGOVT 200901 | 400 | 430 | 34,157 | 2020/9/1 |
| | | 3.375.SINGAPORGOVT 330901 | 200 | 227 | 18,050 | 2033/9/1 |
| | | 3.5.SINGAPORGOVT 270301 | 470 | 531 | 42,177 | 2027/3/1 |
| | | 4.SINGAPORGOVT 180901 | 300 | 320 | 25,399 | 2018/9/1 |
| 小 | 計 | | | | 539,944 | |
| マレーシア | | | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | |
| | 国債証券 | 3.26.MALAYSIAGOV 180301 | 900 | 903 | 24,360 | 2018/3/1 |
| | | 3.314.MALAYSIA 171031 | 1,100 | 1,105 | 29,819 | 2017/10/31 |
| | | 3.418.MALAYSIAGOV 220815 | 900 | 879 | 23,730 | 2022/8/15 |
| | | 3.48.MALAYSIAGOV 230315 | 1,200 | 1,173 | 31,654 | 2023/3/15 |
| | | 3.492.MALAYSIAGOV 200331 | 900 | 899 | 24,256 | 2020/3/31 |
| | | 3.502.MALAYSIAGOV 270531 | 800 | 750 | 20,252 | 2027/5/31 |
| | | 3.58.MALAYSIAGOV 180928 | 800 | 806 | 21,742 | 2018/9/28 |
| | | 3.654.MALAYSIAGOV 191031 | 700 | 705 | 19,027 | 2019/10/31 |
| | | 3.659.MALAYSIAGOV 201015 | 1,000 | 1,007 | 27,185 | 2020/10/15 |
| | | 3.733.MALAYSIAGO 280615 | 600 | 572 | 15,435 | 2028/6/15 |
| | | 3.759.MALAYSIAGOV 190315 | 450 | 456 | 12,311 | 2019/3/15 |
| | | 3.795.MALAYSIAGOV 220930 | 900 | 898 | 24,244 | 2022/9/30 |
| | | 3.8.MALAYSIAGOV 230817 | 200 | 200 | 5,400 | 2023/8/17 |
| | | 3.844.MALAYSIAGOV 330415 | 300 | 281 | 7,590 | 2033/4/15 |
| | | 3.889.MALAYSIAGO 200731 | 700 | 710 | 19,154 | 2020/7/31 |
| | | 3.892.MALAYSIAGOV 270315 | 500 | 488 | 13,177 | 2027/3/15 |
| | | 3.955.MALAYSIAGOV 250915 | 1,150 | 1,154 | 31,131 | 2025/9/15 |
| | | 4.012.MALAYSIAGOV 170915 | 1,500 | 1,520 | 40,997 | 2017/9/15 |
| | | 4.048.MALAYSIA 210930 | 900 | 915 | 24,688 | 2021/9/30 |
| | | 4.127.MALAYSIA 320415 | 700 | 682 | 18,399 | 2032/4/15 |
| | | 4.16.MALAYSIAGOV 210715 | 1,200 | 1,228 | 33,138 | 2021/7/15 |
| | | 4.181.MALAYSIAGOV 240715 | 1,400 | 1,423 | 38,381 | 2024/7/15 |
| | | 4.232.MALAYSIAGOV 310630 | 300 | 301 | 8,128 | 2031/6/30 |
| | | 4.24.MALAYSIAGOV 180207 | 1,200 | 1,224 | 33,022 | 2018/2/7 |
| | | 4.254.MALAYSIAGOV 350531 | 350 | 347 | 9,376 | 2035/5/31 |
| | | 4.378.MALAYSIAGOV 191129 | 1,900 | 1,960 | 52,866 | 2019/11/29 |
| | | 4.392.MALAYSIAGOV 260415 | 1,000 | 1,026 | 27,696 | 2026/4/15 |
| | | 4.498.MALAYSIAGOV 300415 | 1,200 | 1,229 | 33,155 | 2030/4/15 |
| | | 4.935.MALAYSIAGOV 430930 | 600 | 619 | 16,699 | 2043/9/30 |
| | | 5.248.MALAYSIA 280915 | 200 | 219 | 5,909 | 2028/9/15 |
| | | 5.734.MALAYSIAGOV 190730 | 700 | 748 | 20,186 | 2019/7/30 |
| 小 | 計 | | | | 713,120 | |
| 南アフリカ | | | 千南アフリカランド | 千南アフリカランド | | |
| | 国債証券 | 10.5.SOUTH AFRICA 261221 | 15,000 | 16,338 | 117,800 | 2026/12/21 |
| | | 6.25.SOUTH AFRICA 360331 | 7,350 | 5,129 | 36,980 | 2036/3/31 |
| | | 6.5.SOUTH AFRICA 410228 | 7,200 | 4,977 | 35,889 | 2041/2/28 |
| | | 6.75.SOUTH AFRICA 210331 | 5,700 | 5,267 | 37,981 | 2021/3/31 |
| | | 7.SOUTH AFRICA 310228 | 8,000 | 6,367 | 45,912 | 2031/2/28 |

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | | |
|-------|------|--------------------------|-----------|-----------|--------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| 南アフリカ | | % | 千南アフリカランド | 千南アフリカランド | 千円 | | |
| | 国債証券 | 7.25 SOUTH AFRICA 200115 | 7.25 | 5,500 | 5,280 | 38,069 | 2020/1/15 |
| | | 7.75 SOUTH AFRICA 230228 | 7.75 | 5,000 | 4,701 | 33,899 | 2023/2/28 |
| | | 8 SOUTH AFRICA 181221 | 8.0 | 4,100 | 4,074 | 29,374 | 2018/12/21 |
| | | 8 SOUTH AFRICA 300131 | 8.0 | 8,500 | 7,491 | 54,016 | 2030/1/31 |
| | | 8.25 SOUTH AFRICA 170915 | 8.25 | 5,000 | 5,021 | 36,207 | 2017/9/15 |
| | | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 8.25 | 5,800 | 5,123 | 36,938 | 2032/3/31 |
| | | 8.5 SOUTH AFRICA 370131 | 8.5 | 7,000 | 6,179 | 44,556 | 2037/1/31 |
| | | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 8.75 | 5,000 | 4,440 | 32,014 | 2044/1/31 |
| | | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 8.75 | 9,700 | 8,597 | 61,984 | 2048/2/28 |
| | | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 8.875 | 2,500 | 2,308 | 16,641 | 2035/2/28 |
| | | 9 SOUTH AFRICA 400131 | 9.0 | 1,400 | 1,285 | 9,268 | 2040/1/31 |
| | 小 計 | | | | | 667,536 | |
| | 合 計 | | | | | 154,462,427 | |

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

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

損益の状況、組入資産の明細は「先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）」の第1期（2014年11月14日～2015年11月2日）の決算資料から抜粋したものです。

■ 損益及び余剰金計算書

| 区 分 | 第1期 (自 平成26年11月14日 至 平成27年11月2日) |
|-----------------------------|--|
| | 金 額 (円) |
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 18,169,577 |
| 営業収益合計 | 18,169,577 |
| 営業費用 | |
| 受託者報酬 | 213,689 |
| 委託者報酬 | 1,496,327 |
| その他費用 | 282,600 |
| 営業費用合計 | 1,992,616 |
| 営業利益 | 16,176,961 |
| 経常利益 | 16,176,961 |
| 当期純利益 | 16,176,961 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 | 1,417,240 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 (△) | — |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 55,798,247 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額 | 55,798,247 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,487,085 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額 | 1,487,085 |
| 分配金 | — |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) | 69,070,883 |

■ 組入資産の明細

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|------------------------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益証券 | ブラックロック先進国リート・インデックス・マザーファンド | 656,278,308 | 992,883,452 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 656,278,308 | 992,883,452 | |
| 合計 | | 656,278,308 | 992,883,452 | |

(注)親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

下記は、ブラックロック先進国リート・インデックス・マザーファンドの内容です。

外国投資証券

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|---------------------------------------|---|---------|-------|-------|-------|-----------|-------------|
| | | 口 | 数 | 口 | 数 | 評 価 額 | |
| | | | | | | 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 |
| ACADIA REALTY TRUST | | | 0.334 | | 0.875 | 28 | 3,469 |
| AGREE REALTY CORP | | | 0.089 | | 0.265 | 8 | 1,034 |
| ALEXANDER'S INC | | | 0.022 | | 0.046 | 18 | 2,190 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY | | | 0.467 | | 0.885 | 79 | 9,575 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | | | 0.124 | | 0.473 | 19 | 2,404 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | | | 0.689 | | 1.349 | 54 | 6,598 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | | | 0.876 | | 1.941 | 32 | 3,861 |
| AMERICAN REALTY CAPITAL PROP | | | 5.289 | | - | - | - |
| AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT | | | 0.316 | | 0.484 | 8 | 966 |
| AMREIT INC | | | 0.119 | | - | - | - |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | | | 0.965 | | 1.914 | 75 | 9,043 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | | | - | | 2.008 | 39 | 4,774 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES Inc | | | - | | 0.345 | 3 | 446 |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC | | | - | | 0.316 | 4 | 560 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | | | 0.401 | | 1.032 | 7 | 856 |
| ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION | | | 0.3 | | - | - | - |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | | 0.816 | | 1.612 | 281 | 33,979 |
| AVIV REIT INC | | | 0.136 | | - | - | - |
| BIOMED REALTY TRUST INC | | | 1.291 | | 2.447 | 57 | 6,906 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | | | - | | 0.21 | 2 | 296 |
| BOSTON PROPERTIES INC | | | 0.966 | | 1.854 | 233 | 28,132 |

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | |
|--------------------------------|---------|-------|-------|--------|-------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 外 貨 換 算 金 額 |
| | | | 外 貨 | 建 金 額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千米ドル | 千円 | |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 1.197 | 2.164 | 29 | 3,522 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 0.55 | 2.094 | 53 | 6,468 | |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 1.154 | 1.867 | 27 | 3,282 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 0.554 | 1.064 | 78 | 9,466 | |
| CAMPUS CREST COMMUNITIES INC | 0.35 | 0.821 | 5 | 656 | |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC | - | 0.899 | 29 | 3,571 | |
| CARETRUST REIT INC | 0.112 | 0.584 | 6 | 797 | |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 0.447 | 1.075 | 7 | 905 | |
| CHAMBERS STREET PROPERTIES | 1.759 | 2.862 | 20 | 2,443 | |
| CHATHAM LODGING TRUST | 0.143 | 0.511 | 11 | 1,410 | |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 0.389 | 0.701 | 19 | 2,327 | |
| CITY OFFICE REIT INC | - | 0.189 | 2 | 261 | |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 0.818 | 1.517 | 37 | 4,543 | |
| CORESITE REALTY CORP | 0.114 | 0.324 | 17 | 2,146 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 0.631 | 1.136 | 26 | 3,150 | |
| CORRECTIONS CORP OF AMERICA | 0.766 | 1.411 | 40 | 4,848 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 1.317 | 2.475 | 24 | 2,996 | |
| CUBESMART | 0.915 | 2.042 | 56 | 6,849 | |
| CYRUSONE INC | 0.199 | 0.771 | 27 | 3,279 | |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 2.082 | - | - | - | |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | - | 1.068 | 39 | 4,779 | |
| DDR CORP | 1.979 | 3.655 | 61 | 7,403 | |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 1.335 | 2.473 | 28 | 3,482 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 0.875 | 1.655 | 122 | 14,758 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 0.912 | 1.708 | 52 | 6,291 | |
| DUKE REALTY CORP | 2.232 | 4.209 | 87 | 10,504 | |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY | 0.431 | 0.801 | 25 | 3,099 | |
| EPR PROPERTIES TRUST | 0.369 | 0.695 | 39 | 4,760 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES | - | 0.134 | 2 | 282 | |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 0.211 | 0.393 | 22 | 2,661 | |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 0.812 | - | - | - | |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | - | 0.601 | 21 | 2,602 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 0.5 | 1.35 | 24 | 2,900 | |
| EQUITY COMMONWEALTH | 0.782 | 1.567 | 44 | 5,424 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 0.542 | 0.989 | 59 | 7,211 | |
| EQUITY ONE INC | 0.539 | 0.916 | 24 | 2,935 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 2.252 | 4.405 | 340 | 41,065 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 0.384 | 0.795 | 175 | 21,129 | |
| EXCEL TRUST INC | 0.258 | - | - | - | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 0.723 | 1.496 | 118 | 14,292 | |
| FEDERAL REALTY INVS | 0.442 | 0.837 | 120 | 14,480 | |
| FELCOR LODGING TRUST INC | 0.785 | 1.58 | 12 | 1,533 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 0.613 | 1.372 | 29 | 3,586 | |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 0.307 | 0.706 | 8 | 1,003 | |

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|-------------------------------------|---------|-------|------|-----|----|--------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | | |
| | | | 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 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 0.559 | 1.234 | 12 | | | 1,550 |
| GEO GROUP INC/THE | 0.451 | 0.892 | 28 | | | 3,470 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 0.574 | 1.118 | 32 | | | 3,932 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES | 3.944 | 7.06 | 204 | | | 24,642 |
| GETTY REALTY CORP | 0.159 | 0.449 | 7 | | | 913 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 0.113 | 0.28 | 4 | | | 540 |
| GLIMCHER REALTY TRUST | 0.977 | - | - | | | - |
| GLOBAL NET LEASE INC | - | 2.048 | 18 | | | 2,266 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST | 0.46 | 0.702 | 11 | | | 1,377 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST INC | 0.757 | - | - | | | - |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST INC | - | 0.716 | 16 | | | 1,957 |
| HCP INC | 2.879 | 5.598 | 208 | | | 25,108 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 0.653 | 1.219 | 32 | | | 3,874 |
| HEALTH CARE REIT INC | 2.063 | - | - | | | - |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 1.548 | - | - | | | - |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | - | 1.514 | 39 | | | 4,802 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 1.411 | - | - | | | - |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | - | 0.614 | 14 | | | 1,777 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 0.45 | 1.14 | 49 | | | 5,972 |
| HOME PROPERTIES INC | 0.38 | - | - | | | - |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 1.015 | 1.826 | 49 | | | 5,909 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 4.497 | 9.051 | 156 | | | 18,911 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 0.328 | 0.948 | 27 | | | 3,265 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | - | 0.384 | 3 | | | 362 |
| INLAND REAL ESTATE CORPATION | 0.418 | 1.036 | 9 | | | 1,105 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 0.523 | 1.45 | 11 | | | 1,419 |
| IRON MOUNTAIN INC | 1.13 | - | - | | | - |
| IRON MOUNTAIN INC | - | 2.288 | 70 | | | 8,452 |
| KILROY REALTY CORP | 0.541 | 1.115 | 73 | | | 8,851 |
| KIMCO REALTY CORP | 2.542 | 5.03 | 134 | | | 16,235 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 0.547 | 1.041 | 27 | | | 3,314 |
| LTC PROPERTIES INC | 0.207 | 0.449 | 19 | | | 2,319 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 0.707 | 1.388 | 40 | | | 4,921 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 1.461 | 2.587 | 22 | | | 2,757 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 0.966 | 1.848 | 62 | | | 7,580 |
| MACERICH CO/THE | 0.916 | 1.626 | 137 | | | 16,613 |
| MACK-CALI REALTY CORPRATION | 0.603 | 1.022 | 22 | | | 2,681 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 1.071 | 2.804 | 31 | | | 3,820 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNIES INC | 0.491 | 0.926 | 78 | | | 9,511 |
| MONMOUTH REIT-CLASS A | 0.327 | 0.646 | 6 | | | 810 |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC | - | 1.952 | 19 | | | 2,320 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 0.184 | 0.4 | 23 | | | 2,832 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 0.813 | 1.661 | 63 | | | 7,610 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | - | 0.285 | 4 | | | 516 |

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期 | | | 末 |
|--------------------------------|---------|-------|------|--------|---|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 額 |
| | | | 外貨 | 建金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千米ドル | 千円 | |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | - | 1,066 | 10 | 1,287 | |
| NEW YORK REIT INC | 1.183 | 1,985 | 22 | 2,728 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | - | 0.266 | 3 | 422 | |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE | - | 4,196 | 50 | 6,075 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 0.855 | 1,976 | 68 | 8,224 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 0.087 | 0.148 | 3 | 420 | |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 0.134 | 0.244 | 20 | 2,523 | |
| PARKWAY PROPERTIES INC | 0.477 | 1,001 | 16 | 2,019 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 0.42 | 0.867 | 29 | 3,572 | |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 0.456 | 0.838 | 18 | 2,271 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 0.275 | 0.927 | 14 | 1,786 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 1.001 | 1,868 | 36 | 4,364 | |
| POST PROPERTIES INC | 0.368 | 0.661 | 39 | 4,761 | |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | - | 0.265 | 2 | 349 | |
| PROLOGIS INC | 3.137 | 6,334 | 270 | 32,632 | |
| PUBLIC STORAGE INC | 0.91 | 1,782 | 408 | 49,300 | |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A | 0.061 | 0.414 | 17 | 2,146 | |
| RLJ LODGING TRUST | 0.856 | 1,585 | 39 | 4,794 | |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 0.622 | 1,025 | 17 | 2,076 | |
| REALTY INCOME CORP | 1.44 | 3,022 | 149 | 18,021 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 0.603 | 1,156 | 78 | 9,472 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENT | 0.625 | 1,223 | 22 | 2,673 | |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 1.493 | 2,897 | 43 | 5,228 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 0.221 | 0.656 | 9 | 1,198 | |
| ROUSE PROPERTIES INC | 0.188 | 0.464 | 8 | 984 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 0.346 | 0.611 | 32 | 3,874 | |
| SL GREEN REALTY CORP | 0.451 | 1,198 | 142 | 17,133 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 0.351 | 0.803 | 18 | 2,195 | |
| SAUL CENTERS INC | 0.069 | 0.139 | 7 | 939 | |
| SELECT INCOME REIT | 0.146 | 0.756 | 15 | 1,841 | |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 1.328 | 2,862 | 43 | 5,241 | |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 0.2 | 0.539 | 8 | 1,052 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 1.95 | 3,747 | 754 | 91,014 | |
| SOVRAN SELF STORAGE INC | 0.23 | 0.432 | 43 | 5,201 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 2.449 | 5,338 | 54 | 6,551 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 0.32 | 0.815 | 16 | 2,016 | |
| STARWOOD WAYPOINT RESIDE | 0.292 | 0.507 | 12 | 1,503 | |
| STORE CAPITAL CORP | - | 0.646 | 14 | 1,765 | |
| STRATEGIC HOTELS & RESORTS Inc | 1.564 | 3,384 | 47 | 5,752 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 0.446 | 1,097 | 14 | 1,730 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 0.273 | 0.651 | 43 | 5,260 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 1.435 | 2,505 | 36 | 4,367 | |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 0.656 | 1,165 | 40 | 4,909 | |
| TAUBMAN CENTERS INC | 0.429 | 0.621 | 47 | 5,763 | |

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|--|---------|--------|---------|-----------|-------------|
| | 口 数 | | 口 数 | 評 価 額 | |
| | 口 数 | | | 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 |
| TERRENO REALTY CORP | | 0.25 | 0.487 | 10 | 1,314 |
| UDR INC | | 1.517 | 3.16 | 108 | 13,129 |
| UMH PROPERTIES INC | | - | 0.456 | 4 | 543 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | | - | 1.015 | 24 | 2,905 |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | | 0.1 | 0.167 | 3 | 404 |
| VENTAS INC | | 1.755 | 4.014 | 215 | 25,998 |
| VEREIT INC | | - | 11.043 | 91 | 10,997 |
| VORNADO REALTY TRUST | | 1.074 | 2.135 | 214 | 25,883 |
| WP CAREY INC | | 0.584 | 1.199 | 75 | 9,160 |
| WP GLIMCHER INC | | - | 2.267 | 26 | 3,176 |
| WASHINGTON PRIME GROUP | | 1.008 | - | - | - |
| WASHINGTON REIT | | 0.476 | 0.817 | 22 | 2,660 |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | | 0.749 | 1.42 | 50 | 6,122 |
| WELLTOWER INC | | - | 4.261 | 276 | 33,326 |
| WHITESTONE REIT | | 0.144 | 0.362 | 4 | 539 |
| WINTHROP REALTY TRUST | | 0.191 | 0.441 | 6 | 770 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | | - | 1.316 | 22 | 2,751 |
| 通貨小計 | 口数・金額 | 116.84 | 241.557 | 8,672 | 1,045,668 |
| | 銘柄数・比率 | 142銘柄 | 155銘柄 | - | (68.6%) |
| (カナダ) | | 千口 | 千口 | 千カナダドル | 千円 |
| CALLOWAY REAL ESTATE INVESTMENT | | 0.43 | - | - | - |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | | 0.44 | 0.719 | 19 | 1,784 |
| MORGUARD REAL ESTATE INVESTMENT | | 0.182 | 0.28 | 4 | 372 |
| CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | | 0.224 | 0.402 | 17 | 1,578 |
| RIOCAN REAL ESTATE I | | 1.02 | 1.881 | 47 | 4,421 |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | | 0.309 | 0.431 | 15 | 1,425 |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | | 0.401 | 0.94 | 14 | 1,332 |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | | 0.143 | 0.289 | 15 | 1,431 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | | 0.305 | 0.771 | 10 | 951 |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT | | 0.477 | 0.608 | 7 | 728 |
| INTERENT REAL ESTATE INVESTMENT | | - | 0.257 | 1 | 153 |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE | | 0.592 | 0.91 | 4 | 372 |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | | 0.851 | 1.663 | 34 | 3,216 |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERIES | | 0.102 | 0.175 | 4 | 442 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | | - | 0.298 | 2 | 235 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | | - | 0.18 | 1 | 174 |
| INNVEST REAL ESTATE INVESTMENT | | - | 0.823 | 4 | 397 |
| MILESTONE APARTMENTS REAL ES | | - | 0.317 | 4 | 447 |
| CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN | | 0.446 | - | - | - |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT | | 0.115 | 0.299 | 11 | 1,050 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | | 0.286 | 0.467 | 5 | 507 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | - | 0.373 | 4 | 446 |
| PLAZA RETAIL REIT | | - | 0.368 | 1 | 150 |
| NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE INVESTMENT | | - | 0.145 | 2 | 247 |

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|---|---------|---------|------------|-------------|-----------------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額 |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (カナダ) | 千口 | 千口 | 千カナダドル | 千円 | |
| SLATE RETAIL REIT | - | 0.172 | 2 | 214 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | - | 0.475 | 3 | 352 | |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT | 0.319 | 0.84 | 7 | 703 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT | 0.344 | 0.679 | 14 | 1,313 | |
| ONEREIT | - | 0.45 | 1 | 140 | |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT | - | 0.76 | 23 | 2,175 | |
| 通貨小計 | 口数・金額 | 6,986 | 15,972 | 290 | 26,769 |
| | 銘柄数・比率 | 18銘柄 | 28銘柄 | - | <1.8%> |
| (オーストラリア) | 千口 | 千口 | 千オーストラリアドル | 千円 | |
| BWP TRUST | 3.392 | 6.104 | 19 | 1,692 | |
| MIRVAC GROUP | 23.764 | 45.015 | 81 | 6,995 | |
| INVESTA OFFICE FUND | 3.662 | 7.255 | 29 | 2,523 | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 6.276 | 16.904 | 16 | 1,462 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 2.046 | 3.48 | 14 | 1,270 | |
| ASPEN GROUP | - | 1.141 | 1 | 137 | |
| GPT GROUP | 10.882 | 21.28 | 101 | 8,739 | |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 1.768 | 3.186 | 10 | 897 | |
| ALE PROPERTY GROUP | 1.038 | 2.029 | 7 | 681 | |
| STOCKLAND | 14.856 | 28.841 | 116 | 10,057 | |
| DEXUS PROPERTY GROUP | 34.897 | 11.839 | 91 | 7,889 | |
| GOODMAN GROUP | 10.126 | 19.178 | 116 | 10,022 | |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 0.401 | 0.609 | 3 | 275 | |
| 360 CAPITAL GROUP LTD | - | 1.882 | 1 | 165 | |
| CHARTER HALL GROUP | 1.209 | 3.969 | 17 | 1,534 | |
| GALILEO JAPAN TRUST | - | 0.871 | 1 | 132 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | - | 1.881 | 5 | 498 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 4.093 | 8.64 | 3 | 338 | |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 3.145 | 9.315 | 19 | 1,652 | |
| FEDERATION CENTRES | - | 40.252 | 117 | 10,085 | |
| ARENA REIT | 1.315 | 1.947 | 3 | 287 | |
| INDUSTRIA REIT | - | 1.26 | 2 | 222 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 3.778 | 3.007 | 4 | 407 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | - | 1.32 | 3 | 292 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 3.22 | 4.967 | 4 | 384 | |
| 360 CAPITAL OFFICE FUND | - | 0.745 | 1 | 128 | |
| SCENTRE GROUP | 34.343 | 64.506 | 267 | 22,993 | |
| WESTFIELD CORP | 12.431 | 23.146 | 237 | 20,426 | |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST | 1.242 | 2.391 | 5 | 457 | |
| FEDERATION CENTRES | 9.202 | - | - | - | |
| NOVION PROPERTY GROUP | 15.337 | - | - | - | |
| 通貨小計 | 口数・金額 | 202,423 | 336.96 | 1,308 | 112,652 |
| | 銘柄数・比率 | 23銘柄 | 29銘柄 | - | <7.4%> |
| (香港) | 千口 | 千口 | 千香港ドル | 千円 | |
| LINK REIT | 14.5 | 28 | 1,300 | 20,237 | |

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|---------------------------------|---------|--|-------|--|-----------|--------|
| | 口数 | | 口数 | | 評価額 | |
| | 口数・金額 | | 口数 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (香港) | 千口 | | 千口 | | 千香港ドル | 千円 |
| PROSPERITY REIT | 13 | | 13 | | 37 | 576 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 9 | | 15 | | 61 | 956 |
| CHAMPION REIT | 16 | | 28 | | 113 | 1,768 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 9 | | 13 | | 51 | 794 |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT | — | | 10 | | 19 | 306 |
| FORTUNE REIT | 9 | | 18 | | 145 | 2,263 |
| NEW CENTURY REIT | — | | 3 | | 9 | 141 |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN | 7 | | 8 | | 24 | 385 |
| 通貨小計 | 口数・金額 | | 口数 | | 1,762 | 27,431 |
| | 銘柄数・比率 | | 銘柄 | | — | (1.8%) |
| (シンガポール) | 千口 | | 千口 | | 千シンガポールドル | 千円 |
| CAPITALAND MALL TRUST | 18 | | 31 | | 61 | 5,293 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV | 13 | | 24.2 | | 57 | 4,987 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 11 | | 25.1 | | 35 | 3,052 |
| SUNTEC REIT | 15 | | 30 | | 49 | 4,268 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 8 | | 18.6 | | 18 | 1,636 |
| STARHILL GLOBAL REIT | 7 | | 16.6 | | 13 | 1,159 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 4 | | 9.9 | | 11 | 1,033 |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | 5 | | 6.9 | | 9 | 815 |
| KEPPEL REIT | 8 | | 19.7 | | 19 | 1,639 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 3 | | 6.6 | | 12 | 1,112 |
| CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST | 12 | | 15 | | 9 | 789 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 5 | | 7 | | 9 | 817 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 3 | | 8.3 | | 12 | 1,088 |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 3 | | 5.9 | | 7 | 630 |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 2 | | 4.7 | | 10 | 936 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL | 10 | | 18.1 | | 5 | 499 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 8 | | 13.7 | | 20 | 1,801 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 9 | | 15.2 | | 20 | 1,795 |
| CACHE LOGISTICS TRUST | 4 | | 9.2 | | 9 | 797 |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL | 3,275 | | 7,375 | | 10 | 890 |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 4 | | 8.9 | | 6 | 583 |
| MAPLETREE GREATER CHINA COMMERC | 11 | | 20.1 | | 19 | 1,724 |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 4 | | 8.1 | | 5 | 475 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 5 | | 7.8 | | 5 | 450 |
| SPH REIT | 4 | | 11 | | 10 | 891 |
| OUE HOSPITALITY TRUST | 8 | | 8 | | 6 | 562 |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 3 | | 7.8 | | 6 | 538 |
| OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | — | | 5.51 | | 3 | 325 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | — | | 7.5 | | 5 | 501 |
| KEPPEL DC REIT | — | | 12.1 | | 12 | 1,090 |
| 通貨小計 | 口数・金額 | | 口数 | | 489 | 42,189 |
| | 銘柄数・比率 | | 銘柄 | | — | (2.8%) |

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | |
|------------------------------|-------------------|---------------|-----------------|-----------|-------------------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |
| (ニュージーランド) | 千口 | 千口 | 千ニュージーランドドル | 千円 | |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | - | 10,214 | 12 | 1,017 | |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | - | 2,581 | 4 | 370 | |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 8,273 | 12,345 | 14 | 1,214 | |
| KIWI INCOME PROPERTY TRUST | 7,197 | - | - | - | |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 2,454 | 4,892 | 7 | 615 | |
| STRIDE PROPERTY LTD | 2,442 | 3,538 | 7 | 603 | |
| ARGOSY PROPERTY LTD | - | 8,853 | 9 | 813 | |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | - | 14,955 | 20 | 1,660 | |
| 通貨小計 | 口数・金額 銘柄数・(比率) | 20,366 4銘柄 | 57,378 7銘柄 | 77 - | 6,295 (0.4%) |
| (イギリス) | 千口 | 千口 | 千英国ポンド | 千円 | |
| BRITISH LAND COMPANY PLC | 6,549 | 12,469 | 108 | 20,205 | |
| DERWENT LONDON PLC | 0.55 | 1,348 | 52 | 9,736 | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 1.02 | 1,724 | 12 | 2,406 | |
| HAMMERSON PLC | 4,652 | 9,57 | 60 | 11,338 | |
| MCKAY SECURITIES PLC-ORD | 1.2 | 0,945 | 2 | 462 | |
| MUCKLOW (A & J) GROUP PLC | 0.3 | - | - | - | |
| INTU PROPERTIES PLC | 5,961 | 11,591 | 40 | 7,472 | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 1,132 | 1,235 | 5 | 991 | |
| SHAFTESBURY PLC | 1,755 | 3,434 | 32 | 6,012 | |
| LAND SECURITIES GROUP | 4,994 | 9,759 | 130 | 24,324 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 1,806 | 4,232 | 37 | 7,007 | |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | - | 5,284 | 3 | 585 | |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | 5,626 | 8,518 | 10 | 1,967 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 1,084 | 2,599 | 8 | 1,574 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 4,261 | 7,23 | 12 | 2,277 | |
| SEGRO PLC | 4.88 | 9,07 | 40 | 7,594 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 0.73 | 1,477 | 14 | 2,632 | |
| REDEFINE INTERNATIONAL PLC | 5 | 12,911 | 7 | 1,330 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 2 | 8,958 | 11 | 2,146 | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | - | 3,389 | 3 | 690 | |
| ASSURA PLC | - | 12,173 | 6 | 1,274 | |
| 通貨小計 | 口数・金額 銘柄数・(比率) | 53.5 18銘柄 | 127,924 20銘柄 | 601 - | 112,032 (7.3%) |
| (イスラエル) | 千口 | 千口 | 千イスラエルシェケル | 千円 | |
| REIT 1 LTD | - | 1,901 | 20 | 630 | |
| 通貨小計 | 口数・金額 銘柄数・(比率) | - - | 1,901 1銘柄 | 20 - | 630 (0.0%) |
| (ユーロ…アイルランド) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | |
| GREEN REIT PLC | 4,773 | 8,334 | 13 | 1,744 | |
| HIBERNIA REIT PLC | 2,089 | 7,562 | 10 | 1,352 | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | - | 3,594 | 4 | 535 | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV | 0,241 | 0,586 | 25 | 3,384 | |

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|----------------------------------|-------------|---------|-----------|-------------|-----------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (ユーロ…オランダ) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | |
| VASTNED RETAIL NV | 0.093 | 0.244 | 10 | 1,435 | |
| CORIO NV | 0.655 | - | - | - | |
| WERELDHAVE NV | 0.129 | 0.483 | 27 | 3,645 | |
| NSI NV | 0.609 | 1.63 | 6 | 858 | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | |
| BEFIMMO | 0.119 | 0.245 | 14 | 1,983 | |
| COFINIMMO | 0.099 | 0.247 | 25 | 3,332 | |
| RETAIL ESTATES | - | 0.066 | 4 | 661 | |
| WERELDHAVE BELGIUM NV | - | 0.025 | 2 | 358 | |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | - | 0.098 | 2 | 299 | |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 0.056 | 0.162 | 12 | 1,604 | |
| AEDIFICA | 0.05 | 0.153 | 9 | 1,240 | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | |
| AFFINE | - | 0.071 | 1 | 158 | |
| ICADE | 0.209 | 0.429 | 28 | 3,841 | |
| ALTAREA | 0.019 | 0.029 | 4 | 660 | |
| KLEPIERRE | 0.628 | 2.27 | 98 | 13,027 | |
| GECINA SA | 0.213 | 0.426 | 49 | 6,591 | |
| FONCIERE DES REGIONS | 0.303 | 0.523 | 44 | 5,961 | |
| ANF IMMOBILIER | 0.093 | 0.103 | 2 | 290 | |
| MERCIALYS | 0.368 | 0.234 | 4 | 650 | |
| FONCIERE DES MURS | - | 0.099 | 2 | 347 | |
| UNIBAIL-RODAMCO SE | 0.631 | 1.184 | 300 | 39,989 | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | | |
| HAMBORNER REIT AG | 0.562 | 0.774 | 7 | 994 | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 0.515 | 1.016 | 12 | 1,714 | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 0.423 | 0.85 | 8 | 1,084 | |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 0.745 | 3.702 | 43 | 5,737 | |
| AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA | 0.384 | 0.802 | 10 | 1,385 | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | |
| BENI STABILI SPA | 4.471 | 13.463 | 10 | 1,340 | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 1.384 | 3.271 | 2 | 395 | |
| ユーロ小計 | 口 数 ・ 金 額 | 19,861 | 52,675 | 802 | 106,606 |
| | 銘 柄 数・(比 率) | 26銘柄 | 31銘柄 | - | (7.0%) |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 687,751 | 1,360,252 | - | 1,480,275 |
| | 銘 柄 数・(比 率) | 265銘柄 | 310銘柄 | - | (97.1%) |

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

(注2) 〈 〉は純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

「iシェアーズ MSCI エマージング・マーケット・ミニマム・ボラティリティ ETF」は、名称を「iシェアーズ エッジ MSCI ミニマム・ボラティリティ・エマージング・マーケット ETF」に変更しました。

iシェアーズ MSCI エマージング・マーケット・ミニマム・ボラティリティ ETF

(iShares MSCI Emerging Markets Minimum Volatility ETF)

損益計算書、投資明細表は、入手可能なFinancial Statementsから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1. 損益計算書

(2015年8月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

投資純利益

| | |
|---------------------------|-------------------|
| 受取配当金－関連会社以外 ^a | \$ 64,332,717 |
| 受取利息－関連会社以外 | 185 |
| 受取利息－関連会社 | 504 |
| 有価証券貸付収益－関連会社 | 3,249,371 |
| | <u>67,582,777</u> |
| 差引：その他の外国税 | (495,622) |
| 投資収益合計 | <u>67,087,155</u> |

費用

| | |
|--------------|-------------------|
| 投資顧問報酬 | 15,586,950 |
| モーリシャス所得税 | 6,422 |
| コミットメント・フィー | 2,046 |
| 支払利息 | 4,241 |
| 費用合計 | <u>15,599,659</u> |
| 差引：投資顧問報酬放棄額 | (9,914,710) |
| 費用純額 | <u>5,684,949</u> |
| 投資純利益 | <u>61,402,206</u> |

実現および未実現損益（純額）

| | |
|-------------------|-------------------------|
| 実現純損益 | |
| 投資－関連会社以外 | (71,929,174) |
| 現物償還－関連会社以外 | 7,795,576 |
| 外国通貨取引 | (1,467,421) |
| 実現純損益 | <u>(65,601,019)</u> |
| 未実現評価損益の純変動 | |
| 投資 | (459,078,197) |
| 外貨建て資産および負債の換算 | (145,213) |
| 未実現評価損益の純変動 | <u>(459,223,410)</u> |
| 実現および実現損益（純額） | <u>(524,824,429)</u> |
| 営業活動による純資産の増減（純額） | <u>\$ (463,422,223)</u> |

a：外国源泉徴収税控除後の金額です。

(注) ()内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2015年8月31日現在)

| 銘柄 | 数量 | 価額 | 銘柄 | 数量 | 価額 |
|--|-------------|---------------|---|------------|--------------|
| COMMON STOCKS — 98.34% | | | | | |
| BRAZIL — 2.35% | | | | | |
| Ambev SA | 2,028,600 | \$ 10,632,432 | China Life Insurance Co. Ltd. Class H | 974,000 | \$ 3,368,133 |
| BRF SA | 193,200 | 3,687,628 | China Medical System Holdings Ltd. ^a | 5,796,000 | 6,297,033 |
| Cielo SA | 1,806,948 | 19,025,727 | China Mengniu Dairy Co. Ltd. | 3,395,000 | 11,871,472 |
| Souza Cruz SA | 531,300 | 3,871,426 | China Merchants Holdings International Co. Ltd. ^a | 966,000 | 3,228,289 |
| TOTVS SA | 728,100 | 6,336,954 | China Minsheng Banking Corp. Ltd. Class H | 1,449,100 | 1,404,215 |
| Tractebel Energia SA | 289,800 | 2,668,650 | China Mobile Ltd. | 2,430,000 | 29,442,004 |
| Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA Units | 821,100 | 4,170,595 | China Petroleum & Chemical Corp. Class H | 16,884,000 | 11,241,404 |
| Ultrapar Participacoes SA | 435,100 | 7,582,071 | China Resources Gas Group Ltd. ^a | 4,830,000 | 12,744,885 |
| | | 57,975,483 | China Resources Power Holdings Co. Ltd. | 2,898,000 | 7,097,250 |
| CHILE — 3.94% | | | CSPC Pharmaceutical Group Ltd. | 11,592,000 | 10,619,699 |
| AES Gener SA | 7,666,176 | 3,856,662 | Dalian Wanda Commercial Properties Co. Ltd. Class H ^c | 1,159,200 | 7,119,686 |
| Aguas Andinas SA Series A | 29,762,460 | 15,427,772 | ENN Energy Holdings Ltd. | 412,000 | 2,102,515 |
| Banco de Chile | 284,587,003 | 29,416,800 | Guangdong Investment Ltd. | 15,456,000 | 20,900,366 |
| Banco de Credito e Inversiones | 60,142 | 2,627,587 | Haier Electronics Group Co. Ltd. | 1,502,000 | 2,693,892 |
| Cia. Cervecerias Unidas SA | 391,230 | 4,336,131 | Hanergy Thin Film Power Group Ltd. ^{a,b} | 39,762,000 | 51 |
| Colbun SA | 64,232,721 | 17,452,850 | Hengnan International Group Co. Ltd. ^a | 2,184,500 | 21,436,149 |
| Empresa Nacional de Electricidad SA/Chile | 10,992,114 | 13,631,916 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Class H | 24,633,000 | 14,557,214 |
| Empresas COPEC SA | 226,527 | 2,215,202 | Inner Mongolia Yitai Coal Co. Ltd. Class B | 6,134,119 | 5,189,465 |
| SACI Falabella | 318,780 | 1,968,421 | Jiangsu Expressway Co. Ltd. Class H | 15,524,000 | 18,348,248 |
| Vina Concha y Toro SA | 3,569,853 | 5,991,156 | Lenovo Group Ltd. ^a | 12,786,000 | 10,492,701 |
| | | 96,924,497 | Luye Pharma Group Ltd. ^b | 2,415,000 | 2,056,632 |
| CHINA — 18.21% | | | PetroChina Co. Ltd. Class H | 4,830,000 | 4,013,548 |
| AAC Technologies Holdings Inc. ^a | 1,449,000 | 8,161,089 | Semiconductor Manufacturing International Corp. ^{a,b} | 27,531,000 | 2,415,608 |
| Agricultural Bank of China Ltd. Class H | 19,320,000 | 7,802,737 | Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. Class H | 1,932,000 | 1,351,145 |
| Bank of China Ltd. Class H | 50,715,000 | 23,165,154 | Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd. Class H | 2,125,200 | 4,431,356 |
| Bank of Communications Co. Ltd. Class H | 3,381,000 | 2,547,731 | Shenzhen International Group Holdings Ltd. ^a | 4,830,000 | 24,399,133 |
| Beijing Enterprises Holdings Ltd. | 2,415,000 | 14,100,393 | Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd. | 10,904,000 | 2,110,438 |
| Beijing Enterprises Water Group Ltd. ^a | 11,592,000 | 8,301,314 | Sino Biopharmaceutical Ltd. | 15,504,000 | 18,404,630 |
| China CITIC Bank Corp. Ltd. Class H ^b | 5,313,000 | 3,256,334 | | | |
| China Communications Services Corp. Ltd. Class H | 16,422,000 | 6,039,019 | | | |
| China Construction Bank Corp. Class H | 27,048,000 | 19,020,729 | | | |
| China Everbright Bank Co. Ltd. Class H | 14,973,000 | 6,839,236 | | | |
| China Gas Holdings Ltd. ^a | 966,000 | 1,410,974 | | | |

(2015年8月31日現在)

| 銘柄 | 数量 | 価額 | 銘柄 | 数量 | 価額 |
|--|------------|--------------|---|-------------|--------------|
| Sinopharm Group Co. Ltd. | | | Tech Mahindra Ltd. | 244,398 | \$ 1,893,418 |
| Class H | 579,600 | \$ 2,194,987 | Wipro Ltd. | 912,387 | 7,848,107 |
| SOHO China Ltd. ^a | 21,010,500 | 8,973,459 | | | 74,436,891 |
| Sun Art Retail Group Ltd. ^a | 17,629,500 | 14,694,946 | INDONESIA — 6.60% | | |
| Tencent Holdings Ltd. | 1,255,800 | 21,356,564 | Astra Agro Lestari Tbk PT | 2,415,000 | 2,943,550 |
| Tingyi Cayman Islands | | | Bank Central Asia Tbk PT | 37,674,000 | 34,590,363 |
| Holding Corp. | 6,016,000 | 9,252,936 | Bank Danamon Indonesia Tbk PT | 20,672,400 | 5,201,205 |
| Tsingtao Brewery Co. Ltd. | | | Bank Mandiri Persero Tbk PT | 18,305,700 | 11,856,361 |
| Class H | 1,240,000 | 6,095,961 | Bank Negara Indonesia Persero | | |
| Want Want China Holdings Ltd. ^a | 2,415,000 | 1,947,568 | Tbk PT | 11,012,400 | 3,879,814 |
| Zhejiang Expressway Co. Ltd. | | | Bank Rakyat Indonesia Persero | | |
| Class H | 17,388,000 | 18,666,739 | Tbk PT | 14,345,100 | 10,848,163 |
| ZTE Corp. Class H | 2,634,120 | 5,308,992 | Gudang Garam Tbk PT | 531,300 | 1,682,765 |
| | | 448,474,023 | Indocement Tunggal Prakarsa | | |
| COLOMBIA — 0.66% | | | Tbk PT | 775,800 | 1,083,635 |
| Almacenes Exito SA | 551,103 | 2,989,335 | Indofood CBP Sukses Makmur | | |
| Corp. Financiera Colombiana SA | 293,181 | 3,478,178 | Tbk PT | 2,946,300 | 2,673,689 |
| Ecopetrol SA | 8,987,664 | 4,634,015 | Indofood Sukses Makmur Tbk PT | 29,076,600 | 10,968,397 |
| Isagen SA ESP | 5,419,743 | 5,150,814 | Jasa Marga Persero Tbk PT | 27,917,400 | 10,233,068 |
| | | 16,252,342 | Kalbe Farma Tbk PT | 134,032,500 | 15,978,963 |
| CZECH REPUBLIC — 0.36% | | | Perusahaan Gas Negara Persero | | |
| CEZ AS | 291,249 | 6,647,465 | Tbk PT | 6,810,300 | 1,347,518 |
| Komerční Banka AS | 9,660 | 2,197,592 | Tambang Batubara Bukit Asam | | |
| | | 8,845,057 | Persero Tbk PT | 2,656,500 | 1,106,087 |
| EGYPT — 0.61% | | | Telekomunikasi Indonesia | | |
| Commercial International Bank | | | Persero Tbk PT | 98,773,500 | 20,176,509 |
| Egypt SAE | 2,333,648 | 14,937,636 | Tower Bersama Infrastructure | | |
| | | 14,937,636 | Tbk PT ^b | 14,973,000 | 7,646,354 |
| HUNGARY — 0.08% | | | Unilever Indonesia Tbk PT | 7,196,700 | 20,347,965 |
| Richter Gedeon Nyrt | 134,757 | 2,057,285 | | | 162,564,406 |
| | | 2,057,285 | MALAYSIA — 7.89% | | |
| INDIA — 3.02% | | | Astro Malaysia Holdings Bhd | 1,551,400 | 1,071,205 |
| Cipla Ltd. | 211,071 | 2,165,958 | Axiata Group Bhd | 13,330,800 | 19,488,360 |
| Coal India Ltd. | 310,569 | 1,711,575 | Berjaya Sports Toto Bhd | 1,690,597 | 1,187,443 |
| Dabur India Ltd. | 4,235,427 | 17,397,267 | DiGi.Com Bhd ^a | 2,318,400 | 2,886,960 |
| Divi's Laboratories Ltd. | 258,405 | 9,189,850 | Hong Leong Bank Bhd ^a | 5,409,600 | 16,847,040 |
| Dr. Reddy's Laboratories Ltd. | 165,669 | 10,723,065 | IHH Healthcare Bhd | 22,556,100 | 31,417,425 |
| HCL Technologies Ltd. | 113,440 | 1,657,103 | Malayan Banking Bhd ^a | 13,717,200 | 28,610,160 |
| Hindustan Unilever Ltd. | 336,168 | 4,353,622 | Maxis Bhd ^a | 14,007,000 | 21,910,950 |
| Infosys Ltd. | 103,362 | 1,701,683 | Petronas Chemicals Group Bhd ^a | 4,781,700 | 6,910,695 |
| Sun Pharmaceuticals | | | Petronas Dagangan Bhd | 386,400 | 1,946,720 |
| Industries Ltd. | 944,838 | 12,777,166 | Petronas Gas Bhd ^a | 2,366,700 | 12,013,820 |
| Tata Consultancy Services Ltd. | 78,246 | 3,018,077 | Public Bank Bhd ^a | 7,293,380 | 31,257,343 |
| | | | Sime Darby Bhd ^a | 3,381,000 | 5,997,250 |

(2015年8月31日現在)

| 銘柄 | 数量 | 価額 | 銘柄 | 数量 | 価額 |
|---|------------|--------------|---------------------------------------|---------------------------|-------------------------|
| Telekom Malaysia Bhd | 5,023,200 | \$ 7,762,040 | QATAR — 3.65% | Commercial Bank QSC (The) | 1,518,440 \$ 23,937,397 |
| Tenaga Nasional Bhd | 1,835,400 | 4,885,660 | | Doha Bank QSC | 355,005 |
| | | 194,193,071 | Industries Qatar QSC | 114,954 | 4,198,974 |
| MEXICO — 3.39% | | | Masraf Al Rayan QSC | 104,811 | 1,255,049 |
| America Movil SAB de CV | 9,128,700 | 8,307,226 | Ooredoo QSC | 207,690 | 3,964,312 |
| Arca Continental SAB de CV | 2,223,400 | 12,660,660 | Qatar Electricity & Water Co. QSC | 369,495 | 22,223,890 |
| Coca-Cola Femsa SAB de CV Series L | 386,400 | 2,774,803 | Qatar Insurance Co. SAQ | 222,663 | 5,992,962 |
| El Puerto de Liverpool SAB de CV Series C1 | 2,270,100 | 27,040,976 | Qatar Islamic Bank SAQ | 437,115 | 13,565,679 |
| Fibra Uno Administracion SA de CV | 966,000 | 2,066,135 | Qatar National Bank SAQ | 173,880 | 8,548,109 |
| Gruma SAB de CV Series B | 434,700 | 5,831,923 | Vodafone Qatar QSC | 272,412 | 1,058,644 |
| Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV Series B | 1,014,300 | 8,485,544 | | | 89,902,733 |
| Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV Series B | 338,100 | 4,912,323 | RUSSIA — 0.21% | | |
| Grupo Bimbo SAB de CV ^b | 531,300 | 1,364,029 | Rosneft OAO | 906,120 | 3,302,204 |
| Wal-Mart de Mexico SAB de CV | 4,153,800 | 9,933,969 | Rosneft OAO GDR ^d | 534,949 | 2,015,688 |
| | | 83,377,588 | | | 5,317,892 |
| PERU — 1.05% | | | SOUTH AFRICA — 5.92% | | |
| Cia. de Minas Buenaventura SA ADR | 357,903 | 2,261,947 | Aspen Pharmacare Holdings Ltd. | 197,064 | 5,088,595 |
| Credicorp Ltd. | 213,969 | 23,532,311 | Bidvest Group Ltd. (The) | 268,681 | 6,459,647 |
| | | 25,794,258 | Discovery Ltd. | 633,505 | 6,400,362 |
| PHILIPPINES — 3.98% | | | Foschini Group Ltd. (The) | 239,085 | 2,701,912 |
| Aboitiz Power Corp. | 14,586,600 | 13,497,442 | Liberty Holdings Ltd. | 497,490 | 4,830,783 |
| Bank of the Philippine Islands | 10,674,304 | 19,320,627 | Life Healthcare Group Holdings Ltd. | 2,938,089 | 8,430,455 |
| BDO Unibank Inc. | 6,158,250 | 12,977,913 | Mediclinic International Ltd. | 218,015 | 1,751,122 |
| International Container Terminal Services Inc. | 4,873,470 | 9,691,678 | Mr. Price Group Ltd. | 213,969 | 3,849,563 |
| Jollibee Foods Corp. | 2,337,730 | 9,577,991 | MTN Group Ltd. | 80,178 | 1,069,725 |
| Metropolitan Bank & Trust Co. | 4,402,141 | 7,887,876 | Nedbank Group Ltd. | 555,450 | 9,881,832 |
| Philippine Long Distance Telephone Co. | 466,099 | 25,109,912 | Netcare Ltd. | 1,200,255 | 3,606,850 |
| | | 98,063,439 | Pick n Pay Stores Ltd. | 1,231,650 | 5,812,714 |
| POLAND — 1.58% | | | Rand Merchant Insurance Holdings Ltd. | 2,403,891 | 7,608,070 |
| Bank Pekao SA | 235,704 | 10,055,679 | Redefine Properties Ltd. | 12,799,752 | 11,077,984 |
| Bank Zachodni WBK SA ^b | 58,926 | 4,732,636 | Sasol Ltd. | 146,832 | 4,703,650 |
| PGE Polska Grupa Energetyczna SA | 3,975,573 | 16,449,630 | Shoprite Holdings Ltd. | 776,181 | 9,501,367 |
| Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA | 66,364 | 7,578,124 | SPAR Group Ltd. (The) | 566,076 | 8,108,596 |
| | | 38,816,069 | Standard Bank Group Ltd. | 2,387,469 | 26,300,542 |
| | | | Tiger Brands Ltd. | 173,397 | 3,919,138 |
| | | | Tsogo Sun Holdings Ltd. | 579,117 | 1,026,010 |
| | | | Vodacom Group Ltd. | 1,278,501 | 13,637,794 |
| | | | | | 145,766,711 |

(2015年8月31日現在)

| 銘柄 | 数量 | 価額 | 銘柄 | 数量 | 価額 |
|---|------------|---------------|---|------------|---------------|
| SOUTH KOREA — 11.74% | | | Far EasTone | | |
| AmorePacific Corp. | 46,034 | \$ 14,731,658 | Telecommunications Co. Ltd. | 13,617,000 | \$ 29,882,401 |
| AmorePacific Group | 72,118 | 10,487,674 | First Financial Holding Co. Ltd. | 36,422,946 | 17,631,590 |
| Cheil Worldwide Inc. ^b | 128,824 | 1,895,191 | Formosa Chemicals & Fibre Corp. | 483,300 | 1,033,860 |
| CJ CheilJedang Corp. | 16,905 | 5,617,134 | Formosa Petrochemical Corp. | 4,830,000 | 10,822,074 |
| Coway Co. Ltd. | 50,048 | 3,571,381 | Formosa Plastics Corp. | 4,023,840 | 8,867,388 |
| Dongbu Insurance Co. Ltd. | 337,617 | 15,185,986 | Formosa Taffeta Co. Ltd. | 6,792,000 | 5,907,721 |
| E-Mart Co. Ltd. | 18,837 | 3,639,192 | Foxconn Technology Co. Ltd. | 4,391,328 | 12,349,598 |
| Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd. ^a | 658,329 | 15,585,045 | Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. | 2,415,000 | 6,865,856 |
| Hyundai Wia Corp. | 16,560 | 1,463,133 | HTC Corp. | 3,864,000 | 5,468,933 |
| Kangwon Land Inc. | 515,844 | 18,557,736 | Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd. | 32,825,175 | 15,536,873 |
| KEPCO Plant Service & Engineering Co. Ltd. | 110,607 | 11,783,117 | Kinsus Interconnect Technology Corp. | 2,898,000 | 5,166,093 |
| Kia Motors Corp. | 161,514 | 6,650,376 | Lite-On Technology Corp. | 16,018,548 | 14,671,525 |
| Korea Electric Power Corp. | 246,330 | 9,996,906 | MediaTek Inc. | 483,000 | 3,726,119 |
| KT Corp. ^b | 232,323 | 5,666,894 | Novatek Microelectronics Corp. | 200,000 | 670,027 |
| KT&G Corp. | 363,033 | 33,916,843 | President Chain Store Corp. | 1,940,000 | 12,968,711 |
| LG Display Co. Ltd. | 52,385 | 1,020,904 | Quanta Computer Inc. | 966,000 | 1,775,473 |
| Lotte Shopping Co. Ltd. | 12,075 | 2,730,977 | Standard Foods Corp. | 1,140,340 | 2,590,089 |
| NAVER Corp. | 3,659 | 1,532,897 | Synnex Technology International Corp. | 9,660,000 | 10,272,805 |
| Orion Corp./Republic of Korea S-1 Corp. ^a | 11,109 | 8,763,219 | Taiwan Business Bank ^b | 9,846,921 | 2,481,705 |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 213,486 | 16,948,920 | Taiwan Cement Corp. | 6,762,000 | 7,242,922 |
| Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. | 9,241 | 8,508,517 | Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd. | 63,900,375 | 27,103,060 |
| Samsung Life Insurance Co. Ltd. | 65,688 | 14,967,589 | Taiwan Mobile Co. Ltd. | 10,189,000 | 30,627,127 |
| SK Holdings Co. Ltd. | 198,513 | 16,498,692 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 9,177,000 | 36,385,327 |
| SK Hynix Inc. | 57,477 | 13,120,938 | Transcend Information Inc. | 2,898,000 | 7,811,489 |
| SK Telecom Co. Ltd. | 269,633 | 8,161,371 | U-Ming Marine Transport Corp. | 5,796,000 | 5,745,052 |
| SK Telecom Co. Ltd. | 76,797 | 15,843,135 | United Microelectronics Corp. | 5,313,000 | 1,755,432 |
| Yuhan Corp. ^a | 105,777 | 22,224,126 | WPG Holdings Ltd. | 1,932,000 | 1,825,947 |
| | | 289,069,551 | | | 412,947,686 |
| TAIWAN — 16.77% | | | THAILAND — 3.90% | | |
| Advanced Semiconductor Engineering Inc. | 1,941,000 | 2,004,475 | Advanced Info Service PCL NVDR | 1,305,800 | 8,670,119 |
| Advantech Co. Ltd. | 1,932,481 | 12,294,799 | Bangkok Bank PCL NVDR ^a | 1,110,900 | 5,098,146 |
| Asia Cement Corp. | 13,199,125 | 14,178,431 | Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR | 16,101,700 | 8,759,469 |
| Asustek Computer Inc. | 1,103,000 | 10,034,669 | BTS Group Holdings PCL NVDR | 79,501,800 | 21,624,844 |
| Chicony Electronics Co. Ltd. | 4,381,579 | 10,881,226 | CP ALL PCL NVDR | 10,995,400 | 15,644,173 |
| China Airlines Ltd. ^b | 25,116,828 | 9,032,053 | Delta Electronics Thailand PCL NVDR | 3,042,900 | 7,385,474 |
| China Steel Corp. | 23,667,517 | 14,184,798 | | | |
| Chunghwa Telecom Co. Ltd. | 13,524,000 | 41,067,470 | | | |
| Delta Electronics Inc. | 1,936,000 | 9,699,041 | | | |
| EVA Airways Corp. ^b | 3,949,899 | 2,385,527 | | | |

(2015年8月31日現在)

| 銘柄 | 数量 | 価額 |
|--|------------|---------------|
| Glow Energy PCL NVDR | 2,511,600 | \$ 6,919,250 |
| Kasikornbank PCL NVDR ^a | 1,034,000 | 5,206,779 |
| PTT Exploration & Production PCL NVDR | 1,143,100 | 2,535,262 |
| PTT PCL NVDR | 1,555,300 | 11,628,411 |
| Thai Oil PCL NVDR | 1,738,800 | 2,498,206 |
| | | 95,970,133 |
| UNITED ARAB EMIRATES — 2.43% | | |
| Abu Dhabi Commercial Bank PJSC | 1,757,637 | 3,828,180 |
| DP World Ltd. | 771,351 | 17,201,127 |
| First Gulf Bank PJSC | 4,571,595 | 17,860,467 |
| National Bank of Abu Dhabi PJSC | 7,406,842 | 20,971,987 |
| | | 59,861,761 |
| TOTAL COMMON STOCKS | | |
| (Cost: \$2,701,179,502) | | 2,421,548,512 |
| PREFERRED STOCKS — 1.11% | | |
| COLOMBIA — 0.89% | | |
| Banco Davivienda SA | 913,836 | 7,042,460 |
| Grupo de Inversiones Suramericana SA | 1,310,862 | 14,865,052 |
| | | 21,907,512 |
| RUSSIA — 0.18% | | |
| AK Transneft OAO | 1,899 | 4,383,183 |
| | | 4,383,183 |
| SOUTH KOREA — 0.04% | | |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 1,449 | 1,065,847 |
| | | 1,065,847 |
| TOTAL PREFERRED STOCKS | | |
| (Cost: \$40,718,162) | | 27,356,542 |
| SHORT-TERM INVESTMENTS — 3.12% | | |
| MONEY MARKET FUNDS — 3.12% | | |
| BlackRock Cash Funds: Institutional, SL Agency Shares 0.18% ^{e,f,g} | 72,529,174 | 72,529,174 |
| BlackRock Cash Funds: Prime, SL Agency Shares 0.18% ^{e,f,g} | 4,164,982 | 4,164,982 |
| | | 76,694,156 |
| TOTAL SHORT-TERM INVESTMENTS | | |
| (Cost: \$76,694,156) | | 76,694,156 |

TOTAL INVESTMENTS**IN SECURITIES — 102.57%**

(Cost: \$2,818,591,820)

\$2,525,599,210

Other Assets, Less Liabilities — (2.57)%

(63,242,222)

NET ASSETS — 100.00%\$2,462,356,988

ADR — American Depositary Receipts

GDR — Global Depositary Receipts

NVDR — Non-Voting Depositary Receipts

^a All or a portion of this security represents a security on loan. See Note 1.^b Non-income earning security.^c This security may be resold to qualified institutional buyers under Rule 144A of the Securities Act of 1933.^d This security may be resold to qualified foreign investors and foreign institutional buyers under Regulation S of the Securities Act of 1933.^e Affiliated issuer. See Note 2.^f The rate quoted is the annualized seven-day yield of the fund at period end.^g All or a portion of this security represents an investment of securities lending collateral. See Note 1.

iシェアーズ J.P. モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF

(iShares J.P. Morgan USD Emerging Markets Bond ETF)

損益計算書、投資明細表は、入手可能なFinancial Statementsから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1. 損益計算書

(2015年10月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

| | |
|-----------------------|------------------------|
| 投資純利益 | |
| 受取利息－関連会社以外 | \$ 236,781,015 |
| 受取利息－関連会社 | 1,343 |
| 投資収益合計 | <u>236,782,358</u> |
| 費用 | |
| 投資顧問報酬 | 28,288,791 |
| 費用合計 | <u>28,288,791</u> |
| 差引：投資顧問報酬放棄額 | <u>(9,391,710)</u> |
| 費用純額 | <u>18,897,081</u> |
| 投資純利益 | <u>217,885,277</u> |
| 実現および未実現損益（純額） | |
| 実現純損益 | |
| 投資－関連会社以外 | (66,418,042) |
| 現物償還－関連会社以外 | 6,340,430 |
| 実現純損益 | <u>(60,077,612)</u> |
| 未実現評価損益の純変動 | <u>(222,657,001)</u> |
| 実現および実現損益（純額） | <u>(282,734,613)</u> |
| 営業活動による純資産の増減（純額） | <u>\$ (64,849,336)</u> |

(注) ()内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2015年10月31日現在)

| 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 | 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 |
|---|---|---|--|--|---|
| CORPORATE BONDS & NOTES^a — 19.09% | | | | | |
| AZERBAIJAN — 0.28% | | | | | |
| State Oil Co. of the Azerbaijan Republic 4.75%, 03/13/23 ^b | \$14,355 | \$ 12,596,513 | Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd. 2.50%, 04/28/20 ^b 3.25%, 04/28/25 ^b | \$22,260 2,300 | \$ 21,947,915 2,206,781 |
| | | 12,596,513 | State Grid Overseas Investment 2013 Ltd. 3.13%, 05/22/23 ^b | 9,725 | 9,612,422 |
| BRAZIL — 0.33% | | | | | |
| Caixa Economica Federal 4.25%, 05/13/19 ^b 4.50%, 10/03/18 ^b | 8,285 7,750 | 7,560,063 7,323,750 | State Grid Overseas Investment 2014 Ltd. 2.75%, 05/07/19 ^b 4.13%, 05/07/24 ^b | 9,800 13,800 | 9,949,756 14,639,292 |
| | | 14,883,813 | | | 184,795,862 |
| CHILE — 1.44% | | | INDONESIA — 1.38% | | |
| Corp. Nacional del Cobre de Chile 3.00%, 07/17/22 ^b 3.75%, 11/04/20 ^b 3.88%, 11/03/21 ^b 4.50%, 09/16/25 ^c | 19,259 11,694 16,461 18,000 | 18,140,052 11,914,666 16,567,749 17,845,920 | Majapahit Holding BV 7.75%, 01/20/20 ^b Pelabuhan Indonesia II PT 4.25%, 05/05/25 ^b Pertamina Persero PT 4.30%, 05/20/23 ^b 4.88%, 05/03/22 ^b 5.25%, 05/23/21 ^b 5.63%, 05/20/43 ^b 6.00%, 05/03/42 ^b 6.45%, 05/30/44 ^b | 6,045 6,000 8,536 5,896 5,202 7,920 8,232 7,600 | 6,800,625 5,520,000 8,055,850 5,792,820 5,306,040 6,543,623 7,132,740 6,992,000 |
| | | 64,468,387 | Perusahaan Listrik Negara PT 5.25%, 10/24/42 ^b 5.50%, 11/22/21 ^b | 5,160 5,200 | 4,231,200 5,356,000 |
| CHINA — 4.14% | | | | | 61,730,898 |
| Amber Circle Funding Ltd. 3.25%, 12/04/22 ^b Charming Light Investments Ltd. 3.75%, 09/03/19 ^b CNOOC Curtis Funding No. 1 Pty Ltd. 4.50%, 10/03/23 ^b Export-Import Bank of China (The) 2.50%, 07/31/19 ^b 3.63%, 07/31/24 ^b Sinochem Overseas Capital Co. Ltd. 4.50%, 11/12/20 ^b Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd. 3.90%, 05/17/22 ^b 4.88%, 05/17/42 ^b Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd. 4.38%, 10/17/23 ^b Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd. 4.38%, 04/10/24 ^b | 8,700 10,500 11,854 12,900 12,649 11,077 16,109 10,369 13,100 15,546 | 8,645,740 10,659,336 12,388,378 13,035,579 12,956,497 11,659,100 16,514,165 10,632,684 13,704,834 16,243,383 | KAZAKHSTAN — 2.07% Development Bank of Kazakhstan JSC 4.13%, 12/10/22 ^b Kazakhstan Temir Zholy Finance BV 6.95%, 07/10/42 ^b KazMunaiGaz Finance Sub BV 9.13%, 07/02/18 ^b KazMunayGas National Co. JSC 4.40%, 04/30/23 ^b 5.75%, 04/30/43 ^b 6.00%, 11/07/44 ^b 6.38%, 04/09/21 ^b 7.00%, 05/05/20 ^b | 13,830 10,375 13,098 11,000 19,094 10,000 11,746 12,395 | 12,101,250 8,585,313 14,424,172 9,652,500 14,941,055 7,828,000 11,848,895 12,952,775 |
| | | | | | 92,333,960 |

(2015年10月31日現在)

| 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 | 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 |
|-----------------------------------|--------------|---------------|--|--------------|--------------|
| MALAYSIA — 2.83% | | | Russian Railways OJSC via RZD | | |
| 1MDB Global Investments Ltd. | | | Capital PLC | | |
| 4.40%, 03/09/23 ^b | \$38,000 | \$ 28,975,000 | 5.70%, 04/05/22 ^b | \$ 9,290 | \$ 9,220,325 |
| Petronas Capital Ltd. | | | Vnesheconombank Via VEB | | |
| 3.50%, 03/18/25 ^b | 24,673 | 23,848,441 | Finance PLC | | |
| 4.50%, 03/18/45 ^b | 17,556 | 16,536,758 | 5.94%, 11/21/23 ^b | 2,300 | 2,202,250 |
| 5.25%, 08/12/19 ^b | 37,647 | 40,990,057 | 6.03%, 07/05/22 ^b | 6,200 | 6,021,750 |
| 7.88%, 05/22/22 ^b | 12,936 | 16,111,925 | 6.80%, 11/22/25 ^b | 6,100 | 6,005,450 |
| | | 126,462,181 | 6.90%, 07/09/20 ^b | 8,078 | 8,271,872 |
| | | | | | 42,429,772 |
| MEXICO — 2.95% | | | SOUTH AFRICA — 1.16% | | |
| Comision Federal de Electricidad | | | Eskom Holdings SOC Ltd. | | |
| 4.88%, 05/26/21 ^b | 3,336 | 3,494,460 | 5.75%, 01/26/21 ^b | 16,147 | 15,028,820 |
| 4.88%, 01/15/24 ^b | 4,200 | 4,305,000 | 6.75%, 08/06/23 ^b | 13,798 | 12,828,690 |
| Petroleos Mexicanos | | | 7.13%, 02/11/25 ^b | 13,639 | 12,701,319 |
| 3.50%, 07/18/18 | 3,200 | 3,254,400 | Transnet SOC Ltd. | | |
| 3.50%, 07/23/20 ^b | 5,650 | 5,585,025 | 4.00%, 07/26/22 ^b | 11,782 | 11,104,535 |
| 3.50%, 01/30/23 | 3,021 | 2,797,446 | | | 51,663,364 |
| 4.25%, 01/15/25 ^b | 4,722 | 4,492,983 | VENEZUELA — 1.00% | | |
| 4.50%, 01/23/26 ^b | 4,290 | 4,087,083 | Petroleos de Venezuela SA | | |
| 4.88%, 01/24/22 | 7,925 | 8,062,103 | 5.38%, 04/12/27 ^b | 13,802 | 4,761,759 |
| 4.88%, 01/18/24 | 4,210 | 4,206,632 | 5.50%, 04/12/37 ^b | 6,593 | 2,249,861 |
| 5.50%, 01/21/21 | 12,769 | 13,598,985 | 6.00%, 05/16/24 ^b | 24,981 | 8,843,274 |
| 5.50%, 06/27/44 | 8,612 | 7,339,146 | 6.00%, 11/15/26 ^b | 23,069 | 8,069,536 |
| 5.63%, 01/23/46 ^b | 13,593 | 11,689,980 | 8.50%, 11/02/17 ^b | 8,284 | 5,000,757 |
| 5.75%, 03/01/18 | 8,137 | 8,645,563 | 9.00%, 11/17/21 ^b | 7,867 | 3,221,537 |
| 6.00%, 03/05/20 | 7,448 | 8,088,081 | 9.75%, 05/17/35 ^b | 14,094 | 5,849,106 |
| 6.38%, 01/23/45 | 10,425 | 9,794,287 | 12.75%, 02/17/22 ^b | 13,494 | 6,734,181 |
| 6.50%, 06/02/41 | 10,267 | 9,769,051 | | | 44,730,011 |
| 6.63%, 06/15/35 | 12,616 | 12,380,081 | TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES | | |
| 8.00%, 05/03/19 | 8,647 | 9,879,197 | (Cost: \$914,972,235) | | |
| | | 131,469,503 | 852,362,264 | | |
| PHILIPPINES — 0.56% | | | FOREIGN GOVERNMENT OBLIGATIONS^a — 79.38% | | |
| Power Sector Assets & Liabilities | | | ANGOLA — 0.31% | | |
| Management Corp. | | | Republic of Angola Via Northern | | |
| 7.25%, 05/27/19 ^b | 9,048 | 10,563,540 | Lights III BV | | |
| 7.39%, 12/02/24 ^b | 10,866 | 14,234,460 | 7.00%, 08/16/19 ^b | 14,370 | 14,010,750 |
| | | 24,798,000 | | | 14,010,750 |
| RUSSIA — 0.95% | | | ARGENTINA — 2.87% | | |
| Russian Agricultural Bank OJSC | | | Argentine Republic Government | | |
| Via RSHB Capital SA | | | International Bond | | |
| 5.10%, 07/25/18 ^b | 7,600 | 7,581,000 | 2.50%, 12/31/38 ^d | 68,661 | 43,256,430 |
| 5.30%, 12/27/17 ^b | 3,100 | 3,127,125 | 8.28%, 12/31/33 ^d | 21,945 | 23,809,998 |

(2015年10月31日現在)

| 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 | 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 |
|-------------------------------------|--------------|---------------|-----------------------------------|--------------|---------------|
| 8.28%, 12/31/33 ^d | \$54,879 | \$ 60,916,097 | 5.63%, 02/26/44 | | |
| | | 127,982,525 | (Call 08/26/43) | \$21,768 | \$ 21,060,540 |
| AZERBAIJAN — 0.37% | | | 6.13%, 01/18/41 | 22,781 | 23,407,477 |
| Republic of Azerbaijan | | | 7.38%, 03/18/19 | 20,766 | 23,725,155 |
| International Bond | | | 7.38%, 09/18/37 | 16,570 | 19,221,200 |
| 4.75%, 03/18/24 ^b | 17,230 | 16,476,188 | 8.13%, 05/21/24 | 9,698 | 12,001,275 |
| | | 16,476,188 | | | 171,135,491 |
| BRAZIL — 4.05% | | | COSTA RICA — 0.84% | | |
| Banco Nacional de Desenvolvimento | | | Costa Rica Government | | |
| Economico e Social | | | International Bond | | |
| 4.00%, 04/14/19 ^b | 7,400 | 6,882,000 | 4.25%, 01/26/23 ^b | 14,084 | 12,675,600 |
| 5.50%, 07/12/20 ^b | 7,275 | 6,802,125 | 7.00%, 04/04/44 ^b | 16,770 | 15,072,038 |
| 5.75%, 09/26/23 ^b | 11,623 | 10,228,240 | 7.16%, 03/12/45 ^b | 10,492 | 9,508,375 |
| 6.37%, 06/16/18 ^b | 6,000 | 6,112,500 | | | 37,256,013 |
| 6.50%, 06/10/19 ^b | 4,565 | 4,565,000 | CROATIA — 2.42% | | |
| Brazil Minas SPE via State of | | | Croatia Government | | |
| Minas Gerais | | | International Bond | | |
| 5.33%, 02/15/28 ^b | 9,681 | 7,877,914 | 5.50%, 04/04/23 ^b | 20,447 | 21,060,410 |
| Brazilian Government | | | 6.00%, 01/26/24 ^b | 23,565 | 24,978,900 |
| International Bond | | | 6.38%, 03/24/21 ^b | 19,381 | 20,873,337 |
| 2.63%, 01/05/23 | 13,285 | 10,976,731 | 6.63%, 07/14/20 ^b | 18,350 | 19,928,100 |
| 4.25%, 01/07/25 | 25,955 | 23,061,017 | 6.75%, 11/05/19 ^b | 19,572 | 21,260,085 |
| 4.88%, 01/22/21 | 19,563 | 19,245,101 | | | 108,100,832 |
| 5.00%, 01/27/45 | 22,723 | 17,241,076 | DOMINICAN REPUBLIC — 2.34% | | |
| 5.63%, 01/07/41 | 15,251 | 12,448,629 | Dominican Republic | | |
| 5.88%, 01/15/19 | 11,657 | 12,429,276 | International Bond | | |
| 7.13%, 01/20/37 | 13,552 | 13,162,380 | 5.50%, 01/27/25 ^b | 18,160 | 17,933,000 |
| 8.25%, 01/20/34 | 10,703 | 11,452,210 | 5.88%, 04/18/24 ^b | 12,690 | 12,880,350 |
| 8.88%, 04/15/24 | 7,478 | 8,945,558 | 6.85%, 01/27/45 ^b | 26,307 | 26,043,930 |
| 10.13%, 05/15/27 | 7,241 | 9,512,864 | 7.45%, 04/30/44 ^b | 20,680 | 21,817,400 |
| | | 180,942,621 | 7.50%, 05/06/21 ^b | 23,470 | 25,611,638 |
| CHILE — 0.23% | | | | | 104,286,318 |
| Chile Government International Bond | | | ECUADOR — 0.86% | | |
| 3.13%, 03/27/25 | 10,225 | 10,288,906 | Ecuador Government | | |
| | | 10,288,906 | International Bond | | |
| COLOMBIA — 3.83% | | | 7.95%, 06/20/24 ^b | 25,182 | 19,012,410 |
| Colombia Government | | | 10.50%, 03/24/20 ^b | 23,160 | 19,135,950 |
| International Bond | | | | | 38,148,360 |
| 2.63%, 03/15/23 | | | EGYPT — 0.77% | | |
| (Call 12/15/22) | 10,315 | 9,314,445 | Egypt Government | | |
| 4.00%, 02/26/24 | | | International Bond | | |
| (Call 11/26/23) | 18,243 | 17,896,383 | 5.75%, 04/29/20 ^b | 11,874 | 12,185,693 |
| 4.38%, 07/12/21 | 20,654 | 21,252,966 | 5.88%, 06/11/25 ^b | 23,830 | 22,209,560 |
| 5.00%, 06/15/45 | | | | | 34,395,253 |
| (Call 12/15/44) | 26,204 | 23,256,050 | | | |

(2015年10月31日現在)

| 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 | 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 |
|------------------------------|--------------|-------------|--------------------------------|--------------|--------------|
| EL SALVADOR — 0.28% | | | 5.38%, 10/17/23 ^b | \$ 5,164 | \$ 5,538,390 |
| El Salvador Government | | | 5.88%, 03/13/20 ^b | 10,322 | 11,431,615 |
| International Bond | | | 5.88%, 01/15/24 ^b | 7,216 | 7,928,580 |
| 6.38%, 01/18/27 ^b | \$ 200 | \$ 178,250 | 6.63%, 02/17/37 ^b | 7,202 | 7,904,195 |
| 7.65%, 06/15/35 ^b | 13,757 | 12,450,085 | 6.75%, 01/15/44 ^b | 10,391 | 11,689,875 |
| | | 12,628,335 | 6.88%, 01/17/18 ^b | 9,207 | 10,139,209 |
| ETHIOPIA — 0.28% | | | 7.75%, 01/17/38 ^b | 9,726 | 12,011,610 |
| Federal Democratic Republic | | | 8.50%, 10/12/35 ^b | 10,390 | 13,662,850 |
| of Ethiopia | | | 11.63%, 03/04/19 ^b | 13,860 | 17,758,125 |
| 6.63%, 12/11/24 ^b | 13,300 | 12,352,375 | | | 168,487,022 |
| | | 12,352,375 | IRAQ — 0.61% | | |
| GABON — 0.38% | | | Republic of Iraq | | |
| Gabon Government | | | 5.80%, 01/15/28 ^b | | |
| International Bond | | | (Call 12/14/15) | 37,225 | 27,360,375 |
| 6.38%, 12/12/24 ^b | 19,770 | 17,026,913 | | | 27,360,375 |
| | | 17,026,913 | IVORY COAST — 0.97% | | |
| GHANA — 0.56% | | | Ivory Coast Government | | |
| Republic of Ghana | | | International Bond | | |
| 7.88%, 08/07/23 ^b | 14,068 | 12,098,480 | 5.75%, 12/31/32 ^{b,e} | 35,722 | 31,881,885 |
| 8.13%, 01/18/26 ^b | 15,012 | 12,778,965 | 6.38%, 03/03/28 ^b | 12,450 | 11,454,000 |
| | | 24,877,445 | | | 43,335,885 |
| HUNGARY — 3.98% | | | JAMAICA — 0.44% | | |
| Hungary Government | | | Jamaica Government | | |
| International Bond | | | International Bond | | |
| 4.00%, 03/25/19 | 6,642 | 6,952,215 | 6.75%, 04/28/28 | 19,359 | 19,600,988 |
| 4.13%, 02/19/18 | 12,548 | 13,111,248 | | | 19,600,988 |
| 5.38%, 02/21/23 | 24,092 | 26,499,530 | KAZAKHSTAN — 1.44% | | |
| 5.38%, 03/25/24 | 23,780 | 26,268,458 | KazAgro National Management | | |
| 5.75%, 11/22/23 | 18,528 | 20,883,187 | Holding JSC | | |
| 6.25%, 01/29/20 | 23,939 | 27,025,814 | 4.63%, 05/24/23 ^b | 10,000 | 8,087,500 |
| 6.38%, 03/29/21 | 31,968 | 36,762,401 | Kazakhstan Government | | |
| 7.63%, 03/29/41 | 14,908 | 20,331,456 | International Bond | | |
| | | 177,834,309 | 3.88%, 10/14/24 ^b | 15,760 | 14,755,300 |
| INDONESIA — 3.77% | | | 4.88%, 10/14/44 ^b | 13,640 | 11,201,850 |
| Indonesia Government | | | 5.13%, 07/21/25 ^b | 19,600 | 19,502,000 |
| International Bond | | | 6.50%, 07/21/45 ^b | 11,006 | 10,730,850 |
| 3.38%, 04/15/23 ^b | 10,600 | 10,070,000 | | | 64,277,500 |
| 3.75%, 04/25/22 ^b | 12,051 | 11,900,362 | KENYA — 0.54% | | |
| 4.13%, 01/15/25 ^b | 3,000 | 2,925,000 | Kenya Government | | |
| 4.63%, 04/15/43 ^b | 6,750 | 6,081,986 | International Bond | | |
| 4.88%, 05/05/21 ^b | 15,106 | 15,899,065 | 6.88%, 06/24/24 ^b | 26,060 | 24,203,225 |
| 5.13%, 01/15/45 ^b | 11,655 | 10,897,425 | | | 24,203,225 |
| 5.25%, 01/17/42 ^b | 13,332 | 12,648,735 | | | |

(2015年10月31日現在)

| 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 | 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 |
|------------------------------|--------------|---------------|------------------------------|--------------|---------------|
| LATVIA — 0.42% | | | MOROCCO — 0.43% | | |
| Republic of Latvia | | | Morocco Government | | |
| 2.75%, 01/12/20 ^b | \$17,967 | \$ 18,280,434 | International Bond | | |
| 5.25%, 06/16/21 ^b | 500 | 569,128 | 4.25%, 12/11/22 ^b | \$19,109 | \$ 19,290,536 |
| | | 18,849,562 | | | 19,290,536 |
| LEBANON — 3.12% | | | PAKISTAN — 0.64% | | |
| Lebanese Republic | | | Pakistan Government | | |
| 6.65%, 02/26/30 ^b | 18,312 | 18,060,210 | International Bond | | |
| Lebanon Government | | | 7.25%, 04/15/19 ^b | 14,181 | 14,711,157 |
| International Bond | | | 8.25%, 04/15/24 ^b | 12,906 | 13,750,375 |
| 5.15%, 11/12/18 ^b | 13,538 | 13,419,543 | | | 28,461,532 |
| 6.00%, 01/27/23 ^b | 14,072 | 13,896,100 | PANAMA — 2.02% | | |
| 6.10%, 10/04/22 ^b | 19,503 | 19,405,485 | Panama Government | | |
| 6.38%, 03/09/20 | 15,704 | 15,998,450 | International Bond | | |
| 6.60%, 11/27/26 ^b | 21,874 | 21,874,000 | 3.75%, 03/16/25 | | |
| 6.75%, 11/29/27 ^b | 14,317 | 14,495,962 | (Call 12/16/24) | 19,413 | 19,315,935 |
| 8.25%, 04/12/21 ^b | 19,982 | 21,955,222 | 4.00%, 09/22/24 | | |
| | | 139,104,972 | (Call 06/22/24) | 17,830 | 18,052,875 |
| LITHUANIA — 1.86% | | | 5.20%, 01/30/20 | 18,058 | 19,728,365 |
| Lithuania Government | | | 6.70%, 01/26/36 | 27,018 | 33,232,140 |
| International Bond | | | | | 90,329,315 |
| 6.13%, 03/09/21 ^b | 18,920 | 22,065,450 | PARAGUAY — 0.34% | | |
| 6.63%, 02/01/22 ^b | 21,379 | 25,962,764 | Republic of Paraguay | | |
| 7.38%, 02/11/20 ^b | 29,249 | 35,111,816 | 6.10%, 08/11/44 ^b | 14,751 | 14,972,265 |
| | | 83,140,030 | | | 14,972,265 |
| MEXICO — 3.10% | | | PERU — 3.17% | | |
| Mexico Government | | | Peruvian Government | | |
| International Bond | | | International Bond | | |
| 3.60%, 01/30/25 | 13,821 | 13,734,619 | 4.13%, 08/25/27 | 10,318 | 10,369,590 |
| 3.63%, 03/15/22 | 12,128 | 12,385,720 | 5.63%, 11/18/50 | 32,855 | 35,319,125 |
| 4.00%, 10/02/23 | 16,260 | 16,788,450 | 6.55%, 03/14/37 | 12,068 | 14,511,770 |
| 4.60%, 01/23/46 | 10,650 | 9,877,875 | 7.35%, 07/21/25 | 28,592 | 36,740,720 |
| 4.75%, 03/08/44 | 17,508 | 16,632,600 | 8.75%, 11/21/33 | 500 | 727,500 |
| 5.13%, 01/15/20 | 9,154 | 10,103,727 | 8.75%, 11/21/33 | 30,154 | 43,874,070 |
| 5.55%, 01/21/45 | 11,582 | 12,276,920 | | | 141,542,775 |
| 5.75%, 10/12/49 | 10,362 | 10,128,855 | PHILIPPINES — 4.58% | | |
| 5.95%, 03/19/19 | 8,708 | 9,792,146 | Philippine Government | | |
| 6.05%, 01/11/40 | 12,416 | 14,030,080 | International Bond | | |
| 6.75%, 09/27/34 | 5,651 | 6,929,539 | 3.95%, 01/20/40 | 18,205 | 18,842,175 |
| 8.30%, 08/15/31 | 3,978 | 5,847,660 | 4.00%, 01/15/21 | 13,662 | 14,891,580 |
| | | 138,528,191 | 4.20%, 01/21/24 | 14,556 | 16,102,575 |
| MONGOLIA — 0.25% | | | 5.00%, 01/13/37 | 13,714 | 16,319,660 |
| Mongolia Government | | | 5.50%, 03/30/26 | 9,240 | 11,088,000 |
| International Bond | | | 6.38%, 01/15/32 | 11,728 | 15,363,680 |
| 5.13%, 12/05/22 ^b | 13,465 | 11,243,275 | 6.38%, 10/23/34 | 20,411 | 27,350,740 |
| | | 11,243,275 | | | |

(2015年10月31日現在)

| 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 | 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 |
|---------------------------------|--------------|---------------|-------------------------------|--------------|---------------|
| 7.75%, 01/14/31 | \$17,773 | \$ 25,637,553 | SOUTH AFRICA — 2.50% | | |
| 8.38%, 06/17/19 | 10,447 | 12,836,751 | South Africa Government | | |
| 9.50%, 02/02/30 | 15,197 | 24,467,170 | International Bond | | |
| 10.63%, 03/16/25 | 13,576 | 21,653,720 | 4.67%, 01/17/24 | \$16,708 | \$ 16,850,018 |
| | | 204,553,604 | 5.38%, 07/24/44 | 11,102 | 10,879,960 |
| POLAND — 3.68% | | | 5.50%, 03/09/20 | 23,180 | 24,918,500 |
| Poland Government | | | 5.88%, 05/30/22 | 11,121 | 12,205,297 |
| International Bond | | | 5.88%, 09/16/25 | 19,899 | 21,590,415 |
| 3.00%, 03/17/23 | 22,993 | 23,174,672 | 6.88%, 05/27/19 | 22,611 | 25,188,654 |
| 4.00%, 01/22/24 | 20,517 | 21,798,513 | | | 111,632,844 |
| 5.00%, 03/23/22 | 38,342 | 43,137,242 | SRI LANKA — 1.20% | | |
| 5.13%, 04/21/21 | 24,237 | 27,423,317 | Sri Lanka Government | | |
| 6.38%, 07/15/19 | 41,929 | 48,624,013 | International Bond | | |
| | | 164,157,757 | 5.88%, 07/25/22 ^b | 13,844 | 13,272,935 |
| ROMANIA — 2.00% | | | 6.00%, 01/14/19 ^b | 13,243 | 13,304,779 |
| Romanian Government | | | 6.25%, 10/04/20 ^b | 14,658 | 14,712,967 |
| International Bond | | | 6.25%, 07/27/21 ^b | 12,580 | 12,469,925 |
| 4.38%, 08/22/23 ^b | 17,994 | 18,916,192 | | | 53,760,606 |
| 4.88%, 01/22/24 ^b | 15,792 | 17,173,800 | TUNISIA — 0.32% | | |
| 6.13%, 01/22/44 ^b | 14,610 | 17,283,630 | Banque Centrale de Tunisie SA | | |
| 6.75%, 02/07/22 ^b | 29,971 | 35,702,954 | 5.75%, 01/30/25 ^b | 15,192 | 14,265,288 |
| | | 89,076,576 | | | 14,265,288 |
| RUSSIA — 4.56% | | | TURKEY — 5.37% | | |
| Russian Foreign Bond — Eurobond | | | Turkey Government | | |
| 3.50%, 01/16/19 ^b | 9,400 | 9,477,550 | International Bond | | |
| 4.50%, 04/04/22 ^b | 10,600 | 10,817,300 | 3.25%, 03/23/23 | 9,066 | 8,408,715 |
| 4.88%, 09/16/23 ^b | 19,000 | 19,608,000 | 4.25%, 04/14/26 | 1,911 | 1,830,738 |
| 5.00%, 04/29/20 ^b | 20,200 | 21,230,200 | 4.88%, 04/16/43 | 16,565 | 14,900,217 |
| 5.63%, 04/04/42 ^b | 14,800 | 14,670,500 | 5.13%, 03/25/22 | 6,968 | 7,281,560 |
| 5.88%, 09/16/43 ^b | 9,400 | 9,611,500 | 5.63%, 03/30/21 | 10,856 | 11,664,772 |
| 7.50%, 03/31/30 ^{b,e} | 68,062 | 81,027,871 | 5.75%, 03/22/24 | 16,618 | 17,922,513 |
| 11.00%, 07/24/18 ^b | 11,594 | 13,891,061 | 6.00%, 01/14/41 | 18,769 | 19,669,912 |
| 12.75%, 06/24/28 ^b | 14,139 | 23,011,222 | 6.25%, 09/26/22 | 18,639 | 20,661,331 |
| | | 203,345,204 | 6.63%, 02/17/45 | 6,847 | 7,850,086 |
| SERBIA — 1.52% | | | 6.75%, 04/03/18 | 12,509 | 13,603,538 |
| Republic of Serbia | | | 6.75%, 05/30/40 | 9,894 | 11,274,213 |
| 4.88%, 02/25/20 ^b | 22,488 | 23,190,750 | 6.88%, 03/17/36 | 18,365 | 21,101,385 |
| 5.88%, 12/03/18 ^b | 15,977 | 16,935,620 | 7.00%, 03/11/19 | 9,314 | 10,385,110 |
| 7.25%, 09/28/21 ^b | 24,107 | 27,572,381 | 7.00%, 06/05/20 | 6,194 | 7,014,705 |
| | | 67,698,751 | 7.25%, 03/05/38 | 6,782 | 8,141,791 |
| SLOVAKIA — 0.54% | | | 7.38%, 02/05/25 | 15,315 | 18,293,767 |
| Slovakia Government | | | 7.50%, 11/07/19 | 9,812 | 11,234,740 |
| International Bond | | | 8.00%, 02/14/34 | 9,720 | 12,427,020 |
| 4.38%, 05/21/22 ^b | 21,709 | 24,310,244 | 11.88%, 01/15/30 | 9,700 | 16,174,750 |
| | | 24,310,244 | | | 239,840,863 |

(2015年10月31日現在)

| 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 |
|---|--------------|---------------|
| UKRAINE — 1.55% | | |
| Ukraine Government International Bond | | |
| 7.50%, 04/17/23 ^b | \$19,721 | \$ 14,901,681 |
| 7.75%, 09/23/20 ^b | 16,666 | 12,342,909 |
| 7.80%, 11/28/22 ^b | 34,904 | 26,332,741 |
| 7.95%, 02/23/21 ^b | 20,239 | 15,740,123 |
| | | 69,317,454 |
| URUGUAY — 1.96% | | |
| Uruguay Government International Bond | | |
| 4.50%, 08/14/24 | 26,226 | 27,275,040 |
| 5.10%, 06/18/50 | 44,845 | 40,304,659 |
| 7.63%, 03/21/36 | 15,721 | 19,867,414 |
| | | 87,447,113 |
| VENEZUELA — 1.30% | | |
| Venezuela Government International Bond | | |
| 6.00%, 12/09/20 ^b | 6,076 | 2,293,690 |
| 7.00%, 12/01/18 ^b | 1,916 | 833,460 |
| 7.00%, 03/31/38 ^b | 8,354 | 3,111,865 |
| 7.65%, 04/21/25 | 7,055 | 2,663,263 |
| 7.75%, 10/13/19 ^b | 11,837 | 4,675,615 |
| 8.25%, 10/13/24 ^b | 9,930 | 3,773,400 |
| 9.00%, 05/07/23 ^b | 14,339 | 5,628,058 |
| 9.25%, 09/15/27 | 20,409 | 8,928,937 |
| 9.25%, 05/07/28 ^b | 7,692 | 3,019,110 |
| 9.38%, 01/13/34 | 6,815 | 2,743,038 |
| 11.75%, 10/21/26 ^b | 12,789 | 5,659,132 |
| 11.95%, 08/05/31 ^b | 18,992 | 8,641,451 |
| 12.75%, 08/23/22 ^b | 12,479 | 5,927,525 |
| | | 57,898,544 |
| VIETNAM — 0.25% | | |
| Vietnam Government International Bond | | |
| 4.80%, 11/19/24 ^b | 11,535 | 11,333,138 |
| | | 11,333,138 |
| ZAMBIA — 0.56% | | |
| Zambia Government International Bond | | |
| 8.50%, 04/14/24 ^b | 10,743 | 9,037,549 |
| 8.97%, 07/30/27 ^b | 18,839 | 15,824,760 |
| | | 24,862,309 |
| TOTAL FOREIGN GOVERNMENT OBLIGATIONS | | |
| (Cost: \$3,698,831,880) | | 3,543,970,377 |

| 銘柄 | 元本 (単位：千) | 価額 |
|--|--------------|-----------------|
| SHORT-TERM INVESTMENTS — 0.17% | | |
| MONEY MARKET FUNDS — 0.17% | | |
| BlackRock Cash Funds: Treasury, SL Agency Shares | | |
| 0.02% ^{f,g} | 7,532 | \$ 7,532,143 |
| | | 7,532,143 |
| TOTAL SHORT-TERM INVESTMENTS | | |
| (Cost: \$7,532,143) | | 7,532,143 |
| TOTAL INVESTMENTS | | |
| IN SECURITIES — 98.64% | | |
| (Cost: \$4,621,336,258) | | 4,403,864,784 |
| Other Assets, Less Liabilities — 1.36% | | |
| | | 60,578,620 |
| NET ASSETS — 100.00% | | |
| | | \$4,464,443,404 |

^a Investments are denominated in U.S. dollars.^b This security may be resold to qualified foreign investors and foreign institutional buyers under Regulation S of the Securities Act of 1933.^c This security may be resold to qualified institutional buyers under Rule 144A of the Securities Act of 1933.^d Issuer is in default of interest payments.^e Step coupon security. Coupon rate will either increase (step-up bond) or decrease (step-down bond) at regular intervals until maturity. Interest rate shown reflects the rate currently in effect.^f Affiliated issuer. See Note 2.^g The rate quoted is the annualized seven-day yield of the fund at period end.