

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

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

スマート・クオリティ・オープン （成長型）（1年決算型）

愛称：スマラップN

第2期（決算日：2016年8月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

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

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

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

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

(9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆ 目 次

スマート・クオリティ・オープン（成長型）（1年決算型）のご報告

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

投資対象ファンドのご報告

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

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			投 資 信 託 率 証 券 比 率	純 資 産 額 総 額
	(分配落)	税 込 み 分 配 金	期 騰 落 率		
(設 定 日) 2015年1月30日	円 10,000	円 —	% —	% —	百万円 281
1期(2015年8月13日)	10,567	0	5.7	97.2	1,121
2期(2016年8月15日)	9,396	0	△11.1	97.3	2,153

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 率 証 券 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期 首) 2015年8月13日	円 10,567	% —	% 97.2
8月末	10,061	△ 4.8	98.0
9月末	9,604	△ 9.1	97.6
10月末	10,243	△ 3.1	97.1
11月末	10,343	△ 2.1	96.5
12月末	10,145	△ 4.0	96.5
2016年1月末	9,582	△ 9.3	97.3
2月末	9,406	△11.0	97.0
3月末	9,737	△ 7.9	96.1
4月末	9,727	△ 7.9	97.3
5月末	9,687	△ 8.3	97.5
6月末	9,144	△13.5	97.3
7月末	9,466	△10.4	98.3
(期 末) 2016年8月15日	9,396	△11.1	97.3

(注) 騰落率は期首比。

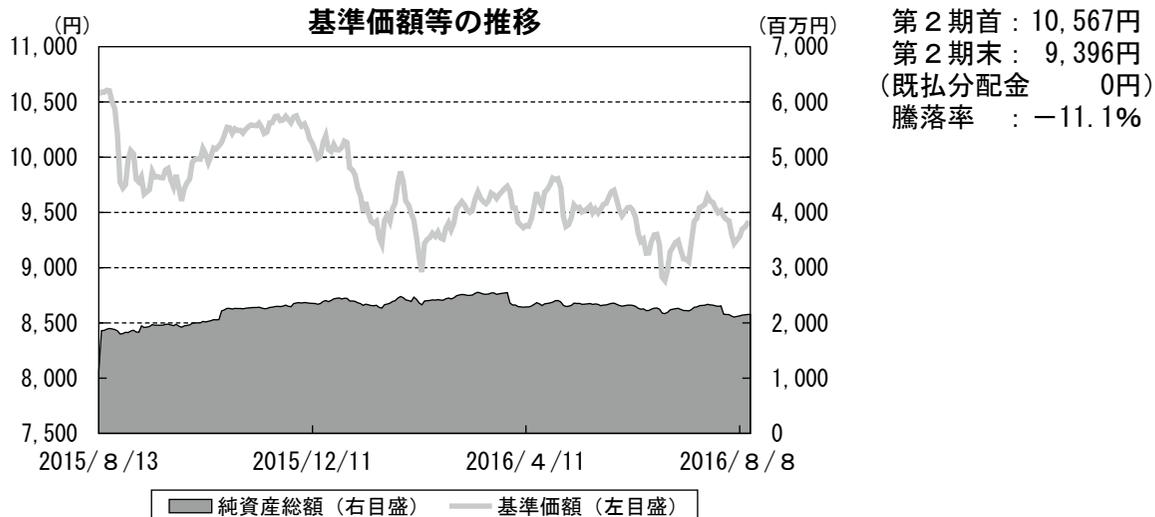
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第2期：2015/8/14～2016/8/15）

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ11.1%の下落となりました。



基準価額の主な変動要因

下落要因

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

投資環境について

（第2期：2015/8/14～2016/8/15）

◎国内債券市況

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

◎国内株式市況

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

◎国内リート市況

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

◎先進国債券市況

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

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

◎先進国株式市況

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

◎先進国リート市況

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

◎新興国株式市況

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

◎新興国債券市況

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

◎為替市況

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

当該投資信託のポートフォリオについて

- ・投資信託証券への投資を通じて、主として「国内株式」、「国内債券」、「国内リート」、「先進国株式」、「先進国債券」、「先進国リート」、「新興国株式」、「新興国債券」の8資産（以下「8資産」ということがあります。）に分散投資を行いました。
- ・8資産への投資にあたっては、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 投資顧問部からのアドバイスを基に、当ファンドの目標リスク水準（年率標準偏差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。
- ・2015年11月に原則年1回実施される基本資産配分比率の変更を設定来初めて行いました。今回の変更では、相対的に高い投資妙味が見込まれる日本株式への配分を引き上げるとともに、先進国株式においては「iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・クオリティ・ファクター UCITS ETF」を新たに加え、米国における今後の追加利上げを念頭においた比率に変更を行いました。なお、当該投資信託証券への投資は12月に行いました。（当該投資信託証券は、期中に名称変更を行っており、変更後の名称を記載しています。）
- ・2016年2月には臨時の基本資産配分比率の変更を行いました。市場の変動性が上昇していたことなどを背景に基本資産配分比率をリスク水準引き下げ方向に若干調整（国内株式等の組入比率を引き下げ、国内債券等の組入比率を引き上げ）しましたが、3月上旬には市場の変動性が落ち着きを見せたことなどから、従来の基本資産配分比率に戻しました。
- ・外貨建資産については、為替ヘッジは行いませんでした。
- ・前記の運用の結果、国内株式が大幅下落したことに加えて、米ドルが対円で下落したことなどから、基準価額は期首と比較して11.1%下落しました。

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

（ご参考）
ポートフォリオの状況

資産区分	選定した投資信託証券の名称	期首 (2015年8月13日) 比率	期末 (2016年8月15日) 比率
国内株式	国際 J P X日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用）	19.5%	29.5%
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%	14.9%
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%	4.1%
先進国株式	iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・ミニマム・ボラティリティ UCITS ETF	41.5%	16.1%
	iシェアーズ エッジ MSCI ワールド・クオリティ・ファクター UCITS ETF	—	16.2%
先進国債券	MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6.1%	3.0%
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%	4.8%
新興国株式	iシェアーズ エッジ MSCI ミニマム・ボラティリティ・エマージング・マーケット ETF	5.4%	4.3%
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%	4.2%

（注）比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

（注）上記は指定投資信託証券の中から選定した投資信託証券を記載しています。

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について

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

分配金について

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

【分配原資の内訳】（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第2期
	2015年8月14日～2016年8月15日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	211

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

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

今後の運用方針

◎運用環境の見通し

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

◎今後の運用方針

- ・今後も、経済・金融市場の環境を多角的に分析しつつ、基本資産配分比率を維持し、中長期的に当ファンドが目標とするリスク水準をめざした運用を行います。
- ・当ファンドにおいては、引き続き目標リスク水準（年率標準偏差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8月14日～2016年8月15日）

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	159円	1.629%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× （期中の日数÷年間日数）
(投信会社)	(71)	(0.728)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販売会社)	(85)	(0.869)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.033)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	9	0.093	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(投資信託証券)	(9)	(0.093)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	3	0.026	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.015)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監査費用)	(1)	(0.011)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	171	1.748	
期中の平均基準価額は、9,762円です。			

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

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

（2015年8月14日～2016年8月15日）

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	国際 JPX日経インデックス400オープン(適格機関投資家専用)	千口	千円	千口	千円
		764,747	811,192	284,189	278,033
	国内リートインデックス・ファンド(適格機関投資家限定)	84,641	87,550	36,842	40,355
	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)	107,458	113,557	36,405	37,809
	MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	443,477	534,909	283,953	351,728
	MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	85,492	119,265	80,924	110,438
小計		1,485,816	1,666,475	722,314	818,365
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	ISHARES JP MORGAN USD EMERG1	7	818	7	752
	ISHARES EDGE MSCI MIN VOL EM	13	685	6	284
	ISH EDGE MSCI WLD MIN VOL	118	4,105	139	4,866
	ISH EDGE MSCI WLD QLY FCTR	158	4,207	34	917
	小計	298	9,816	187	6,821

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

（2015年8月14日～2016年8月15日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投資信託証券	百万円 2,837	百万円 1,666	% 58.7	百万円 1,615	百万円 818	% 50.7
為替直物取引	598	23	3.8	366	—	—

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2015年8月14日～2016年8月15日）

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

○組入資産の明細

（2016年8月15日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	期首（前期末）	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
国際 JPY日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用）	185,288	665,846	635,616	29.5
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	80,434	89,177	4.1
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	101,639	103,915	4.8
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	255,678	321,387	14.9
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	51,872	64,078	3.0
合 計	391,968	1,155,470	1,214,175	56.4

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

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

銘柄	期首（前期末）	当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
（アメリカ）					
ISHARES JP MORGAN USD EMERGI	7	7	893	90,612	4.2
ISHARES EDGE MSCI MIN VOL EM	9	16	919	93,253	4.3
ISH EDGE MSCI WLD MIN VOL	108	87	3,425	347,576	16.1
ISH EDGE MSCI WLD QLY FCTR	—	123	3,444	349,488	16.2
合 計	124	235	8,681	880,930	40.9

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

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

○投資信託財産の構成

（2016年8月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,214,175	55.9
投資証券	880,930	40.5
コール・ローン等、その他	77,587	3.6
投資信託財産総額	2,172,692	100.0

（注）期末における外貨建純資産（884,388千円）の投資信託財産総額（2,172,692千円）に対する比率は40.7%です。

（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年8月15日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,172,692,054
コール・ローン等	77,585,864
投資信託受益証券（評価額）	1,214,175,573
投資証券（評価額）	880,930,617
(B) 負債	19,160,669
未払信託報酬	19,033,750
未払利息	91
その他未払費用	126,828
(C) 純資産総額（A－B）	2,153,531,385
元本	2,292,044,187
次期繰越損益金	△ 138,512,802
(D) 受益権総口数	2,292,044,187口
1万口当たり基準価額（C/D）	9,396円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,060,880,916円
 期中追加設定元本額 1,924,832,352円
 期中一部解約元本額 693,669,081円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9396円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は138,512,802円です。

③分配金の計算過程

項 目	2015年8月14日～ 2016年8月15日
費用控除後の配当等収益額	0円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
収益調整金額	32,218,987円
分配準備積立金額	16,284,378円
当ファンドの分配対象収益額	48,503,365円
1万口当たり収益分配対象額	211円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2015年8月14日～2016年8月15日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,332,332
受取配当金	6,318,396
受取利息	28,710
支払利息	△ 14,774
(B) 有価証券売買損益	△ 170,889,749
売買益	122,318,525
売買損	△ 293,208,274
(C) 信託報酬等	△ 37,433,170
(D) 当期損益金（A+B+C）	△ 201,990,587
(E) 前期繰越損益金	16,284,378
(F) 追加信託差損益金	47,193,407
（配当等相当額）	（ 32,218,987）
（売買損益相当額）	（ 14,974,420）
(G) 計（D+E+F）	△ 138,512,802
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金（G+H）	△ 138,512,802
追加信託差損益金	47,193,407
（配当等相当額）	（ 32,218,987）
（売買損益相当額）	（ 14,974,420）
分配準備積立金	16,284,378
繰越損益金	△ 201,990,587

(注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

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

【お知らせ】

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

〈ご参考〉組入投資信託証券の概要

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

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

■組入投資信託証券の対象指数（ベンチマーク）について

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

国際 J P X日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用）

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

○損益の状況（2015年2月14日～2016年2月15日）

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

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○組入資産の明細

（2016年2月15日現在）

親投資信託残高

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

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

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

国内株式

2016年2月15日現在

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

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

国際 J P X 日経インデックス400オープン (適格機関投資家専用)

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

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

国際 J P X 日経インデックス400オープン (適格機関投資家専用)

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

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

国際 J P X 日経インデックス400オープン (適格機関投資家専用)

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

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

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

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

(注) 銘柄欄の () 内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の < > 内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

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

MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

○損益の状況 （2015年5月13日～2016年5月12日）

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

(注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	113,326,227	199,687,055	269,038,369

下記は、日本債券インデックスマザーファンド全体の内容です。

国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

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

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第288回利付国債 (10年)	1.7	2,026,000	2,079,992	2017/9/20
第289回利付国債 (10年)	1.5	2,453,000	2,522,444	2017/12/20
第290回利付国債 (10年)	1.4	1,640,000	1,690,266	2018/3/20
第291回利付国債 (10年)	1.3	940,000	967,072	2018/3/20
第292回利付国債 (10年)	1.7	794,000	822,750	2018/3/20
第293回利付国債 (10年)	1.8	1,081,000	1,127,807	2018/6/20
第294回利付国債 (10年)	1.7	1,570,000	1,634,668	2018/6/20
第295回利付国債 (10年)	1.5	1,240,000	1,285,855	2018/6/20
第296回利付国債 (10年)	1.5	2,020,000	2,103,486	2018/9/20
第297回利付国債 (10年)	1.4	836,000	871,830	2018/12/20
第298回利付国債 (10年)	1.3	2,640,000	2,746,233	2018/12/20
第299回利付国債 (10年)	1.3	2,760,000	2,881,688	2019/3/20
第300回利付国債 (10年)	1.5	957,000	1,004,677	2019/3/20
第301回利付国債 (10年)	1.5	1,872,000	1,973,892	2019/6/20
第302回利付国債 (10年)	1.4	2,850,000	2,996,233	2019/6/20
第303回利付国債 (10年)	1.4	2,325,000	2,453,688	2019/9/20
第304回利付国債 (10年)	1.3	1,170,000	1,230,804	2019/9/20
第305回利付国債 (10年)	1.3	3,808,000	4,020,029	2019/12/20
第306回利付国債 (10年)	1.4	2,488,000	2,646,286	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)	1.3	1,610,000	1,706,181	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	1,374,000	1,461,221	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	2,300,000	2,426,983	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	2,886,000	3,041,872	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	2,700,000	2,822,121	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	4,030,000	4,297,753	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	2,969,000	3,191,496	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	1,590,000	1,693,572	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	2,253,000	2,420,352	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	980,000	1,047,747	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	1,557,000	1,670,022	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	2,490,000	2,657,253	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	1,519,000	1,634,474	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	2,850,000	3,050,497	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	2,515,000	2,699,827	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	1,770,000	1,889,581	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	1,675,000	1,793,121	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	3,440,000	3,661,295	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	3,435,000	3,665,248	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	1,360,000	1,445,204	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	2,240,000	2,395,344	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	740,000	782,979	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	3,210,000	3,447,251	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	2,390,000	2,572,070	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	1,480,000	1,570,635	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	3,110,000	3,304,468	2023/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第333回利付国債（10年）	0.6	4,060,000	4,318,825	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	4,200,000	4,472,790	2024/6/20
第335回利付国債（10年）	0.5	4,240,000	4,484,351	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	1,360,000	1,439,492	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	3,980,000	4,143,180	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	4,440,000	4,663,021	2025/3/20
第339回利付国債（10年）	0.4	5,380,000	5,652,819	2025/6/20
第340回利付国債（10年）	0.4	5,330,000	5,602,576	2025/9/20
第341回利付国債（10年）	0.3	4,820,000	5,018,969	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	3,680,000	3,758,752	2026/3/20
第1回利付国債（30年）	2.8	76,000	104,404	2029/9/20
第2回利付国債（30年）	2.4	98,000	130,290	2030/2/20
第3回利付国債（30年）	2.3	117,000	154,486	2030/5/20
第4回利付国債（30年）	2.9	127,000	179,675	2030/11/20
第5回利付国債（30年）	2.2	108,000	142,701	2031/5/20
第6回利付国債（30年）	2.4	169,000	229,611	2031/11/20
第7回利付国債（30年）	2.3	164,000	221,729	2032/5/20
第8回利付国債（30年）	1.8	142,000	181,231	2032/11/22
第9回利付国債（30年）	1.4	116,000	140,505	2032/12/20
第10回利付国債（30年）	1.1	185,000	215,108	2033/3/20
第11回利付国債（30年）	1.7	137,000	173,261	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	220,000	293,774	2033/9/20
第13回利付国債（30年）	2.0	205,000	270,716	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	493,000	686,965	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	346,000	488,818	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	302,000	427,961	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	327,000	458,454	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	427,000	591,984	2035/3/20
第19回利付国債（30年）	2.3	303,000	420,809	2035/6/20
第20回利付国債（30年）	2.5	495,000	707,726	2035/9/20
第21回利付国債（30年）	2.3	379,000	528,094	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	570,000	817,875	2036/3/20
第23回利付国債（30年）	2.5	554,000	796,319	2036/6/20
第24回利付国債（30年）	2.5	411,000	592,349	2036/9/20
第25回利付国債（30年）	2.3	742,000	1,043,021	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	1,064,000	1,520,211	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	910,000	1,327,635	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	1,191,000	1,747,852	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	1,400,000	2,037,070	2038/9/20
第30回利付国債（30年）	2.3	1,336,000	1,925,763	2039/3/20
第31回利付国債（30年）	2.2	1,228,000	1,752,380	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	1,509,000	2,197,677	2040/3/20
第33回利付国債（30年）	2.0	1,834,000	2,561,786	2040/9/20
第34回利付国債（30年）	2.2	1,626,000	2,359,374	2041/3/20
第35回利付国債（30年）	2.0	1,769,000	2,495,032	2041/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第36回利付国債（30年）	2.0	1,809,000	2,565,035	2042/3/20
第37回利付国債（30年）	1.9	1,827,000	2,559,517	2042/9/20
第38回利付国債（30年）	1.8	1,425,000	1,970,703	2043/3/20
第39回利付国債（30年）	1.9	1,200,000	1,693,860	2043/6/20
第40回利付国債（30年）	1.8	970,000	1,347,960	2043/9/20
第41回利付国債（30年）	1.7	1,060,000	1,445,596	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	1,010,000	1,380,447	2044/3/20
第43回利付国債（30年）	1.7	1,270,000	1,739,722	2044/6/20
第44回利付国債（30年）	1.7	1,250,000	1,716,162	2044/9/20
第45回利付国債（30年）	1.5	1,130,000	1,493,035	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	1,530,000	2,025,459	2045/3/20
第47回利付国債（30年）	1.6	1,380,000	1,867,567	2045/6/20
第48回利付国債（30年）	1.4	1,580,000	2,054,331	2045/9/20
第49回利付国債（30年）	1.4	1,520,000	1,977,185	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	890,000	1,007,747	2046/3/20
第36回利付国債（20年）	3.0	201,000	209,890	2017/9/20
第38回利付国債（20年）	2.7	400,000	421,936	2018/3/20
第40回利付国債（20年）	2.3	601,000	637,120	2018/9/20
第42回利付国債（20年）	2.6	869,000	939,797	2019/3/20
第43回利付国債（20年）	2.9	74,000	81,828	2019/9/20
第44回利付国債（20年）	2.5	480,000	530,817	2020/3/20
第47回利付国債（20年）	2.2	114,000	126,145	2020/9/21
第48回利付国債（20年）	2.5	209,000	235,526	2020/12/21
第49回利付国債（20年）	2.1	515,000	573,704	2021/3/22
第51回利付国債（20年）	2.0	200,000	223,124	2021/6/21
第52回利付国債（20年）	2.1	214,000	241,075	2021/9/21
第54回利付国債（20年）	2.2	480,000	546,288	2021/12/20
第55回利付国債（20年）	2.0	241,000	272,930	2022/3/21
第56回利付国債（20年）	2.0	449,000	511,060	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	147,000	167,224	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	589,000	665,145	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	289,000	313,715	2023/3/20
第63回利付国債（20年）	1.8	442,000	506,359	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	441,000	510,633	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	318,000	369,659	2023/12/20
第66回利付国債（20年）	1.8	500,000	577,365	2023/12/20
第68回利付国債（20年）	2.2	846,000	1,007,391	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	422,000	511,447	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	160,000	191,284	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	534,000	636,645	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	620,000	736,739	2024/12/20
第74回利付国債（20年）	2.1	318,000	380,646	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	575,000	690,644	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	200,000	236,640	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	210,000	250,353	2025/3/20

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

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第123回利付国債（20年）	2.1	1,748,000	2,273,868	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	700,000	900,417	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	734,000	967,947	2031/3/20
第126回利付国債（20年）	2.0	810,000	1,044,268	2031/3/20
第127回利付国債（20年）	1.9	560,000	713,697	2031/3/20
第128回利付国債（20年）	1.9	1,214,000	1,551,649	2031/6/20
第129回利付国債（20年）	1.8	600,000	757,884	2031/6/20
第130回利付国債（20年）	1.8	1,182,000	1,495,903	2031/9/20
第131回利付国債（20年）	1.7	890,000	1,112,820	2031/9/20
第132回利付国債（20年）	1.7	827,000	1,035,776	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	1,190,000	1,508,789	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	965,000	1,225,636	2032/3/20
第135回利付国債（20年）	1.7	370,000	464,139	2032/3/20
第136回利付国債（20年）	1.6	770,000	953,860	2032/3/20
第137回利付国債（20年）	1.7	472,000	593,039	2032/6/20
第138回利付国債（20年）	1.5	890,000	1,089,965	2032/6/20
第139回利付国債（20年）	1.6	480,000	595,468	2032/6/20
第140回利付国債（20年）	1.7	2,427,000	3,056,515	2032/9/20
第141回利付国債（20年）	1.7	1,550,000	1,954,891	2032/12/20
第142回利付国債（20年）	1.8	840,000	1,073,133	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	1,380,000	1,720,032	2033/3/20
第144回利付国債（20年）	1.5	1,020,000	1,254,467	2033/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	2,790,000	3,528,457	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	2,070,000	2,621,344	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	2,360,000	2,951,746	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	2,170,000	2,679,103	2034/3/20
第149回利付国債（20年）	1.5	2,500,000	3,086,425	2034/6/20
第150回利付国債（20年）	1.4	2,420,000	2,946,979	2034/9/20
第151回利付国債（20年）	1.2	2,620,000	3,098,097	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	2,920,000	3,453,367	2035/3/20
第153回利付国債（20年）	1.3	2,400,000	2,885,568	2035/6/20
第154回利付国債（20年）	1.2	2,290,000	2,708,978	2035/9/20
第155回利付国債（20年）	1.0	2,530,000	2,895,306	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	1,510,000	1,552,808	2036/3/20
第14回ポーランド共和国円貨債券（2013）	0.67	100,000	100,703	2018/11/15
小 計		380,496,000	430,939,878	
地方債証券				
第1回東京都公募公債（20年）	1.54	20,000	22,141	2023/6/20
第7回東京都公募公債（30年）	2.51	10,000	14,225	2038/9/17
第8回東京都公募公債（30年）	2.23	80,000	109,130	2038/9/17
第16回東京都公募公債（20年）	2.01	100,000	123,399	2028/12/20
第20回東京都公募公債（20年）	2.09	80,000	100,457	2029/9/20
第21回東京都公募公債（20年）	2.19	80,000	101,831	2029/12/20
第22回東京都公募公債（20年）	1.92	120,000	149,548	2030/6/20
第24回東京都公募公債（20年）	1.98	70,000	88,857	2031/6/20

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

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第89回大阪府公募公債（5年）	0.2	100,000	100,219	2017/12/27
第92回大阪府公募公債（5年）	0.14	100,000	100,131	2018/3/28
第306回大阪府公募公債	1.83	30,000	30,727	2017/9/27
第313回大阪府公募公債	1.66	100,000	103,120	2018/4/27
第314回大阪府公募公債	1.8	30,000	31,063	2018/5/29
第316回大阪府公募公債	1.85	100,000	103,951	2018/7/30
第325回大阪府公募公債	1.66	153,000	160,184	2019/4/26
第326回大阪府公募公債	1.66	10,000	10,482	2019/5/28
第331回大阪府公募公債	1.41	100,000	104,606	2019/10/29
第332回大阪府公募公債	1.58	71,600	75,386	2019/11/27
第334回大阪府公募公債	1.47	264,000	277,561	2020/1/28
第337回大阪府公募公債	1.44	110,000	115,897	2020/4/28
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	72,688	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,605	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	105,761	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	58,844	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	58,948	2022/3/29
第366回大阪府公募公債	0.79	156,000	163,112	2022/11/29
第386回大阪府公募公債	0.585	100,000	104,249	2024/7/30
第389回大阪府公募公債	0.53	100,000	103,915	2024/10/30
平成21年度第5回京都市公募公債	1.35	20,000	20,950	2019/12/24
平成22年度第5回京都市公募公債	1.26	110,000	116,176	2020/12/21
平成23年度第9回京都市公募公債	1.01	140,000	147,919	2022/3/16
平成24年度第3回京都市公募公債（20年）	1.63	200,000	244,844	2032/8/13
平成24年度第10回京都市公募公債	0.67	100,000	104,352	2023/3/22
平成25年度第1回京都市公募公債	0.58	100,000	103,752	2023/4/28
平成25年度第2回京都市公募公債（15年）	1.05	100,000	110,713	2028/4/28
第2回兵庫県公募公債（30年）	2.36	40,000	55,785	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債（15年）	1.31	100,000	113,124	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債（15年）	1.09	100,000	111,085	2029/4/16
第16回兵庫県公募公債（20年）	1.7	100,000	122,916	2032/11/19
平成20年度第5回兵庫県公募公債	1.93	50,000	51,984	2018/6/20
平成21年度第1回兵庫県公募公債	1.62	120,000	125,515	2019/4/23
平成21年度第3回兵庫県公募公債	1.62	190,000	198,975	2019/5/22
平成21年度第25回兵庫県公募公債	1.54	100,000	105,176	2019/11/20
平成20年度第1回静岡県公募公債	1.73	14,500	15,009	2018/5/28
平成20年度第2回静岡県公募公債	1.91	100,000	104,035	2018/6/26
平成20年度第4回静岡県公募公債	1.65	100,000	103,788	2018/8/28
平成20年度第5回静岡県公募公債	1.59	11,000	11,427	2018/10/30
平成21年度第4回静岡県公募公債	1.56	52,920	55,604	2019/8/20
平成22年度第1回静岡県公募公債	1.455	101,700	107,458	2020/4/20
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	104,831	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	104,429	2020/8/25
平成23年度第6回静岡県公募公債	1.201	170,000	180,285	2021/7/23
平成24年度第10回静岡県公募公債	0.678	100,000	104,442	2023/3/22

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

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

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

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成25年度第2回広島市公募公債		0.72	100,000	105,210	2023/12/27
平成24年度第2回千葉市公募公債		0.81	100,000	105,085	2022/11/22
平成26年度第2回千葉市公募公債		0.505	100,000	103,826	2024/11/27
平成22年度第1回三重県公募公債		1.056	87,050	91,089	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	98,410	103,787	2021/11/30
平成24年度第1回三重県公募公債		0.801	140,660	147,602	2022/10/25
平成24年度第4回福井県公募公債		0.46	100,000	102,988	2023/4/26
平成20年度第1回徳島県公募公債		1.73	36,000	37,586	2018/11/28
平成24年度第1回徳島県公募公債		0.68	100,000	104,495	2023/3/24
平成26年度第1回徳島県公募公債		0.495	100,000	103,831	2024/11/28
平成20年度第1回岡山県公募公債		1.56	48,700	50,691	2018/12/25
小 計			28,006,180	30,032,413	
特殊債券(除く金融債)					
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	200,000	204,682	2017/7/31
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	106,000	108,832	2017/10/31
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	100,000	102,590	2018/1/31
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	102,616	2018/3/23
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	100,000	103,476	2018/5/30
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.7	34,000	35,280	2018/7/31
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	206,000	213,535	2018/8/29
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	224,000	231,945	2018/9/28
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	50,000	51,963	2018/10/31
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.6	115,000	119,656	2018/11/28
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	159,000	164,736	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	141,000	146,187	2019/3/19
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	200,000	209,120	2019/5/31
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	200,000	250,406	2029/5/31
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.5	210,000	219,819	2019/6/28
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	79,000	82,464	2019/9/30
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	125,662	2029/9/28
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	125,749	2029/10/31
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	139,000	144,989	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	210,000	220,096	2020/1/31
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.3	100,000	142,066	2040/2/29
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	50,000	52,494	2020/3/19
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	126,997	2030/4/30
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	200,000	210,680	2020/6/30
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	104,342	2020/9/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	112,000	116,538	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	71,000	74,912	2020/12/28
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	100,000	126,565	2031/1/31
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	91,000	96,051	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	60,000	63,432	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	122,000	128,503	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	105,464	2021/10/29

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

国内リートインデックス・ファンド（適格機関投資家限定）

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

■ 損益及び余剰金計算書

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

■ 組入資産の明細

(単位：円)

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

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

下記は、ブラックロック国内リート・インデックス・マザーファンドの内容です。

(1)国内投資証券

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

(注1) 合計欄の()内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

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

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

(iShares MSCI World Minimum Volatility UCITS ETF)

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

1. 損益計算書

(2016年3月31日に終了する期間)

(2016年3月31日現在)

(米ドルで表示)

(千米ドル)

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

(注) () 内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2016年3月31日現在)

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

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

(2016年3月31日現在)

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

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

(2016年3月31日現在)

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

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

(2016年3月31日現在)

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

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

(2016年3月31日現在)

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

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

(2016年3月31日現在)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(iShares MSCI World Quality Factor UCITS ETF)

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

1. 損益計算書

(2014年10月6日～2015年5月31日)

(2015年5月31日現在)

(米ドルで表示)

(千米ドル)

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

(注) ()内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2015年5月31日現在)

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

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

(2015年5月31日現在)

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

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

(2015年5月31日現在)

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

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

(2015年5月31日現在)

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

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

(2015年5月31日現在)

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

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

(2015年5月31日現在)

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

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

(2015年5月31日現在)

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

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

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

保有数 銘柄	公正価値 千米ドル	純資産 比率%
Net assets attributable to redeemable participating shareholders		
	21,708	99.98
Adjustment to align to the valuation methodology as set out in the prospectus	4	0.02
Net asset value attributable to redeemable participating shareholders at the end of the period		
	21,712	100.00
[†] Cash holdings of \$91,137 are held with State Street Bank and Trust Company. \$17,058 is held as security for futures contracts with Barclays Plc. * Investment in related party.		

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

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

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

○損益の状況 (2015年5月13日～2016年5月12日)

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

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○組入資産の明細

(2016年5月12日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 9,333,697	千口 13,634,758	千円 26,825,024

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

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）

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

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

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

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

■ 損益及び余剰金計算書

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

■ 組入資産の明細

(単位：円)

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

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

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

外国投資証券

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末			
		口	数	口	数	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)			千口		千口	千米ドル	千円
ACADIA REALTY TRUST			0.334		0.875	28	3,469
AGREE REALTY CORP			0.089		0.265	8	1,034
ALEXANDER'S INC			0.022		0.046	18	2,190
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY			0.467		0.885	79	9,575
AMERICAN ASSETS TRUST INC			0.124		0.473	19	2,404
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES			0.689		1.349	54	6,598
AMERICAN HOMES 4 RENT- A			0.876		1.941	32	3,861
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP			5.289		-	-	-
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERT			0.316		0.484	8	966
AMREIT INC			0.119		-	-	-
APARTMENT INVT & MGMT CO -A			0.965		1.914	75	9,043
APPLE HOSPITALITY REIT INC			-		2.008	39	4,774
ARMADA HOFFLER PROPERTIES Inc			-		0.345	3	446
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC			-		0.316	4	560
ASHFORD HOSPITALITY TRUST			0.401		1.032	7	856
ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION			0.3		-	-	-
AVALONBAY COMMUNITIES INC			0.816		1.612	281	33,979
AVIV REIT INC			0.136		-	-	-
BIOMED REALTY TRUST INC			1.291		2.447	57	6,906
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH			-		0.21	2	296
BOSTON PROPERTIES INC			0.966		1.854	233	28,132

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

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

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	0.559	1.234	12	1,550
GEO GROUP INC/THE	0.451	0.892	28	3,470
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	0.574	1.118	32	3,932
GENERAL GROWTH PROPERTIES	3.944	7.06	204	24,642
GETTY REALTY CORP	0.159	0.449	7	913
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.113	0.28	4	540
GLIMCHER REALTY TRUST	0.977	-	-	-
GLOBAL NET LEASE INC	-	2.048	18	2,266
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	0.46	0.702	11	1,377
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	0.757	-	-	-
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	-	0.716	16	1,957
HCP INC	2.879	5.598	208	25,108
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	0.653	1.219	32	3,874
HEALTH CARE REIT INC	2.063	-	-	-
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	1.548	-	-	-
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	-	1.514	39	4,802
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1.411	-	-	-
HERSHA HOSPITALITY TRUST	-	0.614	14	1,777
HIGHWOODS PROPERTIES INC	0.45	1.14	49	5,972
HOME PROPERTIES INC	0.38	-	-	-
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1.015	1.826	49	5,909
HOST HOTELS & RESORTS INC	4.497	9.051	156	18,911
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	0.328	0.948	27	3,265
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	-	0.384	3	362
INLAND REAL ESTATE CORPATION	0.418	1.036	9	1,105
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	0.523	1.45	11	1,419
IRON MOUNTAIN INC	1.13	-	-	-
IRON MOUNTAIN INC	-	2.288	70	8,452
KILROY REALTY CORP	0.541	1.115	73	8,851
KIMCO REALTY CORP	2.542	5.03	134	16,235
KITE REALTY GROUP TRUST	0.547	1.041	27	3,314
LTC PROPERTIES INC	0.207	0.449	19	2,319
LASALLE HOTEL PROPERTIES	0.707	1.388	40	4,921
LEXINGTON REALTY TRUST	1.461	2.587	22	2,757
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.966	1.848	62	7,580
MACERICH CO/THE	0.916	1.626	137	16,613
MACK-CALI REALTY CORPRATION	0.603	1.022	22	2,681
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1.071	2.804	31	3,820
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNIES INC	0.491	0.926	78	9,511
MONMOUTH REIT-CLASS A	0.327	0.646	6	810
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	-	1.952	19	2,320
NATL HEALTH INVESTORS INC	0.184	0.4	23	2,832
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.813	1.661	63	7,610
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	-	0.285	4	516

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	口数	口数	評価額			
			外貨	建金額	邦貨	換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル		千円	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	-	1,066	10			1,287
NEW YORK REIT INC	1,183	1,985	22			2,728
NEXPOINT RESIDENTIAL	-	0,266	3			422
NORTHSTAR REALTY FINANCE	-	4,196	50			6,075
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	0,855	1,976	68			8,224
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0,087	0,148	3			420
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0,134	0,244	20			2,523
PARKWAY PROPERTIES INC	0,477	1,001	16			2,019
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	0,42	0,867	29			3,572
PENN REAL ESTATE INVEST TST	0,456	0,838	18			2,271
PHYSICIANS REALTY TRUST	0,275	0,927	14			1,786
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	1,001	1,868	36			4,364
POST PROPERTIES INC	0,368	0,661	39			4,761
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	-	0,265	2			349
PROLOGIS INC	3,137	6,334	270			32,632
PUBLIC STORAGE INC	0,91	1,782	408			49,300
QTS REALTY TRUST INC-CL A	0,061	0,414	17			2,146
RLJ LODGING TRUST	0,856	1,585	39			4,794
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	0,622	1,025	17			2,076
REALTY INCOME CORP	1,44	3,022	149			18,021
REGENCY CENTERS CORP	0,603	1,156	78			9,472
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENT	0,625	1,223	22			2,673
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	1,493	2,897	43			5,228
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	0,221	0,656	9			1,198
ROUSE PROPERTIES INC	0,188	0,464	8			984
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0,346	0,611	32			3,874
SL GREEN REALTY CORP	0,451	1,198	142			17,133
SABRA HEALTH CARE REIT INC	0,351	0,803	18			2,195
SAUL CENTERS INC	0,069	0,139	7			939
SELECT INCOME REIT	0,146	0,756	15			1,841
SENIOR HOUSING PROP TRUST	1,328	2,862	43			5,241
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	0,2	0,539	8			1,052
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,95	3,747	754			91,014
SOVRAN SELF STORAGE INC	0,23	0,432	43			5,201
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2,449	5,338	54			6,551
STAG INDUSTRIAL INC	0,32	0,815	16			2,016
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	0,292	0,507	12			1,503
STORE CAPITAL CORP	-	0,646	14			1,765
STRATEGIC HOTELS & RESORTS Inc	1,564	3,384	47			5,752
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	0,446	1,097	14			1,730
SUN COMMUNITIES INC	0,273	0,651	43			5,260
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,435	2,505	36			4,367
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	0,656	1,165	40			4,909
TAUBMAN CENTERS INC	0,429	0,621	47			5,763

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	
TERRENO REALTY CORP	0.25	0.487	10	1,314	
UDR INC	1.517	3.16	108	13,129	
UMH PROPERTIES INC	-	0.456	4	543	
URBAN EDGE PROPERTIES	-	1.015	24	2,905	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	0.1	0.167	3	404	
VENTAS INC	1.755	4.014	215	25,998	
VEREIT INC	-	11.043	91	10,997	
VORNADO REALTY TRUST	1.074	2.135	214	25,883	
WP CAREY INC	0.584	1.199	75	9,160	
WP GLIMCHER INC	-	2.267	26	3,176	
WASHINGTON PRIME GROUP	1.008	-	-	-	
WASHINGTON REIT	0.476	0.817	22	2,660	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	0.749	1.42	50	6,122	
WELLTOWER INC	-	4.261	276	33,326	
WHITESTONE REIT	0.144	0.362	4	539	
WINTHROP REALTY TRUST	0.191	0.441	6	770	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	-	1.316	22	2,751	
通貨小計	口数・金額 銘柄数・(比率)	116.84 142銘柄	241,557 155銘柄	8,672	1,045,668 (68.6%)
(カナダ)	千口	千口	千カナダドル	千円	
CALLOWAY REAL ESTATE INVESTMENT	0.43	-	-	-	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.44	0.719	19	1,784	
MORGUARD REAL ESTATE INVESTMENT	0.182	0.28	4	372	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	0.224	0.402	17	1,578	
RIOCAN REAL ESTATE I	1.02	1.881	47	4,421	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	0.309	0.431	15	1,425	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	0.401	0.94	14	1,332	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.143	0.289	15	1,431	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	0.305	0.771	10	951	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	0.477	0.608	7	728	
INTERENT REAL ESTATE INVESTMENT	-	0.257	1	153	
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	0.592	0.91	4	372	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	0.851	1.663	34	3,216	
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERIES	0.102	0.175	4	442	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	-	0.298	2	235	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	-	0.18	1	174	
INNVEST REAL ESTATE INVESTMENT	-	0.823	4	397	
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	-	0.317	4	447	
CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	0.446	-	-	-	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT	0.115	0.299	11	1,050	
CHOICE PROPERTIES REIT	0.286	0.467	5	507	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	-	0.373	4	446	
PLAZA RETAIL REIT	-	0.368	1	150	
NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE INVESTMENT	-	0.145	2	247	

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

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

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

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

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

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

先進国リートインデックス・ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家限定）

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

(iShares MSCI Emerging Markets Minimum Volatility ETF)

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

1. 損益計算書

(2015年8月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

投資純利益

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

費用

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

実現および未実現損益（純額）

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

a：外国源泉徴収税控除後の金額です。

(注) ()内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2015年8月31日現在)

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

(2015年8月31日現在)

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

(2015年8月31日現在)

銘柄	数量	価額	銘柄	数量	価額
Telekom Malaysia Bhd	5,023,200	\$ 7,762,040	QATAR — 3.65%	Commercial Bank QSC (The)	1,518,440 \$ 23,937,397
Tenaga Nasional Bhd	1,835,400	4,885,660		Doha Bank QSC	355,005 5,157,717
		194,193,071	Industries Qatar QSC	114,954 4,198,974	
MEXICO — 3.39%			Masraf Al Rayan QSC	104,811 1,255,049	
America Movil SAB de CV	9,128,700	8,307,226	Ooredoo QSC	207,690 3,964,312	
Arca Continental SAB de CV	2,223,400	12,660,660	Qatar Electricity & Water		
Coca-Cola Femsa SAB de CV			Co. QSC	369,495 22,223,890	
Series L	386,400	2,774,803	Qatar Insurance Co. SAQ	222,663 5,992,962	
El Puerto de Liverpool SAB de CV			Qatar Islamic Bank SAQ	437,115 13,565,679	
Series C1	2,270,100	27,040,976	Qatar National Bank SAQ	173,880 8,548,109	
Fibra Uno Administracion SA			Vodafone Qatar QSC	272,412 <u>1,058,644</u>	
de CV	966,000	2,066,135		89,902,733	
Gruma SAB de CV Series B	434,700	5,831,923	RUSSIA — 0.21%		
Grupo Aeroportuario del Pacifico			Rosneft OAO	906,120 3,302,204	
SAB de CV Series B	1,014,300	8,485,544	Rosneft OAO GDR ^d	534,949 <u>2,015,688</u>	
Grupo Aeroportuario del Sureste				5,317,892	
SAB de CV Series B	338,100	4,912,323	SOUTH AFRICA — 5.92%		
Grupo Bimbo SAB de CV ^b	531,300	1,364,029	Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	197,064 5,088,595	
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	4,153,800	9,933,969	Bidvest Group Ltd. (The)	268,681 6,459,647	
		83,377,588	Discovery Ltd.	633,505 6,400,362	
PERU — 1.05%			Foschini Group Ltd. (The)	239,085 2,701,912	
Cia. de Minas Buenaventura			Liberty Holdings Ltd.	497,490 4,830,783	
SA ADR	357,903	2,261,947	Life Healthcare Group		
Credicorp Ltd.	213,969	<u>23,532,311</u>	Holdings Ltd.	2,938,089 8,430,455	
		25,794,258	Mediclinic International Ltd.	218,015 1,751,122	
PHILIPPINES — 3.98%			Mr. Price Group Ltd.	213,969 3,849,563	
Aboitiz Power Corp.	14,586,600	13,497,442	MTN Group Ltd.	80,178 1,069,725	
Bank of the Philippine Islands	10,674,304	19,320,627	Nedbank Group Ltd.	555,450 9,881,832	
BDO Unibank Inc.	6,158,250	12,977,913	Netcare Ltd.	1,200,255 3,606,850	
International Container Terminal			Pick n Pay Stores Ltd.	1,231,650 5,812,714	
Services Inc.	4,873,470	9,691,678	Rand Merchant Insurance		
Jollibee Foods Corp.	2,337,730	9,577,991	Holdings Ltd.	2,403,891 7,608,070	
Metropolitan Bank & Trust Co.	4,402,141	7,887,876	Redefine Properties Ltd.	12,799,752 11,077,984	
Philippine Long Distance			Sasol Ltd.	146,832 4,703,650	
Telephone Co.	466,099	<u>25,109,912</u>	Shoprite Holdings Ltd.	776,181 9,501,367	
		98,063,439	SPAR Group Ltd. (The)	566,076 8,108,596	
POLAND — 1.58%			Standard Bank Group Ltd.	2,387,469 26,300,542	
Bank Pekao SA	235,704	10,055,679	Tiger Brands Ltd.	173,397 3,919,138	
Bank Zachodni WBK SA ^b	58,926	4,732,636	Tsogo Sun Holdings Ltd.	579,117 1,026,010	
PGE Polska Grupa			Vodacom Group Ltd.	1,278,501 <u>13,637,794</u>	
Energetyczna SA	3,975,573	16,449,630		145,766,711	
Powszechny Zaklad					
Ubezpieczen SA	66,364	<u>7,578,124</u>			
		38,816,069			

(2015年8月31日現在)

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

(2015年8月31日現在)

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

TOTAL INVESTMENTS**IN SECURITIES — 102.57%**

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

\$2,525,599,210

Other Assets, Less Liabilities — (2.57)%

(63,242,222)

NET ASSETS — 100.00%\$2,462,356,988

ADR — American Depositary Receipts

GDR — Global Depositary Receipts

NVDR — Non-Voting Depositary Receipts

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

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

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

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

1. 損益計算書

(2015年10月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

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

(注) ()内の金額は、マイナスの金額です。

2. 投資明細表

(2015年10月31日現在)

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

(2015年10月31日現在)

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

(2015年10月31日現在)

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

(2015年10月31日現在)

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

(2015年10月31日現在)

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

(2015年10月31日現在)

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

(2015年10月31日現在)

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

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

^a Investments are denominated in U.S. dollars.

^b This security may be resold to qualified foreign investors and foreign institutional buyers under Regulation S of the Securities Act of 1933.

^c This security may be resold to qualified institutional buyers under Rule 144A of the Securities Act of 1933.

^d Issuer is in default of interest payments.

^e Step coupon security. Coupon rate will either increase (step-up bond) or decrease (step-down bond) at regular intervals until maturity. Interest rate shown reflects the rate currently in effect.

^f Affiliated issuer. See Note 2.

^g The rate quoted is the annualized seven-day yield of the fund at period end.