

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。
主要投資対象	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12.0%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。
主な投資制限	<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、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」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。

運用報告書（全体版）

スマート・クオリティ・オープン （成長型）（1年決算型）

愛称：スマラップN

第1期（決算日：2015年8月13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（成長型）（1年決算型）（愛称：スマラップN）」は、去る8月13日に第1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。

国際投信投資顧問株式会社は2015年7月1日に三菱UFJ投信株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



三菱UFJ国際投信

MUFG

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. 0120-759311

(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（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	5
◇1万口当たりの費用明細	6
◇売買及び取引の状況	7
◇利害関係人との取引状況等	8
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	8
◇組入資産の明細	9
◇投資信託財産の構成	9
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	10
◇損益の状況	10
◇分配金のお知らせ	10
◇お知らせ	11

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	12
◇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）	13
◇MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	19
◇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
◇iシェアーズ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF	42
◇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
◇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）	67
◇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	68
◇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	74

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 証 券 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 み 分 配 金	期 中 騰 落 率		
(設 定 日) 2015年 1月30日	円 10,000	円 —	% —	% —	百万円 281
1期 (2015年 8月13日)	10,567	0	5.7	97.2	1,121

(注) 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

※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 証 券 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(設 定 日) 2015年 1月30日	円 10,000	% —	% —
1月末	10,000	0.0	—
2月末	10,299	3.0	97.6
3月末	10,362	3.6	97.9
4月末	10,484	4.8	96.9
5月末	10,655	6.6	97.1
6月末	10,395	4.0	88.7
7月末	10,553	5.5	96.7
(期 末) 2015年 8月13日	10,567	5.7	97.2

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 騰落率は設定日比です。

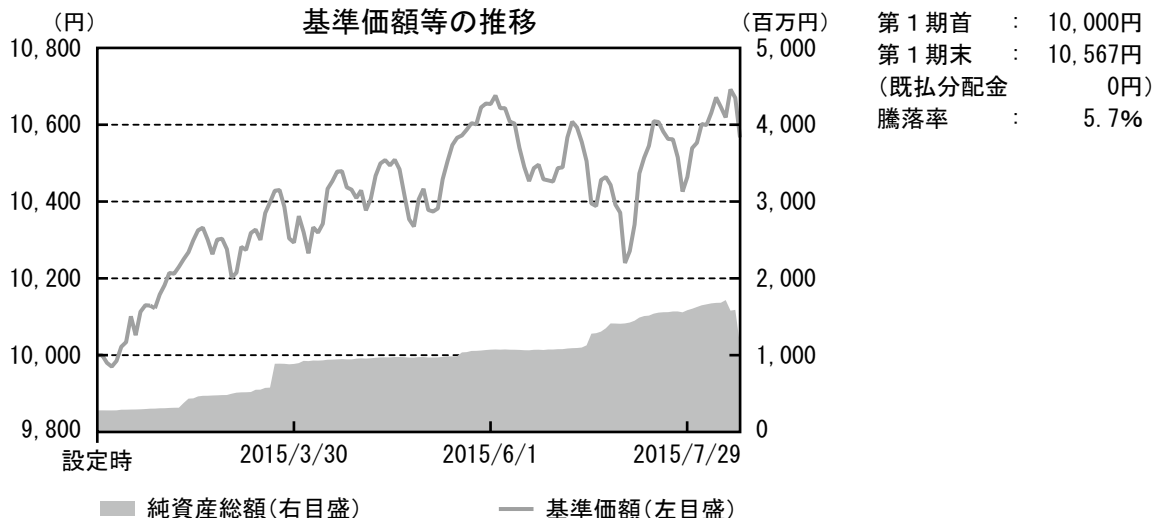
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第1期：2015/1/30～2015/8/13）

基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ5.7%の上昇となりました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	先進国株式や国内株式が上昇したことに加えて、米ドルが対円で上昇したことなどがプラス要因となりました。
下落要因	新興国株式が下落したことなどがマイナス要因となりました。

投資環境について

（第1期：2015/1/30～2015/8/13）

◎国内株式市況

- ・国内株式は大幅上昇しました。ギリシャの債務問題や中国の景気減速懸念などを背景に、一時的に国内株式市場が急落する局面も見られたものの、期を通してみると円安や原油安などを背景とした企業業績への根強い期待などから上昇しました。加えて、世界の株式市場が不安定となった局面においては、日銀によるETF購入などが国内株式市場の下支えとなりました。

◎国内債券市況

- ・国内債券は、海外債券市場の動きなどの影響を受けて、期を通してみると軟調となりました。2015年4月後半から5月上旬にかけて欧州の金利が急上昇した局面では、その影響などから国内金利も上昇しました。しかし、中国の景気減速懸念や原油価格の値下がりなどを受けた世界的なリスク回避姿勢の高まりに加えて、日銀による金融緩和政策の維持などを背景に6月以降、国内金利は低下傾向となりました。

◎国内リート市況

- ・2015年4月後半から5月上旬にかけて世界的に金利が上昇したことに加えて、6月中旬から7月上旬にかけて中国株式市場の急落などを嫌気した世界的なリスク回避姿勢の高まりなどから、国内リートも一時大幅下落しました。その後、国内リート市場の下落による配当利回りの上昇などにより投資妙味が高まったことなどから、7月中旬以降に反発する動きも見られたものの、期を通してみると国内リートは値下がりしました。

◎先進国株式市況

- ・欧州中央銀行（ECB）が量的金融緩和を継続するなかユーロ圏内の鉱工業生産指数などが持ち直しの兆しを見せたことや、米雇用統計など好調な米経済指標と底堅い米企業業績などが好感されて、先進国株式市場は値上がりしました。

◎先進国債券市況

- ・米雇用統計などおおむね好調となった米経済指標を背景に米連邦準備理事会（FRB）議長が2015年内の利上げ開始を示唆したことなどから、米国の金利が上昇しました。加えて、ユーロ圏でも1-3月期域内総生産（GDP）が堅調な結果となり過度に悲観的な景況感が後退したことなどから、先進国債券は軟調となりました。

◎先進国リート市況

- ・FRB議長が年内の利上げ開始を示唆したことなどをを受けて、米国での2015年内の利上げ観測が高まったことなどから、先進国リートは値下がりしました。

◎新興国株式市況

- ・米国の早期利上げ観測が高まったことに加え、資源価格の下落、中国株式市場の急落などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり、新興国株式は下落しました。

◎新興国債券市況

- ・新興国債券は、一時原油相場が落ち着いた動きとなったことなどから資源輸出国を中心に上昇する局面もあったものの、その後、原油価格が再び下落したことなどをを受けて資源輸出国を中心に下落に転じ、期を通してみると新興国債券は軟調となりました。

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す。
- ・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12.0%）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。
- ・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、期末の基準価額は設定時と比較して5.7%上昇しました。

※指定投資信託証券の決定、投資する投資信託証券の選定やリバランス等についても、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

（2015年8月13日現在）

資産区分	選定した投資信託証券の名称	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）	19.5%
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）	10.2%
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）	2.9%
先進国株式	iシェアーズ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF	41.5%
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）	6.1%
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）	3.0%
新興国株式	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	5.4%
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	8.5%

（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。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは運用の目標となるベンチマーク等を設けておりません。そのため、記載すべき事項はありません。

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 1 期
	2015年1月30日～2015年8月13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	566

（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

- ・当ファンドにおけるリスクは想定される範囲内で推移しており、引き続き目標リスク水準（年率標準偏差12.0%）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1月30日～2015年8月13日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	90	0.870	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間日数}}$
（投信会社）	（40）	（0.392）	当ファンドの運用、受託会社への運用指図、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	（48）	（0.461）	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）	（2）	（0.017）	当ファンドの財産の保管および管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	15	0.147	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（投資信託証券）	（15）	（0.147）	売買委託手数料は、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
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（投資信託証券）	（0）	（0.000）	有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	2	0.019	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（保管費用）	（1）	（0.013）	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等
（監査費用）	（1）	（0.006）	監査法人に支払われる当ファンドの監査費用等
合 計	107	1.036	
期中の平均基準価額は、10,392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1月30日～2015年8月13日）

投資信託証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	千口	千円	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）	285,083	315,898	99,795	118,384
国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）	48,471	51,107	15,836	16,031
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）	45,940	49,876	15,354	16,851
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	226,984	268,510	130,829	155,000
MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	72,778	101,248	25,474	36,489
小 計	679,258	786,641	287,290	342,757
外 国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ				
ISHARES MSCI EMERGING MARKET MIN VOL	9	566	0.6	32
ISHARES JP MORGAN USD EMG	8	955	1	162
ISHARES MSCI WORLD MIN VOL	148	5,081	40	1,386
小 計	166	6,603	42	1,581

（注1）金額は受渡代金です。

（注2）口数・金額の単位未満は切り捨てです。

○利害関係人との取引状況等

（2015年1月30日～2015年8月13日）

利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投 資 信 託 証 券	1,587	786	49.5	539	342	63.5
為 替 直 物 取 引	796	450	56.5	58	—	—

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	1,367千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	—千円
(B) / (A)	—%

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ信託銀行株式会社です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2015年1月30日～2015年8月13日）

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	当期末残高(元本)	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	商品性を適正に維持するための取得

○組入資産の明細

（2015年8月13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	当 期 末		
	口 数	評 価 額	組入比率
	千口	千円	%
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）	185,288	219,084	19.5
国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）	32,634	33,010	2.9
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）	30,586	33,608	3.0
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	96,154	113,981	10.2
MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	47,304	67,957	6.1
合 計	口 数・金 額	391,968	467,642
	銘 柄 数<比率>	5	<41.7%>

（注1）<>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

（注2）口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

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	口 数	当 期 末		組入比率
		評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
（アメリカ）				
ISHARES MSCI EMERGING MARKET MIN VOL	9	491	61,084	5.4
ISHARES JP MORGAN USD EMG	7	770	95,817	8.5
ISHARES MSCI WORLD MIN VOL	108	3,745	465,585	41.5
合 計	口 数・金 額	124	5,008	—
	銘 柄 数<比率>	3	—	<55.5%>

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

（注2）<>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

（注3）口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

○投資信託財産の構成

（2015年8月13日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	563,459	32.1
投 資 証 券	526,669	30.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	667,518	37.9
投 資 信 託 財 産 総 額	1,757,646	100.0

（注1）当期末における外貨建純資産（762,274千円）の投資信託財産総額（1,757,646千円）に対する比率は43.4%です。

（注2）外貨建資産は、当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、8月13日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=124.29円です。

（注3）評価額の単位未満は切り捨てです。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2015年8月13日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	1,757,646,490
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	178,742,383
投 資 信 託 受 益 証 券（評価額）	563,459,566
投 資 証 券（評価額）	526,669,259
未 収 入 金	488,775,038
未 収 利 息	244
(B) 負 債	636,622,106
未 払 解 約 金	635,519,978
未 払 信 託 報 酬	1,094,834
そ の 他 未 払 費 用	7,294
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,121,024,384
元 本	1,060,880,916
次 期 繰 越 損 益 金	60,143,468
(D) 受 益 権 総 口 数	1,060,880,916口
1万口当たり基準価額 (C/D)	10,567円

○損益の状況（2015年1月30日～2015年8月13日）

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	1,429,090
受 取 配 当 金	1,573,008
受 取 利 息	△ 143,918
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	28,824,890
売 買 損 益	48,082,947
売 買 損 益	△ 19,258,057
(C) 信 託 報 酬 等	△ 8,437,883
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	21,816,097
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	38,327,371
(配 当 等 相 当 額)	(633,830)
(売 買 損 益 相 当 額)	(37,693,541)
(F) 計 (D + E)	60,143,468
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	60,143,468
追 加 信 託 差 損 益 金	38,327,371
(配 当 等 相 当 額)	(633,830)
(売 買 損 益 相 当 額)	(37,693,541)
分 配 準 備 積 立 金	21,816,097

(注1) 損益の状況の中で

- ・(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
- ・(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。
- ・(E)追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注2) 当ファンドの期首元本額は281,323,243円、期中追加設定元本額は1,390,599,191円、期中一部解約元本額は611,041,518円です。

(注3) 1口当たり純資産額は、当期末1.0567円です。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期 末
(a) 配当等収益（費用控除後）	1,030,822円
(b) 有価証券等損益額（費用控除後）	20,785,275
(c) 信託約款に規定する収益調整金	38,327,371
(d) 信託約款に規定する分配準備積立金	—
(e) 分配対象収益 (a + b + c + d)	60,143,468
(f) 分配金額	—
(g) 分配金額 (1万口当たり)	—

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンドの監査は終了していません。

○分配金のお知らせ

当期分配金はありません。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに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委託者である「国際投信投資顧問株式会社」は「三菱UFJ投信株式会社」との合併により解散し、存続会社である「三菱UFJ投信株式会社」は2015年7月1日付で「三菱UFJ国際投信株式会社」と商号変更するための、所要の約款変更を2015年7月1日に行いました。
- ②委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行うための、所要の約款変更を2015年7月1日に行いました。
- 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 JPX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 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。
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 MSCI エマージング・マーケット・ミニマム・ボラティリティ 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、一切の責任を負いません。
- ・「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1期（2014年11月14日～2015年2月13日）の決算資料から抜粋したものです。

■ 損益の状況

当期（自2014年11月14日 至2015年2月13日）

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	1,641
受 取 利 息	1,641
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	163,114,472
売 買 損 益	165,682,163
売 買 損 益	△ 2,567,691
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,258,567
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	160,857,546
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 10,113,783
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 10,113,783)
(F) 計 (D+E)	150,743,763
(G) 収 益 分 配 金	△ 2,678,870
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	148,064,893
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 10,113,783
(配 当 等 相 当 額)	(1,710,879)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 11,824,662)
分 配 準 備 積 立 金	158,178,676

- (注1) 損益の状況の中で
- ・(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 - ・(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。
 - ・(E)追加信託差損益金とは、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

親投資信託残高

2015年2月13日現在

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	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	5,500,306

- (注1) 当該マザーファンド全体の受益権口数は5,346,851千口です。
(注2) 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 (5,346,851千口)の内容です。

①国内株式

上場株式

2015年2月13日現在

銘柄	当 期 末	
	株 数	評価額
	千株	千円
鉱 業 (0.5%)		
国際石油開発帝石	20.8	29,109
建設 業 (2.2%)		
安 藤 ・ 間	2.6	1,807
コムシスホールディングス	1.7	2,510
ミ サ ワ ホ ー ム	0.4	426
大成 建設	20	13,080
長谷工コーポレーション	4.9	4,963
鹿 島 建設	17	8,687
大 東 建 託	1.5	19,875
N I P P O	1	1,662
住 友 林 業	2.9	3,349
大 和 ハ ウ ス エ 業	11.6	26,123
積 水 ハ ウ ス	12.1	18,724
協 和 エ ク シ オ	1.6	1,840
日 揮	4	9,782
東 芝 プ ラ ン ト シ ス テ ム	0.6	1,082
千 代 田 化 工 建 設	3	2,889
食 料 品 (4.3%)		
日清製粉グループ本社	4.3	6,054
カ ル ビ	1.5	6,592
ヤ ク ル ト 本 社	2.1	14,511
明治ホールディングス	1.2	15,912
日 本 ハ ム	3	8,061
アサヒグループホールディングス	7.9	29,356
キリンホールディングス	16.9	26,051
伊 藤 園	1.2	2,836
キ ッ コ ー マ ン	3	9,765
味 の 素	9	20,178
キ ュ ー ピ ー	2	5,600
ニ チ レ イ	4	2,332
東 洋 水 産	2.1	8,484
日清食品ホールディングス	1.7	9,792
日 本 た ば こ 産 業	18.9	69,003
織 維 製 品 (0.5%)		
東 レ	29	28,701

銘柄	当 期 末	
	株 数	評価額
	千株	千円
パルプ・紙 (0.1%)		
王子ホールディングス	15	7,395
化 学 (6.8%)		
ク ラ レ	6.3	9,538
旭 化 成	23	26,921
昭 和 電 工	25	3,750
日 産 化 学 工 業	2.5	5,495
東 ソ ー	9	4,869
東 亜 合 成	5	2,610
氣 化 学 工 業	8	3,600
信 越 化 学 工 業	6.6	53,460
エ ア ・ ウ ォ ー タ ー	3	6,084
大 陽 日 酸	5	7,295
日本パーカライズニング	0.9	2,452
日 本 触 媒	3	4,647
J S R	3.6	7,484
三菱ケミカルホールディングス	23.1	14,014
日 本 合 成 化 学 工 業	1	698
ダ イ セ ル	5.2	8,023
積 水 化 学 工 業	9	12,699
日 本 ゼ オ ン	3	3,228
ア イ カ 工 業	1.1	2,820
宇 部 興 産	19	3,572
日 立 化 成	1.8	4,368
日 本 化 薬	2	3,006
花 王	9.9	50,450
日本ペイントホールディングス	3.2	11,840
関 西 ペ イ ン ト	4	7,908
D I C	15	4,590
東洋インキSCホールディングス	5	2,236
富士フイルムホールディングス	8.4	33,751
資 生 堂	6.6	12,922
ド ク タ ー シ ー ラ ボ	0.2	790
小 林 製 薬	0.6	4,770
日 東 電 工	2.9	21,802
エ フ ピ コ	0.4	1,574

銘柄	当期末	
	株数	評価額
	千株	千円
ニフコム	0.8	3,156
ユニ・チャーム	7.5	24,671
医薬品 (6.4%)		
協和発酵キリン	4	5,624
武田薬品工業	13.8	83,669
アステラス製薬	42	76,587
塩野義製薬	5.8	19,111
田辺三菱製薬	4.3	8,385
中外製薬	3.7	12,950
科研製薬	1	3,410
工一ザイ	4.9	30,135
一口製薬	1.7	2,612
小野薬品工業	1.7	19,278
久光製薬	1	4,245
持田製薬	0.3	2,016
参天製薬	1.4	10,444
ツムラ	1.2	3,477
沢井製薬	0.6	4,446
第一三共	12.4	22,462
キョーリン製薬ホールディングス	1	2,585
大塚ホールディングス	7.3	26,579
大正製薬ホールディングス	0.9	7,029
石油・石炭製品 (0.6%)		
昭和シェル石油	3.3	3,636
東燃ゼネラル石油	6	6,642
出光興産	1.7	3,481
JXホールディングス	40.9	19,161
ゴム製品 (1.2%)		
横浜ゴム	4	4,224
東洋ゴム工業	1.7	4,068
ブリヂストン	11.6	52,646
住友ゴム工業	2.9	5,672
ガラス・土石製品 (0.8%)		
旭硝子	18	12,708
日本電気硝子	7	3,941
太平洋セメント	23	8,395
大同特殊鋼	5	7,515
日本特殊陶業	3.2	10,624
ニチアス	2	1,332
鉄鋼 (1.5%)		
新日鐵住金	156	46,581
ジェイエフイーホールディングス	9.4	25,478
大同特殊鋼	6	3,084
日立金属	4	7,388
非鉄金属 (1.0%)		
三井金属鉱業	10	2,570
三菱マテリアル	23	8,901
住友金属鉱山	10	17,535

銘柄	当期末	
	株数	評価額
	千株	千円
DOWAホールディングス	4	3,880
住友電気工業	13.9	20,405
アサヒホールディングス	0.5	959
金属製品 (0.5%)		
LEXILグループ	5.5	14,492
リオン	0.7	5,936
ジーテクト	0.3	312
日本発條	3.2	3,804
機械 (5.6%)		
日本製鋼所	5	2,450
一エスジ	1.7	3,825
デイスコ	0.4	4,200
ナブテスコ	2.2	6,611
S M C	1.1	34,716
小松製作所	18.3	44,670
住友重機械工業	10	6,820
日立建機	1.6	3,497
クボタ	18	33,084
荏原製作所	8	3,696
ダイキン工業	5.1	39,259
栗田工業	2.1	5,997
椿本チエイン	2	1,936
タテノ	2	2,866
平和	0.8	1,910
S A N K Y O	1.1	5,098
ユニバーサルエンターテインメント	0.3	597
セガサミーホールディングス	3.8	6,600
T P R	0.4	1,135
ホシザキ電機	1	6,300
日本精工	7	10,528
日エイテクト	3.8	6,672
不二越	3	1,899
T H K	2.3	6,150
マキタ	2.3	12,673
三菱重工	59	37,288
ー H	25	13,050
電気機器 (13.3%)		
コニカミノルタ	8.4	9,912
コラザ工業	4.6	8,868
三菱電機	5	8,350
日立製作所	85	66,478
日東電機	74	35,076
三菱電機	35	47,355
富士電機	10	5,310
安川電機	4.1	6,371
日立電産	3.8	31,418
オムロン	3.8	18,734
ジーエス・ユアサコーポレーション	7	3,549

銘柄	当 期 末	
	株 数	評価額
	千株	千円
富士通	34	24,711
沖電	12	2,940
セイコーエプソン	2.4	10,020
ワコ	2.8	1,752
パナソニック	42.9	59,266
リア	2.2	1,806
富士通ゼネラル	1	1,219
TDK	2.1	16,086
ヒコ	0.6	8,508
横河電機	3.5	4,417
本光電工	0.7	4,032
堀場製作所	0.7	2,856
キーエンス	0.8	46,248
システムエレクトロニクス	2.7	14,661
スタンレー電気	2.5	6,942
カシオ計算機	3.5	6,338
フタバ	3.7	80,105
浜松ホトニクス	1.5	9,450
京セラ	5.8	32,984
村田製作所	3.7	46,768
小糸製作所	2.1	7,360
ミニコン	0.6	1,283
キヤノン	20.4	77,775
輸送用機器 (9.7%)	10.6	12,190
トヨタ紡織	1.2	1,731
鬼怒川ゴム工業	1	484
ユニグレ	0.7	1,474
豊田自動織機	3.2	20,544
デンソー	8.7	47,780
三井造船	14	2,772
川崎重工	26	14,092
名村造船所	0.7	739
いすゞ自動車	49.4	56,118
トヨタ自動車	11.1	18,376
日野自動車	11.4	89,011
三菱自動車工業	5	8,310
NOK	12.9	13,416
カヤバ工業	1.7	5,295
大塚製作所	4	1,760
カルソニックセセイ	0.5	546
アイシン精機	3	2,004
マツダ	3.2	13,728
ダイハツ工業	10.5	24,822
本田技研工業	4.2	6,984
スズキ	19.7	76,475
富士重工	7.4	26,321
	12	48,468

銘柄	当 期 末	
	株 数	評価額
	千株	千円
ヤマハ発動機	5.4	13,937
エクスデイズ	0.5	1,315
豊田合成	1.1	2,778
エフ・シー・シー	0.5	966
シマノ	1.5	24,825
テイ・エス・テック	0.7	2,383
精密機器 (1.2%)		
テルモ	5.4	16,659
ニッポン	6.6	9,655
HONY	8.4	39,110
その他製品 (0.4%)		
バンダイナムコホールディングス	3.9	8,447
アシックス	3.5	10,367
ピッコノ	0.7	5,551
電気・ガス業 (1.1%)		
電源開発	2.4	10,728
東京瓦斯	43	30,534
大阪瓦斯	36	16,902
陸運業 (5.3%)		
東武鉄道	19	10,887
相鉄ホールディングス	8	4,344
京急行電鉄	19	14,896
小田急電鉄	11	12,892
京王電鉄	10	9,850
京成電鉄	5	7,240
東日本旅客鉄道	6.5	62,387
西日本旅客鉄道	3.4	21,879
東海旅客鉄道	3.2	66,112
西日本鉄道	6	3,096
近畿日本鉄道	35	15,015
阪急阪神ホールディングス	24	17,040
京阪電気鉄道	11	7,766
名古屋鉄道	17	8,075
日本通運	14	8,890
ヤマトホールディングス	6.2	16,578
山九	4	1,908
日立物流	0.7	1,150
空運業 (0.4%)		
ANAホールディングス	69	21,659
倉庫・運輸関連業 (0.1%)		
上組	4	4,584
近鉄エクスプレス	0.3	1,512
情報・通信業 (7.2%)		
グーグル	2.1	1,407
ティールイア	0.3	408
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	8.8	3,757
インターネットイニシアティブ	0.6	1,447
野村総合研究所	2	8,030

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
フジ・メディア・ホールディングス	3.6	5,868
オ ー ビ ッ ク	1.2	5,064
ヤ フ	24.9	10,731
ト レ ン ド マ イ ク ロ	1.8	6,102
日 本 オ ラ ク ル	0.6	3,030
伊藤忠テクノソリューションズ	0.4	1,832
大 塚 商 会	0.9	4,099
U S E N	2	610
エイベックス・グループ・ホールディングス	0.7	1,289
日本テレビホールディングス	3.2	5,814
日 本 電 信 電 話	11	80,542
K D D	11.8	91,497
光 通 信	0.3	2,181
N T T コ モ	28.7	59,853
GMOインターネット	1.2	1,446
東 宝	2.5	6,770
エヌ・ティ・ティ・データ	2.1	9,828
S C S K	0.8	2,420
コ ナ ミ	1.4	3,243
ソ フ ト バ ン ク	10	70,580
卸 売 業 (4.5%)		
双 日	23.2	3,944
アルフレッサ ホールディングス	4.1	6,420
シップハルスケアホールディングス	0.6	1,586
三 菱 食 品	0.4	984
第 一 興 商	0.8	2,924
メディカルホールディングス	3.5	4,984
伊 藤 忠 商 事	29.1	37,131
丸 紅	30.4	21,185
豊 田 通 商	3.9	11,493
兼 松	7	1,183
三 井 物 産	29.5	47,170
日立ハイテクノロジーズ	1.2	4,248
山 善	1.3	1,123
住 友 商 事	20.5	25,481
三 菱 商 事	26.6	58,799
岩 谷 産 業	4	3,184
東邦ホールディングス	1.2	2,294
サ ン リ オ	1	3,235
日 鉄 住 金 物 産	3	1,254
ミスミグループ本社	1.3	5,362
小 売 業 (4.6%)		
ロ ー ソ ン	1.3	10,335
エービーシー・マート	0.5	3,165
ゲオホールディングス	0.6	723
日本マクドナルドホールディングス	1.4	3,572
スターバックス コーヒー ジャパン	0.7	1,021
パ ル	0.2	601

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
セ リ ア	0.4	1,454
M o n o t a R O	0.7	2,481
J. フロント リテイリング	4.4	7,119
マツモトキヨシホールディングス	0.8	3,168
スタートトゥデイ	1.1	3,003
三越伊勢丹ホールディングス	6.9	11,971
ウエルシアホールディングス	0.4	1,762
コ ス モ ス 薬 品	0.2	3,734
セブン&アイ・ホールディングス	14.5	65,482
ツルハホールディングス	0.7	5,397
良 品 計 画	0.4	5,620
ドンキホーテホールディングス	1.1	9,163
V T ホールディングス	1.4	641
ユナイテッドアローズ	0.4	1,424
スギホールディングス	0.6	3,408
ファミリーマート	1.2	6,660
AOKIホールディングス	0.8	1,191
コ メ リ	0.6	1,609
し ま む ら	0.4	4,152
高 島 屋	5	5,575
イ オ ン	13.9	18,174
ユニグループ・ホールディングス	3.3	2,405
イ ズ ミ	0.8	3,240
ケーズホールディングス	0.8	2,756
アインファーマシーズ	0.4	1,752
ヤマダ電機	13.7	6,658
ニトリホールディングス	1.5	10,725
王将フードサービス	0.2	888
ア ー ク ス	0.8	1,922
バ ロ ー	0.7	1,538
ファーストリテイリング	0.7	30,803
サ ン ド ラ ッ グ	0.7	4,032
銀 行 業 (8.0%)		
新 生 銀 行	33	7,392
あ お ぞ ら 銀 行	23	9,430
三菱UFJフィナンシャル・グループ	119.1	84,215
りそなホールディングス	40.7	26,296
三井住友トラスト・ホールディングス	77	35,951
三井住友フィナンシャルグループ	16.5	70,842
西 日 本 シ テ ィ 銀 行	12	4,236
千 葉 銀 行	13	10,881
横 浜 銀 行	24	16,572
常 陽 銀 行	13	7,969
群 馬 銀 行	8	6,264
ふくおかフィナンシャルグループ	14	8,414
静 岡 銀 行	10	11,580
十 六 銀 行	6	2,520
ス ル ガ 銀 行	3.7	8,595

銘柄	当 期 末	
	株 数	評価額
	千株	千円
八 十 二 銀 行	8	6,656
ほくほくフィナンシャルグループ	24	6,192
広 島 銀 行	10	6,050
中 国 銀 行	3.3	5,864
伊 予 銀 行	5	7,015
セ ブ ン 銀 行	11.7	6,657
みずほフィナンシャルグループ	358.1	72,837
山口フィナンシャルグループ	5	6,400
北 洋 銀 行	5.2	2,329
京 葉 銀 行	4	2,624
証券・商品先物取引業 (1.6%)		
大和証券グループ本社	33	29,485
野村ホールディングス	71.1	47,189
岡三証券グループ	3	2,589
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4	3,072
松 井 証 券	1.8	1,854
保 険 業 (2.3%)		
ソニーフィナンシャルホールディングス	3.3	5,850
第 一 生 命 保 険	22.3	39,448
東京海上ホールディングス	14.3	59,816
T & Dホールディングス	12.7	18,745
その他金融業 (1.6%)		
クレディセゾン	2.8	6,162
芙蓉総合リース	0.4	1,700
興 銀 リ ー ス	0.7	1,694
東京センチュリーリース	0.8	2,386
J ト ラ ス ト	1	1,015
ア イ フ ル	5.8	2,656
リ コ ー リ ー ス	0.3	985
イオンフィナンシャルサービス	2.3	5,480
ア コ ム	7	2,632
日立キャピタル	0.7	1,756
オ リ ッ ク ス	24.6	38,019
三菱UFJリース	8.8	4,980
日本取引所グループ	5.1	15,182
不 動 産 業 (3.7%)		
ヒ ュ ー リ ッ ク	5.9	7,298
野村不動産ホールディングス	2.1	4,235

銘柄	当 期 末	
	株 数	評価額
	千株	千円
東急不動産ホールディングス	9.1	7,088
飯田グループホールディングス	2.3	3,769
パ ー ク 2 4	1.7	3,481
三 井 不 動 産	18	59,400
三 菱 地 所	26	68,900
住 友 不 動 産	8	32,532
大 京	6	1,032
レ オ パ レ ス 2 1	3.8	2,519
住友不動産販売	0.2	614
タカラレーベン	1.5	862
イ オ ン モ ー ル	2.2	4,576
エヌ・ティ・ティ都市開発	2.2	2,549
サ ー ビ ス 業 (3.0%)		
アコーディア・ゴルフ	1.4	1,674
テンポホールディングス	0.7	2,625
カ カ ク コ ム	2.4	4,459
エ ム ス リ ー	3.2	7,804
ディー・エヌ・エー	1.8	2,525
博報堂DYホールディングス	5.1	6,028
電 通	4.1	19,803
みらかホールディングス	1	5,510
オリエンタルランド	1	28,440
リゾートトラスト	1.4	3,725
もしもしホットライン	0.7	949
ユー・エス・エス	4.4	8,918
サイバーエージェント	0.9	5,103
楽 天	16	28,320
リロ・ホールディング	0.2	1,850
エイチ・アイ・エス	0.6	2,268
セ コ ム	3.6	25,311
ベネッセホールディングス	1.3	4,758
イオンディライト	0.4	1,079
合 計	株 数・金 額	3,754 5,423,491
	銘柄数<比率>	399 <98.6%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。
(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3) 株数合計・評価額の単位未満は切り捨てです。ただし、単位未満の株数は小数で記載しています。

②先物取引の銘柄別期末残高

2015年2月13日現在

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国 内	百万円	百万円
T O P I X	72	-

(注1) 金額の単位未満は切り捨てです。

(注2) 一印は組み入れがありません。

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8期（2014年5月13日～2015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 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	48,684
受取利息	48,684
(B) 有価証券売買損益	1,491,618,084
売買益	1,800,832,736
売買損	△ 309,214,652
(C) 信託報酬等	△ 153,957,307
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,337,709,461
(E) 前期繰越損益金	3,098,771,374
(F) 追加信託差損益金	16,891,256,767
(配当等相当額)	(11,848,209,707)
(売買損益相当額)	(5,043,047,060)
(G) 計(D+E+F)	21,327,737,602
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	21,327,737,602
追加信託差損益金	16,891,256,767
(配当等相当額)	(11,901,446,689)
(売買損益相当額)	(4,989,810,078)
分配準備積立金	4,436,480,835

- (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

(2015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	67,082,591	113,326,227	142,473,733

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	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341回利付国債（2年）	0.1	800,000	800,864	2016/6/15
第342回利付国債（2年）	0.1	1,110,000	1,111,287	2016/7/15
第343回利付国債（2年）	0.1	1,400,000	1,401,750	2016/8/15
第344回利付国債（2年）	0.1	1,430,000	1,431,901	2016/9/15
第345回利付国債（2年）	0.1	940,000	941,334	2016/10/15
第346回利付国債（2年）	0.1	1,250,000	1,251,875	2016/11/15
第347回利付国債（2年）	0.1	350,000	350,553	2016/12/15
第348回利付国債（2年）	0.1	1,050,000	1,051,753	2017/1/15
第349回利付国債（2年）	0.1	1,220,000	1,222,135	2017/2/15
第350回利付国債（2年）	0.1	1,200,000	1,202,196	2017/3/15
第351回利付国債（2年）	0.1	1,240,000	1,242,380	2017/4/15
第97回利付国債（5年）	0.4	1,210,000	1,215,396	2016/6/20
第98回利付国債（5年）	0.3	1,000,000	1,003,350	2016/6/20
第99回利付国債（5年）	0.4	990,000	995,355	2016/9/20
第100回利付国債（5年）	0.3	1,360,000	1,365,521	2016/9/20
第101回利付国債（5年）	0.4	850,000	855,448	2016/12/20
第102回利付国債（5年）	0.3	2,990,000	3,004,352	2016/12/20
第103回利付国債（5年）	0.3	1,360,000	1,367,534	2017/3/20
第104回利付国債（5年）	0.2	1,150,000	1,154,243	2017/3/20
第105回利付国債（5年）	0.2	2,640,000	2,650,533	2017/6/20
第106回利付国債（5年）	0.2	3,130,000	3,143,991	2017/9/20
第107回利付国債（5年）	0.2	1,570,000	1,577,755	2017/12/20
第108回利付国債（5年）	0.1	2,130,000	2,134,984	2017/12/20
第109回利付国債（5年）	0.1	2,450,000	2,455,929	2018/3/20
第110回利付国債（5年）	0.3	1,080,000	1,088,758	2018/3/20
第111回利付国債（5年）	0.4	1,410,000	1,425,453	2018/3/20
第112回利付国債（5年）	0.4	1,200,000	1,213,944	2018/6/20
第113回利付国債（5年）	0.3	2,700,000	2,723,004	2018/6/20
第114回利付国債（5年）	0.3	1,390,000	1,402,329	2018/9/20
第115回利付国債（5年）	0.2	2,170,000	2,181,978	2018/9/20
第116回利付国債（5年）	0.2	3,780,000	3,800,374	2018/12/20
第117回利付国債（5年）	0.2	3,990,000	4,010,668	2019/3/20
第118回利付国債（5年）	0.2	1,690,000	1,698,281	2019/6/20
第119回利付国債（5年）	0.1	1,670,000	1,671,352	2019/6/20
第120回利付国債（5年）	0.2	2,440,000	2,451,102	2019/9/20
第121回利付国債（5年）	0.1	2,360,000	2,360,495	2019/9/20
第122回利付国債（5年）	0.1	3,580,000	3,578,353	2019/12/20
第123回利付国債（5年）	0.1	1,960,000	1,957,628	2020/3/20
第1回利付国債（40年）	2.4	275,000	335,368	2048/3/20
第2回利付国債（40年）	2.2	500,000	584,480	2049/3/20
第3回利付国債（40年）	2.2	493,000	576,593	2050/3/20
第4回利付国債（40年）	2.2	708,000	828,367	2051/3/20
第5回利付国債（40年）	2.0	645,000	719,826	2052/3/20
第6回利付国債（40年）	1.9	690,000	750,292	2053/3/20
第7回利付国債（40年）	1.7	700,000	720,216	2054/3/20

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
国債証券	%	千円	千円	
第8回利付国債（40年）	1.4	170,000	159,781	2055/3/20
第280回利付国債（10年）	1.9	600,000	612,588	2016/6/20
第281回利付国債（10年）	2.0	1,053,000	1,076,250	2016/6/20
第282回利付国債（10年）	1.7	1,790,000	1,831,295	2016/9/20
第283回利付国債（10年）	1.8	1,732,000	1,774,312	2016/9/20
第284回利付国債（10年）	1.7	2,866,000	2,944,299	2016/12/20
第285回利付国債（10年）	1.7	3,468,000	3,577,346	2017/3/20
第286回利付国債（10年）	1.8	1,070,000	1,110,349	2017/6/20
第287回利付国債（10年）	1.9	2,400,000	2,495,544	2017/6/20
第288回利付国債（10年）	1.7	1,596,000	1,659,456	2017/9/20
第289回利付国債（10年）	1.5	1,593,000	1,654,760	2017/12/20
第290回利付国債（10年）	1.4	350,000	363,856	2018/3/20
第291回利付国債（10年）	1.3	940,000	974,535	2018/3/20
第292回利付国債（10年）	1.7	794,000	832,215	2018/3/20
第293回利付国債（10年）	1.8	521,000	549,743	2018/6/20
第294回利付国債（10年）	1.7	940,000	988,945	2018/6/20
第295回利付国債（10年）	1.5	1,040,000	1,087,704	2018/6/20
第296回利付国債（10年）	1.5	1,600,000	1,678,224	2018/9/20
第297回利付国債（10年）	1.4	836,000	876,579	2018/12/20
第298回利付国債（10年）	1.3	1,240,000	1,295,738	2018/12/20
第299回利付国債（10年）	1.3	1,260,000	1,319,749	2019/3/20
第300回利付国債（10年）	1.5	957,000	1,009,721	2019/3/20
第301回利付国債（10年）	1.5	1,512,000	1,600,089	2019/6/20
第302回利付国債（10年）	1.4	1,250,000	1,317,712	2019/6/20
第303回利付国債（10年）	1.4	1,615,000	1,706,732	2019/9/20
第304回利付国債（10年）	1.3	800,000	841,976	2019/9/20
第305回利付国債（10年）	1.3	2,938,000	3,098,796	2019/12/20
第306回利付国債（10年）	1.4	2,488,000	2,641,534	2020/3/20
第307回利付国債（10年）	1.3	1,260,000	1,331,681	2020/3/20
第308回利付国債（10年）	1.3	1,474,000	1,561,393	2020/6/20
第309回利付国債（10年）	1.1	2,190,000	2,297,638	2020/6/20
第310回利付国債（10年）	1.0	2,036,000	2,128,454	2020/9/20
第311回利付国債（10年）	0.8	1,230,000	1,272,791	2020/9/20
第312回利付国債（10年）	1.2	2,430,000	2,571,037	2020/12/20
第313回利付国債（10年）	1.3	1,859,000	1,981,229	2021/3/20
第314回利付国債（10年）	1.1	950,000	1,001,452	2021/3/20
第315回利付国債（10年）	1.2	2,013,000	2,136,900	2021/6/20
第316回利付国債（10年）	1.1	830,000	876,081	2021/6/20
第317回利付国債（10年）	1.1	657,000	694,527	2021/9/20
第318回利付国債（10年）	1.0	1,790,000	1,881,003	2021/9/20
第319回利付国債（10年）	1.1	719,000	760,917	2021/12/20
第320回利付国債（10年）	1.0	2,100,000	2,208,759	2021/12/20
第321回利付国債（10年）	1.0	1,575,000	1,656,774	2022/3/20
第322回利付国債（10年）	0.9	750,000	783,877	2022/3/20
第323回利付国債（10年）	0.9	1,875,000	1,959,337	2022/6/20
第324回利付国債（10年）	0.8	1,250,000	1,297,062	2022/6/20

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325回利付国債（10年）	0.8	2,885,000	2,992,004	2022/9/20
第326回利付国債（10年）	0.7	1,000,000	1,029,350	2022/12/20
第327回利付国債（10年）	0.8	1,110,000	1,150,825	2022/12/20
第328回利付国債（10年）	0.6	2,330,000	2,379,931	2023/3/20
第329回利付国債（10年）	0.8	3,210,000	3,327,710	2023/6/20
第330回利付国債（10年）	0.8	1,990,000	2,062,674	2023/9/20
第331回利付国債（10年）	0.6	1,480,000	1,510,029	2023/9/20
第332回利付国債（10年）	0.6	3,260,000	3,323,896	2023/12/20
第333回利付国債（10年）	0.6	3,650,000	3,717,123	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	3,170,000	3,225,665	2024/6/20
第335回利付国債（10年）	0.5	2,810,000	2,831,496	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	1,360,000	1,368,772	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	2,100,000	2,073,855	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	2,210,000	2,199,568	2025/3/20
第1回利付国債（30年）	2.8	76,000	96,564	2029/9/20
第2回利付国債（30年）	2.4	98,000	119,266	2030/2/20
第3回利付国債（30年）	2.3	117,000	140,809	2030/5/20
第4回利付国債（30年）	2.9	127,000	163,934	2030/11/20
第5回利付国債（30年）	2.2	108,000	128,372	2031/5/20
第6回利付国債（30年）	2.4	169,000	205,754	2031/11/20
第7回利付国債（30年）	2.3	164,000	197,152	2032/5/20
第8回利付国債（30年）	1.8	142,000	159,177	2032/11/22
第9回利付国債（30年）	1.4	116,000	122,577	2032/12/20
第10回利付国債（30年）	1.1	185,000	186,110	2033/3/20
第11回利付国債（30年）	1.7	137,000	150,658	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	220,000	255,939	2033/9/20
第13回利付国債（30年）	2.0	205,000	234,759	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	493,000	596,781	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	346,000	424,804	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	302,000	370,348	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	327,000	395,228	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	427,000	507,997	2035/3/20
第19回利付国債（30年）	2.3	303,000	360,185	2035/6/20
第20回利付国債（30年）	2.5	435,000	531,852	2035/9/20
第21回利付国債（30年）	2.3	379,000	449,349	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	370,000	452,099	2036/3/20
第23回利付国債（30年）	2.5	354,000	432,577	2036/6/20
第24回利付国債（30年）	2.5	341,000	417,060	2036/9/20
第25回利付国債（30年）	2.3	412,000	488,487	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	834,000	1,003,769	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	650,000	794,729	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	801,000	980,688	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	850,000	1,024,845	2038/9/20
第30回利付国債（30年）	2.3	926,000	1,099,578	2039/3/20
第31回利付国債（30年）	2.2	888,000	1,037,743	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	1,079,000	1,284,063	2040/3/20

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33回利付国債 (30年)	2.0	1,204,000	1,358,232	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	1,206,000	1,411,900	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	1,259,000	1,420,831	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	1,069,000	1,204,741	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	1,157,000	1,279,005	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	885,000	956,888	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	900,000	993,753	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	700,000	756,063	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	660,000	696,880	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	760,000	801,906	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	900,000	947,979	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	850,000	894,667	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	970,000	972,987	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	580,000	581,194	2045/3/20
第33回利付国債 (20年)	3.8	36,000	37,851	2016/9/20
第35回利付国債 (20年)	3.3	117,000	124,139	2017/3/20
第36回利付国債 (20年)	3.0	201,000	215,164	2017/9/20
第38回利付国債 (20年)	2.7	400,000	430,648	2018/3/20
第40回利付国債 (20年)	2.3	601,000	646,591	2018/9/20
第42回利付国債 (20年)	2.6	869,000	953,762	2019/3/20
第43回利付国債 (20年)	2.9	74,000	83,016	2019/9/20
第44回利付国債 (20年)	2.5	480,000	535,464	2020/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	114,000	126,551	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	209,000	236,234	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	515,000	572,947	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	200,000	222,110	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	214,000	239,744	2021/9/21
第54回利付国債 (20年)	2.2	480,000	542,380	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	241,000	269,956	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	449,000	503,472	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	147,000	164,157	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	589,000	650,291	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	289,000	304,163	2023/3/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	442,000	493,457	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	441,000	496,676	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	318,000	359,161	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	500,000	560,545	2023/12/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	846,000	979,075	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	422,000	496,769	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	160,000	185,534	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	534,000	616,401	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	620,000	710,749	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	318,000	367,480	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	575,000	666,045	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	200,000	227,780	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	210,000	241,266	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	467,666	2025/6/20
第79回利付国債（20年）	2.0	50,000	57,543	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	315,000	365,570	2025/6/20
第81回利付国債（20年）	2.0	200,000	230,438	2025/9/20
第82回利付国債（20年）	2.1	662,000	769,674	2025/9/20
第83回利付国債（20年）	2.1	293,000	341,060	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	670,000	773,133	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	330,000	384,532	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	515,000	610,707	2026/3/20
第87回利付国債（20年）	2.2	250,000	293,887	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	504,000	598,782	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	410,000	482,799	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	670,000	790,244	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	468,000	557,303	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	902,000	1,055,060	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	270,000	313,027	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	665,000	778,794	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	677,000	809,123	2027/6/20
第96回利付国債（20年）	2.1	380,000	445,310	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	853,000	1,010,540	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	220,000	257,952	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	1,075,000	1,261,706	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	620,000	735,704	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	573,000	693,971	2028/3/20
第102回利付国債（20年）	2.4	680,000	824,166	2028/6/20
第103回利付国債（20年）	2.3	550,000	659,961	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	280,000	329,016	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	690,000	810,936	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	381,000	452,445	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	607,000	713,874	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	630,000	724,796	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	940,000	1,081,723	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	246,000	289,480	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	381,000	453,473	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	860,000	1,012,572	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	1,252,000	1,473,879	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	1,020,000	1,200,438	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	494,000	588,270	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	596,000	709,567	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	890,000	1,047,031	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	296,000	344,088	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	460,000	521,626	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	800,000	884,440	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	929,000	1,065,813	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	620,000	702,850	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	828,000	973,256	2030/12/20

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124回利付国債 (20年)	2.0	500,000	580,405	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	724,000	861,719	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	220,000	255,336	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	520,000	595,842	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	644,000	737,154	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	600,000	677,844	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	852,000	961,303	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	400,000	445,296	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	827,000	919,243	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	650,000	732,381	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	965,000	1,085,711	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	170,000	188,654	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	330,000	361,152	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	812,000	899,606	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	410,000	441,549	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	150,000	163,860	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,507,000	1,666,681	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	1,200,000	1,324,728	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	620,000	694,238	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	990,000	1,075,080	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	610,000	652,730	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,670,000	1,836,499	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,580,000	1,734,018	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,800,000	1,941,966	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	1,610,000	1,706,535	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,800,000	1,903,122	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,600,000	1,660,688	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,630,000	1,630,000	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,250,000	1,246,000	2035/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券 (2013)	0.67	100,000	100,693	2018/11/15
小 計		259,668,000	276,063,134	
地方債証券				
第1回東京都公募公債 (20年)	1.54	20,000	21,818	2023/6/20
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	10,000	11,941	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (30年)	2.23	80,000	91,089	2038/9/17
第16回東京都公募公債 (20年)	2.01	100,000	115,474	2028/12/20
第20回東京都公募公債 (20年)	2.09	80,000	93,284	2029/9/20
第21回東京都公募公債 (20年)	2.19	80,000	94,324	2029/12/20
第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	120,000	136,918	2030/6/20
第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	70,000	80,186	2031/6/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	107,314	2033/3/18
第638回東京都公募公債	1.9	100,000	102,485	2016/9/20
第648回東京都公募公債	1.84	100,000	103,745	2017/6/20
第666回東京都公募公債	1.46	100,000	105,141	2019/3/20
第669回東京都公募公債	1.63	50,000	53,065	2019/6/20
第678回東京都公募公債	1.38	100,000	105,579	2019/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	105,871	2020/3/19
第681回東京都公募公債	1.4	100,000	105,920	2020/3/19
第692回東京都公募公債	1.35	100,000	106,312	2020/12/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	106,702	2021/3/19
第701回東京都公募公債	0.99	120,000	125,587	2021/9/17
第705回東京都公募公債	1.06	70,000	73,669	2022/3/18
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	101,944	2023/3/20
第719回東京都公募公債	0.86	150,000	155,554	2023/3/20
第728回東京都公募公債	0.65	200,000	203,816	2023/12/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	101,948	2024/3/19
第733回東京都公募公債	0.581	100,000	101,095	2024/6/20
平成18年度第6回北海道公募公債	2.1	118,000	121,034	2016/8/31
平成19年度第2回北海道公募公債	1.84	112,000	115,952	2017/5/31
平成19年度第4回北海道公募公債	1.98	20,000	20,790	2017/6/29
平成19年度第16回北海道公募公債	1.58	100,000	104,165	2018/3/23
平成20年度第6回北海道公募公債	1.72	53,990	56,774	2018/8/29
平成21年度第2回北海道公募公債	1.66	100,000	105,926	2019/5/29
平成21年度第12回北海道公募公債	1.42	100,000	105,512	2019/12/25
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	103,769	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	100,000	102,826	2022/10/31
第1回神奈川県公募公債（20年）	2.55	100,000	118,668	2024/6/20
第2回神奈川県公募公債（20年）	2.23	80,000	92,696	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債（30年）	2.87	80,000	100,556	2036/6/20
第3回神奈川県公募公債（20年）	2.11	100,000	115,375	2025/6/20
第27回神奈川県公募公債（20年）	1.398	100,000	102,446	2034/9/20
第152回神奈川県公募公債	1.53	110,000	114,592	2018/3/20
第162回神奈川県公募公債	1.62	140,450	149,002	2019/6/20
第165回神奈川県公募公債	1.4	54,660	57,630	2019/9/20
第170回神奈川県公募公債	1.38	100,000	105,827	2020/3/20
第176回神奈川県公募公債	1.16	128,900	135,453	2020/9/18
第5回大阪府公募公債（20年）	2.16	100,000	116,776	2030/5/28
第74回大阪府公募公債（5年）	0.46	100,000	100,407	2016/6/29
第285回大阪府公募公債	1.5	50,000	50,434	2015/12/25
第300回大阪府公募公債	1.8	135,000	139,306	2017/3/29
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	31,231	2017/9/27
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	104,596	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	31,540	2018/5/29
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	105,553	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	53,000	56,125	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,600	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	105,423	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	76,083	2019/11/27
第334回大阪府公募公債	1.47	44,000	46,609	2020/1/28
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	116,631	2020/4/28
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,790	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,616	2021/3/30

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,584	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,444	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,522	2022/3/29
平成21年度第5回京都府公募公債	1.35	20,000	21,081	2019/12/24
平成22年度第5回京都府公募公債	1.26	110,000	116,339	2020/12/21
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	146,763	2022/3/16
平成25年度第2回京都府公募公債 (15年)	1.05	100,000	103,545	2028/4/28
第2回兵庫県公募公債 (30年)	2.36	40,000	46,217	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債 (15年)	1.31	100,000	106,535	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債 (15年)	1.09	100,000	102,886	2029/4/16
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	108,559	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	52,826	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	20,000	21,149	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	90,000	95,278	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	106,080	2019/11/20
平成18年度第2回静岡県公募公債	2.0	41,300	42,197	2016/6/27
平成19年度第1回静岡県公募公債	1.77	66,900	69,232	2017/5/30
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	15,227	2018/5/28
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	105,114	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,563	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	56,104	2019/8/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	105,045	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	104,473	2020/8/25
平成23年度第5回静岡県公募公債	1.158	100,000	105,540	2021/6/28
平成25年度第9回静岡県公募公債	0.679	100,000	102,131	2023/11/22
平成26年度第5回静岡県公募公債	0.61	100,000	101,277	2024/7/25
平成18年度第4回愛知県公募公債	1.8	110,700	113,449	2016/10/17
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	105,323	2021/7/29
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	104,776	2022/1/31
平成25年度第2回愛知県公募公債	0.576	200,000	202,944	2023/4/26
平成25年度第9回愛知県公募公債	0.849	140,000	145,052	2023/7/25
平成19年度第2回広島県公募公債	1.94	46,050	48,005	2017/8/24
平成20年度第4回広島県公募公債	1.73	60,000	63,398	2018/11/26
平成22年度第8回広島県公募公債	1.33	26,650	28,338	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	105,599	2021/5/27
平成18年度第3回埼玉県公募公債	2.1	107,600	110,243	2016/7/28
平成18年度第5回埼玉県公募公債	1.9	62,100	63,861	2016/11/29
平成18年度第7回埼玉県公募公債	1.85	112,600	116,197	2017/2/27
平成19年度第3回埼玉県公募公債	1.94	39,100	40,776	2017/8/28
平成19年度第6回埼玉県公募公債	1.63	100,000	104,236	2018/1/30
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	106,687	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	105,837	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	103,277	2022/10/26
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	150,000	150,996	2024/9/26
平成18年度第3回福岡県公募公債	1.9	100,000	102,683	2016/10/31
平成19年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.62	70,000	84,812	2037/9/18

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成20年度第1回福岡県公募公債 (30年)	2.28	80,000	91,792	2038/9/17
平成21年度第11回福岡県公募公債	1.44	100,000	105,986	2020/2/25
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	104,711	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,782	2020/10/28
第9回千葉県公募公債 (20年)	1.84	80,000	90,235	2030/10/11
平成20年度第2回千葉県公募公債	1.8	90,000	94,692	2018/5/25
平成20年度第3回千葉県公募公債	1.78	80,000	84,326	2018/7/25
平成20年度第5回千葉県公募公債	1.6	80,000	84,033	2018/9/25
平成22年度第7回千葉県公募公債	0.92	120,000	124,586	2020/10/23
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	84,688	2021/1/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,962	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	20,000	21,025	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	103,337	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	83,706	2023/4/25
平成21年度第1回新潟県公募公債	1.42	23,000	24,210	2019/7/29
平成23年度第1回新潟県公募公債	1.02	119,000	124,632	2021/11/30
第45回共同発行市場公募地方債	1.7	37,500	38,482	2016/12/22
第47回共同発行市場公募地方債	1.8	117,000	120,605	2017/2/24
第50回共同発行市場公募地方債	1.7	29,100	30,066	2017/5/25
第52回共同発行市場公募地方債	1.9	102,000	106,112	2017/7/25
第53回共同発行市場公募地方債	1.8	300	311	2017/8/25
第58回共同発行市場公募地方債	1.59	21,000	21,859	2018/1/25
第59回共同発行市場公募地方債	1.57	100,800	104,990	2018/2/23
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	105,032	2018/5/25
第63回共同発行市場公募地方債	1.88	100,000	105,603	2018/6/25
第64回共同発行市場公募地方債	1.78	100,000	105,408	2018/7/25
第65回共同発行市場公募地方債	1.62	90,000	94,500	2018/8/24
第74回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	105,778	2019/5/24
第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	106,168	2019/6/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.54	10,000	10,594	2019/8/23
第78回共同発行市場公募地方債	1.39	30,000	31,615	2019/9/25
第81回共同発行市場公募地方債	1.32	109,500	115,299	2019/12/25
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	31,458	2020/9/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	106,030	2021/2/25
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	104,949	2021/8/25
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	200,000	209,850	2021/11/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	104,873	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	70,000	73,590	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,000	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	103,094	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	103,451	2022/9/22
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	250,000	258,160	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	102,623	2022/12/22
第118回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	103,519	2023/1/25
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	309,645	2023/2/24
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,290	2023/3/24

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128回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	305,799	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	130,000	133,598	2024/ 1 /25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	203,660	2024/ 3 /25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	100,000	101,737	2024/ 6 /25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	300,000	302,556	2024/ 8 /23
第138回共同発行市場公募地方債	0.554	100,000	100,664	2024/ 9 /25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	197,120	2025/ 1 /24
平成18年度第1回堺市公募公債	1.84	30,000	30,839	2016/12/26
平成19年度第1回堺市公募公債	1.73	100,000	104,195	2017/12/19
平成18年度第2回熊本県公募公債	1.8	84,540	86,661	2016/10/27
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	51,597	2022/10/26
平成22年度第1回新潟市公募公債	1.21	54,980	57,984	2020/12/24
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	38,200	40,079	2021/11/25
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	61,000	62,614	2024/ 1 /24
第1回大阪市公募公債（15年）	1.753	200,000	223,658	2026/ 7 /17
第5回大阪市公募公債（20年）	2.47	100,000	120,746	2028/ 9 /21
平成18年度第6回大阪市公募公債	2.0	75,000	77,080	2016/10/26
平成19年度第4回大阪市公募公債	1.9	30,000	31,143	2017/ 6 /21
平成21年度第6回大阪市公募公債	1.57	125,000	132,791	2019/11/25
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,429	2022/ 1 /27
平成26年度第5回大阪市公募公債	0.593	100,000	100,788	2024/ 9 /27
第1回名古屋市公募公債（12年）	1.033	100,000	104,846	2025/ 6 /20
第2回名古屋市公募公債（20年）	2.56	100,000	118,600	2024/ 6 /20
第10回名古屋市公募公債（20年）	2.26	80,000	95,127	2029/ 8 /17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	104,958	2021/12/20
第5回京都市公募公債（20年）	2.36	50,000	59,417	2026/12/18
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	2.54	120,000	144,304	2026/ 6 /19
平成22年度第9回神戸市公募公債（20年）	2.09	80,000	92,712	2031/ 1 /24
第7回横浜市公募公債（20年）	2.06	100,000	115,190	2025/12/19
第17回横浜市公募公債（20年）	2.07	80,000	93,031	2028/12/20
平成20年度第4回横浜市公募公債	1.71	100,000	105,572	2018/11/16
第20回横浜市公募公債（20年）	2.1	80,000	93,384	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	103,247	2023/ 2 /20
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	102,651	2022/12/22
第25回横浜市公募公債（20年）	1.72	100,000	109,989	2032/ 7 /16
第27回横浜市公募公債（20年）	1.599	60,000	64,356	2033/ 5 /20
平成21年度第5回札幌市公募公債	1.36	112,000	117,815	2019/ 9 /20
平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）	2.277	80,000	91,835	2040/ 9 /20
第82回川崎市公募公債	1.52	100,000	105,931	2019/ 9 /20
第17回北九州市公募公債（20年）	1.529	100,000	104,779	2034/ 6 /20
平成17年度第3回福岡市公募公債	1.6	60,000	60,502	2015/11/30
平成18年度第6回福岡市公募公債	1.8	70,000	71,954	2016/12/26
平成20年度第5回福岡市公募公債	1.57	91,000	95,546	2018/10/24
平成24年度第1回福岡市公募公債（5年）	0.25	34,700	34,828	2017/ 6 /26
平成24年度第3回福岡市公募公債（5年）	0.25	42,500	42,671	2017/ 9 /28
平成25年度第3回福岡市公募公債（5年）	0.31	31,500	31,706	2018/ 9 /26

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4回福岡市公募公債	0.68	50,000	51,018	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債 (20年)	1.371	100,000	102,183	2034/9/20
平成18年度第1回千葉市公募公債	1.8	50,000	51,250	2016/10/25
平成24年度第2回千葉市公募公債	0.81	100,000	103,258	2022/11/22
平成22年度第1回三重県公募公債	1.056	87,050	91,065	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債	1.021	12,750	13,371	2021/11/30
平成24年度第1回三重県公募公債	0.801	40,400	41,723	2022/10/25
平成24年度第4回福井県公募公債	0.46	100,000	100,457	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債	1.73	36,000	38,022	2018/11/28
平成26年度第1回徳島県公募公債	0.495	100,000	99,815	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債	1.56	48,700	51,218	2018/12/25
小 計		18,432,040	19,456,471	
特殊債券(除く金融債)				
第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	120,000	122,833	2016/7/28
第17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	102,542	2016/8/31
第23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	102,680	2016/12/28
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	208,214	2017/7/31
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	112,000	116,757	2017/8/31
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	90,000	93,519	2017/9/28
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	110,565	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	103,929	2018/1/31
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	56,000	58,216	2018/4/20
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	104,996	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	35,783	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	56,000	58,803	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	124,000	129,913	2018/9/28
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	121,123	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	166,185	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	123,000	128,638	2019/3/19
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	234,080	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	110,000	116,260	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	83,011	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	116,982	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	116,988	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	145,703	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	221,323	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	117,538	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	52,757	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	116,986	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	100,000	105,749	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	104,316	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	116,334	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	74,972	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	115,387	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	95,785	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	63,216	2021/7/30

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
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	127,834	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	104,856	2021/10/29
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	100,000	112,027	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	142,630	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	116,756	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	270,000	281,529	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	104,778	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	110,690	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	214,782	2042/5/30
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	150,000	155,040	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	103,421	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	117,000	120,376	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	207,276	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	102,350	2023/3/17
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	300,000	305,388	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	104,005	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	126,124	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	100,000	103,581	2023/8/31
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	101,787	2024/6/28
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	102,962	2034/8/31
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	107,303	2020/7/15
第3回政府保証首都高速道路債券	1.7	9,000	9,278	2017/3/27
第4回政府保証首都高速道路債券	1.7	179,000	185,998	2017/9/25
第1回政府保証阪神高速道路債券	1.6	5,000	5,068	2016/3/31
第2回政府保証成田国際空港債券	1.6	38,000	38,461	2016/2/22
第4回政府保証東日本高速道路債券	1.9	75,000	76,562	2016/6/27
第6回政府保証東日本高速道路債券	1.8	62,000	63,662	2016/11/24
第7回政府保証東日本高速道路債券	1.9	34,000	35,432	2017/8/24
第10回政府保証東日本高速道路債券	1.5	107,000	111,045	2017/12/21
第13回政府保証東日本高速道路債券	1.6	28,000	29,452	2018/10/19
第3回政府保証中日本高速道路債券	1.6	27,000	27,328	2016/2/24
第17回政府保証中日本高速道路債券	1.7	100,000	103,853	2017/9/15
第20回政府保証中日本高速道路債券	1.4	10,000	10,383	2018/3/16
第23回政府保証中日本高速道路債券	1.5	46,000	48,178	2018/9/14
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	10,000	10,564	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	26,325	2019/7/12
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	105,816	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	201,900	2018/1/30
第4回政府保証公営企業債券（15年）	2.0	100,000	111,791	2022/4/22
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	0.093	200,000	200,154	2017/2/24
第5回政府保証公営企業債券（15年）	2.2	100,000	113,403	2022/7/15
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.4	100,000	105,043	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	48,000	50,669	2019/5/24
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	105,642	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	104,311	2020/9/14
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	22,015	2021/10/18

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	52,774	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	104,170	2022/6/17
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	254,000	262,834	2023/2/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,643	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	150,000	155,404	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	39,000	39,932	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	203,830	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	101,372	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	201,882	2024/8/16
第864回政府保証公営企業債券	1.9	14,000	14,287	2016/6/22
第866回政府保証公営企業債券	2.0	63,000	64,553	2016/8/18
第870回政府保証公営企業債券	1.7	52,000	53,381	2016/12/21
第879回政府保証公営企業債券	1.7	102,000	105,948	2017/9/19
第883回政府保証公営企業債券	1.4	100,000	103,845	2018/3/19
第884回政府保証公営企業債券	1.4	114,000	118,482	2018/4/17
第885回政府保証公営企業債券	1.7	104,000	109,159	2018/5/22
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	111,094	2021/4/16
第23回政府保証日本政策金融公庫債券	0.734	30,000	30,873	2022/12/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	103,487	2023/2/24
第190回政府保証中小企業債券	1.8	13,000	13,386	2017/1/24
第191回政府保証中小企業債券	1.7	211,000	219,129	2017/9/15
第16回政府保証民間都市開発債券	0.699	80,000	81,985	2023/10/20
第17回政府保証国民生活債券	1.6	41,000	41,537	2016/3/17
第21回政府保証国民生活債券	1.5	2,000	2,075	2017/12/18
第201回政府保証預金保険機構債券	0.1	200,000	199,956	2019/2/13
第7回政府保証日本政策投資銀行	1.4	100,000	105,894	2020/2/17
第11回政府保証日本政策投資銀行	1.0	137,000	143,591	2021/9/14
第17回政府保証日本政策投資銀行	0.257	200,000	201,140	2018/11/9
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,478	2023/12/18
第27回政府保証日本政策投資銀行	0.11	200,000	198,904	2021/2/12
第53回政府保証関西国際空港債券	1.5	151,000	156,892	2018/1/24
第11回政府保証中部国際空港債券	0.7	100,000	101,160	2017/2/23
第5回政府保証西日本高速道路債券	1.8	41,000	42,220	2017/1/25
第6回政府保証西日本高速道路債券	1.8	51,000	52,597	2017/2/27
第8回政府保証西日本高速道路債券	1.7	100,000	103,335	2017/5/19
第11回政府保証西日本高速道路債券	1.7	31,000	32,297	2017/11/28
第21回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	0.46	100,000	100,645	2017/3/17
第27回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.98	100,000	102,538	2016/9/20
第46回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	1.69	50,000	52,248	2018/3/20
第7回道路債券(財投機関債)	2.7	100,000	116,153	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	23,733	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	127,051	2032/5/20
第13回道路債券(財投機関債)	2.28	100,000	113,501	2022/9/20
第15回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.05	100,000	102,626	2016/9/20
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	37,329	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	121,296	2047/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
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	155,048	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	71,344	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	208,046	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	118,428	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	104,269	2018/3/20
第42回道路債券(財投機関債)	2.22	30,000	34,696	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	105,290	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	100,000	119,837	2029/4/20
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	55,923	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	108,787	2032/6/18
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	102,675	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	102,653	2022/12/20
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	206,176	2023/6/20
第1回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.648	100,000	106,038	2019/6/28
第1回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	58,985	2029/6/28
第2回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.406	80,000	84,087	2019/7/26
第3回回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	20,921	2023/3/22
第3回回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)	1.176	100,000	104,017	2029/1/26
第6回回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	112,975	2023/12/20
第9回回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	58,157	2024/9/24
第10回回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)	0.28	100,000	100,353	2017/5/26
第14回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	93,330	2031/4/28
第16回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.164	100,000	104,823	2020/9/28
第16回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	89,291	2031/8/28
第17回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.87	100,000	111,924	2031/9/26
第19回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.274	50,000	52,797	2020/12/28
第20回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.28	100,000	105,683	2021/1/28
F23回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.075	100,000	102,903	2018/5/29
第23回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.418	100,000	106,658	2021/4/28
第23回回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	250,000	270,955	2032/7/28
F24回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.681	70,000	76,715	2023/3/17
第27回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.034	100,000	104,530	2021/8/27
第35回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.006	100,000	104,476	2022/4/28
第44回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	205,534	2023/1/27
第49回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.887	200,000	206,936	2023/6/28
F89回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.602	100,000	109,856	2027/8/20
F110回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.562	100,000	101,538	2019/4/25
F123回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.6	100,000	108,916	2030/3/19
F131回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	100,000	107,221	2031/7/30
F147回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.291	100,000	106,371	2027/3/19
F226回回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.096	100,000	102,926	2029/2/28
第10回回首都高速道路	0.336	100,000	100,531	2017/9/20
第13回回首都高速道路(財投機関債)	0.223	100,000	100,072	2019/9/20
第10回回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167	80,000	93,266	2030/3/19
第15回回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911	80,000	90,296	2030/10/29
第21回回都市再生債券(財投機関債)	1.72	100,000	105,283	2018/9/20

銘	柄	当 期 末			償 還 年 月 日
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第54回都市再生債券 (財投機関債)		0.434	100,000	100,440	2016/9/20
第100回都市再生債券 (財投機関債)		0.569	100,000	100,306	2024/11/20
第10回福祉医療機構債券 (財投機関債)		2.16	100,000	102,267	2016/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	32,819	35,277	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	26,188	28,163	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	33,979	36,637	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	27,045	29,348	2037/11/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		1.8	100,000	103,124	2017/3/17
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	33,693	36,484	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	23,189	24,578	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	24,112	26,089	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	33,025	35,528	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	28,402	30,302	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	24,166	26,126	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	17,570	18,324	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	34,639	37,050	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	72,667	2017/9/20
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	17,044	17,673	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	24,831	26,818	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	30,322	32,544	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	36,536	37,860	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	25,613	27,630	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	37,789	40,676	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	20,521	21,504	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	37,850	39,671	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	40,542	42,526	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	41,354	43,507	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	124,686	130,478	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	22,501	23,728	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	23,671	25,265	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	105,952	2018/9/20
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	29,877	31,544	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	66,990	70,915	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	36,000	38,080	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	58,191	62,006	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	63,751	67,895	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	65,022	69,161	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	34,177	36,474	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	32,392	34,496	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	73,698	76,709	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	34,607	37,297	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	31,839	34,696	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	77,865	82,248	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	78,179	83,439	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	74,823	79,857	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	73,034	78,474	2046/4/10

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48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	147,680	158,442	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	73,895	78,672	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	73,997	78,379	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	31,992	34,726	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	78,221	82,760	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	79,876	83,896	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	80,668	84,586	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	82,694	86,420	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	249,591	261,164	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	83,868	87,747	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	84,153	87,561	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	85,975	88,657	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	86,049	88,151	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	87,646	89,851	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	88,406	91,504	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	90,881	94,518	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	91,754	2031/6/13
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	33,429	2026/6/19
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	185,814	189,844	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	92,875	94,877	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	94,357	96,113	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	190,094	193,221	2049/5/10
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	111,360	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	97,714	98,741	2049/10/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	98,541	97,884	2050/1/10
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	215,914	2027/3/19
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	144,517	2042/9/19
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)	2.04	50,000	57,075	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	1.991	70,000	79,722	2031/6/13
第11回国際協力機構債券(財投機関債)	1.14	30,000	31,622	2021/12/20
第16回国際協力機構債券(財投機関債)	0.3	85,800	86,229	2018/12/26
第18回東日本高速道路	0.387	100,000	100,639	2017/9/20
第22回東日本高速道路	0.401	100,000	100,838	2018/6/20
第28回東日本高速道路	0.248	100,000	100,122	2019/12/20
第21回中日本高速道路	0.592	100,000	101,134	2017/9/20
第42回中日本高速道路	0.942	100,000	103,852	2022/3/18
第46回中日本高速道路	0.351	200,000	201,134	2017/9/20
第20回西日本高速道路	0.759	100,000	102,156	2023/9/20
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	211,502	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	104,586	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	100,225	2018/6/20
第5回東京都住宅供給公社債券	2.02	100,000	104,053	2017/9/20
小 計		23,778,319	25,080,571	
金融債券				
い第733号商工債券	0.55	100,000	100,450	2016/6/27
い第735号商工債券	0.4	100,000	100,322	2016/8/26

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券	%	千円	千円	
い第736号商工債券	0.45	100,000	100,413	2016/9/27
い第745号商工債券	0.35	100,000	100,433	2017/6/27
い第773号商工債券	0.2	100,000	99,818	2019/10/25
い第734号農林債券	0.6	50,000	50,253	2016/7/27
い第740号農林債券	0.5	100,000	100,547	2017/1/27
い第741号農林債券	0.5	100,000	100,573	2017/2/27
い第744号農林債券	0.4	100,000	100,454	2017/5/26
い第749号農林債券	0.3	200,000	200,586	2017/10/27
い第752号農林債券	0.3	150,000	150,465	2018/1/26
い第760号農林債券	0.4	200,000	201,236	2018/9/27
い第761号農林債券	0.3	250,000	250,707	2018/10/26
い第763号農林債券	0.3	340,000	340,843	2018/12/27
い第765号農林債券	0.3	100,000	100,242	2019/2/27
い第769号農林債券	0.3	100,000	100,201	2019/6/27
い第774号農林債券	0.24	100,000	99,837	2019/11/27
第263回信金中金債	0.5	100,000	100,525	2016/10/27
第269回信金中金債	0.4	50,000	50,255	2017/4/27
第270回信金中金債	0.35	50,000	50,217	2017/5/26
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,454	2017/6/27
第286回信金中金債	0.35	100,000	100,586	2018/9/27
第288回信金中金債	0.3	200,000	200,812	2018/11/27
第291回信金中金債	0.25	100,000	100,204	2019/2/27
第8号商工債券（10年）	1.66	100,000	105,247	2018/12/20
第175号商工債券（3年）	0.15	100,000	100,003	2017/8/25
小 計		3,190,000	3,205,684	
普通社債券				
第459回東京電力	2.7	80,000	84,313	2019/1/29
第524回東京電力	1.795	100,000	101,508	2017/3/14
第532回東京電力	1.75	120,000	122,220	2017/9/28
第534回東京電力	2.055	100,000	103,028	2019/10/29
第536回東京電力	1.672	100,000	101,630	2018/1/29
第544回東京電力	1.976	100,000	102,765	2018/6/25
第559回東京電力	1.377	60,000	60,063	2019/10/29
第567回東京電力	1.958	100,000	97,149	2030/7/29
第490回中部電力	1.444	70,000	73,271	2019/7/25
第498回中部電力	0.566	100,000	100,888	2017/9/25
第499回中部電力	1.194	50,000	52,176	2023/6/23
第448回関西電力	2.16	100,000	105,482	2018/6/20
第456回関西電力	2.01	100,000	103,703	2017/7/25
第473回関西電力	1.665	100,000	104,658	2019/4/25
第485回関西電力	1.285	100,000	103,539	2020/12/18
第374回中国電力	0.814	100,000	102,063	2020/2/25
第376回中国電力	0.628	100,000	101,138	2018/6/25
第379回中国電力	0.619	100,000	100,989	2021/1/25
第288回北陸電力	1.89	100,000	104,179	2017/10/25
第303回北陸電力	0.756	100,000	101,710	2019/6/25

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383回東北電力	2.9	100,000	106,945	2017/12/25
第445回東北電力	1.792	100,000	105,218	2018/11/22
第448回東北電力	1.608	100,000	105,129	2019/5/24
第456回東北電力	1.176	100,000	103,863	2020/11/25
第245回四国電力	2.0	100,000	109,362	2021/6/25
第279回四国電力	0.579	100,000	100,994	2018/2/23
第394回九州電力	1.86	100,000	103,773	2017/9/25
第400回九州電力	1.777	100,000	106,365	2020/4/24
第408回九州電力	1.672	100,000	105,199	2019/6/25
第423回九州電力	0.959	100,000	102,310	2019/9/25
第429回九州電力	0.909	100,000	99,463	2024/9/25
第256回北海道電力	3.7	80,000	82,175	2016/2/25
第261回北海道電力	2.775	24,000	25,482	2017/11/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	52,118	2020/12/25
第315回北海道電力	0.82	100,000	101,427	2018/4/25
第19回沖縄電力	1.452	80,000	84,653	2020/4/24
第7回新関西国際空港	0.217	200,000	200,298	2016/12/20
第344回東京交通債券	1.67	100,000	109,292	2023/2/17
第347回東京交通債券	2.05	100,000	113,118	2024/3/8
第25回関西国際空港	1.361	100,000	105,493	2020/6/19
第38回関西国際空港	1.112	50,000	52,476	2021/12/20
第10回成田国際空港	1.094	160,000	167,808	2021/9/17
第11回成田国際空港	1.067	100,000	104,752	2022/2/18
第12回成田国際空港	0.879	100,000	103,351	2022/9/20
第13回成田国際空港	0.802	100,000	102,707	2023/2/8
第3回セブン&アイ・ホールディングス	1.94	100,000	105,540	2018/6/20
第8回旭化成	1.455	100,000	105,530	2019/12/11
第48回住友化学	0.623	100,000	101,208	2018/6/12
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,375	2022/12/2
第18回豊田自動織機	2.109	100,000	107,364	2019/3/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	104,973	2021/9/17
第10回小松製作所	0.275	100,000	100,346	2019/6/20
第1回日本電産	0.386	100,000	100,536	2017/9/20
第12回パナソニック	0.387	100,000	99,857	2020/3/19
第22回三菱重工業	2.03	100,000	104,428	2017/9/12
第29回三菱重工業	0.662	100,000	100,232	2024/9/3
第1回B号日本生命2011基金	1.12	100,000	101,780	2017/8/5
第1回日本生命2012基金	0.87	100,000	101,580	2018/8/3
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,158	2019/8/7
第55回日産自動車	0.415	100,000	100,605	2018/3/20
第57回日産自動車	0.314	100,000	100,229	2019/3/20
第5回凸版印刷	1.397	100,000	105,949	2020/12/16
第3回大日本印刷	1.358	100,000	105,728	2020/12/18
第48回伊藤忠商事	1.9	100,000	104,353	2017/11/20
第59回三井物産	2.11	100,000	107,225	2019/3/20
第69回三菱商事	1.99	100,000	105,488	2018/5/22

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78回三菱商事	1.155	100,000	105,100	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	104,164	2017/7/27
第7回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.5	100,000	108,521	2019/6/3
第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	1.62	100,000	106,950	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	113,366	2026/10/30
第27回みずほコーポレート銀行	0.515	200,000	200,950	2016/10/20
第28回みずほコーポレート銀行	0.515	200,000	201,124	2017/1/25
第29回みずほコーポレート銀行	0.46	100,000	100,532	2017/4/21
第30回みずほコーポレート銀行	0.34	100,000	100,336	2017/7/25
第31回みずほコーポレート銀行	0.33	200,000	200,690	2017/10/25
第32回みずほコーポレート銀行	0.27	100,000	100,213	2018/1/24
第9回三菱東京UFJ銀行	2.69	100,000	111,596	2020/2/27
第12回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	2.16	100,000	104,286	2017/7/28
第28回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	1.56	100,000	106,366	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	2.46	100,000	117,405	2031/1/20
第87回三菱東京UFJ銀行	1.87	100,000	103,330	2017/4/20
第124回三菱東京UFJ銀行	1.51	100,000	106,882	2021/4/16
第126回三菱東京UFJ銀行	0.545	200,000	200,926	2016/7/14
第1回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位）	0.345	100,000	100,401	2017/6/7
第5回三菱UFJ信託銀行（特定社債間限定同順位）	0.285	200,000	200,656	2018/11/28
第6回住友信託銀行（劣後特約付）	2.78	100,000	119,577	2026/4/27
第6回セブン銀行	0.398	100,000	100,519	2017/6/20
第22回三井住友銀行（劣後特約付）	1.43	100,000	105,449	2020/9/28
第23回三井住友銀行（劣後特約付）	1.61	100,000	106,585	2020/12/17
第25回三井住友銀行（劣後特約付）	2.21	100,000	114,182	2026/6/1
第54回三井住友銀行	0.49	100,000	100,405	2016/7/20
第57回三井住友銀行	0.28	200,000	200,614	2017/10/20
第5回みずほ銀行（劣後特約付）	2.49	100,000	116,154	2026/1/30
第6回みずほ銀行（劣後特約付）	2.25	100,000	102,894	2016/11/4
第8回みずほ銀行（劣後特約付）	1.99	100,000	103,321	2017/4/27
第9回みずほ銀行（劣後特約付）	2.52	100,000	117,021	2027/4/27
第28回日産フィナンシャルサービス	0.253	100,000	100,151	2019/6/20
第29回ホンダファイナンス	0.428	100,000	100,359	2021/3/19
第62回トヨタファイナンス	0.203	100,000	99,871	2019/12/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	201,196	2021/6/18
第152回オリックス	0.92	100,000	100,944	2016/8/31
第176回オリックス	0.354	100,000	100,095	2019/2/27
第9回三井住友ファイナンス&リース	0.518	200,000	202,120	2021/1/29
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	110,948	2025/9/24
第39回野村ホールディングス	0.853	100,000	101,585	2018/2/26
第43回野村ホールディングス	0.454	100,000	100,394	2019/2/25
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	104,812	2018/6/20
第87回三菱地所	1.77	100,000	104,135	2017/11/15
第98回三菱地所	1.165	100,000	104,646	2020/6/19
第105回三菱地所	1.178	100,000	105,457	2022/3/23
第112回三菱地所	0.577	100,000	101,682	2020/12/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第114回三菱地所	0.187	100,000	100,156	2018/3/15
第116回三菱地所	0.643	100,000	100,764	2024/9/19
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	104,628	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	99,713	2024/9/20
第54回小田急電鉄	0.956	100,000	102,136	2017/12/15
第25回京王電鉄	1.695	100,000	104,007	2017/11/29
第5回東日本旅客鉄道	3.3	100,000	105,705	2017/2/25
第15回東日本旅客鉄道	2.65	100,000	112,391	2020/8/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	105,714	2022/12/20
第56回東日本旅客鉄道	1.7	100,000	105,466	2018/12/20
第58回東日本旅客鉄道	1.58	100,000	105,258	2019/3/20
第60回東日本旅客鉄道	1.449	100,000	105,128	2019/7/24
第62回東日本旅客鉄道	1.424	100,000	105,173	2019/9/27
第79回東日本旅客鉄道	1.131	100,000	105,002	2021/9/29
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	110,172	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	105,096	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	138,980	2022/3/25
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	111,096	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	114,968	2031/5/26
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	105,312	2021/12/9
第5回日本通運	1.818	100,000	106,440	2019/5/31
第5回関西西高速鉄道	1.238	100,000	105,114	2020/9/10
第52回日本電信電話	1.77	100,000	103,059	2017/3/17
第59回日本電信電話	1.69	100,000	106,093	2019/6/20
第63回日本電信電話	0.69	100,000	101,818	2023/3/20
第19回KDDI	1.151	100,000	104,260	2020/6/19
第21回KDDI	0.669	100,000	100,636	2024/9/20
第15回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1.96	100,000	105,570	2018/6/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	101,936	2023/9/20
第29回電源開発	1.405	100,000	104,613	2019/11/20
第40回電源開発	0.889	100,000	101,301	2024/6/20
第23回東京ガス	1.01	100,000	104,448	2023/6/9
第9回大阪ガス	2.9	100,000	107,510	2018/1/30
第25回エヌ・ティ・ティ・データ	1.47	100,000	105,925	2020/3/19
第14回GEキャピタルコーポレーション	1.84	100,000	100,901	2015/11/20
第23回GEキャピタルコーポレーション	0.45	200,000	200,758	2016/9/20
第8回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.05	100,000	100,670	2016/2/22
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	1.32	100,000	101,873	2017/2/9
第5回パークレイズ・バンク	1.29	100,000	100,364	2015/9/9
第5回ナショナル・オーストラリア銀行	1.01	100,000	100,636	2016/2/4
第8回ナショナル・オーストラリア銀行	1.3	100,000	101,919	2017/1/20
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	99,795	2020/1/16
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	200,000	201,606	2016/6/10
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.07	100,000	100,295	2015/9/3
第8回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	1.0	100,000	101,070	2016/8/12
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行	0.98	200,000	201,164	2016/1/21

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9回	ラボバンク・ネダーランド	1.81	100,000	106,490	2021/1/28
第17回	ラボバンク・ネダーランド	0.563	100,000	100,192	2015/11/2
第22回	ラボバンク・ネダーランド	0.377	100,000	100,246	2016/12/19
第23回	ラボバンク・ネダーランド	0.557	100,000	100,544	2018/12/19
第4回	ウォルマート・ストアーズ・インク	0.94	100,000	100,179	2015/7/28
第2回	エイチエスビーシー・バンク・ビーエルシー	1.01	100,000	100,286	2015/9/10
小	計		17,347,000	17,990,217	
合	計		322,415,359	341,796,080	

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	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 1,172	百万円 -

国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）

スマート・クオリティ・オープン（成長型）（1年決算型）の第1期決算日（2015年8月13日）現在において、入手し得る直近の決算データが存在しないため掲載していません。

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

(2015年3月31日に終了する期間)

(2015年3月31日現在)

(米ドルで表示)

(千米ドル)

営業収益	11,453
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）	44,607
収益合計	56,060
営業費用	(1,283)
営業純損益	54,777
金融費用：	
支払利息	(2)
金融費用合計	(2)
税引前当期純利益	54,775
還付請求不可能な源泉税	(1,721)
税引後当期純利益	53,054
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	215
事業活動による投資主に帰属する純資産の増加	53,269

(注) ()内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2015年3月31日現在)

保有数	投資	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			
Biotechnology			
19,921	CSL Ltd Com NPV	1,402	0.17
Commercial services			
284,448	Transurban Group Misc NPV	2,069	0.25
Telecommunications			
579,950	Telstra Corp Ltd Com NPV	2,791	0.34
Total Australia		6,262	0.76
Bermuda			
Apparel retailers			
117,500	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd Com HKD 0.25	415	0.05
Engineering & construction			
289,000	Cheung Kong Infrastructure Holdings Ltd Com HKD 1.00	2,471	0.30
Insurance			
63,732	Arch Capital Group Ltd Com USD 0.01	3,925	0.48
7,696	Axis Capital Holdings Ltd Com USD 0.0125	397	0.05
21,187	Everest Re Group Ltd Com USD 0.01	3,685	0.45
15,809	PartnerRe Ltd Com USD 1.00	1,807	0.22
21,806	RenaissanceRe Holdings Ltd Com USD 1.00	2,174	0.27
Total Bermuda		14,874	1.82
Canada			
Banks			
31,526	Bank of Montreal Com NPV	1,888	0.23
79,820	Bank of Nova Scotia Com NPV	4,005	0.49
21,015	Canadian Imperial Bank of Commerce Com NPV	1,523	0.19
63,422	National Bank of Canada Com NPV	2,312	0.28
27,943	Royal Bank of Canada Com NPV	1,682	0.21
63,833	Toronto-Dominion Bank Com NPV	2,732	0.33
Insurance			
4,224	Fairfax Financial Holdings Ltd Com NPV	2,358	0.29
62,963	Intact Financial Corp Com NPV	4,724	0.57
Media			
132,360	Shaw Communications Inc Com NPV	2,969	0.36
52,315	Thomson Reuters Corp Com NPV	2,119	0.26
Mining			
80,288	Agnico Eagle Mines Ltd Com NPV	2,231	0.27
64,909	Barrick Gold Corp Com NPV	710	0.09
162,709	Eldorado Gold Corp Com NPV	745	0.09
74,707	Franco-Nevada Corp Com NPV	3,615	0.44

保有数	投資	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Canada (cont)			
Mining (cont)			
337,394	Goldcorp Inc Com NPV	6,103	0.74
192,891	Silver Wheaton Corp Com NPV	3,663	0.45
Pipelines			
149,084	Enbridge Inc Com NPV	7,182	0.87
64,775	TransCanada Corp Com NPV	2,764	0.34
Real estate investment & services			
46,464	First Capital Realty Inc Com NPV	722	0.09
Real estate investment trusts			
53,705	RioCan Real Estate Investment Trust NPV	1,229	0.15
Retail			
59,975	Dollarama Inc Com NPV	3,343	0.41
Telecommunications			
67,191	BCE Inc Com NPV	2,844	0.35
46,272	Rogers Communications Inc Com NPV	1,549	0.19
91,566	Telus Corp Com NPV	3,036	0.37
Total Canada		66,048	8.06
Cayman Islands			
Telecommunications			
1,076,360	HKT Trust & HKT Ltd Misc HKD 0.0005	1,386	0.17
Total Cayman Islands		1,386	0.17
France			
Engineering & construction			
8,785	Aeroports de Paris Com EUR 3.00	1,050	0.13
Software			
28,538	Dassault Systemes Com EUR 0.50	1,933	0.23
Total France		2,983	0.36
Germany			
Health care services			
49,757	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA Com NPV	4,144	0.51
Machinery - diversified			
16,847	MAN SE Com NPV	1,759	0.21
Media			
10,460	Kabel Deutschland Holding AG Com NPV	1,353	0.16
Pharmaceuticals			
23,858	Celesio AG Com NPV	702	0.09
Total Germany		7,958	0.97
Hong Kong			
Banks			
174,500	BOC Hong Kong Holdings Ltd Com NPV	620	0.08
364,600	Hang Seng Bank Ltd Com NPV	6,584	0.80

(2015年3月31日現在)

保有数	投資	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Equities			
Hong Kong (cont)			
Electricity			
741,500	CLP Holdings Ltd Com NPV	6,465	0.79
257,500	Power Assets Holdings Ltd Com NPV	2,622	0.32
Real estate investment trusts			
1,064,500	Link REIT NPV	6,542	0.80
Transportation			
700,500	MTR Corp Ltd Com NPV	3,325	0.40
	Total Hong Kong	26,158	3.19
Ireland			
Airlines			
81,175	Ryanair Holdings Plc Com EUR 0.00635	971	0.12
Computers			
24,732	Accenture Plc Com USD 0.0000225	2,317	0.28
Food			
26,222	Kerry Group Plc Com EUR 0.125	1,758	0.21
Insurance			
9,818	Willis Group Holdings Plc Com USD 0.000115	473	0.06
Pharmaceuticals			
8,889	Perrigo Co Plc Com NPV	1,472	0.18
	Total Ireland	6,991	0.85
Israel			
Banks			
75,491	Bank Hapoalim BM Com ILS 1.00	363	0.05
204,873	Bank Leumi Le-Israel BM Com ILS 0.10	760	0.09
57,779	Mizrahi Tefahot Bank Ltd Com ILS 0.10	587	0.07
Investment services			
1,466	Delek Group Ltd Com ILS 1.00	378	0.04
Pharmaceuticals			
31,255	Teva Pharmaceutical Industries Ltd Com ILS 0.10	1,962	0.24
Telecommunications			
26,308	NICE-Systems Ltd Com ILS 1.00	1,613	0.20
	Total Israel	5,663	0.69
Japan			
Airlines			
582,000	ANA Holdings Inc Com NPV	1,561	0.19
58,300	Japan Airlines Co Ltd Com NPV	1,816	0.22
Banks			
469,000	Aozora Bank Ltd Com NPV	1,666	0.20
Beverages			
68,000	Suntory Beverage & Food Ltd Com NPV	2,920	0.36

保有数	投資	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Japan (cont)			
Commercial services			
32,800	Benesse Holdings Inc Com NPV	1,034	0.13
46,800	Park24 Co Ltd Com NPV	959	0.12
53,100	Secom Co Ltd Com NPV	3,553	0.43
Computers			
23,600	Itochu Techno-Solutions Corp Com NPV	491	0.06
53,000	Nomura Research Institute Ltd Com NPV	1,995	0.24
22,600	Otsuka Corp Com NPV	963	0.12
Cosmetics & personal care			
25,200	Unicharm Corp Com NPV	662	0.08
Entertainment			
93,200	Oriental Land Co Ltd Com NPV	7,067	0.86
11,600	Sankyo Co Ltd Com NPV	414	0.05
49,500	Toho Co Ltd Com NPV	1,212	0.15
Food			
49,000	Ajinomoto Co Inc Com NPV	1,076	0.13
27,300	Calbee Inc Com NPV	1,186	0.15
26,600	Nissin Foods Holdings Co Ltd Com NPV	1,311	0.16
50,000	Yamazaki Baking Co Ltd Com NPV	904	0.11
Gas			
279,000	Osaka Gas Co Ltd Com NPV	1,169	0.14
Health care services			
26,200	Miraca Holdings Inc Com NPV	1,206	0.15
Healthcare products			
66,000	Shimadzu Corp Com NPV	737	0.09
Internet			
59,900	Kakaku.com Inc Com NPV	998	0.12
93,000	M3 Inc Com NPV	1,977	0.24
Office & business equipment			
121,700	Canon Inc Com NPV	4,309	0.53
Oil & gas			
69,800	Showa Shell Sekiyu KK Com NPV	638	0.08
132,000	TonenGeneral Sekiyu KK Com NPV	1,140	0.14
Pharmaceuticals			
122,000	Astellas Pharma Inc Com NPV	2,001	0.25
120,100	Eisai Co Ltd Com NPV	8,546	1.04
114,000	Kyowa Hakko Kirin Co Ltd Com NPV	1,489	0.18
106,700	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp Com NPV	1,834	0.22
125,000	Otsuka Holdings Co Ltd Com NPV	3,918	0.48
175,000	Santen Pharmaceutical Co Ltd Com NPV	2,551	0.31
192,800	Takeda Pharmaceutical Co Ltd Com NPV	9,643	1.18
Real estate investment trusts			
366	Japan Prime Realty Investment Corp Reits NPV	1,262	0.15
446	Japan Real Estate Investment Corp Reits NPV	2,101	0.26

(2015年3月31日現在)

保有数	投資	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Equities			
Japan (cont)			
Real estate investment trusts (cont)			
1,175	Japan Retail Fund Investment Corp Reits NPV	2,337	0.28
464	Nippon Building Fund Inc Reits NPV	2,279	0.28
699	Nippon Prologis REIT Inc NPV	1,541	0.19
1,202	United Urban Investment Corp Reits NPV	1,874	0.23
Restaurants & bars			
34,300	McDonald's Holdings Co Japan Ltd Com NPV	759	0.09
Retail			
12,100	ABC-Mart Inc Com NPV	708	0.09
23,000	FamilyMart Co Ltd Com NPV	965	0.12
32,400	Lawson Inc Com NPV	2,248	0.27
34,300	Nitori Holdings Co Ltd Com NPV	2,328	0.28
11,300	Shimamura Co Ltd Com NPV	1,048	0.13
100,400	USS Co Ltd Com NPV	1,739	0.21
Software			
19,800	Oracle Corp Japan Com NPV	852	0.10
Telecommunications			
5,500	Hikari Tsushin Inc Com NPV	357	0.04
25,700	KDDI Corp Com NPV	583	0.07
47,800	Nippon Telegraph & Telephone Corp Com NPV	2,948	0.36
480,900	NTT DoCoMo Inc Com NPV	8,363	1.02
Transportation			
9,100	East Japan Railway Co Com NPV	732	0.09
115,000	Kamigumi Co Ltd Com NPV	1,088	0.13
166,000	Nagoya Railroad Co Ltd Com NPV	664	0.08
342,000	Tobu Railway Co Ltd Com NPV	1,623	0.20
75,800	West Japan Railway Co Com NPV	3,983	0.49
152,400	Yamato Holdings Co Ltd Com NPV	3,523	0.43
Total Japan		118,851	14.50
Jersey			
Mining			
42,229	Randgold Resources Ltd Com USD 0.05	2,942	0.36
Total Jersey		2,942	0.36
Luxembourg			
Telecommunications			
6,448	Altice SA Com EUR 0.01	697	0.09
Total Luxembourg		697	0.09
New Zealand			
Engineering & construction			
449,122	Auckland International Airport Ltd Com NPV	1,516	0.18
Total New Zealand		1,516	0.18

保有数	投資	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Portugal			
Oil & gas			
47,757	Galp Energia SGPS SA Com EUR 1.00	516	0.06
Total Portugal		516	0.06
Singapore			
Airlines			
257,600	Singapore Airlines Ltd Com NPV	2,242	0.28
Banks			
343,575	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd Com NPV	2,638	0.32
Media			
249,532	Singapore Press Holdings Ltd Com NPV	762	0.09
Telecommunications			
1,963,200	Singapore Telecommunications Ltd Com NPV	6,254	0.76
300,100	StarHub Ltd Com NPV	950	0.12
Total Singapore		12,846	1.57
Switzerland			
Chemicals			
1,182	Givaudan SA Com CHF 10.00	2,144	0.26
4,546	Syngenta AG Com CHF 0.10	1,547	0.19
Commercial services			
2,232	SGS SA Com CHF 1.00	4,274	0.52
Diversified financial services			
8,032	Partners Group Holding AG Com CHF 0.01	2,402	0.29
Food			
1,013	Barry Callebaut AG Com CHF 18.60	992	0.12
91	Chocoladefabriken Lindt & Sprungli AG Com CHF 10.00	489	0.06
47	Chocoladefabriken Lindt & Sprungli AG Com CHF 100.00	2,969	0.36
142,513	Nestle SA Com CHF 0.10	10,762	1.32
Hand & machine tools			
3,244	Schindler Holding AG Com CHF 0.10	540	0.06
9,872	Schindler Holding AG Com CHF 0.10	1,617	0.20
Pharmaceuticals			
96,975	Novartis AG Com CHF 0.50	9,600	1.17
16,502	Roche Holding AG Com NPV	4,555	0.56
Real estate investment & services			
27,242	Swiss Prime Site AG Com CHF 15.30	2,370	0.29
Telecommunications			
10,831	Swisscom AG Com CHF 1.00	6,295	0.77
Transportation			
25,864	Kuehne & Nagel International AG Com CHF 1.00	3,848	0.47
Total Switzerland		54,404	6.64

(2015年3月31日現在)

保有数	投資	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Equities			
United Kingdom			
Commercial services			
41,296	Capita Plc Com GBP 0.020667	684	0.08
Electricity			
50,360	SSE Plc Com GBP 0.50	1,120	0.14
Entertainment			
211,014	Merlin Entertainments Plc Com GBP 0.01	1,385	0.17
Gas distribution			
225,946	National Grid Plc Com GBP 0.1139535	2,900	0.36
Media			
224,235	Sky Plc Com GBP 0.50	3,305	0.40
Mining			
105,215	Fresnillo Plc Com USD 0.50	1,066	0.13
Nondurable household products			
35,587	Reckitt Benckiser Group Plc Com GBP 0.10	3,064	0.38
Oil & gas			
42,299	Royal Dutch Shell Plc Class 'B' Com EUR 0.07	1,318	0.16
39,158	Royal Dutch Shell Plc Com EUR 0.07	1,167	0.14
Pharmaceuticals			
234,843	GlaxoSmithKline Plc Com GBP 0.25	5,388	0.66
Restaurants & bars			
265,533	Compass Group Plc Com GBP 0.10625	4,616	0.56
Telecommunications			
204,314	Inmarsat Plc Com EUR 0.0005	2,807	0.34
Total United Kingdom		28,820	3.52
United States			
Apparel retailers			
22,013	VF Corp Com NPV	1,658	0.20
Banks			
23,139	US Bancorp Com USD 0.01	1,011	0.12
Beverages			
129,058	Coca-Cola Co Com USD 0.25	5,233	0.64
92,179	PepsiCo Inc Com USD 0.017	8,815	1.07
Chemicals			
61,936	Ecolab Inc Com USD 1.00	7,085	0.86
9,691	Sherwin-Williams Co Com USD 1.00	2,757	0.34
Commercial services			
139,640	Automatic Data Processing Inc Com USD 0.10	11,956	1.46
45,802	Verisk Analytics Inc Com USD 0.001	3,270	0.40
Computers			
21,810	International Business Machines Corp Com USD 0.20	3,500	0.43
71,581	Synopsys Inc Com USD 0.01	3,315	0.40

保有数	投資	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
United States (cont)			
Cosmetics & personal care			
71,716	Colgate-Palmolive Co Com USD 1.00	4,972	0.61
119,359	Procter & Gamble Co Com NPV	9,783	1.19
Distribution & wholesale			
10,081	Genuine Parts Co Com USD 1.00	940	0.11
Diversified financial services			
45,585	Visa Inc Com USD 0.0001	2,985	0.36
Electricity			
135,995	Consolidated Edison Inc Com USD 0.10	8,294	1.01
87,733	Dominion Resources Inc Com NPV	6,217	0.76
77,262	Duke Energy Corp Com USD 0.001	5,928	0.72
24,558	NextEra Energy Inc Com USD 0.01	2,555	0.31
100,253	PG&E Corp Com NPV	5,320	0.65
7,809	Scana Corp Com NPV	429	0.05
236,504	Southern Co Com USD 5.00	10,470	1.28
69,246	Wisconsin Energy Corp Com USD 0.01	3,428	0.42
117,183	Xcel Energy Inc Com USD 2.50	4,077	0.50
Engineering & construction			
44,504	SBA Communications Corp Com USD 0.01	5,211	0.64
Environmental control			
43,892	Republic Services Inc Com USD 0.01	1,780	0.22
40,478	Stericycle Inc Com USD 0.01	5,683	0.69
116,793	Waste Management Inc Com USD 0.01	6,334	0.77
Food			
193,223	General Mills Inc Com USD 0.10	10,936	1.34
32,566	Hershey Co Com USD 1.00	3,287	0.40
53,729	Hormel Foods Corp Com USD 0.0586	3,053	0.37
16,430	JM Smucker Co Com NPV	1,900	0.23
102,831	Kellogg Co Com USD 0.25	6,783	0.83
54,198	McCormick & Co Inc Com NPV	4,180	0.51
11,523	Mondelez International Inc Com NPV	416	0.05
23,746	Sysco Corp Com USD 1.00	896	0.11
Gas			
3,822	Sempra Energy Com NPV	417	0.05
Health care services			
32,387	DaVita HealthCare Partners Inc Com USD 0.001	2,632	0.32
38,856	Laboratory Corp of America Holdings Com USD 0.10	4,897	0.60
32,436	UnitedHealth Group Inc Com USD 0.01	3,839	0.47
Healthcare products			
11,262	Baxter International Inc Com USD 1.00	771	0.10
34,391	Becton Dickinson and Co Com USD 1.00	4,938	0.60
23,304	CR Bard Inc Com USD 0.25	3,898	0.48
40,085	Henry Schein Inc Com USD 0.01	5,597	0.68
39,252	Patterson Cos Inc Com USD 0.01	1,915	0.23
22,788	Varian Medical Systems Inc Com USD 1.00	2,144	0.26

(2015年3月31日現在)

保有数	投資	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Equities			
United States (cont)			
Household goods & home construction			
70,330	Kimberly-Clark Corp Com USD 1.25	7,534	0.92
Insurance			
6,261	Alleghany Corp Com USD 1.00	3,046	0.37
48,915	Berkshire Hathaway Inc Com USD 0.0033	7,077	0.86
64,614	Chubb Corp Com USD 1.00	6,533	0.80
51,283	Marsh & McLennan Cos Inc Com USD 1.00	2,876	0.35
37,759	Travelers Cos Inc Com NPV	4,083	0.50
50,116	WR Berkley Corp Com USD 0.20	2,530	0.31
Internet			
6,154	Facebook Inc Com USD 0.000006	506	0.06
1,538	Google Inc Com USD 0.001	853	0.11
Mining			
238,162	Newmont Mining Corp Com USD 1.60	5,170	0.63
Nondurable household products			
63,968	Church & Dwight Co Inc Com USD 1.00	5,465	0.67
21,178	Clorox Co Com USD 1.00	2,338	0.28
Oil & gas			
102,984	Exxon Mobil Corp Com NPV	8,748	1.07
13,038	Range Resources Corp Com USD 0.01	678	0.08
Pharmaceuticals			
162,455	Abbott Laboratories Com NPV	7,528	0.92
90,134	AmerisourceBergen Corp Com USD 0.01	10,245	1.25
75,967	Bristol-Myers Squibb Co Com USD 0.10	4,900	0.60
7,688	Cardinal Health Inc Com NPV	694	0.09
85,133	Eli Lilly & Co Com NPV	6,185	0.75
30,573	Express Scripts Holding Co Com USD 0.01	2,653	0.32
108,208	Johnson & Johnson Com USD 1.00	10,885	1.33
13,902	McKesson Corp Com USD 0.01	3,145	0.38
129,256	Merck & Co Inc Com USD 0.50	7,431	0.91
32,341	Omnicare Inc Com USD 1.00	2,492	0.30
109,495	Pfizer Inc Com USD 0.05	3,810	0.47
Pipelines			
27,519	Spectra Energy Corp Com USD 0.001	995	0.12
Real estate investment trusts			
42,858	American Tower Corp Reits USD 0.01	4,038	0.49
14,639	AvalonBay Communities Inc Reits USD 0.01	2,551	0.31
6,090	Camden Property Trust Reits USD 0.01	476	0.06
43,295	Crown Castle International Corp Reits USD 0.01	3,575	0.44
31,056	Federal Realty Investment Trust Reits USD 0.01	4,573	0.56
80,299	Health Care REIT Inc USD 1.00	6,214	0.76

保有数	投資	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
United States (cont)			
Real estate investment trusts (cont)			
19,869	Public Storage Reits USD 0.10	3,918	0.48
18,476	Ventas Inc Reits USD 0.25	1,349	0.16
Restaurants & bars			
121,754	McDonald's Corp Com USD 0.01	11,869	1.45
37,082	Starbucks Corp Com USD 0.001	3,511	0.43
5,016	Yum! Brands Inc Com NPV	395	0.05
Retail			
10,907	AutoZone Inc Com USD 0.01	7,442	0.91
2,311	Chipotle Mexican Grill Inc Com USD 0.01	1,504	0.18
27,212	Dollar General Corp Com USD 0.875	2,051	0.25
21,279	Dollar Tree Inc Com USD 0.01	1,727	0.21
41,453	Family Dollar Stores Inc Com USD 0.10	3,285	0.40
13,074	O'Reilly Automotive Inc Com USD 0.01	2,827	0.35
9,581	Ross Stores Inc Com USD 0.01	1,009	0.12
80,787	Target Corp Com USD 0.0833	6,628	0.81
44,952	TJX Cos Inc Com USD 1.00	3,149	0.39
105,681	Wal-Mart Stores Inc Com USD 0.10	8,692	1.06
Savings & loans			
147,075	People's United Financial Inc Com USD 0.01	2,234	0.27
Semiconductors			
34,477	Intel Corp Com USD 0.001	1,078	0.13
94,660	Qualcomm Inc Com USD 0.0001	6,563	0.80
Software			
17,199	Fidelity National Information Services Inc Com USD 0.01	1,171	0.14
56,550	Intuit Inc Com USD 0.01	5,483	0.67
65,931	Microsoft Corp Com USD 0.00000625	2,680	0.33
151,571	Paychex Inc Com USD 0.01	7,519	0.92
Tobacco			
87,354	Altria Group Inc Com USD 0.333	4,369	0.53
8,761	Reynolds American Inc Com USD 0.0001	604	0.08
Telecommunications			
228,432	AT&T Inc Com USD 1.00	7,461	0.91
54,569	Motorola Solutions Inc Com USD 0.01	3,635	0.44
231,872	Verizon Communications Inc Com USD 0.10	11,276	1.38
Transportation			
15,953	JB Hunt Transport Services Inc Com USD 0.01	1,362	0.17
7,455	Union Pacific Corp Com USD 2.50	807	0.10
43,588	United Parcel Service Inc Com USD 0.01	4,224	0.51
Water			
27,230	American Water Works Co Inc Com USD 0.01	1,476	0.18
Total United States		456,830	55.72
Total equities		815,545	99.51

(2015年3月31日現在)

契約数	エクスポージャー	原資産 千米ドル	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Financial derivative instruments				
Futures contracts				
25	MSCI Singapore ETS Index Futures April 2015	1,379	6	0.00
16	S&P 500 E Mini Index Futures June 2015	1,652	(4)	0.00
Total unrealised gains on futures contracts			6	0.00
Total unrealised losses on futures contracts			(4)	0.00
Net unrealised gains on futures contracts			2	0.00
Total financial derivative instruments			2	0.00

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.

Analysis of total current assets gross of all liabilities	Fair value \$'000	% of total current assets
Transferable securities admitted to an official stock exchange listing or traded on a regulated market	815,545	98.68
Exchange traded financial derivative instruments	6	0.00
Other assets	10,909	1.32
Total current assets	826,460	100.00

	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Total value of investments	815,547	99.51
Cash[†]	1,678	0.20
Other net assets	2,047	0.25
Net assets attributable to redeemable participating shareholders	819,272	99.96
Adjustment to align to the valuation methodology as set out in the prospectus	302	0.04
Net asset value attributable to redeemable participating shareholders at the end of the year	819,574	100.00

[†] Cash holdings of \$1,570,583 are held with State Street Bank and Trust Company. \$107,087 is held as security for futures contracts with Barclays Plc.

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

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8期（2014年5月13日～2015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 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	10,075
受取利息	10,075
(B) 有価証券売買損益	1,501,358,001
売買益	1,592,326,539
売買損	△ 90,968,538
(C) 信託報酬等	△ 31,813,847
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,469,554,229
(E) 前期繰越損益金	1,543,087,879
(F) 追加信託差損益金	2,383,701,505
(配当等相当額)	(3,018,089,038)
(売買損益相当額)	(△ 634,387,533)
(G) 計(D+E+F)	5,396,343,613
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	5,396,343,613
追加信託差損益金	2,383,701,505
(配当等相当額)	(3,030,611,247)
(売買損益相当額)	(△ 646,909,742)
分標準備積立金	3,012,642,108

- (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

(2015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 6,862,135	千口 9,333,697	千円 19,562,497

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				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	0.25	3,000	2,998	360,238	2016/5/15
		0.375	1,000	1,000	120,267	2016/4/30
		0.375	1,500	1,498	179,992	2016/10/31
		0.5	4,000	4,007	481,538	2016/6/15
		0.5	2,300	2,303	276,722	2016/7/31
		0.5	1,300	1,301	156,347	2016/8/31
		0.5	2,300	2,301	276,550	2016/9/30
		0.5	500	500	60,079	2016/11/30
		0.5	2,800	2,785	334,659	2017/7/31
		0.625	4,000	4,011	482,008	2016/7/15
		0.625	3,000	3,008	361,421	2016/8/15
		0.625	3,000	3,007	361,308	2016/10/15
		0.625	2,500	2,504	300,973	2016/11/15
		0.625	3,100	3,105	373,090	2016/12/15
		0.625	3,500	3,503	420,968	2017/2/15
		0.625	3,400	3,397	408,206	2017/5/31
		0.625	3,200	3,188	383,128	2017/8/31
		0.625	600	596	71,647	2017/11/30
		0.75	3,400	3,411	409,866	2017/1/15
		0.75	3,000	3,009	361,534	2017/3/15
		0.75	2,700	2,702	324,709	2017/6/30
		0.75	2,700	2,693	323,682	2017/10/31
		0.75	3,100	3,088	371,082	2017/12/31
		0.75	2,000	1,988	238,910	2018/2/28
		0.75	500	496	59,664	2018/3/31
		0.75	1,300	1,290	155,102	2018/4/15
		0.875	2,300	2,313	277,975	2016/9/15
		0.875	3,000	3,017	362,519	2016/11/30
		0.875	3,200	3,218	386,747	2016/12/31
		0.875	3,700	3,719	446,951	2017/1/31
		0.875	3,600	3,619	434,888	2017/2/28
		0.875	3,500	3,517	422,611	2017/4/15
		0.875	3,800	3,818	458,763	2017/4/30
		0.875	2,800	2,812	337,931	2017/5/15
		0.875	3,300	3,313	398,090	2017/6/15
		0.875	1,800	1,806	217,004	2017/7/15
		0.875	3,400	3,408	409,547	2017/8/15
		0.875	2,300	2,300	276,463	2017/11/15
		0.875	1,200	1,198	144,027	2018/1/15
		0.875	2,300	2,297	275,988	2018/1/31
		1.0	3,500	3,525	423,646	2016/8/31
		1.0	4,200	4,231	508,473	2016/9/30
		1.0	2,500	2,519	302,686	2016/10/31
		1.0	3,600	3,627	435,800	2017/3/31

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 T-NOTE 170915	1.0	5,000	5,024	603,636	2017/9/15
		1 T-NOTE 171215	1.0	3,300	3,309	397,656	2017/12/15
		1 T-NOTE 180215	1.0	1,000	1,001	120,342	2018/2/15
		1 T-NOTE 180315	1.0	1,000	1,000	120,248	2018/3/15
		1 T-NOTE 180531	1.0	3,200	3,195	383,969	2018/5/31
		1 T-NOTE 190630	1.0	3,600	3,540	425,443	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	1.0	1,000	980	117,850	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,762	211,792	2019/9/30
		1 T-NOTE 191130	1.0	2,200	2,148	258,114	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,583	190,287	2019/5/31
		1.125 T-NOTE 191231	1.125	2,600	2,550	306,435	2019/12/31
		1.125 T-NOTE 200331	1.125	2,000	1,955	234,949	2020/3/31
		1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,500	2,443	293,569	2020/4/30
		1.25 T-NOTE 181031	1.25	1,900	1,903	228,659	2018/10/31
		1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,501	300,539	2018/11/30
		1.25 T-NOTE 180131	1.25	700	698	83,967	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	3,100	3,066	368,420	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,900	1,872	224,985	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,800	1,771	212,882	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,600	1,614	194,012	2018/6/30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	3,300	3,328	399,871	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	3,800	3,826	459,744	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,400	1,407	169,064	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,000	2,008	241,276	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	2,100	2,104	252,847	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	2,300	2,280	273,991	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,400	2,377	285,656	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	1,500	1,484	178,380	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,500	2,470	296,831	2020/5/31
		1.5 T-NOTE 160630	1.5	3,900	3,950	474,625	2016/6/30
		1.5 T-NOTE 160731	1.5	4,300	4,358	523,668	2016/7/31
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	4,800	4,855	583,343	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	3,300	3,328	399,871	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	3,600	3,627	435,817	2019/1/31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	3,000	3,020	362,928	2019/2/28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,006	120,886	2019/3/31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,400	2,410	289,576	2019/5/31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	200	199	24,016	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,896	348,067	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	3,900	3,781	454,307	2022/1/31
		1.625 T-NOTE 190331	1.625	3,100	3,134	376,567	2019/3/31
		1.625 T-NOTE 190430	1.625	4,000	4,040	485,443	2019/4/30
1.625 T-NOTE 190630	1.625	5,300	5,345	642,267	2019/6/30		
1.625 T-NOTE 190731	1.625	800	805	96,825	2019/7/31		
1.625 T-NOTE 190831	1.625	5,000	5,034	604,880	2019/8/31		

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	1.625 T-NOTE 191231	1.625	500	501	60,281	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,653	198,622	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,000	2,910	349,664	2022/11/15
		1.75 T-NOTE 160531	1.75	2,700	2,740	329,296	2016/5/31
		1.75 T-NOTE 181031	1.75	500	509	61,215	2018/10/31
		1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,800	2,830	340,125	2019/9/30
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,300	3,304	396,990	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,700	2,658	319,412	2022/2/28
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,800	1,771	212,789	2022/5/15
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,700	4,570	549,087	2023/5/15
		1.875 T-NOTE 170831	1.875	3,400	3,485	418,834	2017/8/31
		1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,742	209,369	2017/9/30
		1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,563	307,989	2017/10/31
		1.875 T-NOTE 200630	1.875	2,100	2,124	255,311	2020/6/30
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,400	2,387	286,906	2021/11/30
		2 T-NOTE 160430	2.0	2,100	2,134	256,484	2016/4/30
		2 T-NOTE 200731	2.0	1,000	1,017	122,224	2020/7/31
		2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,624	195,168	2020/9/30
		2 T-NOTE 201130	2.0	1,200	1,215	146,072	2020/11/30
		2 T-NOTE 210228	2.0	2,000	2,020	242,796	2021/2/28
		2 T-NOTE 210531	2.0	2,300	2,317	278,428	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	4,100	4,119	495,001	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	3,700	3,712	446,013	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	2,900	2,910	349,714	2021/11/15
		2 T-NOTE 220215	2.0	1,000	1,002	120,403	2022/2/15
		2 T-NOTE 230215	2.0	4,500	4,472	537,422	2023/2/15
		2 T-NOTE 250215	2.0	6,400	6,248	750,757	2025/2/15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,800	2,862	343,936	2020/8/31
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	3,400	3,460	415,786	2021/1/31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,100	2,129	255,843	2021/6/30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	5,100	5,164	620,544	2021/8/15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,529	303,871	2021/9/30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,500	2,524	303,331	2021/12/31
		2.25 T-NOTE 171130	2.25	2,600	2,690	323,262	2017/11/30
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	2,400	2,456	295,118	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,400	1,432	172,060	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	4,000	4,083	490,587	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	5,000	4,994	600,092	2024/11/15
		2.375 T-NOTE 170731	2.375	3,200	3,316	398,462	2017/7/31
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,100	1,144	137,467	2018/5/31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,039	124,946	2018/6/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	1,100	1,135	136,460	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	6,000	6,067	729,066	2024/8/15	
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,500	3,134	376,566	2045/2/15	
	2.5 T-NOTE 170630	2.5	2,400	2,491	299,387	2017/6/30	

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	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	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,100	3,187	383,027	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	6,500	6,650	799,035	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 160430	2.625	1,300	1,329	159,727	2016/4/30
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,500	1,568	188,468	2018/1/31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	900	942	113,271	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,300	2,410	289,600	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	5,700	5,963	716,556	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	3,300	3,125	375,555	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	4,300	4,069	488,996	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 161130	2.75	1,300	1,345	161,643	2016/11/30
		2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,500	1,562	187,793	2017/5/31
		2.75 T-NOTE 171231	2.75	2,200	2,305	277,061	2017/12/31
		2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,500	1,574	189,201	2018/2/28
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	3,200	3,371	405,070	2019/2/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,000	4,185	502,940	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	4,100	4,282	514,590	2024/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	4,000	3,879	466,144	2043/5/15
		2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,400	1,475	177,270	2018/3/31
		3 T-BOND 420515	3.0	1,500	1,493	179,450	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	3,500	3,482	418,389	2044/11/15
		3 T-NOTE 160831	3.0	3,000	3,100	372,572	2016/8/31
		3 T-NOTE 160930	3.0	3,000	3,106	373,248	2016/9/30
		3 T-NOTE 170228	3.0	2,400	2,503	300,851	2017/2/28
		3.125 T-BOND 411115	3.125	800	818	98,316	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	500	510	61,332	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	4,400	4,480	538,283	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	2,800	2,853	342,885	2044/8/15
		3.125 T-NOTE 161031	3.125	2,800	2,907	349,390	2016/10/31
		3.125 T-NOTE 170131	3.125	3,100	3,235	388,803	2017/1/31
		3.125 T-NOTE 170430	3.125	2,100	2,202	264,585	2017/4/30
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	3,400	3,632	436,403	2019/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,800	3,002	360,705	2021/5/15
		3.25 T-NOTE 160531	3.25	2,100	2,164	260,101	2016/5/31
		3.25 T-NOTE 160630	3.25	2,400	2,478	297,833	2016/6/30
		3.25 T-NOTE 160731	3.25	2,800	2,897	348,168	2016/7/31
		3.25 T-NOTE 161231	3.25	2,800	2,923	351,309	2016/12/31
		3.25 T-NOTE 170331	3.25	1,400	1,469	176,515	2017/3/31
		3.375 T-BOND 440515	3.375	2,900	3,098	372,253	2044/5/15
		3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,300	3,567	428,679	2019/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	800	872	104,860	2039/2/15
3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,600	1,711	205,689	2018/2/15		
3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,500	1,636	196,586	2020/5/15		
3.625 T-BOND 430815	3.625	4,600	5,135	617,026	2043/8/15		
3.625 T-BOND 440215	3.625	2,600	2,905	349,047	2044/2/15		
3.625 T-NOTE 190815	3.625	2,600	2,834	340,529	2019/8/15		

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	3.625 T-NOTE 200215	3.625	4,400	4,816	578,717	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,300	2,530	304,044	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	300	342	41,111	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	2,200	2,511	301,769	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	3,000	3,262	391,961	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,600	1,851	222,502	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,100	1,193	143,430	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	1,900	2,078	249,758	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	800	976	117,349	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,700	2,084	250,451	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,500	1,627	195,593	2017/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	600	746	89,712	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,300	1,617	194,334	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,800	2,245	269,746	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,200	1,505	180,833	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,300	1,649	198,221	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	800	1,011	121,569	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,200	1,518	182,455	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,100	1,184	142,294	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	2,000	2,580	310,043	2040/2/15
	4.625 T-NOTE 161115	4.625	1,600	1,699	204,217	2016/11/15
	4.625 T-NOTE 170215	4.625	900	964	115,894	2017/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,700	2,245	269,847	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 170815	4.75	2,400	2,616	314,368	2017/8/15
	4.875 T-NOTE 160815	4.875	2,100	2,218	266,527	2016/8/15
	5 T-BOND 370515	5.0	700	947	113,830	2037/5/15
	5.125 T-NOTE 160515	5.125	1,700	1,782	214,148	2016/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	800	1,048	126,014	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	600	787	94,612	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,200	1,623	195,014	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	801	96,335	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	900	1,216	146,210	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	600	838	100,706	2027/11/15
6.25 T-BOND 230815	6.25	1,700	2,237	268,802	2023/8/15	
6.25 T-BOND 300515	6.25	700	1,016	122,149	2030/5/15	
6.5 T-BOND 261115	6.5	400	566	68,049	2026/11/15	
7.25 T-BOND 160515	7.25	1,700	1,819	218,560	2016/5/15	
7.5 T-BOND 161115	7.5	1,100	1,216	146,140	2016/11/15	
8 T-BOND 211115	8.0	1,200	1,647	197,988	2021/11/15	
8.125 T-BOND 190815	8.125	600	767	92,173	2019/8/15	
8.75 T-BOND 170515	8.75	1,300	1,510	181,485	2017/5/15	
8.75 T-BOND 200815	8.75	700	951	114,356	2020/8/15	
8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,283	154,158	2019/2/15	
小計				66,032,792		

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	1 CAN GOVT 160501	1.0	800	802	79,620	2016/5/1
	1 CAN GOVT 160801	1.0	1,900	1,907	189,314	2016/8/1
	1 CAN GOVT 161101	1.0	500	502	49,860	2016/11/1
	1.25 CAN GOVT 170801	1.25	900	910	90,405	2017/8/1
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	700	710	70,476	2018/2/1
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	812	80,665	2018/3/1
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	800	814	80,800	2018/9/1
	1.5 CAN GOVT 170201	1.5	400	405	40,252	2017/2/1
	1.5 CAN GOVT 170301	1.5	1,200	1,217	120,872	2017/3/1
	1.5 CAN GOVT 170901	1.5	1,100	1,120	111,234	2017/9/1
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	600	611	60,693	2020/3/1
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,400	1,388	137,841	2023/6/1
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	929	92,301	2019/3/1
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	900	929	92,230	2019/9/1
	2 CAN GOVT 160601	2.0	800	810	80,474	2016/6/1
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,100	1,145	113,744	2025/6/1
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,100	1,173	116,522	2024/6/1
	2.75 CAN GOVT 160901	2.75	1,000	1,026	101,910	2016/9/1
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,000	1,086	107,800	2022/6/1
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	100	108	10,746	2048/12/1
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	400	444	44,147	2064/12/1
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,000	1,116	110,818	2021/6/1
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,200	1,339	132,943	2020/6/1
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,700	2,109	209,425	2045/12/1
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,800	2,003	198,882	2019/6/1
	4 CAN GOVT 160601	4.0	1,800	1,861	184,819	2016/6/1
	4 CAN GOVT 170601	4.0	1,150	1,227	121,864	2017/6/1
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,400	1,833	181,967	2041/6/1
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,100	1,216	120,770	2018/6/1
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,200	1,748	173,542	2037/6/1
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,000	1,444	143,369	2029/6/1
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,100	1,672	166,019	2033/6/1
	8 CAN GOVT 270601	8.0	400	659	65,489	2027/6/1
小 計					3,681,828	
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	18,700	24,160	189,173	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	5,300	7,330	57,398	2036/11/20
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	18,100	18,090	141,650	2018/6/14
	5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	7,800	7,927	62,068	2017/6/15
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	6,000	5,932	46,455	2019/12/11
	6.25 MEXICAN BONO 160616	6.25	11,000	11,309	88,551	2016/6/16
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	10,600	11,078	86,746	2021/6/10
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	9,700	10,109	79,155	2022/6/9
	7.25 MEXICAN BONO 161215	7.25	12,100	12,727	99,658	2016/12/15
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,600	8,400	65,774	2027/6/3

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		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	13,100	14,133	110,661	2017/12/14	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	12,000	13,457	105,373	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	4,600	5,170	40,488	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	10,500	11,851	92,797	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	8,500	9,496	74,357	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	7,200	8,183	64,079	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	13,900	15,514	121,479	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	8,400	10,021	78,467	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	9,200	11,135	87,188	2038/11/18	
小 計					1,691,524		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	1,100	1,095	146,550	2020/4/17
		0 SCHAT 160916	—	1,400	1,404	187,914	2016/9/16
		0 SCHAT 161216	—	1,000	1,003	134,291	2016/12/16
		0 SCHAT 170310	—	200	200	26,866	2017/3/10
		0.25 OBL 180413	0.25	1,500	1,517	202,982	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	700	706	94,575	2019/10/11
		0.25 SCHAT 160610	0.25	1,300	1,306	174,831	2016/6/10
		0.5 BUND 250215	0.5	1,300	1,286	172,118	2025/2/15
		0.5 OBL 170407	0.5	1,700	1,723	230,524	2017/4/7
		0.5 OBL 171013	0.5	1,400	1,423	190,405	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,500	1,527	204,307	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,600	1,633	218,484	2019/4/12
		0.75 OBL 170224	0.75	1,300	1,322	176,944	2017/2/24
		1 BUND 240815	1.0	1,500	1,558	208,521	2024/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,244	166,512	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,455	194,704	2019/2/22
		1.25 OBL 161014	1.25	1,700	1,736	232,264	2016/10/14
		1.5 BUND 220904	1.5	1,400	1,516	202,936	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,600	1,735	232,152	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,800	1,953	261,412	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,500	1,627	217,743	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,700	1,872	250,460	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,800	1,993	266,686	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,500	1,671	223,673	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,700	1,915	256,271	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,400	1,558	208,555	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,400	1,578	211,178	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,700	1,924	257,533	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,600	2,112	282,585	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	800	1,062	142,127	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,900	2,183	292,127	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	2,100	2,413	322,835	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	2,000	2,372	317,443	2021/7/4
3.25 BUND 420704	3.25	1,100	1,626	217,567	2042/7/4		

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	3.5 BUND 190704	3.5	2,800	3,206	429,024	2019/7/4
		3.75 BUND 170104	3.75	1,800	1,918	256,656	2017/1/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,900	2,164	289,534	2019/1/4
		4 BUND 160704	4.0	2,100	2,201	294,571	2016/7/4
		4 BUND 180104	4.0	1,800	1,998	267,384	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	2,200	3,416	457,077	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	2,000	2,191	293,133	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,800	2,047	273,935	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,200	1,977	264,607	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	900	1,343	179,701	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,700	2,788	373,052	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,300	2,309	309,016	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,500	2,492	333,468	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,100	1,742	233,152	2028/1/4
		6 BUND 160620	6.0	140	149	20,016	2016/6/20
		6.25 BUND 240104	6.25	1,100	1,641	219,554	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	900	1,567	209,707	2030/1/4
6.5 BUND 270704	6.5	1,100	1,836	245,661	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	911	121,886	2018/1/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	200	202	27,155	2019/12/1
		1.15 ITALY GOVT 170515	1.15	1,500	1,529	204,678	2017/5/15
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	700	700	93,756	2022/4/15
		1.5 ITALY GOVT 161215	1.5	1,300	1,328	177,762	2016/12/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,035	138,559	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	400	390	52,236	2025/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	700	639	85,608	2032/3/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,372	183,675	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 160515	2.25	1,200	1,226	164,088	2016/5/15
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,900	2,041	273,189	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,700	1,802	241,112	2024/12/1
		2.75 ITALY GOVT 161115	2.75	900	935	125,185	2016/11/15
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	700	766	102,540	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,700	1,835	245,627	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,500	1,642	219,760	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,700	1,882	251,813	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,614	215,982	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 160801	3.75	2,400	2,508	335,545	2016/8/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,100	2,418	323,622	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,700	1,958	261,991	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,800	3,232	432,508	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,450	327,907	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 170201	4.0	2,200	2,346	313,940	2017/2/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,900	2,202	294,695	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,400	2,917	390,276	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,616	349,997	2019/2/1

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,900	3,343	447,276	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	2,200	2,560	342,550	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	2,200	2,449	327,671	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,100	2,375	317,820	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,200	2,529	338,400	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,400	2,816	376,870	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,100	1,341	179,413	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,100	2,572	344,202	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	2,000	2,498	334,274	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 160915	4.75	1,500	1,593	213,227	2016/9/15
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	1,200	1,308	175,013	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,300	1,421	190,154	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,500	3,037	406,370	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,300	2,851	381,492	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,500	1,936	259,144	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,400	1,949	260,814	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,700	2,108	282,063	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,800	2,312	309,408	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,000	2,743	367,093	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,700	2,377	318,067	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,600	2,244	300,310	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	2,500	2,778	371,785	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,600	3,548	474,768	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,800	2,304	308,312	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,000	2,562	342,823	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,150	1,693	226,572	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,700	4,016	537,334	2031/5/1
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,400	3,550	475,061	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	800	1,229	164,481	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,400	2,209	295,643	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	100	100	13,403	2018/2/25
		0 O. A. T 200525	—	1,000	989	132,324	2020/5/25
		0.25 O. A. T 161125	0.25	1,500	1,509	201,959	2016/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,900	1,929	258,141	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,200	1,153	154,390	2025/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	2,200	2,255	301,696	2017/7/25
		1 O. A. T 180525	1.0	2,000	2,063	276,022	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	2,000	2,068	276,771	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	2,000	2,073	277,426	2019/5/25
		1.75 BTAN 170225	1.75	2,500	2,585	345,897	2017/2/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	2,500	2,718	363,641	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	2,600	2,817	376,917	2024/11/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	2,200	2,473	330,909	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	2,600	2,933	392,535	2024/5/25
		2.5 BTAN 160725	2.5	2,400	2,476	331,387	2016/7/25

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	2.5 O. A. T 201025	2.5	2,800	3,140	420,146	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,800	2,113	282,700	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	3,100	3,695	494,380	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	3,000	3,517	470,666	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	3,500	4,135	553,278	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,300	1,775	237,566	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	3,500	4,069	544,428	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	2,600	3,286	439,757	2026/4/25
		3.75 O. A. T 170425	3.75	3,200	3,444	460,794	2017/4/25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	3,200	3,714	496,949	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	3,400	4,086	546,772	2021/4/25
		4 O. A. T 180425	4.0	2,600	2,911	389,561	2018/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	1,950	2,894	387,278	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	1,250	2,029	271,543	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	1,000	1,653	221,201	2060/4/25
		4.25 O. A. T 171025	4.25	3,100	3,431	459,106	2017/10/25
		4.25 O. A. T 181025	4.25	2,200	2,521	337,370	2018/10/25
		4.25 O. A. T 190425	4.25	2,600	3,028	405,215	2019/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	3,100	4,008	536,311	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	2,200	3,563	476,709	2041/4/25
4.75 O. A. T 350425	4.75	2,000	3,155	422,107	2035/4/25		
5 O. A. T 161025	5.0	2,500	2,687	359,610	2016/10/25		
5.5 O. A. T 290425	5.5	2,400	3,740	500,379	2029/4/25		
5.75 O. A. T 321025	5.75	2,550	4,318	577,710	2032/10/25		
6 O. A. T 251025	6.0	1,900	2,870	384,034	2025/10/25		
8.5 O. A. T 191025	8.5	1,000	1,371	183,466	2019/10/25		
8.5 O. A. T 230425	8.5	1,000	1,614	215,990	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	100	100	13,409	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	600	603	80,695	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	700	663	88,726	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 170415	0.5	1,000	1,012	135,502	2017/4/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,400	1,450	194,086	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,400	1,463	195,744	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,400	1,529	204,697	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,300	1,451	194,250	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,800	2,028	271,442	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	1,200	1,254	167,796	2017/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	900	1,103	147,696	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	500	681	91,197	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,500	1,769	236,788	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,300	1,521	203,546	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	900	1,119	149,815	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,350	2,124	284,281	2042/1/15
		4 NETH GOVT 160715	4.0	1,300	1,364	182,527	2016/7/15
4 NETH GOVT 180715	4.0	1,600	1,805	241,496	2018/7/15		

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	4 NETH GOVT 190715	4.0	1,400	1,628	217,930	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,200	1,851	247,709	2037/1/15
		4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,700	1,872	250,460	2017/7/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,100	1,702	227,810	2028/1/15
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	700	705	94,355	2017/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,600	1,653	221,160	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,600	1,578	211,195	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	500	479	64,169	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	2,000	2,077	278,002	2017/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	2,000	2,177	291,367	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,200	2,395	320,489	2024/10/31
		3.25 SPAIN GOVT 160430	3.25	1,500	1,546	206,916	2016/4/30
		3.3 SPAIN GOVT 160730	3.3	1,600	1,663	222,540	2016/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,600	1,786	239,055	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	1,900	2,021	270,457	2017/1/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,800	2,117	283,303	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,100	2,431	325,266	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,700	1,905	254,906	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,500	1,877	251,237	2037/1/31
		4.25 SPAIN GOVT 161031	4.25	2,000	2,123	284,062	2016/10/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	2,000	2,323	310,901	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,700	2,080	278,287	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,800	2,008	268,661	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,800	2,103	281,460	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,400	1,773	237,269	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,100	1,493	199,870	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,200	1,509	201,985	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,600	1,939	259,466	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,150	1,598	213,809	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	800	1,073	143,636	2028/10/31
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	800	1,177	157,529	2044/10/31		
5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,600	2,061	275,767	2023/1/31		
5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	2,000	2,236	299,234	2017/7/30		
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	2,100	2,645	353,910	2021/4/30		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,600	2,359	315,733	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,000	2,598	347,653	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,100	1,540	206,124	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,200	3,182	425,774	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	800	792	106,052	2025/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	1,000	1,039	139,128	2018/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,200	1,352	180,905	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,400	1,622	217,087	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,000	1,125	150,594	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	800	1,014	135,770	2034/6/22
		3.25 BEL GOVT 160928	3.25	1,150	1,204	161,120	2016/9/28

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	3.5 BEL GOVT 170628	3.5	1,100	1,185	158,596	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,600	1,902	254,511	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	600	895	119,768	2045/6/22
		4 BEL GOVT 170328	4.0	1,000	1,078	144,292	2017/3/28
		4 BEL GOVT 180328	4.0	1,000	1,117	149,557	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	1,200	1,382	184,999	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,200	1,489	199,296	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	700	984	131,657	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,300	1,619	216,626	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,300	1,651	220,922	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,300	2,044	273,491	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	800	1,093	146,291	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,650	2,666	356,770	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 170928	5.5	800	907	121,427	2017/9/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,500	2,290	306,456	2028/3/28
オーストリア	国債証券	1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	400	433	57,933	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,300	1,419	189,876	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	1,300	1,399	187,180	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	400	481	64,395	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	650	929	124,331	2044/6/20
		3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	800	847	113,400	2017/2/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	800	969	129,754	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,200	1,437	192,336	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	732	97,934	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	100	176	23,640	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,100	1,309	175,138	2020/7/15
		4 AUSTRIA GOVT 160915	4.0	1,100	1,161	155,425	2016/9/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,350	2,098	280,723	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	500	551	73,805	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,300	1,514	202,607	2019/3/15
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	1,200	1,352	180,921	2018/1/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	700	989	132,444	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	600	967	129,477	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	300	302	40,474	2020/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	250	237	31,748	2031/4/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	207	27,780	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	300	321	42,996	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	700	756	101,229	2022/9/15
		1.875 FINNISH GOV 170415	1.875	500	519	69,554	2017/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	300	334	44,728	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	462	61,815	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	400	486	65,142	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	578	77,377	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	600	712	95,385	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	600	656	87,851	2017/9/15

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	4 FINNISH GOVT 250704	4.0	500	658	88,094	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	600	706	94,506	2019/7/4
アイルランド	国債証券	2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	448	59,946	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	500	553	74,049	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	700	835	111,774	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	500	610	81,611	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	600	702	94,045	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	850	976	130,626	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,100	1,315	176,014	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	700	867	115,998	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,000	1,377	184,268	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	600	680	91,022	2017/10/18
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	700	870	116,462	2019/10/18		
小 計						64,181,677	
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	2,500	2,514	470,432	2017/9/7	
	1.25 GILT 180722	1.25	2,800	2,820	527,512	2018/7/22	
	1.75 GILT 170122	1.75	1,500	1,529	286,173	2017/1/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,140	400,328	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,200	2,200	411,676	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	1,700	1,744	326,285	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	200	198	37,213	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	2,100	2,162	404,512	2023/9/7	
	2.75 GILT 240907	2.75	2,100	2,240	419,145	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	2,200	2,506	468,878	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,300	1,551	290,232	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	1,400	1,813	339,257	2068/7/22	
	3.75 GILT 190907	3.75	1,500	1,657	310,009	2019/9/7	
	3.75 GILT 200907	3.75	1,700	1,900	355,558	2020/9/7	
	3.75 GILT 210907	3.75	2,000	2,261	422,961	2021/9/7	
	3.75 GILT 520722	3.75	1,100	1,424	266,456	2052/7/22	
	4 GILT 160907	4.0	2,000	2,092	391,404	2016/9/7	
	4 GILT 220307	4.0	1,200	1,383	258,771	2022/3/7	
	4 GILT 600122	4.0	1,250	1,760	329,307	2060/1/22	
	4.25 GILT 271207	4.25	1,200	1,477	276,392	2027/12/7	
	4.25 GILT 320607	4.25	1,800	2,275	425,565	2032/6/7	
	4.25 GILT 360307	4.25	1,735	2,235	418,116	2036/3/7	
	4.25 GILT 390907	4.25	1,100	1,447	270,716	2039/9/7	
	4.25 GILT 401207	4.25	1,600	2,118	396,237	2040/12/7	
	4.25 GILT 461207	4.25	1,600	2,196	410,933	2046/12/7	
	4.25 GILT 491207	4.25	1,300	1,821	340,777	2049/12/7	
	4.25 GILT 551207	4.25	1,250	1,815	339,677	2055/12/7	
4.5 GILT 190307	4.5	1,600	1,800	336,887	2019/3/7		
4.5 GILT 340907	4.5	1,900	2,501	467,849	2034/9/7		
4.5 GILT 421207	4.5	1,650	2,296	429,593	2042/12/7		

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		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	4.75 GILT 200307	4.75	1,800	2,084	389,891	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,600	2,115	395,684	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,500	2,103	393,555	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	1,800	2,007	375,580	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	1,600	2,034	380,554	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	900	1,307	244,492	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	1,200	1,648	308,390	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	450	534	99,892	2017/8/25
小 計						13,416,909	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	350	397	50,999	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	400	454	58,310	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	600	660	84,801	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	470	537	68,991	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	360	473	60,788	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	550	813	104,471	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	400	442	56,765	2017/6/5
小 計						485,129	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,500	5,873	84,807	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	5,700	6,635	95,812	2025/5/12
		3 SWD GOVT 160712	3.0	4,600	4,778	68,998	2016/7/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,600	7,953	114,854	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,900	5,476	79,086	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	5,800	6,318	91,236	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	7,400	8,600	124,197	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	7,300	9,183	132,605	2020/12/1
小 計						791,599	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,800	1,802	28,577	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,400	4,542	71,996	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,900	4,326	68,580	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	6,000	6,821	108,123	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	5,600	5,972	94,658	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,300	6,013	95,312	2019/5/22
小 計						467,247	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	5,800	6,265	112,271	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	3,900	4,288	76,841	2025/11/15
		2.5 DMK GOVT 161115	2.5	4,700	4,905	87,900	2016/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	8,000	9,379	168,075	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	4,600	5,090	91,223	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	8,700	10,261	183,888	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	10,800	18,020	322,934	2039/11/15

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	
デンマーク		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
	国債証券 7 DMK GOVT 241110	7.0	2,200	3,504	62,794	2024/11/10
小	計				1,105,930	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券 1.5 POLAND 200425	1.5	1,600	1,537	50,405	2020/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	2,400	2,434	79,808	2018/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	1,400	1,457	47,771	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,900	1,976	64,801	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	1,300	1,367	44,810	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	2,400	2,638	86,495	2023/10/25
	4.75 POLAND 161025	4.75	2,200	2,295	75,249	2016/10/25
	4.75 POLAND 170425	4.75	1,900	2,009	65,856	2017/4/25
	5.25 POLAND 171025	5.25	1,900	2,055	67,386	2017/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	1,500	1,721	56,439	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,800	2,048	67,140	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,400	1,671	54,781	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	2,000	2,421	79,380	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	800	1,053	34,545	2029/4/25
	POLAND 160725	—	1,200	1,176	38,566	2016/7/25
	POLAND 170725	—	200	192	6,303	2017/7/25
小	計				919,744	
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 2.75 AUST GOVT 191021	2.75	500	510	48,435	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,900	1,894	179,582	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	400	365	34,606	2035/6/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	900	933	88,458	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,400	1,447	137,183	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	800	812	77,007	2029/4/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	700	739	70,095	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,700	1,779	168,661	2017/7/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,400	1,573	149,160	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,800	1,985	188,226	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	900	1,051	99,628	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 160615	4.75	2,000	2,059	195,178	2016/6/15
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,300	1,530	145,087	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	2,300	2,560	242,713	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,800	1,959	185,781	2018/1/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,000	2,400	227,564	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,800	2,129	201,864	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,500	1,807	171,325	2022/7/15
	6 AUST GOVT 170215	6.0	1,700	1,815	172,103	2017/2/15
小	計				2,782,667	
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 SINGAPOREGOVT 180401	0.5	200	195	17,534	2018/4/1
	2.25 SINGAPOREGOVT 210601	2.25	500	505	45,331	2021/6/1
	2.375 SINGAPOREGOVT 170401	2.375	500	511	45,900	2017/4/1

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	
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	2.5	800	829	74,381	2019/6/1
		2.75	350	361	32,391	2023/7/1
		2.75	450	436	39,142	2042/4/1
		2.875	100	102	9,213	2029/7/1
		2.875	250	254	22,788	2030/9/1
		3.0	550	577	51,837	2024/9/1
		3.125	420	445	39,981	2022/9/1
		3.25	450	479	43,058	2020/9/1
		3.375	200	215	19,325	2033/9/1
		3.5	520	572	51,343	2027/3/1
		3.75	650	672	60,341	2016/9/1
		4.0	300	325	29,211	2018/9/1
小	計				581,784	
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	3.172	500	499	16,564	2016/7/15
		3.26	900	894	29,656	2018/3/1
		3.314	1,000	999	33,114	2017/10/31
		3.394	600	600	19,907	2017/3/15
		3.418	900	873	28,964	2022/8/15
		3.48	1,100	1,066	35,343	2023/3/15
		3.492	1,000	991	32,845	2020/3/31
		3.502	500	471	15,618	2027/5/31
		3.58	800	801	26,569	2018/9/28
		3.654	100	100	3,316	2019/10/31
		3.659	400	401	13,301	2020/10/15
		3.733	600	575	19,070	2028/6/15
		3.814	100	100	3,342	2017/2/15
		3.844	100	95	3,170	2033/4/15
		3.889	600	605	20,049	2020/7/31
		3.892	500	490	16,253	2027/3/15
		3.955	100	100	3,331	2025/9/15
		4.012	1,800	1,825	60,505	2017/9/15
		4.048	1,000	1,013	33,574	2021/9/30
		4.127	1,400	1,379	45,709	2032/4/15
		4.16	1,200	1,224	40,582	2021/7/15
		4.181	900	914	30,303	2024/7/15
		4.24	1,200	1,223	40,555	2018/2/7
		4.262	2,500	2,533	83,962	2016/9/15
		4.378	2,200	2,266	75,115	2019/11/29
		4.392	1,000	1,030	34,155	2026/4/15
		4.498	500	522	17,322	2030/4/15
		4.935	500	526	17,451	2043/9/30
		5.248	200	222	7,357	2028/9/15
		5.734	1,000	1,082	35,863	2019/7/30
小	計				842,880	

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		千円		
			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	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	13,000	15,329	152,378	2026/12/21	
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	7,400	5,684	56,499	2036/3/31	
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	7,100	5,495	54,626	2041/2/28	
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	7,300	6,988	69,465	2021/3/31	
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	7,900	6,839	67,983	2031/2/28	
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	6,800	6,724	66,838	2020/1/15	
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,100	5,064	50,338	2023/2/28	
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	5,600	5,720	56,859	2018/12/21	
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	4,800	4,593	45,663	2030/1/31	
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	5,200	5,330	52,989	2017/9/15	
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	3,200	3,095	30,771	2032/3/31	
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	4,700	4,596	45,686	2037/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	2,200	2,191	21,781	2044/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	7,300	7,284	72,411	2048/2/28	
小 計					844,293		
合 計					157,826,009		

(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）

スマート・クオリティ・オープン（成長型）（1年決算型）の第1期決算日（2015年8月13日）現在において、入手し得る直近の決算データが存在しないため掲載していません。

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

(2014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	\$ 62,833,263
受取利息－関連会社	322
有価証券貸付収益－関連会社	473,774
	<u>63,307,359</u>
差引：その他の外国税	(150,578)
投資収益合計	<u>63,156,781</u>
費用	
投資顧問報酬	15,031,499
モーリシャス所得税	25,329
コミットメント・フィー	1,304
支払利息	2,799
費用合計	<u>15,060,931</u>
差引：投資顧問報酬放棄額	(9,452,759)
費用純額	<u>5,608,172</u>
投資純利益	<u>57,548,609</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	(108,755,712)
現物償還－関連会社以外	30,119,837
外国通貨取引	(1,401,815)
実現純損益	<u>(80,037,690)</u>
未実現評価損益の純変動	
投資	311,471,749
外貨建て資産および負債の換算	134,328
未実現評価損益の純変動	<u>311,606,077</u>
実現および未実現損益（純額）	<u>231,568,387</u>
営業活動による純資産の増減（純額）	<u>\$ 289,116,996</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

(2014年8月31日現在)

銘柄	数量	価額	銘柄	数量	価額
COMMON STOCKS — 96.24%			China CITIC Bank Corp. Ltd.		
BRAZIL — 5.44%			Class H	3,663,000	\$ 2,311,190
AMBEV SA	1,698,300	\$ 12,371,697	China Communications Services Corp. Ltd. Class H	11,538,000	5,567,908
CCR SA	1,032,300	9,347,008	China Construction Bank Corp. Class H	19,314,000	14,354,385
Cielo SA	1,069,240	20,051,087	China Gas Holdings Ltd. ^a	6,780,000	12,072,541
EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	1,631,700	10,428,062	China Life Insurance Co. Ltd. Class H	1,340,000	3,847,022
Estacio Participacoes SA	133,200	1,769,809	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2,345,000	10,877,564
Kroton Educacional SA	99,900	2,993,584	China Minsheng Banking Corp. Ltd. Class H	999,100	938,491
Natura Cosmeticos SA	268,200	4,915,592	China Mobile Ltd.	2,679,000	33,322,658
Souza Cruz SA	899,100	8,422,219	China Pacific Insurance (Group) Co. Ltd. Class H	666,000	2,500,674
Totvs SA	569,700	10,403,317	China Petroleum & Chemical Corp. Class H	12,450,000	12,626,465
Tractebel Energia SA	1,065,600	17,863,581	China Resources Enterprise Ltd. ^a	670,000	1,802,481
Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	569,500	5,940,484	China Resources Gas Group Ltd.	7,326,000	21,315,884
Ultrapar Participacoes SA	333,400	8,595,940	China Resources Power Holdings Co. Ltd.	3,350,000	10,136,255
		113,102,380	China Telecom Corp. Ltd. Class H	6,704,000	4,143,424
CHILE — 4.22%			China Vanke Co. Ltd. ^{a,b}	1,005,576	1,883,959
AES Gener SA	5,367,294	2,743,909	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	3,330,000	2,784,256
Agua Andinas SA Series A	20,852,127	13,076,829	ENN Energy Holdings Ltd.	332,000	2,345,374
Banco de Chile	197,750,718	24,132,008	Guangdong Investment Ltd.	10,656,000	12,883,198
Banco de Credito e Inversiones	130,536	7,114,367	Haier Electronics Group Co. Ltd.	1,052,000	3,040,561
Colbun SA	45,019,602	11,782,438	Hanergy Solar Group Ltd. ^{a,b}	28,638,000	4,692,846
Compania Cervecerias Unidas SA	163,503	1,756,150	Hengan International Group Co. Ltd.	1,676,000	17,873,383
CorpBanca SA	559,842,264	6,879,225	Huaneng Power International Inc. Class H	666,000	800,903
Empresa Nacional de Electricidad SA	7,725,933	11,803,668	Industrial and Commercial Bank of China Ltd. Class H	17,316,000	11,484,196
Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA	154,569	1,773,153	Inner Mongolia Yitai Coal Co. Ltd. Class B	3,896,127	6,580,559
S.A.C.I. Falabella SA	242,091	1,823,133	Jiangsu Expressway Co. Ltd. Class H	10,724,000	12,218,205
Vina Concha y Toro SA	2,479,851	4,836,422	Kunlun Energy Co. Ltd. ^a	3,404,000	5,621,982
		87,721,302	Lenovo Group Ltd.	12,216,000	18,662,534
CHINA — 20.49%					
AAC Technologies Holdings Inc. ^a	1,014,000	6,613,769			
Agricultural Bank of China Ltd. Class H	13,986,000	6,460,505			
Bank of China Ltd. Class H	38,295,000	17,788,302			
Bank of Communications Co. Ltd. Class H	2,345,000	1,712,573			
Beijing Enterprises Holdings Ltd.	1,831,500	15,786,043			
China BlueChemical Ltd. Class H	2,022,000	996,631			

(2014年8月31日現在)

銘柄	数量	価額	銘柄	数量	価額
PetroChina Co. Ltd. Class H	3,336,000	\$ 4,734,876	INDIA — 2.41%		
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. Class H	1,340,000	1,357,264	Cipla Ltd.	1,559,772	\$ 13,217,448
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd. Class H	6,393,600	13,116,938	Dabur India Ltd.	2,872,791	11,012,050
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	2,997,000	9,338,858	Divi's Laboratories Ltd.	181,152	4,671,351
Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd.	9,657,000	6,466,950	Dr. Reddy's Laboratories Ltd.	119,214	5,791,545
Sino Biopharmaceutical Ltd.	10,704,000	9,861,301	Hindustan Unilever Ltd.	101,898	1,246,773
Sinopec Engineering Group Co. Ltd.	1,665,000	1,899,137	Sun Pharmaceuticals Industries Ltd.	920,412	12,972,682
Sinopharm Group Co. Ltd. Class H	399,600	1,394,706	Tata Consultancy Services Ltd.	27,639	1,148,900
SOHO China Ltd.	15,151,500	12,394,665			50,060,749
Sun Art Retail Group Ltd. ^a	17,149,500	20,468,362	INDONESIA — 4.31%		
Tencent Holdings Ltd.	999,000	16,305,943	PT Astra Agro Lestari Tbk	1,712,300	3,732,733
Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	5,548,000	15,569,892	PT Bank Central Asia Tbk	26,540,100	25,411,337
Tsingtao Brewery Co. Ltd. Class H	1,020,000	7,745,269	PT Bank Danamon Indonesia Tbk	14,418,900	4,622,430
Uni-President China Holdings Ltd. ^a	3,330,000	3,007,684	PT Bank Mandiri (Persero) Tbk	7,758,900	6,881,692
Want Want China Holdings Ltd.	1,665,000	2,064,560	PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk	7,559,100	3,457,250
Zhejiang Expressway Co. Ltd. Class H	12,734,000	12,668,031	PT Indocement Tunggal Prakarsa Tbk	569,100	1,179,797
ZTE Corp. Class H ^a	799,200	1,800,485	PT Indofood Sukses Makmur Tbk	4,861,800	2,857,437
		426,241,642	PT Jasa Marga (Persero) Tbk	19,613,700	10,395,806
COLOMBIA — 1.11%			PT Kalbe Farma Tbk	17,882,100	2,537,661
Almacenes Exito SA	180,486	3,072,623	PT Perusahaan Gas Negara (Persero) Tbk	4,229,100	2,096,925
Corporacion Financiera Colombiana SA NVS	195,138	4,160,204	PT Telekomunikasi Indonesia (Persero) Tbk	57,076,200	13,003,469
Ecopetrol SA	6,221,772	10,783,389	PT Unilever Indonesia Tbk	5,094,900	13,513,082
Grupo Argos SA	412,254	5,110,063			89,689,619
		23,126,279	MALAYSIA — 8.53%		
CZECH REPUBLIC — 0.51%			Astro Malaysia Holdings Bhd	971,500	1,010,952
O2 Czech Republic AS	757,908	10,647,756	Axiata Group Bhd	2,763,900	6,076,722
		10,647,756	Berjaya Sports Toto Bhd	3,463,297	4,131,344
EGYPT — 0.72%			Hong Leong Bank Bhd	3,796,200	17,343,046
Commercial International Bank (Egypt) SAE	2,037,866	13,170,508	IHH Healthcare Bhd	15,817,500	24,489,023
Telecom Egypt Co.	849,842	1,712,746	Malayan Banking Bhd	9,324,000	29,877,030
		14,883,254	Maxis Bhd	9,856,800	20,482,881
			Petronas Chemicals Group Bhd	3,363,300	6,722,332
			Petronas Dagangan Bhd	1,964,700	12,528,702
			Petronas Gas Bhd	1,665,000	12,043,782
			Public Bank Bhd	5,128,280	31,368,413
			Sime Darby Bhd	2,412,600	7,240,861
			Tenaga Nasional Bhd	1,065,600	4,185,320
					177,500,408

(2014年8月31日現在)

銘柄	数量	価額	銘柄	数量	価額
MEXICO — 1.73%			RUSSIA — 0.83%		
Arca Continental SAB de CV	268,000	\$ 1,970,109	LUKOIL OAO	205,128	\$ 11,418,936
Coca-Cola FEMSA SAB de CV Series L	266,400	2,904,311	Rosneft Oil Co. OJSC	965,700	5,957,429
El Puerto de Liverpool SAB de CV Series C1	1,565,100	17,846,844			17,376,365
Fibra Uno Administracion SAB de CV	632,700	2,271,826	SOUTH AFRICA — 6.99%		
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV Series B	699,300	4,854,534	Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	313,353	9,005,429
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV Series B	233,100	2,988,023	Bidvest Group Ltd.	186,147	4,923,827
Wal-Mart de Mexico SAB de CV Series V	1,132,200	3,082,584	Discovery Ltd.	495,171	4,569,742
		35,918,231	Foschini Group Ltd. (The)	175,491	1,899,555
PERU — 1.25%			Growthpoint Properties Ltd.	961,631	2,278,532
Compania de Minas Buenaventura SA SP ADR	180,819	2,632,724	Liberty Holdings Ltd.	344,988	4,235,716
Credicorp Ltd.	150,183	23,288,878	Life Healthcare Group Holdings Ltd.	4,128,867	17,384,458
		25,921,602	Mediclinic International Ltd.	133,533	1,161,135
PHILIPPINES — 4.51%			Mr. Price Group Ltd.	151,848	2,922,625
Aboitiz Power Corp.	3,962,700	3,408,286	MTN Group Ltd.	57,609	1,305,647
Bank of the Philippine Islands	6,360,304	13,858,460	Nedbank Group Ltd.	386,613	8,313,594
BDO Unibank Inc.	1,072,260	2,225,677	Pick n Pay Stores Ltd. ^a	870,462	4,624,283
International Container Terminal Services Inc.	2,920,410	7,562,254	PPC Ltd.	1,791,540	5,577,401
Jollibee Foods Corp.	1,641,700	6,777,661	Redefine Properties Ltd.	7,291,019	6,553,787
Metropolitan Bank & Trust Co.	2,685,390	5,293,791	Remgro Ltd.	624,708	14,302,837
Philippine Long Distance Telephone Co.	692,639	54,807,444	Sasol Ltd.	101,232	5,885,037
		93,933,573	Shoprite Holdings Ltd.	618,714	8,577,898
POLAND — 0.22%			SPAR Group Ltd. (The)	399,267	4,894,262
Bank Zachodni WBK SA	40,293	4,669,040	Standard Bank Group Ltd.	1,678,986	21,785,741
		4,669,040	Tiger Brands Ltd.	120,546	3,479,664
QATAR — 1.48%			Truworths International Ltd.	568,431	3,976,462
Commercial Bank of Qatar QSC (The)	139,527	2,609,521	Vodacom Group Ltd.	645,687	7,792,272
Ooredoo QSC	92,907	2,916,421			145,449,904
Qatar Electricity & Water Co. QSC	263,070	12,354,435	SOUTH KOREA — 11.44%		
Qatar Islamic Bank SAQ	295,704	9,664,060	AmorePacific Corp.	12,321	25,639,637
Qatar National Bank SAQ	58,941	3,269,824	AmorePacific Group	5,328	5,559,469
		30,814,261	CJ CheilJedang Corp.	11,988	4,469,120
			Dongbu Insurance Co. Ltd.	236,763	14,290,543
			E-Mart Co. Ltd.	13,611	3,275,392
			Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd.	458,541	14,087,038
			Hyundai Wia Corp.	11,514	2,532,296
			Kangwon Land Inc.	360,639	12,822,167
			Korea Electric Power Corp.	101,565	4,227,075
			KT Corp.	376,623	13,000,449
			KT&G Corp.	342,324	32,039,595
			LG Household & Health Care Ltd.	2,997	1,516,309

(2014年8月31日現在)

銘柄	数量	価額	銘柄	数量	価額
Lotte Shopping Co. Ltd.	8,658	\$ 2,834,909	ScinoPharm Taiwan Ltd.	2,197,814	\$ 4,485,260
NAVER Corp.	2,942	2,228,370	Standard Foods Corp.	737,400	1,894,659
ORION Corp.	7,992	6,881,026	Synnex Technology International Corp.	4,662,000	7,112,199
S1 Corp.	150,516	10,984,944	Taiwan Cement Corp.	4,662,000	7,408,541
Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd.	14,985	811,358	Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd.	38,808,769	21,682,690
Samsung Electronics Co. Ltd.	6,724	8,183,260	Taiwan Mobile Co. Ltd.	7,372,000	23,504,177
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	46,287	12,667,925	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	7,326,000	30,391,730
Samsung Life Insurance Co. Ltd.	103,563	10,877,715	Transcend Information Inc.	1,665,000	5,598,183
Samsung SDI Co. Ltd.	67,599	10,100,349	U-Ming Marine Transport Corp.	4,357,000	7,171,657
SK C&C Co. Ltd.	40,293	8,444,462	United Microelectronics Corp.	3,996,000	1,824,841
SK Telecom Co. Ltd.	67,599	18,200,628			337,014,514
Yuhan Corp.	72,576	12,382,906	THAILAND — 2.30%		
		238,056,942	Advanced Information Service PCL NVDR	934,100	6,112,301
TAIWAN — 16.20%			Bangkok Bank PCL NVDR	1,528,000	9,807,138
Advanced Semiconductor Engineering Inc.	1,341,000	1,671,175	Bangkok Dusit Medical Services PCL NVDR	11,306,500	6,902,841
Advantech Co. Ltd.	2,680,000	25,149,797	CP All PCL NVDR	5,825,500	8,663,471
Asia Cement Corp.	9,482,125	13,006,377	Kasikornbank PCL NVDR	752,300	5,299,546
ASUSTeK Computer Inc.	842,000	8,817,049	PTT Exploration & Production PCL NVDR	764,800	3,938,936
Chicony Electronics Co. Ltd.	2,676,960	8,776,771	PTT PCL NVDR	709,000	7,125,517
China Airlines Ltd. ^b	17,316,828	5,793,422			47,849,750
China Steel Corp.	16,775,517	14,479,796	UNITED ARAB EMIRATES — 1.55%		
Chunghwa Telecom Co. Ltd.	8,991,000	27,944,126	DP World Ltd.	503,496	9,455,655
Compal Electronics Inc.	1,332,000	1,185,367	First Gulf Bank PJSC	934,731	4,644,326
Delta Electronics Inc.	670,000	4,707,181	National Bank of Abu Dhabi PJSC	4,775,112	18,200,560
EVA Airways Corp. ^b	2,664,000	1,336,880			32,300,541
Far EasTone Telecommunications Co. Ltd.	9,417,000	20,068,681	TOTAL COMMON STOCKS		
First Financial Holding Co. Ltd.	12,321,119	7,625,858	(Cost: \$1,844,307,910)		2,002,278,112
Formosa Chemicals & Fibre Corp.	333,300	829,612	PREFERRED STOCKS — 3.23%		
Formosa Petrochemical Corp.	2,997,000	7,570,081	BRAZIL — 0.44%		
Formosa Plastics Corp.	2,823,840	7,321,644	AES Tiete SA	775,100	6,969,682
Formosa Taffeta Co. Ltd.	4,692,000	4,983,891	Companhia Energetica de Minas Gerais	99,985	856,165
Foxconn Technology Co. Ltd.	3,146,850	7,895,945	Companhia Paranaense de Energia Class B	68,800	1,219,463
Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd.	22,289,474	13,832,814			9,045,310
Kinsus Interconnect Technology Corp.	1,998,000	8,455,764			
Lite-On Technology Corp.	11,322,511	18,769,523			
MediaTek Inc.	333,000	5,564,761			
President Chain Store Corp.	1,340,000	10,154,062			

(2014年8月31日現在)

銘柄	数量	価額
COLOMBIA — 1.91%		
Banco Davivienda SA	810,855 \$	13,482,903
Grupo Argos SA	444,555	5,422,391
Grupo de Inversiones Suramericana SA	920,079	20,910,341
		<u>39,815,635</u>
RUSSIA — 0.38%		
AK Transneft OAO	2,026	4,457,099
Surgutneftegas OJSC	4,662,000	3,431,040
		<u>7,888,139</u>
SOUTH KOREA — 0.50%		
Samsung Electronics Co. Ltd.	10,323	10,384,595
		<u>10,384,595</u>
TOTAL PREFERRED STOCKS		
(Cost: \$59,018,294)		67,133,679
SHORT-TERM INVESTMENTS — 2.14%		
MONEY MARKET FUNDS — 2.14%		
BlackRock Cash Funds: Institutional, SL Agency Shares		
0.14% ^{c,d,e}	41,908,947	41,908,947
BlackRock Cash Funds: Prime, SL Agency Shares		
0.11% ^{c,d,e}	2,638,283	2,638,283
		<u>44,547,230</u>
TOTAL SHORT-TERM INVESTMENTS		
(Cost: \$44,547,230)		<u>44,547,230</u>
TOTAL INVESTMENTS		
IN SECURITIES — 101.61%		
(Cost: \$1,947,873,434)		2,113,959,021
Other Assets, Less Liabilities — (1.61)%		<u>(33,595,711)</u>
NET ASSETS — 100.00%		<u>\$2,080,363,310</u>

NVDR — Non-Voting Depository Receipts

NVS — Non-Voting Shares

SP ADR — Sponsored American Depository Receipts

^a All or a portion of this security represents a security on loan. See Note 1.^b Non-income earning security.^c Affiliated issuer. See Note 2.^d The rate quoted is the annualized seven-day yield of the fund at period end.^e 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

(2014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	\$ 207,921,557
受取利息－関連会社	2,447
投資収益合計	<u>207,924,004</u>
費用	
投資顧問報酬	25,278,958
費用合計	<u>25,278,958</u>
差引：投資顧問報酬放棄額	(606,818)
費用純額	<u>24,672,140</u>
投資純利益	<u>183,251,864</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	(63,912,761)
現物償還－関連会社以外	<u>43,953,176</u>
外国通貨取引	—
実現純損益	<u>(19,959,585)</u>
未実現評価損益の純変動	
投資	130,812,937
外貨建て資産および負債の換算	—
未実現評価損益の純変動	<u>130,812,937</u>
実現および実現損益（純額）	<u>110,853,352</u>
営業活動による純資産の増減（純額）	<u>\$ 294,105,216</u>

(注) ()内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2014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 — 18.76%			CAYMAN ISLANDS — 0.20%		
AUSTRALIA — 0.25%			Amber Circle Funding Ltd.		
CNOOC Curtis Funding No. 1 Pty Ltd.			3.25%, 12/04/22 ^b	\$10,800	\$ 10,459,109
4.50%, 10/03/23 ^b	\$12,000	\$ 12,657,479			10,459,109
		12,657,479	CHILE — 1.07%		
AZERBAIJAN — 0.24%			Corporacion Nacional del Cobre de Chile		
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic			3.00%, 07/17/22 ^b	18,428	17,792,197
4.75%, 03/13/23 ^b	12,200	12,139,000	3.75%, 11/04/20 ^b	17,661	18,068,916
		12,139,000	3.88%, 11/03/21 ^b	18,492	19,099,148
BRAZIL — 0.46%					54,960,261
Caixa Economica Federal			CHINA — 0.31%		
2.38%, 11/06/17 ^b	7,950	7,781,062	Export-Import Bank of China (The)		
4.25%, 05/13/19 ^b	7,400	7,462,900	3.63%, 07/31/24 ^b	15,800	15,890,013
4.50%, 10/03/18 ^b	8,400	8,600,760			15,890,013
		23,844,722	INDONESIA — 1.21%		
BRITISH VIRGIN ISLANDS — 3.24%			Pertamina Persero PT		
Sinochem Overseas Capital Co. Ltd.			6.45%, 05/30/44 ^d	7,500	7,987,500
4.50%, 11/12/20 ^b	17,697	18,872,258	6.45%, 05/30/44 ^b	1,000	1,065,000
Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd.			Pertamina Persero PT		
2.75%, 05/17/17 ^b	10,248	10,477,899	4.30%, 05/20/23 ^b	10,090	9,837,750
3.90%, 05/17/22 ^b	19,792	20,156,828	4.88%, 05/03/22 ^b	7,096	7,237,920
4.88%, 05/17/42 ^b	11,744	12,440,889	5.25%, 05/23/21 ^b	5,000	5,250,000
Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd.			5.63%, 05/20/43 ^b	12,720	12,169,478
4.38%, 10/17/23 ^b	22,100	23,065,387	6.00%, 05/03/42 ^b	8,838	8,860,758
Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.			Perusahaan Listrik Negara PT		
1.01%, 04/10/17 ^{b,c}	14,080	14,100,219	5.25%, 10/24/42 ^b	7,660	6,903,575
1.75%, 04/10/17 ^b	29,500	29,462,240	5.50%, 11/22/21 ^b	3,000	3,180,000
State Grid Overseas Investment 2013 Ltd.					62,491,981
3.13%, 05/22/23 ^b	34,025	32,880,372	IRELAND — 0.75%		
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.			Russian Railways OJSC via RZD Capital PLC		
2.75%, 05/07/19 ^b	5,000	5,040,960	5.74%, 04/03/17 ^b	9,342	9,598,905
4.13%, 05/07/24 ^b	500	519,293	Russian Railways via RZD Capital PLC		
		167,016,345	5.70%, 04/05/22 ^b	6,800	6,757,500
			Vnesheconombank Via VEB Finance PLC		
			5.94%, 11/21/23 ^b	3,400	3,209,430
			6.03%, 07/05/22 ^b	2,700	2,605,500
			6.80%, 11/22/25 ^b	7,200	7,131,888
			6.90%, 07/09/20 ^b	9,178	9,367,985
					38,671,208

(2014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
KAZAKHSTAN — 2.38%			Majapahit Holding BV		
Development Bank of Kazakhstan JSC			7.75%, 01/20/20 ^b	\$10,315	\$ 12,029,869
4.13%, 12/10/22 ^b	\$18,534	\$ 17,570,232			28,125,592
KazMunaiGaz Finance Sub BV			PHILIPPINES — 0.50%		
9.13%, 07/02/18 ^b	23,283	27,421,553	Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.		
KazMunaiGas National Co. JSC			7.25%, 05/27/19 ^b	10,398	12,373,620
4.40%, 04/30/23 ^b	16,176	15,771,600	7.39%, 12/02/24 ^b	10,366	13,408,421
5.75%, 04/30/43 ^b	30,698	29,735,771			25,782,041
6.38%, 04/09/21 ^b	10,130	11,130,338	SOUTH AFRICA — 0.98%		
7.00%, 05/05/20 ^b	18,520	20,765,550	Eskom Holdings Ltd.		
		122,395,044	5.75%, 01/26/21 ^b	23,047	23,738,410
LUXEMBOURG — 0.34%			6.75%, 08/06/23 ^b	12,948	13,863,424
Russian Agricultural Bank OJSC			Transnet SOC Ltd.		
Via RSHB Capital SA			4.00%, 07/26/22 ^b	13,498	12,974,952
5.10%, 07/25/18 ^b	7,600	7,269,248			50,576,786
5.30%, 12/27/17 ^b	3,600	3,495,816	VENEZUELA — 1.49%		
6.30%, 05/15/17 ^b	6,555	6,537,957	Petroleos de Venezuela SA		
		17,303,021	5.25%, 04/12/17 ^b	5,000	3,335,000
MALAYSIA — 2.27%			5.38%, 04/12/27 ^b	13,893	6,599,270
1MDB Global Investments Ltd.			5.50%, 04/12/37 ^b	8,148	3,778,635
4.40%, 03/09/23 ^b	38,500	38,670,994	6.00%, 11/15/26 ^b	23,054	11,316,056
Petronas Capital Ltd.			8.50%, 11/02/17 ^b	32,753	24,679,084
5.25%, 08/12/19 ^b	42,976	48,455,440	9.00%, 11/17/21 ^b	11,320	7,121,412
7.88%, 05/22/22 ^b	22,786	29,814,809	9.75%, 05/17/35 ^b	16,011	9,742,835
		116,941,243	12.75%, 02/17/22 ^b	13,073	10,334,206
MEXICO — 2.52%					76,906,498
Comision Federal de Electricidad			TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		
4.88%, 05/26/21 ^b	4,086	4,351,590	(Cost: \$980,380,142)		
4.88%, 01/15/24 ^b	4,800	5,064,000	965,863,079		
Petroleos Mexicanos			FOREIGN GOVERNMENT OBLIGATIONS^a — 79.34%		
5.50%, 01/21/21	22,664	24,975,728	ARGENTINA — 2.18%		
5.50%, 06/27/44	12,129	12,458,060	Argentine Republic Government		
5.75%, 03/01/18	12,503	13,788,308	International Bond		
6.38%, 01/23/45	12,700	14,763,750	2.50%, 12/31/38 ^e	73,309	39,586,860
6.50%, 06/02/41	10,671	12,511,001	8.28%, 12/31/33 ^e	82,700	72,809,341
6.63%, 06/15/35	10,760	12,655,159			112,396,201
8.00%, 05/03/19	24,027	29,135,140	AZERBAIJAN — 0.43%		
		129,702,736	Republic of Azerbaijan		
NETHERLANDS — 0.55%			International Bond		
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV			4.75%, 03/18/24 ^b	21,200	21,995,000
6.95%, 07/10/42 ^b	14,517	16,095,723			21,995,000

(2014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
BRAZIL — 4.68%			6.13%, 01/18/41	\$30,020	\$ 35,873,900
Banco Nacional de Desenvolvimento			7.38%, 01/27/17	18,155	20,515,150
Economico e Social			7.38%, 03/18/19	25,411	30,455,083
5.50%, 07/12/20 ^b	\$ 8,500	\$ 9,073,750	7.38%, 09/18/37	21,982	29,620,745
5.75%, 09/26/23 ^b	10,661	11,444,050	8.13%, 05/21/24	9,670	12,909,450
6.37%, 06/16/18 ^b	8,800	9,647,000			225,780,251
6.50%, 06/10/19 ^b	8,915	9,913,480	COSTA RICA — 0.63%		
Brazilian Government			Costa Rica Government		
International Bond			International Bond		
2.63%, 01/05/23	28,764	26,390,970	4.25%, 01/26/23 ^b	15,170	14,335,650
4.25%, 01/07/25	23,081	23,450,296	7.00%, 04/04/44 ^b	17,510	17,991,525
4.88%, 01/22/21	18,400	19,872,000			32,327,175
5.00%, 01/27/45	20,548	20,137,040	CROATIA — 2.79%		
5.63%, 01/07/41	22,622	24,318,650	Croatia Government		
5.88%, 01/15/19	15,684	17,738,604	International Bond		
6.00%, 01/17/17	12,946	14,162,924	5.50%, 04/04/23 ^b	21,058	21,979,288
7.13%, 01/20/37	12,409	15,666,363	6.00%, 01/26/24 ^b	25,417	27,386,817
8.25%, 01/20/34	11,602	16,010,760	6.25%, 04/27/17 ^b	18,354	19,569,953
10.13%, 05/15/27	9,696	15,222,720	6.38%, 03/24/21 ^b	25,498	27,920,310
11.00%, 08/17/40 (Call 08/17/15)	7,217	7,794,360	6.63%, 07/14/20 ^b	20,333	22,493,381
		240,842,967	6.75%, 11/05/19 ^b	22,158	24,539,985
CAYMAN ISLANDS — 0.17%					143,889,734
Brazil Minas SPE			DOMINICAN REPUBLIC — 1.41%		
5.33%, 02/15/28 ^b	8,946	8,990,730	Dominican Republic		
		8,990,730	International Bond		
CHILE — 0.76%			5.88%, 04/18/24 ^b	16,200	17,091,000
Chile Government			7.45%, 04/30/44 ^b	25,900	28,943,250
International Bond			7.50%, 05/06/21 ^b	23,257	26,454,838
3.25%, 09/14/21	14,400	14,904,000			72,489,088
3.88%, 08/05/20	22,449	24,076,553	ECUADOR — 0.67%		
		38,980,553	Ecuador Government		
CHINA — 0.30%			International Bond		
Export-Import Bank of China (The)			7.95%, 06/20/24 ^b	32,811	34,287,495
2.50%, 07/31/19 ^b	15,300	15,306,273	9.38%, 12/15/15 ^b	100	104,000
		15,306,273			34,391,495
COLOMBIA — 4.39%			EGYPT — 0.31%		
Colombia Government			Egypt Government		
International Bond			International Bond		
2.63%, 03/15/23 (Call 12/15/22)	12,600	11,812,500	5.75%, 04/29/20 ^b	15,174	16,085,957
4.00%, 02/26/24 (Call 11/26/23)	26,930	27,670,575			16,085,957
4.38%, 07/12/21	24,515	26,145,248			
5.63%, 02/26/44 (Call 08/26/43)	27,480	30,777,600			

(2014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 — 0.32%			8.50%, 10/12/35 ^b	\$ 9,520	\$ 13,280,400
El Salvador Government			11.63%, 03/04/19 ^b	13,549	18,155,660
International Bond					195,541,421
7.65%, 06/15/35 ^b	\$15,352	\$ 16,733,680	IRAQ — 0.76%		
		16,733,680	Republic of Iraq		
GABON — 0.53%			5.80%, 01/15/28 ^b		
Gabonese Republic			(Call 12/14/14)	44,319	39,277,714
6.38%, 12/12/24 ^b	25,570	27,104,200			39,277,714
		27,104,200	IVORY COAST — 0.80%		
GHANA — 0.65%			Ivory Coast Government		
Republic of Ghana			International Bond		
7.88%, 08/07/23 ^b	19,900	19,949,750	7.77%, 12/31/32 ^{b,f}	42,581	40,984,213
8.13%, 01/18/26 ^d	13,380	13,446,900			40,984,213
		33,396,650	KAZAKHSTAN — 0.66%		
HUNGARY — 4.01%			KazAgro National Management		
Hungary Government			Holding JSC		
International Bond			4.63%, 05/24/23 ^b	12,100	11,570,020
4.00%, 03/25/19	12,524	12,831,840	Kazakhstan Government		
4.13%, 02/19/18	18,954	19,634,593	International Bond		
5.38%, 02/21/23	23,438	25,163,974	3.88%, 10/14/24 ^d	10,000	9,825,000
5.38%, 03/25/24	30,558	32,698,282	4.88%, 10/14/44 ^d	12,840	12,390,600
5.75%, 11/22/23	31,074	34,181,400			33,785,620
6.25%, 01/29/20	20,751	23,289,885	KENYA — 0.48%		
6.38%, 03/29/21	34,188	38,680,084	Kenya Government		
7.63%, 03/29/41	15,306	19,792,954	International Bond		
		206,273,012	6.88%, 06/24/24 ^b	23,500	24,968,750
INDONESIA — 3.80%					24,968,750
Indonesia Government			LATVIA — 0.80%		
International Bond			Republic of Latvia		
3.38%, 04/15/23 ^b	8,900	8,499,500	2.75%, 01/12/20 ^b	21,029	20,700,544
3.75%, 04/25/22 ^b	4,236	4,204,230	5.25%, 02/22/17 ^b	18,732	20,304,259
4.63%, 04/15/43 ^b	8,875	8,253,750			41,004,803
4.88%, 05/05/21 ^b	20,660	22,054,550	LEBANON — 3.05%		
5.25%, 01/17/42 ^b	14,448	14,448,000	Lebanon Government		
5.38%, 10/17/23 ^b	4,613	5,051,235	International Bond		
5.88%, 03/13/20 ^b	11,354	12,688,095	5.15%, 11/12/18 ^b	17,535	17,535,000
5.88%, 01/15/24 ^b	16,700	18,996,250	6.00%, 01/27/23 ^b	13,422	13,489,110
6.63%, 02/17/37 ^b	9,317	10,900,890	6.10%, 10/04/22 ^b	20,790	21,153,825
6.75%, 01/15/44 ^b	16,500	20,191,875	6.38%, 03/09/20	15,931	16,687,722
6.88%, 03/09/17 ^b	5,873	6,511,689	6.60%, 11/27/26 ^b	22,116	22,558,320
6.88%, 01/17/18 ^b	13,341	15,041,977	6.75%, 11/29/27 ^b	18,092	18,634,760
7.75%, 01/17/38 ^b	13,128	17,263,320			

(2014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
8.25%, 04/12/21 ^b	\$22,012	\$ 25,313,800	PAKISTAN — 0.67%		
9.00%, 03/20/17	19,710	<u>21,848,535</u>	Pakistan Government		
		157,221,072	International Bond		
LITHUANIA — 1.91%			7.25%, 04/15/19 ^b	\$17,800	\$ 18,378,500
Lithuania Government			8.25%, 04/15/24 ^b	15,520	<u>16,218,400</u>
International Bond					34,596,900
6.13%, 03/09/21 ^b	21,914	25,505,119	PANAMA — 1.77%		
6.63%, 02/01/22 ^b	26,782	32,370,737	Panama Government		
7.38%, 02/11/20 ^b	33,317	<u>40,357,548</u>	International Bond		
		98,233,404	4.00%, 09/22/24 (Call 06/24/24)	17,900	18,302,750
MEXICO — 2.96%			5.20%, 01/30/20	27,585	30,481,425
Mexico Government			6.70%, 01/26/36	33,852	<u>42,484,260</u>
International Bond					91,268,435
3.63%, 03/15/22	17,782	18,288,787	PARAGUAY — 0.35%		
4.00%, 10/02/23	28,308	29,553,552	Republic of Paraguay		
4.75%, 03/08/44	18,722	19,002,830	6.10%, 08/11/44 ^b	16,700	<u>17,889,875</u>
5.55%, 01/21/45	10,850	12,314,750			17,889,875
5.63%, 01/15/17	10,486	11,482,170	PERU — 2.84%		
5.75%, 10/12/49	9,914	10,533,625	Peruvian Government		
5.95%, 03/19/19	7,414	8,537,221	International Bond		
6.05%, 01/11/40	14,866	17,913,530	5.63%, 11/18/50	25,004	28,317,030
6.75%, 09/27/34	9,132	11,848,770	6.55%, 03/14/37	18,130	23,161,075
8.30%, 08/15/31	2,000	2,980,000	7.35%, 07/21/25	31,994	42,312,065
United Mexican States			8.75%, 11/21/33	34,378	<u>52,598,340</u>
5.13%, 01/15/20	8,800	<u>9,869,200</u>			146,388,510
		152,324,435	PHILIPPINES — 4.72%		
MONGOLIA — 0.29%			Philippine Government		
Mongolia Government			International Bond		
International Bond			4.00%, 01/15/21	21,121	22,652,272
5.13%, 12/05/22 ^b	17,065	<u>15,187,850</u>	4.20%, 01/21/24	21,117	22,779,964
		15,187,850	5.00%, 01/13/37	18,084	20,819,205
MOROCCO — 0.44%			5.50%, 03/30/26	14,000	16,397,500
Morocco Government			6.38%, 01/15/32	12,615	16,115,662
International Bond			6.38%, 10/23/34	27,452	36,030,750
4.25%, 12/11/22 ^b	22,209	<u>22,486,613</u>	7.75%, 01/14/31	21,349	30,288,894
		22,486,613	8.38%, 06/17/19	12,540	15,831,750
NETHERLANDS — 0.37%			9.50%, 02/02/30	24,192	38,616,480
Republic of Angola Via Northern			10.63%, 03/16/25	14,853	<u>23,616,270</u>
Lights III BV					243,148,747
7.00%, 08/16/19 ^b	17,944	<u>19,146,248</u>			
		19,146,248			

(2014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
POLAND — 3.66%			SOUTH AFRICA — 2.77%		
Poland Government			South Africa Government		
International Bond			International Bond		
3.00%, 03/17/23	\$28,540	\$ 28,075,069	4.67%, 01/17/24	\$20,152	\$ 20,932,890
4.00%, 01/22/24	24,734	25,885,237	5.38%, 07/24/44	12,950	13,403,250
5.00%, 03/23/22	42,342	47,504,760	5.50%, 03/09/20	26,145	28,661,456
5.13%, 04/21/21	23,888	26,971,224	5.88%, 05/30/22	13,587	15,353,310
6.38%, 07/15/19	50,484	60,035,573	5.88%, 09/16/25	25,324	28,584,465
		188,471,863	6.88%, 05/27/19	30,889	35,522,350
					142,457,721
ROMANIA — 2.16%			SRI LANKA — 1.35%		
Romanian Government			Sri Lanka Government		
International Bond			International Bond		
4.38%, 08/22/23 ^b	27,544	28,576,900	5.88%, 07/25/22 ^b	16,884	17,601,570
4.88%, 01/22/24 ^b	13,422	14,395,095	6.00%, 01/14/19 ^b	14,128	14,975,680
6.13%, 01/22/44 ^b	17,116	20,004,325	6.25%, 10/04/20 ^b	16,856	17,972,710
6.75%, 02/07/22 ^b	40,443	48,228,278	6.25%, 07/27/21 ^b	17,821	19,001,641
		111,204,598			69,551,601
RUSSIA — 4.16%			TURKEY — 5.73%		
Russian Foreign Bond – Eurobond			Turkey Government		
International Bond			International Bond		
3.25%, 04/04/17 ^b	9,600	9,600,000	3.25%, 03/23/23	11,966	11,173,253
3.50%, 01/16/19 ^b	7,000	6,886,250	4.88%, 04/16/43	9,422	9,104,008
4.50%, 04/04/22 ^b	11,400	11,300,250	5.63%, 03/30/21	15,600	17,082,000
4.88%, 09/16/23 ^b	14,200	14,217,750	5.75%, 03/22/24	16,818	18,583,890
5.00%, 04/29/20 ^b	12,800	13,232,000	6.00%, 01/14/41	23,741	26,293,157
5.63%, 04/04/42 ^b	17,200	17,329,000	6.25%, 09/26/22	16,289	18,488,015
5.88%, 09/16/43 ^b	7,800	8,092,500	6.63%, 02/17/45	9,486	11,359,485
7.50%, 03/31/30 ^{b,f}	79,695	90,453,263	6.75%, 04/03/18	16,439	18,432,229
11.00%, 07/24/18 ^b	15,559	19,394,294	6.75%, 05/30/40	11,701	14,070,452
12.75%, 06/24/28 ^b	14,295	23,622,487	6.88%, 03/17/36	16,764	20,284,440
		214,127,794	7.00%, 03/11/19	19,998	22,947,705
SERBIA — 1.57%			7.00%, 06/05/20		
Republic of Serbia			7.25%, 03/05/38		
4.88%, 02/25/20 ^b	25,488	25,997,760	7.38%, 02/05/25	28,105	34,639,412
5.88%, 12/03/18 ^b	18,241	19,359,173	7.50%, 07/14/17	13,030	14,675,037
7.25%, 09/28/21 ^b	30,934	35,458,098	8.00%, 02/14/34	8,259	11,118,679
		80,815,031	11.88%, 01/15/30	12,600	21,971,250
					294,772,822
SLOVAKIA — 0.50%			UKRAINE — 2.42%		
Slovakia Government			Ukraine Government		
International Bond			International Bond		
4.38%, 05/21/22 ^b	23,709	25,696,727	6.58%, 11/21/16 ^b	8,000	7,000,000
		25,696,727			

(2014年10月31日現在)

銘柄	元本 (単位：千)	価額
7.50%, 04/17/23 ^b	\$20,031	\$ 16,876,118
7.75%, 09/23/20 ^b	23,037	20,042,190
7.80%, 11/28/22 ^b	31,988	27,509,680
7.95%, 02/23/21 ^b	21,611	18,936,639
9.25%, 07/24/17 ^b	37,870	34,130,337
		124,494,964
URUGUAY — 1.80%		
Uruguay Government International Bond		
4.50%, 08/14/24	36,269	38,173,122
5.10%, 06/18/50	30,323	30,059,150
7.63%, 03/21/36	18,045	24,586,313
		92,818,585
VENEZUELA — 1.59%		
Venezuela Government International Bond		
6.00%, 12/09/20 ^b	6,000	3,585,000
7.00%, 12/01/18 ^b	1,200	804,000
7.00%, 03/31/38 ^b	5,194	3,012,520
7.65%, 04/21/25	5,547	3,314,333
7.75%, 10/13/19 ^b	9,147	5,922,683
8.25%, 10/13/24 ^b	10,330	6,301,300
9.00%, 05/07/23 ^b	8,035	5,142,400
9.25%, 09/15/27	15,693	10,435,845
9.25%, 05/07/28 ^b	8,998	5,758,720
9.38%, 01/13/34	5,990	3,803,650
11.75%, 10/21/26 ^b	11,696	8,538,080
11.95%, 08/05/31 ^b	17,672	12,856,525
12.75%, 08/23/22 ^b	15,625	12,460,937
		81,935,993
VIETNAM — 0.40%		
Vietnam Government International Bond		
6.75%, 01/29/20 ^b	18,512	20,779,720
		20,779,720
ZAMBIA — 0.33%		
Zambia Government International Bond		
8.50%, 04/14/24 ^b	14,800	16,909,000
		16,909,000
TOTAL FOREIGN GOVERNMENT OBLIGATIONS (Cost: \$4,064,771,405)		4,084,473,995

銘柄	元本 (単位：千)	価額
SHORT-TERM INVESTMENTS — 0.40%		
MONEY MARKET FUNDS — 0.40%		
BlackRock Cash Funds: Treasury, SL Agency Shares		
0.00% ^{a,h}	20,259	\$ 20,259,161
		20,259,161
TOTAL SHORT-TERM INVESTMENTS (Cost: \$20,259,161)		20,259,161
TOTAL INVESTMENTS IN SECURITIES — 98.50%		
(Cost: \$5,065,410,708)		5,070,596,235
Other Assets, Less Liabilities — 1.50%		77,371,689
NET ASSETS — 100.00%		<u>\$5,147,967,924</u>

^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 Variable rate security. Rate shown is as of report date.^d This security may be resold to qualified institutional buyers under Rule 144A of the Securities Act of 1933.^e Issuer is in default of interest payments.^f 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.^g Affiliated issuer. See Note 2.^h The rate quoted is the annualized seven-day yield of the fund at period end.