

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	2026年7月3日まで（2006年3月17日設定）	
運用方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券、三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券、MUAM J-REITマザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。各マザーファンド受益証券への資産配分は、信託財産の純資産総額に対して、それぞれ10%、10%、10%、50%、10%、10%を基本投資割合とします。
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 外国株式マザーファンド	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
	MUAM J-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	MUAM G-REITマザーファンド	S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	三菱UFJ 外国株式マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）並びに外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	MUAM J-REITマザーファンド	投資信託証券への投資に制限を設けません。株式および外貨建資産への投資は行いません。
	MUAM G-REITマザーファンド	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には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。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ 6資産バランス ファンド（2ヵ月分配型）

第86期（決算日：2020年9月7日）

第87期（決算日：2020年11月5日）

第88期（決算日：2021年1月5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「三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）」は、去る1月5日に第88期の決算を行いましたので、法令に基づいて第86期～第88期の運用状況をまとめて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

ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の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、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

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。

○最近15期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 税 分	価 達 配	額 み 金	期 騰 落	中 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	円		円			%	%	%	%	%	%	百万円
74期(2018年9月5日)	10,031		40		0.7		19.2	0.4	59.5	0.1	19.6	2,861
75期(2018年11月5日)	9,878		40		△1.1		18.5	0.4	60.0	0.0	19.8	2,774
76期(2019年1月7日)	9,528		40		△3.1		18.8	0.4	60.0	0.0	19.0	2,650
77期(2019年3月5日)	10,020		40		5.6		19.5	0.3	59.2	0.0	19.7	2,738
78期(2019年5月7日)	10,046		40		0.7		19.3	0.5	59.4	0.0	19.8	2,718
79期(2019年7月5日)	10,144		40		1.4		19.4	0.4	58.6	0.0	19.9	2,722
80期(2019年9月5日)	10,114		40		0.1		18.8	0.3	59.2	0.0	20.2	2,700
81期(2019年11月5日)	10,408		40		3.3		19.8	0.3	58.6	0.0	20.2	2,756
82期(2020年1月6日)	10,313		40		△0.5		19.7	0.3	58.8	0.0	19.8	2,708
83期(2020年3月5日)	10,243		40		△0.3		18.7	0.3	59.5	0.0	20.0	2,681
84期(2020年5月7日)	9,377		40		△8.1		19.7	0.4	58.5	0.0	20.1	2,403
85期(2020年7月6日)	9,945		40		6.5		19.6	0.2	59.0	0.0	19.9	2,570
86期(2020年9月7日)	10,117		40		2.1		19.5	0.3	58.6	0.0	19.9	2,602
87期(2020年11月5日)	9,961		40		△1.1		19.5	0.4	58.5	0.0	19.7	2,542
88期(2021年1月5日)	10,268		40		3.5		19.6	0.3	58.8	0.0	19.9	2,576

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 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。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準	価 額	株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率					
第86期	(期 首) 2020年 7 月 6 日	円	%	%	%	%	%	%
		9,945	—	19.6	0.2	59.0	0.0	19.9
	7 月 末	9,941	△0.0	18.9	0.3	59.5	0.0	19.7
	8 月 末	10,151	2.1	19.5	0.3	58.9	0.0	20.1
第87期	(期 末) 2020年 9 月 7 日	10,157	2.1	19.5	0.3	58.6	0.0	19.9
	(期 首) 2020年 9 月 7 日	10,117	—	19.5	0.3	58.6	0.0	19.9
	9 月 末	10,050	△0.7	19.6	0.4	58.8	0.0	19.7
	10 月 末	9,827	△2.9	19.0	0.5	59.6	0.0	19.3
第88期	(期 末) 2020年11月 5 日	10,001	△1.1	19.5	0.4	58.5	0.0	19.7
	(期 首) 2020年11月 5 日	9,961	—	19.5	0.4	58.5	0.0	19.7
	11 月 末	10,197	2.4	19.1	0.4	60.0	0.0	19.9
	12 月 末	10,361	4.0	19.6	0.3	58.3	0.0	20.1
第88期	(期 末) 2021年 1 月 5 日	10,308	3.5	19.6	0.3	58.8	0.0	19.9

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第86期～第88期：2020年7月7日～2021年1月5日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第 86 期 首	9,945円
第 88 期 末	10,268円
既払分配金	120円
騰 落 率	4.5%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ4.5%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

> 基準価額の主な変動要因**上昇要因**

主に外国株式市況が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

基準価額の主な変動要因の内訳は以下の通りです。

内訳

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	1.4%程度
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	1.5%程度
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	0.0%程度
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	0.8%程度
MUAM J－REITマザーファンド	0.7%程度
MUAM G－REITマザーファンド	0.5%程度
その他（信託報酬等）	△0.4%程度

第86期～第88期：2020年7月7日～2021年1月5日

投資環境について

▶ 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

日銀によるＥＴＦ（上場投資信託）の積極的な買入れや、主要国の経済対策への期待、新型コロナウイルスのワクチン開発に関する報道等が支援材料となり、国内株式市況は上昇しました。

▶ 外国株式市況

外国株式市況は上昇しました。

外国株式市況は、主要国の経済対策への期待や新型コロナウイルスのワクチン開発に関する報道等が支援材料となり上昇しました。

▶ 国内債券市況

国内債券市況は上昇しました。

国内債券市況は、新型コロナウイルスワクチンの開発による経済正常化への期待が高まった一方で、日本銀行が緩和的な金融政策を継続したことから、もみ合いで推移し、当作成期を通して見ると上昇しました。

▶ 外国債券市況

先進国債券市況は上昇しました。

先進国債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことや世界的な金融緩和スタンス等を背景に、当作成期首との比較では上昇しました。

▶ 国内ＲＥＩＴ市況

国内ＲＥＩＴ市況は上昇しました。

新型コロナウイルスの感染再拡大に対する警戒感の高まりやオフィス・ビル空室率の上昇傾向から一時的に弱含む局面もあったものの、各国が積極的な金融政策や財政政策を継続したことや、治療薬やワクチンの開発進展に関する報道などにより経済正常化への期待が高まったことなどから、当作成期首から当作成期末にかけて概ね上昇基調で推移しました。

▶ 外国ＲＥＩＴ市況

外国ＲＥＩＴ市況は上昇しました。

外国ＲＥＩＴ市況は、主要国の経済対策への期待や新型コロナウイルスのワクチン開発に関する報道等が支援材料となり上昇しました。

▶ 為替市況

米ドルは円に対して下落、ユーロは円に対して上昇しました。

為替市況は、当作成期首に比べて4.2%の円高・米ドル安、4.3%の円安・ユーロ高となりました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）

資産配分は、ファンドの基本投資割合に準じて運用を行いました。

基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して以下の通りです。

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	10%
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	10%
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	10%
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	50%
MUAM J-REITマザーファンド	10%
MUAM G-REITマザーファンド	10%

▶ 三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

▶ 三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

ベンチマークであるＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（ＲＥＩＴ）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。株式の国別比率、業種別比率などがベン

チマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル
株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

▶ 三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド

資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。

ベンチマークであるＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

▶ 三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

作成期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

▶ MUAM J－REITマザーファンド

東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果をめざします。

銘柄選定およびポートフォリオの構築は主に、定性的評価・定量的評価を経て行っています。

定性的評価については、事業内容および財務内容などの分析を中心に行い、定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、投資口価格純資産倍率（PBR）などの分析を行いました。

組入銘柄数は54～55銘柄程度で推移させました。

主な売買動向については、保有物件の売却益なども活用しながら持続的な分配金成長が期待できると判断したGLP投資法人のウェイトを引き上げたことや、各種バリュエーションの相対的な割安度を勘案して伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人のウェイトを引き下げたことなどが挙げられます。

▶ MUAM G－REITマザーファンド

ベンチマークであるS＆P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

＞ 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、分配対象額の水準等を勘案し、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86期 2020年7月7日～ 2020年9月7日	第87期 2020年9月8日～ 2020年11月5日	第88期 2020年11月6日～ 2021年1月5日
当期分配金（対基準価額比率）	40 (0.394%)	40 (0.400%)	40 (0.388%)
当期の収益	33	22	33
当期の収益以外	6	17	6
翌期繰越分配対象額	719	701	695

（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 （作成対象期間末での見解です。）

▶ 三菱UFJ 6資産バランスファンド （2ヵ月分配型）

資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また、各資産の組入比率は、作成期を通じて同割合に準ずるよう調整を行います。

▶ 三菱UFJ トピックスインデックス マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 三菱UFJ 外国株式マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 三菱UFJ 国内債券マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 三菱UFJ 外国債券マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ MUAM J-REITマザーファンド

REITの組入比率については、高水準（90%以上）を維持する方針です。
配当利回りやPBR等のバリュエーション、また物件ポートフォリオのクオリティ等に注目し、安定した分配金が見込

め相対的に割安と思われる銘柄への投資ウェイトを高めた運用を行います。

新型コロナウイルスワクチンの接種が各国で始まり、国内においても実用化に向けた期待が高まっています。ただし世界的な感染者数の拡大は継続しており、また、ワクチンが広く普及するには相応の時間を要することから、当面の経済の回復ペースは緩やかなものになると考えております。一方で、各国中央銀行による金融緩和策を背景とした低金利環境も当面続くことなどから、引き続き国内REIT市況は堅調に推移するとみています。

このような市場環境に対する想定のもと、物流や小売など大口テナントの業界動向に加えて、スポンサーのサポート体制にも着目しつつ、REIT各社に対する綿密な調査を継続することにより、個別銘柄ごとの業績動向や中長期的な成長性を慎重に見極めて選別投資を行い、パフォーマンスの向上に努めてまいります。

▶ MUAM G-REITマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2020年7月7日～2021年1月5日

1万口当たりの費用明細

項目	第86期～第88期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	56	0.551	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(23)	(0.231)	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）	(29)	(0.287)	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	0	0.002	(b) 売買委託手数料 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成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
（株式）	(0)	(0.000)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.002)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(c) 有価証券取引税 = 作成期中の有価証券取引税 ÷ 作成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
（株式）	(0)	(0.000)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	2	0.019	(d) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.010)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(0)	(0.002)	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）	(1)	(0.007)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	58	0.573	

作成期中の平均基準価額は、10,105円です。

(注) 作成期間の費用（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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

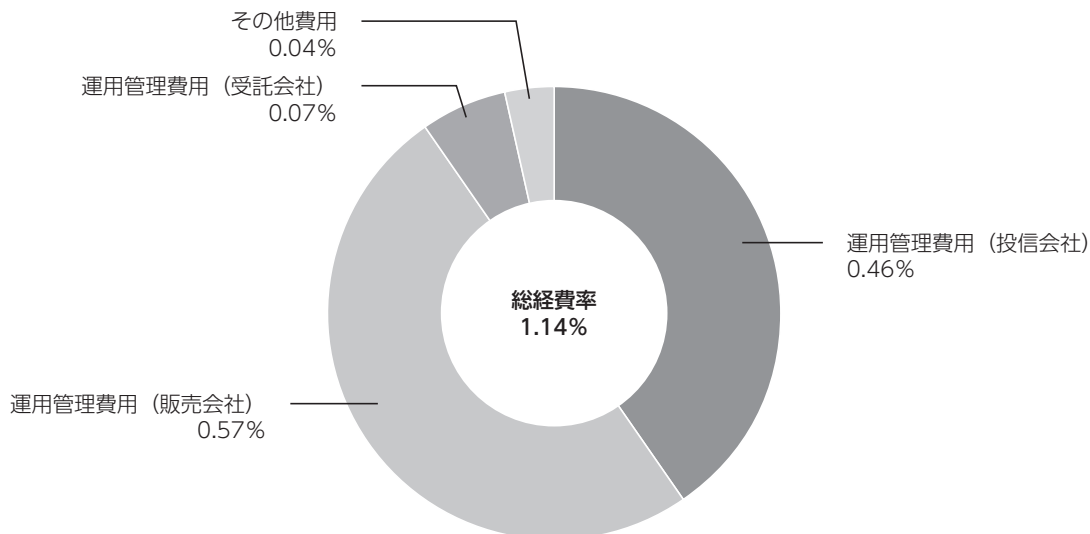
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

（参考情報）

■総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（１口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.14%**です。



(注) 費用は、１万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2020年7月7日～2021年1月5日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第86期～第88期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	6	9	23,442	35,196
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	694	978	1,881	2,646
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	490	1,424	6,145	17,669
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	10	28	14,037	39,162
MUAM G－R E I Tマザーファンド	234	348	9,770	15,644
MUAM J－R E I Tマザーファンド	295	913	4,476	14,131

○株式売買比率

(2020年7月7日～2021年1月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第86期～第88期	
	三菱ＵＦＪ トピックス インデックスマザーファンド	三菱ＵＦＪ 外国株式 マザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	52,526,889千円	20,914,756千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	235,821,629千円	99,533,723千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.22	0.21

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月7日～2021年1月5日)

利害関係人との取引状況

<三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）>

該当事項はございません。

<三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド>

区 分	第86期～第88期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 19,845	百万円 70	% 0.4	百万円 32,681	百万円 647	% 2.0
貸付有価証券(株式)	460,847	293,129	63.6	457,557	285,321	62.4

平均保有割合 0.1%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド>

区 分	第86期～第88期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 67,400	百万円 12,204	% 18.1	百万円 42,158	百万円 9,305	% 22.1

平均保有割合 0.1%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

<三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド>

区 分	第86期～第88期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 6,701	百万円 3,412	% 50.9	百万円 6,757	百万円 5,143	% 76.1

平均保有割合 2.7%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド>

区 分	第86期～第88期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 11,114	百万円 10,071	% 90.6	百万円 18,827	百万円 17,066	% 90.6

平均保有割合 0.2%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<MUAM G-REITマザーファンド>

区 分	第86期～第88期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 6,740	百万円 13	% 0.2	百万円 1,795	百万円 21	% 1.2

平均保有割合 0.7%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

＜MUAM J－REITマザーファンド＞

区 分	第86期～第88期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 1,256	百万円 231	% 18.4	百万円 874	百万円 287	% 32.8

平均保有割合 1.8%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

種 類	第86期～第88期		
	買 付 額	売 付 額	第88期末保有額
株式	百万円 258	百万円 392	百万円 3,339

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

種 類	第86期～第88期		
	買 付 額	売 付 額	第88期末保有額
公社債	百万円 816	百万円 1,010	百万円 1,020

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

種 類	第86期～第88期
	買 付 額
株式	百万円 117

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

種 類	第86期～第88期
	買 付 額
公社債	百万円 6,100

<MUAM J-REITマザーファンド>

種 類	第86期～第88期	
	買	付 額
投資信託証券		百万円 84

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第86期～第88期
売買委託手数料総額 (A)	62千円
うち利害関係人への支払額 (B)	7千円
(B) / (A)	12.4%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは中京銀行、三菱ＵＦＪ銀行、三菱ＵＦＪ信託銀行、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券、三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ、三菱ＵＦＪリース、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFG証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2021年1月5日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第85期末	第88期末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	187,927	164,491	258,169
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	178,374	177,188	249,799
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	447,781	442,125	1,287,514
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	102,440	88,414	258,762
MUAM G-REITマザーファンド	170,025	160,490	253,670
MUAM J-REITマザーファンド	85,472	81,291	264,034

○有価証券の貸付及び借入の状況

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンドにおいて、2021年1月5日現在における貸付株数の総株数は30,419,000株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFG証券に対する貸付は、17,984,700株です。

○投資信託財産の構成

(2021年１月５日現在)

項 目	第88期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	258,169	10.0
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	249,799	9.6
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	1,287,514	49.7
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	258,762	10.0
MUAM G－REITマザーファンド	253,670	9.8
MUAM J－REITマザーファンド	264,034	10.2
コール・ローン等、その他	19,513	0.7
投資信託財産総額	2,591,461	100.0

(注) 三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産（49,395,208千円）の投資信託財産総額（51,360,849千円）に対する比率は96.2%です。

(注) 三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産（109,211,095千円）の投資信託財産総額（109,788,009千円）に対する比率は99.5%です。

(注) MUAM G－REITマザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産（40,358,023千円）の投資信託財産総額（40,849,626千円）に対する比率は98.8%です。

(注) 外貨建資産は、作成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、作成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＝103.15円	1 カナダドル＝80.68円	1 メキシコペソ＝5.18円	1 ユーロ＝126.42円
1 イギリスポンド＝139.93円	1 スイスフラン＝117.03円	1 スウェーデンクローネ＝12.51円	1 ノルウェークローネ＝12.05円
1 デンマーククローネ＝17.00円	1 ポーランドズロチ＝27.77円	1 オーストラリアドル＝79.07円	1 ニュージーランドドル＝74.00円
1 香港ドル＝13.30円	1 シンガポールドル＝78.15円	1 マレーシアリングgit＝25.69円	100韓国ウォン＝9.51円
1 イスラエルシェケル＝32.11円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第86期末	第87期末	第88期末
	2020年 9 月 7 日現在	2020年11月 5 日現在	2021年 1 月 5 日現在
	円	円	円
(A) 資産	2,618,007,097	2,559,767,908	2,591,461,022
コール・ローン等	9,699,747	9,095,895	9,306,349
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド(評価額)	260,262,147	260,291,129	258,169,167
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド(評価額)	250,522,548	248,997,641	249,799,781
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド(評価額)	1,304,267,566	1,269,069,354	1,287,514,748
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド(評価額)	261,536,266	251,669,740	258,762,562
MUAM G－REITマザーファンド(評価額)	260,794,787	250,501,890	253,670,639
MUAM J－REITマザーファンド(評価額)	260,448,803	257,032,789	264,034,428
未収入金	10,475,233	13,109,470	10,203,345
未収利息	—	—	3
(B) 負債	15,234,424	17,436,075	14,801,224
未払収益分配金	10,291,062	10,208,928	10,038,069
未払解約金	—	2,634,952	—
未払信託報酬	4,924,159	4,574,369	4,744,668
未払利息	18	7	—
その他未払費用	19,185	17,819	18,487
(C) 純資産総額(A－B)	2,602,772,673	2,542,331,833	2,576,659,798
元本	2,572,765,736	2,552,232,171	2,509,517,357
次期繰越損益金	30,006,937	△ 9,900,338	67,142,441
(D) 受益権総口数	2,572,765,736口	2,552,232,171口	2,509,517,357口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,117円	9,961円	10,268円

○損益の状況

項 目	第86期	第87期	第88期
	2020年 7 月 7 日～ 2020年 9 月 7 日	2020年 9 月 8 日～ 2020年11月 5 日	2020年11月 6 日～ 2021年 1 月 5 日
	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 446	△ 257	△ 225
受取利息	4	－	5
支払利息	△ 450	△ 257	△ 230
(B) 有価証券売買損益	59,331,858	△ 24,859,352	91,661,294
売買益	59,471,114	9,814,225	92,679,200
売買損	△ 139,256	△ 34,673,577	△ 1,017,906
(C) 信託報酬等	△ 4,943,344	△ 4,592,188	△ 4,763,155
(D) 当期損益金(A+B+C)	54,388,068	△ 29,451,797	86,897,914
(E) 前期繰越損益金	△ 97,565,577	△ 53,007,521	△ 91,083,763
(F) 追加信託差損益金	83,475,508	82,767,908	81,366,359
(配当等相当額)	(134,465,252)	(133,425,193)	(131,210,247)
(売買損益相当額)	(△ 50,989,744)	(△ 50,657,285)	(△ 49,843,888)
(G) 計(D+E+F)	40,297,999	308,590	77,180,510
(H) 収益分配金	△ 10,291,062	△ 10,208,928	△ 10,038,069
次期繰越損益金(G+H)	30,006,937	△ 9,900,338	67,142,441
追加信託差損益金	83,475,508	82,767,908	81,366,359
(配当等相当額)	(134,465,906)	(133,426,775)	(131,211,148)
(売買損益相当額)	(△ 50,990,398)	(△ 50,658,867)	(△ 49,844,789)
分配準備積立金	50,667,859	45,674,148	43,250,635
繰越損益金	△104,136,430	△138,342,394	△ 57,474,553

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(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。

<注記事項>

- ①作成期首（前作成期末）元本額 2,584,557,863円
作成期中追加設定元本額 3,256,059円
作成期中一部解約元本額 78,296,565円
また、1口当たり純資産額は、作成期末1.0268円です。

②分配金の計算過程

項 目	2020年 7 月 7 日～ 2020年 9 月 7 日	2020年 9 月 8 日～ 2020年11月 5 日	2020年11月 6 日～ 2021年 1 月 5 日
費用控除後の配当等収益額	8,681,267円	5,652,116円	8,395,514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	－円	－円	－円
収益調整金額	134,465,906円	133,426,775円	131,211,148円
分配準備積立金額	52,277,654円	50,230,960円	44,893,190円
当ファンドの分配対象収益額	195,424,827円	189,309,851円	184,499,852円
1万口当たり収益分配対象額	759円	741円	735円
1万口当たり分配金額	40円	40円	40円
収益分配金金額	10,291,062円	10,208,928円	10,038,069円

○分配金のお知らせ

	第86期	第87期	第88期
1 万口当たり分配金（税込み）	40円	40円	40円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

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

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド

《第20期》決算日2020年2月20日

〔計算期間：2019年2月21日～2020年2月20日〕

「三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド」は、2月20日に第20期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 株式（株価指数先物取引等を含む）の組入比率は、高位を保ちます。 運用の効率化を図るためおよび当該株価指数への連動をめざすため、株価指数先物取引等を利用します。
主 要 運 用 対 象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率	東 証 株 価 指 数 (ＴＯＰＩＸ) (配当込み)	期 騰 落 中 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	%		%	%	%	百万円
16期(2016年2月22日)	10,155	△11.7	1,813.06	△11.7	99.0	1.0	199,359
17期(2017年2月20日)	12,356	21.7	2,205.76	21.7	98.6	1.3	209,506
18期(2018年2月20日)	14,375	16.3	2,565.77	16.3	99.0	1.0	206,265
19期(2019年2月20日)	13,457	△6.4	2,400.99	△6.4	99.4	0.5	207,606
20期(2020年2月20日)	14,322	6.4	2,554.63	6.4	99.2	0.7	238,603

(注) 東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）（ＴＯＰＩＸといいます）の指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、東京証券取引所の知的財産権であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利およびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (TOPIX) (配当込み)	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率				
(期 首) 2019年2月20日	円	%		%	%	%
	13,457	—	2,400.99	—	99.4	0.5
2月末	13,413	△0.3	2,393.08	△0.3	98.6	0.9
3月末	13,424	△0.2	2,395.21	△0.2	99.2	1.8
4月末	13,647	1.4	2,434.82	1.4	98.2	1.6
5月末	12,761	△5.2	2,275.96	△5.2	99.8	1.8
6月末	13,109	△2.6	2,338.89	△2.6	97.8	1.7
7月末	13,229	△1.7	2,360.18	△1.7	99.3	0.5
8月末	12,783	△5.0	2,280.58	△5.0	100.9	0.6
9月末	13,554	0.7	2,418.29	0.7	95.4	2.0
10月末	14,232	5.8	2,539.02	5.7	96.7	1.6
11月末	14,510	7.8	2,588.40	7.8	97.7	1.6
12月末	14,721	9.4	2,625.91	9.4	98.4	1.1
2020年1月末	14,406	7.1	2,569.77	7.0	100.5	0.8
(期 末) 2020年2月20日						
	14,322	6.4	2,554.63	6.4	99.2	0.7

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

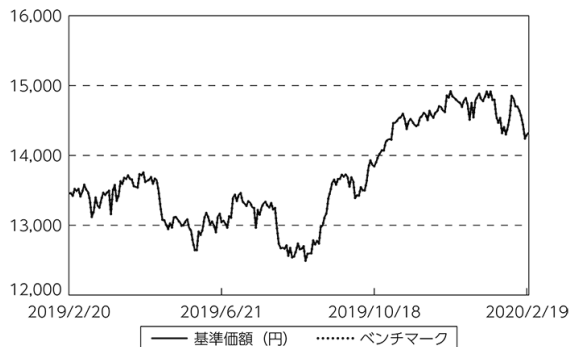
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率
(6.4%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

- ・期首から2019年9月末にかけて米中貿易摩擦問題や英国の欧州連合（ＥＵ）離脱問題の進退等を受け、国内株式市況は上下する展開になりました。10月から期末にかけて、米中貿易交渉の進展期待等を受け、国内株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオは、ベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）と業種別比率等がほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いて構築しました。

(注) マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・企業規模等）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは6.4%の上昇となったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・その他の要因※によるものです。

※貸株収入要因等が含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

(2019年２月21日～2020年２月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 0	% 0.001	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) そ の 他 費 用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、13,691円です。			

(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

(2019年２月21日～2020年２月20日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		31,157	56,302,846	18,391	36,843,413
		(2,460)	()		

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

新株予約権証券

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証券 — (168,500)	千円 — (—)	証券 168,500	千円 674

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株主割当および権利行使等による増減分です。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 42,422	百万円 41,890	百万円 —	百万円 —

○株式売買比率

(2019年2月21日～2020年2月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	93,146,260千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	223,619,188千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年2月21日～2020年2月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 56,302	百万円 11,289	% 20.1	百万円 36,843	百万円 6,580	% 17.9
新株予約権証券	—	—	—	0.674	0.674	100.0
貸付有価証券(株式)	661,390	361,009	54.6	650,605	345,721	53.1

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 900	百万円 588	百万円 4,222

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 2

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	3,337千円
うち利害関係人への支払額 (B)	92千円
(B) / (A)	2.8%

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中京銀行、auカブコム証券、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFJ証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2020年2月20日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	3.9	4.8	13,440
日本水産	121.6	136.3	83,143
マルハニチロ	17.6	19.7	50,530
カネコ種苗	3.7	4.1	5,432
サカタのタネ	14.8	16.2	54,027
ホクト	10.2	10.4	20,529
ホクリョウ	2	2.1	1,602
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	27	27.5	3,932
日鉄鉱業	2.8	3.1	13,113
三井松島ホールディングス	5	5.3	5,936
国際石油開発帝石	487.9	546.7	586,062
石油資源開発	17.4	17.8	49,804
K&Oエナジーグループ	5.8	6.6	10,863
建設業 (2.8%)			
ヒノキヤグループ	2.5	3.4	6,929
ショーボンドホールディングス	8.7	21.2	89,782
ミライト・ホールディングス	34.1	40.5	61,155
タマホーム	5.9	7.3	10,329
サンヨーホームズ	1.9	1.2	891
日本アクア	3.2	5.4	3,299
ファーストコーポレーション	3.7	4.2	2,499
ベステラ	2.4	2.3	2,553
TATERU	14.8	28.1	5,339
キャンディル	—	1.2	796
スペースバリューホールディングス	15	16.6	8,847
ダイセキ環境ソリューション	2.4	2.6	2,576
第一カッター興業	1.5	1.7	3,245
明豊ファシリティワークス	—	3.3	2,471
安藤・間	77.8	81.1	69,421
東急建設	35.4	39.9	29,885
コムシスホールディングス	43.1	48.3	140,987
ミサワホーム	9.5	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビーアールホールディングス	10.4	14.8	7,281
高松コンストラクショングループ	7.6	8.5	22,049
東建コーポレーション	3.8	4.2	34,440
ソネック	1.4	1.4	1,057
ヤマウラ	4.6	5.9	5,540
大成建設	99.9	104.9	426,943
大林組	300.9	314.7	386,766
清水建設	306.9	319.4	345,590
飛島建設	8.8	9	12,177
長谷工コーポレーション	125.4	121.8	172,468
松井建設	11	12.4	8,853
銭高組	1.2	1.4	5,544
鹿島建設	235.2	247	315,666
不動テトラ	6.9	8.2	13,456
大末建設	3.6	3.6	3,427
鉄建建設	6.1	6.8	18,054
西松建設	21.6	24.2	58,685
三井住友建設	72	76	46,360
大豊建設	6.8	7.1	18,651
前田建設工業	71.5	78.8	84,079
佐田建設	6.4	6.8	2,665
ナカノフドー建設	7.7	8.6	3,887
奥村組	16.5	17.1	48,375
東鉄工業	12	13.5	41,445
イチケン	1.9	2.3	3,889
富士ビー・エス	3.4	4.6	2,387
浅沼組	3.5	3.5	18,025
戸田建設	116.6	130.7	93,058
熊谷組	14.3	14.6	46,574
青木あすなろ建設	4.7	—	—
北野建設	2.1	1.9	4,769
植木組	1.5	1.4	3,491
矢作建設工業	13.4	13.9	11,606
ビーエス三菱	10.7	10.4	6,822

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日本ハウスホールディングス	19.7	21.5	9,503	
大東建託	35.7	37.7	468,234	
新日本建設	11.9	13.4	11,524	
N I P P O	26.6	26	69,680	
東亜道路工業	1.9	2	6,720	
前田道路	31.4	33.3	113,220	
日本道路	2.7	3	21,480	
東亜建設工業	8.8	9.8	17,297	
日本国土開発	—	23	13,593	
若築建設	5	5.7	9,114	
東洋建設	36.5	35.3	17,720	
五洋建設	119.3	124.7	82,052	
世紀東急工業	14.6	15.1	13,333	
福田組	3.3	3.6	15,894	
住友林業	71.1	79.7	137,084	
日本基礎技術	10.6	10.6	3,847	
巴コーポレーション	12.6	14	5,222	
大和ハウス工業	277.8	311.3	1,027,290	
ライト工業	19.2	18	26,370	
積水ハウス	307.2	344.3	797,915	
日特建設	8.4	8.2	6,920	
北陸電気工事	4.8	5.4	5,772	
ユアテック	15.9	18	11,466	
四電工	1.5	1.7	4,386	
中電工	12.9	12.7	31,000	
関電工	45.5	44.8	44,934	
きんでん	66.7	74.8	134,116	
東京エネシス	10.2	10.4	8,694	
トーエネック	2.7	3.2	11,616	
住友電設	6.9	8.9	21,902	
日本電設工業	17.1	17.3	38,475	
協和エクシオ	39.3	47.7	125,403	
新日本空調	8.4	8.3	16,425	
九電工	19.8	22.1	69,173	
三機工業	22.6	22.7	31,076	
日揮ホールディングス	86.4	96.9	150,291	
中外炉工業	2.8	3.4	5,780	
ヤマト	8.8	10.1	7,332	
太平電業	6.7	7.6	19,250	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高砂熱学工業	25.1	27.3	50,778
三晃金属工業	1.2	1.4	3,649
朝日工業社	2.1	2.1	6,583
明星工業	18	20.4	16,054
大気社	13.6	15.3	52,632
ダイダン	6.7	7.5	20,512
日比谷総合設備	9.5	10.1	19,331
東芝プラントシステム	21.6	—	—
フィル・カンパニー	—	1.4	5,488
ＯＳＪＢホールディングス	44.9	49.6	13,094
東洋エンジニアリング	12	13.2	7,590
千代田化工建設	72.7	—	—
レイズネクスト	17.9	16.9	21,733
食料品 (3.8%)			
日本製粉	29.8	29.5	48,645
日清製粉グループ本社	101.5	113.8	222,592
日東富士製粉	0.6	0.7	4,354
昭和産業	8.3	9.2	27,922
鳥越製粉	8.3	8.9	7,351
中部飼料	10.9	12.3	20,036
フィード・ワン	60.2	67.6	11,830
東洋精糖	1.4	1.7	2,019
日本甜菜製糖	5.2	5.3	9,789
三井製糖	7.1	8.8	18,321
塩水港精糖	11	10.9	2,463
日新製糖	4.3	4.8	9,638
森永製菓	22.6	23.6	110,684
中村屋	2.3	2.6	10,439
江崎グリコ	27	29.9	140,829
名糖産業	4.3	4.8	6,672
井村屋グループ	3.8	4.3	8,170
不二家	4.8	5.6	12,969
山崎製パン	73.5	75.5	151,528
第一屋製パン	1.9	1.7	1,620
モロゾフ	1.5	1.7	8,364
亀田製菓	5.6	5.7	27,217
寿スピリッツ	9.5	9.7	61,013
カルビー	41	45.9	139,995
森永乳業	18	18.6	75,702

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
六甲バター	6.6	6.7	10,351	
ヤクルト本社	66.6	69.3	373,527	
明治ホールディングス	63.7	66.6	470,862	
雪印メグミルク	21.6	24.2	59,774	
ブリマハム	12.7	15.7	39,045	
日本ハム	38.9	38.5	179,410	
林兼産業	—	3.3	2,267	
丸大食品	9.7	10.7	21,410	
S F o o d s	8	8	21,080	
柿安本店	—	3.5	10,867	
伊藤ハム米久ホールディングス	57.5	64.8	42,897	
サッポロホールディングス	32.9	34.4	85,071	
アサヒグループホールディングス	188.2	210.9	1,017,381	
キリンホールディングス	406.6	427.1	968,022	
宝ホールディングス	67.3	75.4	71,780	
オエノンホールディングス	26	26.6	10,320	
養命酒製造	2.7	3.1	5,986	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	68.8	70.7	207,645	
サントリー食品インターナショナル	60.1	67.4	313,747	
ダイドーグループホールディングス	5.1	5.2	20,462	
伊藤園	27.3	30.6	167,382	
キーコーヒー	8.9	9.9	22,275	
ユニカフェ	2.8	2.6	2,472	
ジャパンフーズ	1.4	1.4	1,689	
日清オイリオグループ	11.5	13	48,230	
不二製油グループ本社	21.9	24.6	67,600	
かどや製油	1	1.1	4,180	
Jーオイルミルズ	4.6	5.2	22,100	
キッコーマン	59.3	72.5	426,300	
味の素	198.5	222.4	441,908	
キュービー	50	56.1	120,727	
ハウス食品グループ本社	34.3	37.7	129,688	
カゴメ	36	38.2	101,764	
焼津水産化学工業	4.5	4.9	4,958	
アリアケジャパン	8.2	9.2	69,000	
ビエトロ	1.4	1.3	2,133	
エバラ食品工業	2.2	2.4	5,232	
やまみ	—	0.6	1,349	
ニチレイ	46.7	48	134,160	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東洋水産	46.2	51.8	235,949
イートアンド	3.2	3.5	6,436
大冷	1.3	1.3	2,537
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2.6	5.5	6,286
日清食品ホールディングス	38.2	42.8	380,920
永谷園ホールディングス	4.6	4.9	10,392
一正蒲鉾	3.8	3.9	3,708
フジッコ	9.6	10.9	20,535
ロック・フィールド	9.6	10.8	15,303
日本たばこ産業	519	581.5	1,318,260
ケンコーマヨネーズ	5.1	5.6	12,387
わらべや日洋ホールディングス	6	6.6	12,111
なとり	5.2	5.6	9,486
イフジ産業	1.9	1.8	1,519
ビックルスコーポレーション	2.2	2.2	5,728
北の達人コーポレーション	35.3	35.2	22,105
ユーグレナ	38.5	43	35,432
ミヨシ油脂	3.1	3.9	4,180
理研ビタミン	4.3	4.8	19,032
繊維製品 (0.6%)			
片倉工業	10.9	14.3	19,047
グンゼ	5.9	7.2	29,772
東洋紡	37.1	38.8	58,200
ユニチカ	26.2	28.8	10,051
富士紡ホールディングス	4.6	4.7	16,074
倉敷紡績	8.3	9.8	22,559
シキボウ	5	5.2	6,552
日本毛織	29.3	32.3	32,687
ダイトウボウ	—	15.9	3,593
トーア紡コーポレーション	4.2	3.9	2,004
ダイドーリミテッド	11.3	12.9	3,418
帝国繊維	9.9	11	24,002
帝人	71.5	80.2	161,282
東レ	680.4	711.6	498,120
サカイオーベックス	2.2	2.6	4,947
住江織物	2.6	2.2	5,130
日本フエルト	4.6	5.6	2,716
イチカワ	1.1	1.4	2,003
日東製網	—	1.1	1,817

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アツギ	7.2	8.1	6,374
ダイニック	3.5	3.7	2,974
セーレン	21.6	24.2	38,357
ソトー	4.1	3.9	3,779
東海染工	1.6	1.4	1,572
小松マテール	14.6	16.1	12,719
ワコールホールディングス	25.5	25.6	71,680
ホギメディカル	10.9	11.2	37,016
レナウン	—	25.2	2,620
クラウドシアホールディングス	2.4	2.4	1,101
T S I ホールディングス	32.6	33	16,335
マツオカコーポレーション	2.8	2.8	5,737
ワールド	8.7	13.9	32,303
三陽商会	5.4	5.1	7,767
ナイガイ	3.5	3.6	1,519
オンワードホールディングス	52.7	59	36,108
ルックホールディングス	3.3	3.4	3,474
キムラタン	—	51.3	1,385
ゴールドウイン	7.9	17.8	127,626
デサント	21.6	19.2	31,353
キング	4.9	4.6	2,580
ヤマトインターナショナル	6.3	6	2,430
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	5.6	6.2	24,769
王子ホールディングス	394.8	410.8	245,247
日本製紙	42	43.5	74,863
三菱製紙	14.7	11.2	4,928
北越コーポレーション	58.1	65.2	32,013
中越パルプ工業	4	4.2	6,207
巴川製紙所	3.2	2.9	2,459
大王製紙	42.7	43.1	62,107
阿波製紙	2.7	2.5	1,295
レンゴー	90.4	92.9	76,085
トーモク	5.3	6	10,236
ザ・バック	6.6	7.4	30,821
化学 (7.1%)			
クラレ	148	154.8	195,357
旭化成	623.9	651.4	667,033
共和レザー	5.2	5.3	4,086

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	58.3	70	185,850	
住友化学	690.4	722	319,124	
住友精化	4.3	4.4	13,926	
日産化学	53.9	55	277,750	
ラサ工業	3.1	3.5	5,005	
クレハ	8.1	8.4	49,980	
多木化学	2.6	2.9	12,832	
テイカ	7.2	7.2	11,743	
石原産業	16.9	17.6	14,484	
片倉コープアグリ	2.6	2.5	3,077	
日東エフシー	5.5	—	—	
日本曹達	13.8	14.5	46,037	
東ソー	135.6	151.9	249,267	
トクヤマ	25.3	28.3	76,834	
セントラル硝子	19.1	20.1	45,727	
東亜合成	55	61.7	75,582	
大阪ソーダ	9.5	10	27,300	
関東電化工業	21	23.3	23,300	
デンカ	34.5	35.9	105,653	
信越化学工業	154.5	168.8	2,320,156	
日本カーバイド工業	3	3.3	4,194	
堺化学工業	5.8	6.4	13,990	
第一稀元素化学工業	7.3	10.6	9,020	
エア・ウォーター	71.8	91.4	139,750	
大陽日酸	72.2	94.4	207,113	
日本化学工業	3	3.1	8,233	
東邦アセチレン	1.3	1.5	2,002	
日本パーカライジング	47.9	49.6	54,659	
高压ガス工業	13.7	15.6	11,731	
チタン工業	1.1	1.2	2,617	
四国化成工業	14.7	15.2	18,422	
戸田工業	1.9	2.3	4,726	
ステラ ケミファ	5.2	5.4	17,442	
保土谷化学工業	3.1	3.7	16,076	
日本触媒	14.7	15.3	92,565	
大日精化工業	7.2	8.7	22,872	
カネカ	23.4	25.4	84,074	
三菱瓦斯化学	90.2	92.8	168,988	
三井化学	79.6	89.2	226,657	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
J S R	88	91.6	194,375	
東京応化工業	15	16.9	74,698	
大阪有機化学工業	8.1	9.1	15,606	
三菱ケミカルホールディングス	586.3	657	517,256	
KHネオケム	13.4	17.3	42,108	
ダイセル	136.2	134.4	134,803	
住友ベークライト	15.2	15.4	55,363	
積水化学工業	191.7	211.3	381,819	
日本ゼオン	79.1	88.6	107,117	
アイカ工業	26.3	29.5	102,512	
宇部興産	44.3	49.6	107,433	
積水樹脂	14.4	17.7	42,002	
タキロンシーアイ	18.9	21.3	13,312	
旭有機材	6.1	5.6	8,982	
日立化成	40.6	45.1	207,685	
ニチバン	4.6	5.2	8,736	
リケンテクノス	24.2	24.7	11,460	
大倉工業	4.5	4.6	7,498	
積水化成成品工業	13.2	13.2	8,936	
群栄化学工業	2.2	2.2	5,387	
タイガースポリマー	4.7	5.2	2,880	
ミライアル	2.7	3.5	4,119	
ダイキアクシス	3.2	3.5	2,856	
ダイキョーニシカワ	18.6	20.7	15,007	
竹本容器	3.2	3.5	2,992	
森六ホールディングス	4.6	5.3	11,389	
日本化薬	55.8	60.8	78,188	
カーリットホールディングス	9.4	10.5	5,827	
日本精化	7	7.9	10,759	
扶桑化学工業	8.9	10	34,200	
トリケミカル研究所	2	2.2	21,010	
A D E K A	43.2	45.2	69,924	
日油	33.8	37	137,270	
新日本理化	16.6	16.3	3,227	
ハリマ化成グループ	7.1	8.1	8,513	
花王	217.4	240.3	2,048,557	
第一工業製薬	3.3	3.7	15,873	
石原ケミカル	2.2	2.7	4,938	
日華化学	2.9	3.3	2,564	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ニイタカ	1.5	1.5	3,907	
三洋化成工業	5.8	5.9	28,526	
有機合成薬品工業	7.5	7.5	3,135	
大日本塗料	9.9	11.1	11,888	
日本ペイントホールディングス	72.4	81.1	406,311	
関西ペイント	98.5	110.4	279,422	
神東塗料	6.6	7.7	1,540	
中国塗料	28.8	28	26,124	
日本特殊塗料	6.6	7.4	8,798	
藤倉化成	12	13.3	7,049	
太陽ホールディングス	7.3	7.2	34,200	
D I C	39.7	41.5	121,470	
サカタインクス	19.2	21.5	24,854	
東洋インキＳＣホールディングス	18.3	20.8	49,753	
T & K T O K A	6.6	7.6	6,992	
富士フイルムホールディングス	186	192.4	1,032,033	
資生堂	177.9	199.4	1,392,809	
ライオン	124.7	130.5	260,869	
高砂香料工業	6.2	6.3	14,546	
マンダム	20.1	22.6	57,652	
ミルボン	11	13.4	78,792	
ファンケル	39.9	40.6	124,642	
コーセー	15.2	18.9	269,892	
コタ	4.4	5.3	7,838	
シーズ・ホールディングス	2.7	—	—	
シーボン	1.1	1.3	3,191	
ポーラ・オルビスホールディングス	38.2	42.8	96,856	
ノエビアホールディングス	5.7	9.6	48,864	
アジupanコスメジャパン	2.1	2.2	2,171	
エステー	6.4	6.4	10,246	
アグロ カネショウ	3.6	3.1	4,367	
コニシ	16	16.5	25,228	
長谷川香料	10.7	13.3	28,954	
星光PMC	6	5.7	5,038	
小林製薬	25.1	28.1	240,817	
荒川化学工業	8	9	13,419	
メック	6.2	6.9	10,639	
日本高純度化学	2.5	2.8	7,450	
タカラバイオ	23.4	26.3	59,148	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
J C U	11.6	12.1	35,840
新田ゼラチン	5.6	6.3	4,032
O A Tアグリオ	1.3	1.7	2,317
デクセリアルズ	23	25.9	23,698
アース製薬	6.7	7.6	46,056
北興化学工業	9.4	10.3	6,437
大成ラミック	2.8	3.3	9,253
クミアイ化学工業	37.1	41.5	34,569
日本農薬	21.4	17.9	9,880
アキレス	6.6	6.9	13,448
有沢製作所	14.1	15.9	14,469
日東電工	67.6	69.2	415,200
レック	9.5	10.7	12,465
三光合成	7.7	11.5	3,852
きもと	15.7	17.1	2,736
藤森工業	8	9	29,565
前澤化成工業	6.1	6.4	7,180
未来工業	4.8	5.4	10,956
ウェーブブロックホールディングス	1.9	3.5	2,425
J S P	5.3	5.9	10,525
エフビコ	7.4	11	75,790
天馬	6.1	6.7	12,830
信越ポリマー	16	18	17,100
東リ	21.9	25	7,300
ニフコ	35.9	36.8	104,953
バルカー	7.3	8.2	19,007
ユニ・チャーム	189.9	193.4	762,963
ショーエイコーポレーション	0.5	1.1	941
医薬品 (6.2%)			
協和キリン	112.2	100.9	273,439
武田薬品工業	567.6	834.9	3,475,688
アステラス製薬	825.6	882.7	1,688,605
大日本住友製薬	66.4	74.4	128,116
塩野義製薬	117.2	128.3	828,689
田辺三菱製薬	93.7	—	—
わかもと製薬	11.6	11.9	3,320
あすか製薬	11.1	11.4	12,665
日本新薬	23.4	26.3	242,486
ビオフェルミン製薬	1.4	1.7	4,035

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中外製薬	93.4	104.6	1,264,091
科研製薬	16.2	17.2	100,104
エーザイ	107.2	120.1	1,077,056
ロート製薬	45.9	51.5	168,405
小野薬品工業	211.5	230.4	585,446
久光製薬	26.5	26.5	146,545
持田製薬	6.8	13.9	59,214
参天製薬	169.8	186.9	365,202
扶桑薬品工業	3.1	3.5	6,842
日本ケミファ	1.2	1.3	3,400
ツムラ	27.7	31.1	87,173
日医工	22.9	28.4	37,374
キッセイ薬品工業	15.7	17.8	50,872
生化学工業	17.6	19.5	23,770
栄研化学	15.8	17.6	38,209
日本製薬	3.7	4.2	5,539
鳥居薬品	4.8	6.3	22,711
J C R ファーマ	6.3	7.1	78,313
東和薬品	4.3	12.8	30,566
富士製薬工業	6	6.8	8,425
沢井製薬	18.4	20.6	145,024
ゼリア新薬工業	17.7	18.2	35,490
第一三共	256.3	287.2	2,215,748
キョーリン製薬ホールディングス	19.7	22.1	47,050
大幸薬品	4.1	4	20,920
ダイト	5.2	5.9	20,060
大塚ホールディングス	170.6	191.2	858,679
大正製薬ホールディングス	20	21.2	153,488
ペプチドリーム	44.6	50.8	263,652
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	72.1	84.8	6,444
昭和シェル石油	69.7	—	—
ニチレキ	11.6	11.8	16,437
ユシロ化学工業	4.3	5.6	7,476
ビービー・カストロール	3.1	3.6	4,939
富士石油	21.9	26.8	6,217
MORESCO	3.4	3.6	4,809
出光興産	75	112.9	327,748
J X T Gホールディングス	1,506.2	1,509.6	706,945

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
コスモエネルギーホールディングス	25.9	29.1	58,200	
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	51.9	58.1	117,187	
TOYO TIRE	46	57.6	93,312	
ブリヂストン	275.2	308.4	1,228,357	
住友ゴム工業	80.4	90.1	112,264	
藤倉コンポジット	8.1	8.8	4,004	
オカモト	6.2	6.1	22,326	
フコク	4.1	4.4	3,027	
ニッタ	10	11.3	32,555	
住友理工	17.3	19.4	16,140	
三ツ星ベルト	11.8	13.2	22,796	
バンドー化学	17.2	17.7	14,460	
ガラス・土石製品 (0.8%)				
日東紡績	13.4	14.9	75,245	
AGC	88.5	99.2	345,216	
日本板硝子	42.7	48	27,216	
石塚硝子	1.3	1.8	4,762	
日本山村硝子	3.6	4.2	4,998	
日本電気硝子	38.7	40.3	82,977	
オハラ	3.6	4	5,096	
住友大阪セメント	18.1	19	79,230	
太平洋セメント	56.6	63.4	186,776	
日本ヒューム	8.6	10.1	7,696	
日本コンクリート工業	19.4	21.6	6,220	
三谷セキサン	4.2	4.7	17,813	
アジアパイルホールディングス	12.9	14.2	7,497	
東海カーボン	81.3	105.1	106,781	
日本カーボン	4.3	5.2	20,800	
東洋炭素	5.3	5.9	11,876	
ノリタケカンパニーリミテド	5.3	5.5	22,935	
TOTO	68.9	71.7	329,820	
日本碍子	109.3	122.5	230,545	
日本特殊陶業	75.5	78.1	150,967	
ダントーホールディングス	—	7.5	847	
MARUWA	3.1	3.9	30,264	
品川リフラクトリーズ	2.4	2.6	7,607	
黒崎播磨	1.8	2	12,640	
ヨータイ	7.8	8	5,384	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
イソライト工業	4.7	5.1	2,835	
東京窯業	11.5	12.8	3,968	
ニッカトー	4.1	4.5	3,028	
フジミインコーポレーテッド	7.9	8.9	27,189	
クニミネ工業	3	4.1	4,940	
エーアンドエーマテリアル	1.8	1.7	2,330	
ニチアス	24.4	27.5	70,015	
ニチハ	12.4	14	35,406	
鉄鋼 (0.7%)				
日本製鉄	411.5	444.1	603,087	
神戸製鋼所	162.1	181.6	82,628	
中山製鋼所	12.4	13.8	6,237	
合同製鐵	4.3	5.3	14,596	
ジェイ エフ イー ホールディングス	239.2	268	296,944	
東京製鐵	47.5	48.3	38,591	
共英製鋼	10	11.2	21,044	
大和工業	18.8	21.1	52,728	
東京鐵鋼	3.8	4.1	5,703	
大阪製鐵	5.9	5.3	8,411	
淀川製鋼所	11.9	13.4	26,491	
丸一鋼管	31.4	32.2	92,059	
モリ工業	2.7	3	7,863	
大同特殊鋼	14.5	16.2	68,931	
日本高周波鋼業	3.4	3.7	1,498	
日本冶金工業	73.5	8.2	16,523	
山陽特殊製鋼	11.2	6.8	9,853	
愛知製鋼	5	5.6	18,760	
日立金属	95.4	106.9	181,195	
日本金属	2.1	2.3	1,851	
大太平洋金属	6	6.7	15,986	
新日本電工	53.2	63.9	10,926	
栗本鐵工所	4.4	4.9	10,343	
虹技	1.3	1.5	1,963	
日本鑄鉄管	1.1	1	1,549	
三菱製鋼	6.6	7.3	7,154	
日亜鋼業	12.7	14.5	4,480	
日本精線	1.3	1.6	5,744	
エンビプロ・ホールディングス	2.5	4.2	2,885	
シンニッタン	14.1	15.4	6,036	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
新家工業	2	2.3	3,215	
非鉄金属 (0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	14.4	16.3	10,774	
日本軽金属ホールディングス	241.3	251.1	53,986	
三井金属鉱業	23.9	26.8	78,282	
東邦亜鉛	4.9	5.1	9,378	
三菱マテリアル	58.5	65.5	180,976	
住友金属鉱山	121.3	126.8	388,388	
DOWAホールディングス	20.7	25.1	98,894	
古河機械金属	14.7	17.6	23,513	
エス・サイエンス	—	43.9	2,151	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10.3	10.3	13,317	
東邦チタニウム	15.9	17.8	15,041	
UACJ	13.4	15.1	31,936	
CKサンエツ	1.7	2.1	7,045	
古河電気工業	25.5	30.8	79,217	
住友電気工業	331.1	371	541,103	
フジクラ	106.8	119.8	46,123	
昭和電線ホールディングス	10.5	11.5	14,973	
東京特殊電線	1.2	1.5	3,861	
タツタ電線	17.7	19.7	11,406	
カナレ電気	1.4	1.6	2,856	
平河ヒューテック	3.7	3.7	4,872	
リョービ	10.9	12.2	20,313	
アーレスティ	10.9	13	6,500	
アサヒホールディングス	16.6	17.4	47,032	
金属製品 (0.6%)				
稲葉製作所	5.2	5.6	7,470	
宮地エンジニアリンググループ	2.7	3	6,129	
トーカロ	22.8	27.6	31,050	
アルファC o	3.2	3.5	4,112	
SUMCO	97.8	118.8	222,037	
川田テクノロジーズ	2	2	12,380	
RS Technologies	1.8	2.8	7,803	
信和	—	4.2	4,431	
東洋製織グループホールディングス	56.4	63.2	125,578	
ホッカンホールディングス	4.5	5.5	9,977	
コロナ	4.7	5.5	5,450	
横河ブリッジホールディングス	16.5	18.5	41,033	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
駒井ハルテック	1.7	1.9	3,180	
高田機工	0.8	0.9	2,515	
三和ホールディングス	91.5	95.2	105,291	
文化シヤッター	26.3	29.2	24,411	
三協立山	12.4	12.8	16,742	
アルインコ	6.9	7.2	7,855	
東洋シヤッター	2.3	2.4	1,572	
L I X I L グループ	130.7	146.4	279,184	
日本フィルコン	7.2	7.6	3,876	
ノーリツ	19.7	20.6	26,903	
長府製作所	9.1	10.1	22,634	
リンナイ	15.8	19.3	157,681	
ダイニチ工業	4.9	5.3	3,519	
日東精工	12.4	13.7	7,206	
三洋工業	1.4	1.3	2,570	
岡部	18	20.1	17,125	
ジーテクト	9.7	12.3	17,958	
中国工業	1.5	—	—	
東ブレ	16.4	18.5	29,692	
高周波熱練	17.2	19.1	15,547	
東京製綱	5.6	7.1	6,716	
サンコール	5.1	5.6	3,068	
モリテック スチール	7.1	7.7	2,564	
パイオラックス	14.2	14.7	26,562	
エイチワン	8.7	9.7	6,469	
日本発條	88.2	106.5	96,915	
中央発條	1	1.2	3,372	
アドバネクス	1.2	1.4	2,081	
立川ブラインド工業	3.9	4.4	5,337	
三益半導体工業	7.9	7.7	17,140	
機械 (5.0%)				
日本ドライケミカル	2.4	2.5	4,422	
日本製鋼所	26.9	30.1	54,782	
三浦工業	38.3	42.9	164,736	
タクマ	32.2	33.6	41,664	
ツガミ	20	20.6	20,146	
オークマ	11.3	11.6	58,000	
東芝機械	10	11.2	35,616	
アマダホールディングス	136.7	126.2	137,053	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アイダエンジニアリング	24.8	26	22,828	
滝澤鉄工所	2.9	3.1	3,983	
F U J I	26.4	42.7	81,514	
牧野フライス製作所	10.4	11.6	47,154	
オーエスジー	43.6	45.9	81,656	
ダイジェット工業	1.1	1.1	1,516	
旭ダイヤモンド工業	23.3	26	14,846	
DMG森精機	56	62.8	95,958	
ソディック	19.5	23.3	19,036	
ディスコ	12	13.4	331,516	
日東工器	4.8	5.4	13,176	
日進工具	2.6	2.9	8,172	
パンチ工業	6.2	9	3,681	
富士ダイス	3.9	4.4	2,767	
豊和工業	5	5.5	4,229	
OKK	3.8	4.1	2,460	
石川製作所	2.2	2.4	3,535	
東洋機械金属	6.3	7.1	3,557	
津田駒工業	1.9	1.9	1,905	
エンシュウ	—	2.4	2,668	
島精機製作所	12.2	16	30,848	
オプトラン	8.7	11.1	36,241	
NCホールディングス	3.6	3	1,944	
イワキポンプ	—	4.7	5,024	
ブリュー	7.3	9.7	11,232	
ヤマシンフィルタ	15.5	21.6	14,947	
日阪製作所	10.9	12.2	11,419	
やまびこ	17	19.2	19,276	
平田機工	4.2	4.7	27,401	
ベガサスミシン製造	8.4	10.1	4,605	
マルマエ	2.4	4.1	3,673	
タツモ	2.8	4.6	6,026	
ナブテスコ	48.7	58.5	189,832	
三井海洋開発	9.4	10.5	20,895	
レオン自動車機	8.7	9.7	12,998	
SMC	26.2	31.5	1,550,745	
ヤマハモーターロボティクスホールディング	6.6	8.6	6,432	
ホソカワミクロン	3.1	3.5	18,830	
ユニオンツール	3.8	3.7	11,048	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
オイレス工業	12.3	12.8	19,763	
日精エー・エス・ビー機械	2.6	3.3	13,563	
サトーホールディングス	10.7	14.1	38,690	
技研製作所	6.2	8.7	38,410	
日本エアーテック	3	3.1	3,196	
カワタ	1.8	2.9	2,911	
日精樹脂工業	7.5	8.3	7,710	
オカダアイオン	3	3.1	3,348	
ワイエイシイホールディングス	3.3	4.3	2,584	
小松製作所	405.5	454.5	1,045,350	
住友重機械工業	51.3	57.4	153,028	
日立建機	35.9	40.2	118,670	
日工	2.5	13.7	10,631	
巴工業	3.8	4.3	9,137	
井関農機	9	10	13,590	
TOWA	7.6	10.1	11,221	
丸山製作所	1.9	2.2	3,550	
北川鉄工所	4	4.5	8,914	
ローツェ	3.9	4.4	17,446	
タカキタ	3.2	3.5	1,848	
クボタ	479.7	532.4	855,566	
荏原実業	2.7	2.5	5,005	
三菱化工機	3.1	3.5	6,695	
月島機械	17.7	18.5	24,919	
帝国電機製作所	6.3	8.3	12,134	
東京機械製作所	—	4.1	1,381	
新東工業	21.5	23.8	21,420	
澁谷工業	7.8	8.8	24,068	
アイチ コーポレーション	15.2	17.3	12,023	
小森コーポレーション	24.1	25.4	23,444	
鶴見製作所	7	7.8	14,656	
住友精密工業	1.5	1.5	4,492	
日本ギア工業	—	3	1,155	
酒井重工業	1.7	1.9	4,978	
荏原製作所	39.7	41.5	117,445	
石井鐵工所	1.5	1.3	3,719	
西島製作所	9.2	10.1	8,494	
北越工業	9.2	10.3	13,359	
ダイキン工業	122.2	127.8	1,973,871	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
オルガノ	3.2	3.6	24,804	
トーヨーカネツ	3.4	4.4	10,797	
栗田工業	48.5	54.3	175,660	
椿本チエイン	11.6	14.3	46,046	
大同工業	4.2	4.8	3,705	
木村化工機	7.4	8.3	4,623	
アネスト岩田	14	15.6	15,974	
ダイフク	49.3	51.3	357,561	
サムコ	2.6	2.8	5,376	
加藤製作所	4.6	5.5	8,002	
油研工業	1.6	1.7	2,849	
タダノ	43.2	48.4	49,077	
フジテック	32.4	36.5	62,050	
CKD	24.9	27.9	54,851	
キトー	6.8	7.6	12,783	
平和	25	28	63,000	
理想科学工業	8	8.9	17,159	
SANKYO	22.4	22.3	86,858	
日本金銭機械	10.2	11.1	8,658	
マースグループホールディングス	5.8	6.4	12,748	
フクシマガリレイ	5.5	6.2	24,955	
オーイズミ	4.5	4.2	2,280	
ダイコク電機	4.4	4.6	6,361	
竹内製作所	15	16.8	32,104	
アマノ	25.6	26.3	75,770	
JUKI	12.5	14	11,228	
サンデンホールディングス	11.2	13.1	8,174	
蛇の目マシン工業	8.1	9.1	3,549	
マックス	13.8	15.3	30,707	
グローリー	24.8	25.8	81,528	
新晃工業	8.4	9.3	15,475	
大和冷機工業	13	14.5	15,529	
セガサミーホールディングス	88.8	99.5	165,170	
日本ビストンリング	3.3	3.7	5,298	
リケン	4.1	4.6	15,663	
TPR	12	13.5	22,261	
ツバキ・ナカシマ	13.6	20.5	24,559	
ホシザキ	26.2	29.3	307,064	
大豊工業	7.4	8.2	5,559	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本精工	183.9	188.9	171,521
N T N	192.4	232.2	68,266
ジェイテクト	85.9	96.3	111,611
不二越	8.3	9.3	37,386
日本トムソン	26.7	29.8	12,784
T H K	55.8	58.4	161,300
ユーシン精機	7.1	7.8	7,012
前澤給装工業	3.5	3.6	7,912
イーグル工業	11.1	12.4	11,581
前澤工業	6	6.7	2,586
日本ビラー工業	9	10.1	15,240
キッツ	36.2	40.7	28,978
マキタ	109	130.9	540,617
日立造船	71.4	79.5	33,708
三菱重工業	150.1	168.2	632,768
I H I	68.8	72.3	197,885
スター精密	15.2	15.5	20,584
電気機器 (14.6%)			
日清紡ホールディングス	49.6	66.9	69,442
イビデン	54.8	61.4	167,990
コニカミノルタ	195.7	219.2	143,356
ブラザー工業	116.6	122.5	262,395
ミネベアミツミ	166.2	186.3	404,643
日立製作所	403.1	482.2	2,019,935
三菱電機	895.4	1,003.4	1,571,826
富士電機	58.1	60.5	204,792
東洋電機製造	3.6	3.6	5,014
安川電機	103.8	108	403,380
シンフォニアテクノロジー	12.5	13	15,405
明電舎	17.7	18.4	36,450
オリジン	2.5	2.7	4,012
山洋電気	4.3	4.8	24,672
デンヨー	8.3	8.5	17,348
東芝テック	11.3	12.6	52,416
芝浦メカトロニクス	1.6	1.8	6,102
マブチモーター	24.8	27.8	115,648
日本電産	107.8	120.7	1,698,852
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4.8	6	2,328
トレックス・セミコンダクター	3	5.8	8,624

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
東光高岳	4.6	5.6	6,395	
ダブル・スコープ	13.1	15.9	11,845	
宮越ホールディングス	—	3.7	3,111	
ダイヘン	9.8	11	36,355	
ヤーマン	13	16.4	10,282	
JVCケンウッド	69.8	81.7	20,588	
ミマキエンジニアリング	8.2	9	4,491	
第一精工	3.7	4.1	9,983	
日新電機	21	23.5	26,343	
大崎電気工業	18	20	12,040	
オムロン	95.2	90	604,800	
日東工業	14.4	14.7	31,546	
I D E C	12	14.5	26,868	
正興電機製作所	1.6	2.4	3,151	
不二電機工業	0.9	1.2	1,446	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	32.2	33.5	71,589	
サクサホールディングス	2.4	2.3	4,229	
メルコホールディングス	3.7	3.5	8,879	
テクノメディカ	2	2.3	4,726	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	—	1.6	1,398	
日本電気	115.9	121.7	583,551	
富士通	86.3	96.7	1,221,321	
沖電気工業	38.8	40.8	54,264	
岩崎通信機	4.6	4.4	3,581	
電気興業	4.8	4.8	15,816	
サンケン電気	10.5	10.9	31,642	
ナカヨ	2.1	1.9	3,085	
アイホン	5.1	5.7	9,553	
ルネサスエレクトロニクス	92.8	479.5	373,530	
セイコーエプソン	111.1	124.5	210,529	
ワコム	65.1	67.5	26,190	
アルバック	17.8	18.5	66,877	
アクセル	3.8	4.2	3,717	
E I Z O	8.2	7.8	29,094	
ジャパンディスプレイ	213.4	290	20,590	
日本信号	22.8	25.5	34,629	
京三製作所	19.1	23.5	13,042	
能美防災	11.9	13.3	31,042	
ホーチキ	5.7	7.3	10,037	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
星和電機	3.7	4.9	3,028	
エレコム	8.3	11	43,450	
パナソニック	1,023	1,146.5	1,363,188	
シャープ	88.8	116.1	173,105	
アンリツ	57.6	64.6	130,685	
富士通ゼネラル	27.4	27.2	66,204	
ソニー	600.6	634.5	4,772,709	
T D K	46.8	48.4	554,180	
帝国通信工業	4.1	4.4	5,412	
タムラ製作所	35.1	33.5	19,229	
アルプスアルパイン	93.2	88.8	163,036	
池上通信機	—	3.2	3,248	
パイオニア	155.5	—	—	
日本電波工業	8.5	9.1	4,368	
鈴木	4.8	4.9	4,277	
日本トリム	1.7	1.3	5,024	
ローランド ディー・ジー	4.7	5.5	10,092	
フォスター電機	10.6	10.5	16,222	
クラリオン	7.3	—	—	
SMK	2.5	2.6	7,363	
ヨコオ	6.4	6.5	19,201	
ティアック	—	7.2	1,310	
ホシデン	26.4	27.4	29,975	
ヒロセ電機	12.8	15.5	199,795	
日本航空電子工業	20.6	23	44,183	
T O A	9.7	10.8	11,070	
マクセルホールディングス	19.3	21.6	30,520	
古野電気	11.6	12.9	13,661	
ユニデンホールディングス	2.7	2.8	5,740	
スミダコーポレーション	7.7	7.7	8,577	
アイコム	5.1	5.6	14,442	
リオン	4.2	4.2	11,848	
本多通信工業	7.9	8.6	4,411	
船井電機	9.6	10.1	7,140	
横河電機	89.6	92.1	178,581	
新電元工業	3.2	3.5	11,970	
アズビル	57.8	63.3	185,912	
東亜ディーケーケー	4.5	5	4,885	
日本光電工業	39.5	41.5	145,665	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
チノー	3.2	3.5	4,445	
共和電業	9.7	10.5	4,546	
日本電子材料	3.6	4	3,996	
堀場製作所	17.7	19.9	136,116	
アドバンテス	61	74.6	418,506	
小野測器	4.2	4.2	2,448	
エスベック	8	8.9	19,437	
キーエンス	44	90.9	3,486,015	
日置電機	4.7	5.2	19,214	
シスメックス	69.8	71.7	533,734	
日本マイクロニクス	14.7	17.5	19,022	
メガチップス	7.1	9.3	16,740	
OBARA GROUP	5.2	5.2	16,068	
澤藤電機	1.1	1.2	2,341	
原田工業	2.8	4.7	4,497	
コーセル	11.5	13.4	15,316	
イリソ電子工業	8.2	8.4	34,104	
オブテックスグループ	15.8	16.5	24,964	
千代田インテグレ	3.8	4.6	9,742	
アイ・オー・データ機器	3.3	3.2	2,908	
レーザーテック	18.3	44.1	248,283	
スタンレー電気	63.3	70.6	206,152	
岩崎電気	3.5	3.9	6,372	
ウシオ電機	54.3	58.3	85,992	
岡谷電機産業	6.6	7.9	2,867	
ヘリオス テクノ ホールディング	8.3	9.2	3,634	
エノモト	1.9	3	3,627	
日本セラミック	9.1	10.2	25,122	
遠藤照明	4.6	5.1	3,498	
古河電池	6.4	7.2	5,040	
双信電機	4.6	4.9	2,018	
山一電機	6.5	7.3	13,702	
図研	5.9	6.5	15,769	
日本電子	17.7	19.8	66,627	
カシオ計算機	79.2	88.8	186,480	
ファナック	85.1	95.3	1,950,791	
日本シイエムケイ	22.9	23.6	13,216	
エンプラス	4.1	5.1	15,264	
大真空	3.4	3.7	6,341	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ローム	43.3	44.6	367,058
浜松ホトニクス	64.2	72	332,280
三井ハイテック	10	11.1	17,882
新光電気工業	30.1	33.7	45,865
京セラ	136.5	141.2	1,055,046
太陽誘電	39.8	44.6	155,431
村田製作所	93.9	294.8	1,853,997
ユーシン	13.6	—	—
双葉電子工業	14.8	15.9	18,841
北陸電気工業	3.5	4	4,164
ニチコン	28.3	34	29,818
日本ケミコン	6.4	7.6	13,573
K O A	13.5	15.1	17,893
市光工業	13.4	15	10,740
小糸製作所	53.6	60.1	279,765
ミツバ	16.7	18.5	13,431
S C R E E Nホールディングス	15.5	17.4	108,054
キャノン電子	8.2	10.5	21,283
キャノン	482.1	540.2	1,505,807
リコー	269.2	255.3	283,638
象印マホービン	16.8	29.4	56,330
M U T O Hホールディングス	1.3	1.4	2,363
東京エレクトロン	59.7	66.9	1,683,538
輸送用機器 (7.7%)			
トヨタ紡織	31.3	29.2	47,420
芦森工業	1.9	2.1	2,669
ユニプレス	17.3	19.4	25,142
豊田自動織機	72.5	81.2	514,808
モリタホールディングス	15.6	17.5	30,905
三櫻工業	11.6	12.7	12,877
デンソー	197.2	220.9	986,760
東海理化電機製作所	23.4	26.4	47,995
三井E&Sホールディングス	32.4	36.2	31,783
川崎重工業	69.7	78.1	173,303
名村造船所	27.3	32.3	7,848
サノヤスホールディングス	13.1	12.2	2,098
日本車輛製造	3.3	3.7	10,619
三菱ロジスネクスト	10.7	13.3	22,330
近畿車輛	1.3	1.5	2,035

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日産自動車	1,056.1	1,183.4	596,906	
いすゞ自動車	283.1	290.8	330,639	
トヨタ自動車	997.9	1,119.6	8,679,139	
日野自動車	111.8	125.3	126,553	
三菱自動車工業	331.5	371.4	150,417	
エフテック	6.2	7	5,166	
レシップホールディングス	3.7	3.9	2,402	
GMB	1.8	1.8	1,456	
ファルテック	1.9	1.8	1,771	
武蔵精密工業	21.7	22.3	29,948	
日産車体	17.5	19.6	21,030	
新明和工業	40.2	27	34,722	
極東開発工業	17.7	18.6	25,761	
日信工業	16.7	20.2	45,248	
トビー工業	7.4	8.3	14,276	
ティラド	3.3	3.6	6,372	
曙ブレーキ工業	50.6	55.1	13,113	
タチエス	15.1	16.5	20,658	
NOK	48.1	53.9	84,299	
フタバ産業	25.3	27.9	17,298	
KYB	9.3	11.2	30,520	
大同メタル工業	14.6	19.2	12,825	
プレス工業	44.3	49.7	17,494	
ミクニ	11.6	12.7	4,064	
太平洋工業	18.9	21	27,153	
ケーヒン	20.5	23.2	60,018	
河西工業	10.9	13.5	9,990	
アイシン精機	73.7	82.6	322,553	
マツダ	281	295.3	265,179	
今仙電機製作所	8.4	9.3	7,942	
本田技研工業	755.4	790.1	2,402,694	
スズキ	163.8	198.9	964,665	
SUBARU	278	311.5	910,358	
安永	4.4	4.8	5,481	
ヤマハ発動機	126.5	130.9	254,731	
ショーク	21.1	23.4	53,492	
TBK	10.3	11.9	5,081	
エクセディ	12.1	13.6	30,287	
豊田合成	28.9	32.4	81,032	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
愛三工業	14.1	15.7	10,880	
盟和産業	1.7	1.5	1,584	
日本ブラスト	7.2	7.9	5,182	
ヨロズ	8.2	9.4	13,592	
エフ・シー・シー	16.1	16.4	34,997	
シマノ	36.1	37.6	584,680	
テイ・エス テック	20.8	23.3	71,997	
ジャムコ	4.5	5	6,485	
精密機器 (2.4%)				
テルモ	126.7	283.9	1,091,311	
クリエートメディック	3	3.3	3,643	
日機装	28.8	30.1	33,380	
日本エム・ディ・エム	—	5.8	11,124	
島津製作所	115.2	119.9	344,952	
JMS	8.4	8.5	7,140	
クボテック	—	2.6	1,008	
長野計器	7.1	7.3	7,124	
プイ・テクノロジー	2.1	4.7	20,962	
東京計器	5.8	6.4	5,747	
愛知時計電機	1.2	1.3	5,642	
インターアクション	4.2	5.4	14,909	
オーバル	8.8	9	2,079	
東京精密	16.2	18.2	70,525	
マニー	10.9	40	101,920	
ニコン	156	162.4	194,068	
トプコン	48.1	50.5	61,963	
オリンパス	133.4	555.2	1,171,472	
理研計器	7.9	8.8	19,624	
タムロン	8.1	8.1	21,853	
HOYA	180.3	200.4	2,043,078	
シード	3.8	4.3	4,132	
ノーリツ銅機	7	6.8	10,268	
エー・アンド・デイ	8.3	9.1	9,172	
朝日インテック	38	85.2	241,116	
シチズン時計	98	117.5	57,222	
リズム時計工業	2.9	3.1	2,728	
大研医器	7.2	6.9	4,678	
メニコン	12.2	13.8	69,414	
シンシア	1.4	1.1	610	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
松風	4.1	4.5	8,815
セイコーホールディングス	13.9	14.2	32,475
ニプロ	62	69.4	86,056
その他製品 (2.2%)			
中本バックス	2.4	2.5	3,955
スノーピーク	3.5	4.9	4,169
パラマウントベッドホールディングス	10.2	10.6	48,442
トランザクション	4.9	6.4	6,867
粧美堂	3.3	2.9	1,133
ニホンフラッシュ	3.9	4.7	11,980
前田工繊	9.8	11.1	23,654
永大産業	12.3	13.1	4,270
アートネイチャー	10.1	10.7	7,843
バンダイナムコホールディングス	92.6	103.7	612,867
アイフィスジャパン	2.3	2.6	1,838
共立印刷	13.4	16.7	2,788
SHOEI	4.3	4.8	25,776
フランスベッドホールディングス	12.5	14.2	13,021
パイロットコーポレーション	15.6	16.4	68,798
萩原工業	5	5.6	9,195
トッパン・フォームズ	19	21.5	24,832
フジシールインターナショナル	20.1	22.5	47,430
タカラトミー	37.5	45	47,655
廣済堂	8.6	7	6,083
エステールホールディングス	2.5	2.7	1,841
アーク	34.7	38.3	3,447
タカノ	3.1	3.9	2,889
プロネクス	7.6	8.6	9,735
ホクシン	8.1	6.2	899
ウッドワン	3.1	3.4	3,631
大建工業	6.8	6.7	12,696
凸版印刷	126.4	141.6	288,580
大日本印刷	126.2	131.3	385,496
図書印刷	8.4	—	—
共同印刷	2.6	3.1	8,862
NISSHA	18.5	20.6	20,352
光村印刷	0.8	0.9	1,490
TAKARA & COMPANY	4.4	4.8	7,944
アシックス	88.9	82.8	110,620

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツツミ	2.8	3.1	6,116
小松ウオール工業	2.6	3.1	6,426
ヤマハ	53.3	59.7	351,036
河合楽器製作所	2.8	3.1	9,346
クリナップ	8.3	9.3	5,580
ビジョン	54.1	60.6	238,158
オリバー	—	2.1	7,822
兼松サステック	0.7	0.6	1,095
キングジム	7.6	8.3	6,972
リンテック	21.2	23.9	60,801
イトーキ	16.6	21.3	8,988
任天堂	55.1	61.5	2,466,150
三菱鉛筆	14.7	16.5	26,235
タカラスタンダード	18.5	20.7	35,521
コクヨ	43	48.1	76,430
ナカバヤシ	9	9.9	5,969
グローブライド	4.3	4.5	9,936
オカムラ	31.2	35	35,210
美津濃	8.9	9.1	22,795
電気・ガス業 (1.5%)			
東京電力ホールディングス	714.9	801	349,236
中部電力	274	307	466,947
関西電力	365.4	380.2	482,093
中国電力	123.8	138.7	203,889
北陸電力	87.7	91.7	76,202
東北電力	209.7	250.7	255,964
四国電力	80.6	90.4	79,190
九州電力	184.6	206.8	176,400
北海道電力	83.8	93.9	48,734
沖縄電力	16.5	18.6	37,367
電源開発	71.2	79.8	201,574
エフオン	4.2	5.4	3,547
イーレックス	15.6	14.3	21,164
レノバ	11	16.6	18,791
東京瓦斯	175.7	193	459,147
大阪瓦斯	173.8	194.7	365,062
東邦瓦斯	44.4	49.4	202,046
北海道瓦斯	4.8	5.4	8,640
広島ガス	18	20.7	7,017

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西部瓦斯	10.1	11.3	26,668
静岡ガス	27.7	28.5	27,189
メタウォーター	4.3	4.8	19,680
陸運業 (4.1%)			
SBSホールディングス	8.8	8.7	15,799
東武鉄道	94.4	105.8	379,822
相鉄ホールディングス	30.7	32.1	86,894
東急	243.2	253.1	469,753
京浜急行電鉄	122.7	128.9	233,824
小田急電鉄	143.4	149.2	343,756
京王電鉄	50	52.1	304,264
京成電鉄	67.1	69.8	273,267
富士急行	12.2	13.7	46,306
新京成電鉄	2.2	2.6	6,216
東日本旅客鉄道	159.2	176.6	1,591,872
西日本旅客鉄道	80.3	89.4	780,640
東海旅客鉄道	80.2	83.4	1,728,465
西武ホールディングス	114.1	134.6	225,455
鴻池運輸	14.1	16	23,536
西日本鉄道	24.8	27.8	72,280
ハマキョウレックス	6.9	7.7	24,409
サカイ引越センター	4.7	5.3	32,118
近鉄グループホールディングス	84.8	95	491,150
阪急阪神ホールディングス	113.1	126.8	507,834
南海電気鉄道	37.8	45	119,475
京阪ホールディングス	37.8	42.3	201,136
神戸電鉄	2.2	2.3	9,096
名古屋鉄道	67.9	78.1	239,376
山陽電気鉄道	6.6	6.8	14,334
日本通運	33.3	33.6	197,904
ヤマトホールディングス	148.7	166.6	321,038
山九	23.6	26.4	134,640
丸運	5.3	5.4	1,663
丸全昭和運輸	6.8	7.7	21,275
センコーグループホールディングス	46.7	52.4	45,430
トナミホールディングス	2	2.3	11,166
ニッコンホールディングス	32.3	34	81,736
日本石油輸送	1.1	1	3,095
福山通運	10.8	12.2	43,859

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セイノーホールディングス	63.5	71.2	95,479
エスライン	2.4	2.9	2,856
神奈川中央交通	2.1	2.4	9,420
日立物流	18.6	17.4	54,114
丸和運輸機関	4.5	10	19,920
C＆F ロジホールディングス	8.6	9.6	12,144
九州旅客鉄道	71.2	84.7	306,614
S Gホールディングス	80.1	99.8	222,454
海運業 (0.2%)			
日本郵船	70.9	79.5	138,807
商船三井	50.3	60.1	154,156
川崎汽船	26.3	29.3	43,539
N Sユナイテッド海運	4.7	5.2	9,588
明治海運	9.2	10.1	3,585
飯野海運	40.8	45	16,065
共栄タンカー	0.9	1.7	1,567
乾汽船	7.7	5.5	6,550
空運業 (0.5%)			
日本航空	155.3	171.1	513,043
A N Aホールディングス	155	173.7	568,346
パスコ	1.9	1.8	3,477
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	2.4	2.7	21,006
日新	7.3	8.2	13,841
三菱倉庫	29.3	30.1	87,530
三井倉庫ホールディングス	10.4	10.9	18,944
住友倉庫	31.7	35	50,400
澁澤倉庫	4.5	5.2	10,769
東陽倉庫	16.2	17.2	5,332
日本トランスシティ	18.6	20.9	9,969
ケイヒン	1.8	1.8	2,426
中央倉庫	5.1	5.8	6,559
川西倉庫	1.8	1.7	1,759
安田倉庫	7	7.8	7,823
ファイズホールディングス	1.1	2	1,616
東洋埠頭	2.5	2.9	3,981
宇徳	7.5	8.1	4,131
上組	52.3	54.4	123,270
サンリツ	2.2	2.2	1,463

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キムラユニティー	2.1	2.5	2,745
キューソー流通システム	2.1	2.4	4,519
近鉄エクスプレス	15.9	20.2	38,319
東海運	5.8	5.4	1,522
エーアイティー	5.7	6.7	6,432
内外トランスライン	2.6	3.3	3,976
日本コンセプト	2.4	3	4,206
情報・通信業 (9.3%)			
NECネットエスアイ	9.6	9.3	39,246
クロスキャット	1.7	2.6	3,096
システナ	31.3	35.1	58,055
デジタルアーツ	4.7	4.8	26,256
日鉄ソリューションズ	13.1	14.8	49,358
キューブシステム	4.6	5.2	3,796
エイジア	1.8	1.8	2,817
コア	3.7	4.2	5,619
ソリトンシステムズ	5	4.3	5,065
ソフトクリエイトホールディングス	3.9	4.3	7,593
T I S	29.3	32.8	233,536
ネオス	3.3	3.9	2,609
電算システム	3.4	3.8	9,887
グリー	60.9	60.4	27,602
コーエーテクモホールディングス	18	20.1	61,908
三菱総合研究所	3.4	4.2	17,304
ボルテージ	1.6	2.1	1,064
電算	0.9	1.1	2,476
AGS	5.1	5.6	4,435
ファインデックス	7.6	8.3	7,345
ヒト・コミュニケーションズ	2	—	—
ブレインパッド	1.7	2.5	12,725
KL a b	15.9	19	14,421
ポルトゥワイン・ビットクルーホールディ	11.7	11.9	11,638
イーブックイニシアティブジャパン	1.4	1.4	2,287
ネクソン	223.8	280.4	511,169
アイスタイル	22.5	27.6	9,660
エムアップ	3	2.8	7,644
エイチーム	5.5	6.8	6,038
エニグモ	—	7	5,803
テクノスジャパン	7.5	7.6	3,769

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
e n i s h	—	4.4	2,239	
コロブラ	25.5	32.2	30,493	
オルトプラス	—	7.3	6,686	
ブロードリーフ	43.4	48.8	25,522	
クロス・マーケティンググループ	2.5	4.4	1,892	
デジタルハーツホールディングス	4	5.2	5,018	
システム情報	—	5	4,180	
メディアドゥホールディングス	2.7	3.1	9,548	
じげん	9.3	24.4	10,687	
ブイキューブ	5	6	3,996	
エンカレッジ・テクノロジー	—	1.6	1,411	
サイバーリンクス	1.5	1.5	1,560	
ディー・エル・イー	—	7.9	1,295	
フィックスターズ	8.4	10.5	14,164	
CARTA HOLDINGS	4.7	4.8	5,275	
オブティム	1.9	2.6	12,090	
セレス	2.9	3.2	4,096	
SHIFT	—	2.6	18,772	
ベリサープ	0.9	—	—	
ティーガイア	8.7	8.7	20,131	
セック	1.4	1.4	5,138	
日本アジアグループ	9.2	10.4	3,660	
豆蔵ホールディングス	6	6.6	12,414	
テクマトリックス	6.2	6.9	19,527	
プロシップ	2.5	2.8	3,886	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	211.8	23.7	43,584	
GMOペイメントゲートウェイ	14.5	16.2	122,310	
ザッパラス	4.6	4.3	1,526	
システムリサーチ	1.2	2.6	5,244	
インターネットイニシアティブ	14.3	14.6	48,764	
さくらインターネット	10.9	10.5	6,457	
ヴィンクス	3	2.8	2,772	
GMOクラウド	2	1.8	4,462	
SRAホールディングス	4.6	5.2	13,410	
M i n o r i ソリューションズ	1.7	—	—	
システムインテグレータ	2.5	3.1	2,870	
朝日ネット	6.9	7	4,991	
e B A S E	2.6	5.9	10,059	
アバント	3.1	7	6,727	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アドソル日進	3.1	3.5	8,547	
フリービット	5.2	5.1	4,095	
コムチュア	4.9	11	24,838	
サイバーコム	1.6	1.7	3,230	
アステリア	4.5	6	3,174	
アイル	—	3.5	6,391	
マークラインズ	3	4.9	9,790	
メディカル・データ・ビジョン	7.8	7.5	6,937	
g u m i	11.3	12.6	9,147	
ショーケース	2	2.3	1,543	
モバイルファクトリー	2.5	2.2	4,070	
テラスカイ	0.5	3.5	11,357	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3.9	3.9	6,454	
P C I ホールディングス	1.6	2	4,500	
パイブドHD	1.4	1.3	2,169	
アイピーシー	1.5	1.8	1,980	
ネオジャパン	1.7	1.8	2,511	
P R T I M E S	0.6	0.8	2,064	
ランドコンピュータ	1.1	1.5	1,795	
ダブルスタンダード	0.6	1.3	5,226	
オープンドア	4.4	4.9	5,929	
マイネット	2.9	3.2	1,772	
アカツキ	3.1	3.5	16,555	
ベネフィットジャパン	0.6	0.7	1,100	
U b i c o mホールディングス	1.6	2.2	2,901	
L I N E	26.7	22.4	120,288	
カナミックネットワーク	1.3	6	4,122	
ノムラシステムコーポレーション	0.8	2.2	1,025	
チェンジ	1.1	2	8,520	
シンクロ・フード	3.8	4.2	1,801	
オークネット	4.6	6.1	7,265	
セグエグループ	—	1.6	1,472	
エイトレッド	—	1.2	1,651	
A O I T Y O H o l d i n g s	9.7	9.9	7,335	
マクロミル	15.6	20.1	20,863	
ピーグリー	1.7	1.9	2,861	
オロ	0.9	2.6	8,671	
ユーザーローカル	—	0.7	2,380	
デモナ	—	1.3	908	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ニーズウェル	—	1.2	868	
サインポスト	—	1.5	2,997	
ソルクシーズ	3.8	4.2	3,620	
フェイス	3.4	3.4	2,648	
プロトコーポレーション	—	8.8	11,783	
ハイマックス	1	1.2	2,340	
野村総合研究所	55.9	139.6	368,544	
サイバネットシステム	7.6	7	5,446	
C E ホールディングス	2.5	5.6	2,665	
日本システム技術	1.4	1.6	1,995	
インテージホールディングス	11.3	12.3	10,282	
東邦システムサイエンス	2.7	2.6	2,358	
ソースネクスト	34.1	46.7	18,773	
インフォコム	3.6	10.8	30,250	
HEROZ	—	1	5,000	
ラクスル	—	5.2	17,914	
F I G	8.2	10.7	3,081	
システムサポート	—	0.8	2,616	
イーソル	—	3.5	6,573	
アルテリア・ネットワークス	7.3	10.9	20,699	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	—	2.2	3,414	
フォーカスシステムズ	5.9	6.1	5,441	
クレスコ	2.7	6	11,658	
フジ・メディア・ホールディングス	91.2	94.8	134,710	
オービック	30.5	34.1	498,883	
ジャストシステム	12.5	16	82,080	
T D C ソフト	7.6	8.6	7,989	
Z ホールディングス	572.9	1,352.2	571,980	
トレンドマイクロ	46.8	43.8	257,982	
I D ホールディングス	2.5	3.8	6,190	
日本オラクル	17.8	20	191,200	
アルファシステムズ	2.7	3.1	8,769	
フューチャー	11.8	11.9	21,039	
C A C H o l d i n g s	6.3	6.4	8,160	
S B テクノロジー	3.7	3.5	8,270	
トーセ	2.5	2.7	2,397	
オービックビジネスコンサルタント	8.9	10.1	42,066	
伊藤忠テクノソリューションズ	40	44.9	149,292	
アイティフォー	10.7	11.9	8,913	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
東計電算	1.3	1.5	6,795	
エックスネット	1.8	1.5	1,456	
大塚商会	47.5	53.3	258,505	
サイボウズ	10.2	11.5	25,863	
ソフトブレーン	7	5.8	2,940	
電通国際情報サービス	5.4	6.1	30,225	
デジタルガレージ	17.1	17.7	72,127	
EMシステムズ	7.2	13.8	12,406	
ウェザーニューズ	2.9	3.3	12,688	
C I J	7	6.7	5,514	
ビジネスエンジニアリング	0.9	1.1	3,498	
日本エンタープライズ	10	10	2,560	
WOWOW	4.2	4.7	12,516	
スカラ	6.2	6.5	4,608	
インテリジェント ウェイブ	—	4.3	3,182	
I M A G I C A G R O U P	7.6	8.4	3,872	
ネットワンシステムズ	31.1	37.5	92,512	
システムソフト	23.4	23.3	2,190	
アルゴグラフィックス	3.7	8.4	30,870	
マーベラス	13.5	15	10,080	
エイベックス	15.2	16.9	20,972	
日本ユニシス	27.4	30.7	115,125	
兼松エレクトロニクス	4.8	5.4	18,306	
東京放送ホールディングス	58.3	59.9	113,690	
日本テレビホールディングス	80.7	82.2	119,847	
朝日放送グループホールディングス	8.9	9.8	7,056	
テレビ朝日ホールディングス	24.1	27	54,729	
スカパー J S A Tホールディングス	66.7	64.8	30,391	
テレビ東京ホールディングス	7.2	8.1	19,156	
日本BS放送	2.7	3.3	4,072	
ビジョン	2.7	9.2	10,258	
スマートバリュー	1.9	2.6	2,259	
USEN-NEXT HOLDINGS	3.4	3.7	6,230	
ワイヤレスゲート	4	4.6	2,677	
コネクシオ	6.2	5.6	8,573	
日本通信	76.8	76.8	16,512	
クロップス	1.7	1.8	1,305	
日本電信電話	601	1,316.2	3,653,771	
KDD I	774.3	733.8	2,501,524	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ソフトバンク	698.7	894.8	1,328,330	
光通信	10.4	10.2	236,334	
NTTドコモ	630.9	727.3	2,277,176	
エムティーアイ	10.3	9.5	6,156	
GMOインターネット	32	38.8	80,548	
ファイバーゲート	—	2.3	2,888	
アイドマーケティングコミュニケーション	2	2.9	1,647	
KADOKAWA	25.8	26.5	43,592	
学研ホールディングス	3	3.3	23,628	
ゼンリン	17.5	19.6	28,616	
昭文社	4.7	4.5	1,651	
インプレスホールディングス	8.3	8.1	1,344	
アイネット	5	5.1	7,486	
松竹	5.8	6.5	90,155	
東宝	57.8	58.9	227,943	
東映	3.7	3.7	51,652	
エヌ・ティ・ティ・データ	234	262.2	381,501	
ビー・シー・エー	1.2	1.3	5,356	
ビジネスブレイン太田昭和	1.5	1.7	4,766	
D T S	9.7	22	48,180	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40.9	42	208,320	
シーイーシー	9.4	10.5	20,349	
カブコン	37.7	46.4	160,312	
アイ・エス・ビー	1.7	1.9	4,411	
ジャステック	5.1	6.3	6,577	
S C S K	23.2	22.7	141,648	
日本システムウエア	2.9	3.2	7,324	
アイネス	11.2	9.7	16,296	
T K C	7.4	8.3	43,990	
富士ソフト	13.1	12.6	51,849	
N S D	14.2	31.6	59,850	
コナミホールディングス	35.9	35.8	156,625	
福井コンピュータホールディングス	2.9	3.9	12,207	
J B C Cホールディングス	6.9	6.6	12,718	
ミロク情報サービス	8.7	8.7	23,055	
ソフトバンクグループ	367.2	781.3	4,321,370	
卸売業 (5.0%)				
ハウスイ	1	0.8	694	
高千穂交易	3.5	3.8	4,259	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
伊藤忠食品	2.2	2.4	11,688	
エレマテック	4.1	9.2	9,043	
J A L U X	2.4	2.8	6,344	
あらた	4.9	7.9	35,905	
トーマンデバイス	1.3	1.5	5,955	
東京エレクトロン デバイス	3.1	3.6	10,008	
フィールズ	8.1	7.6	3,617	
双日	487.1	545.9	186,697	
アルフレッサ ホールディングス	98	109.8	239,364	
横浜冷凍	23.3	27.7	25,954	
神栄	—	1.4	1,040	
ラサ商事	4.8	5.2	4,695	
ラクーンホールディングス	4.2	4.2	3,675	
アルコニックス	9.4	10.5	12,988	
神戸物産	13.3	34.1	152,086	
あい ホールディングス	12.7	14.1	24,407	
ディーブイエックス	3.3	3.5	3,213	
ダイワボウホールディングス	8	8.4	52,668	
マクニカ・富士エレホールディングス	24.4	23.6	40,474	
ラクト・ジャパン	1.9	3.7	14,578	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16.4	18.6	19,474	
八洲電機	6.5	7.6	6,710	
メディアスホールディングス	5	5.6	4,340	
レスターホールディングス	5.7	10.3	18,993	
ジュテックホールディングス	2.1	2.3	2,661	
大光	2.8	4.2	2,751	
O C H I ホールディングス	2.6	2.9	4,248	
T O K A I ホールディングス	46.5	52.2	51,469	
黒谷	1.7	2.2	1,056	
C o m i n i x	1.6	1.7	1,383	
三洋貿易	4.4	9.9	11,929	
ビューティガレージ	1.4	1.6	3,251	
ウイン・パートナーズ	5.7	7.1	7,533	
ミタチ産業	2.7	3	2,067	
シップヘルスケアホールディングス	18.4	15.8	73,154	
明治電機工業	2.8	3.1	4,464	
デリカフーズホールディングス	1.7	3.5	2,418	
スターティアホールディングス	1.9	2.2	1,564	
コメダホールディングス	20.2	21.5	46,031	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ビーバンドットコム	—	0.7	806	
アセンテック	—	0.8	2,355	
富士興産	3.4	3	2,031	
協栄産業	1.1	1.1	1,516	
小野建	7.7	8.9	11,329	
南陽	1.8	2.2	3,944	
佐島電機	6.6	6.7	5,768	
エコートレーディング	1.7	2.3	1,292	
伯東	6	6	7,164	
コンドーテック	6.7	7.6	8,861	
中山福	5.1	5.7	2,901	
ナガイレーベン	12.8	14.3	33,504	
三菱食品	9.6	10.9	31,958	
松田産業	6.4	7.2	10,792	
第一興商	13.1	14.7	70,486	
メディパルホールディングス	95.2	106.7	235,273	
S P K	1.9	2.1	5,508	
萩原電気ホールディングス	3.2	3.7	9,342	
アズワン	6.3	6.4	58,048	
スズデン	3.1	3.4	4,811	
尾家産業	2.8	2.9	4,065	
シモジマ	5.5	6	6,624	
ドウシシャ	8.4	9.3	14,582	
小津産業	2	2.2	3,715	
高速	5.3	5.9	7,091	
たけびし	3.3	3.5	5,029	
リックス	2	2.2	3,781	
丸文	7.4	8.7	5,185	
ハビネット	7.5	8.2	10,446	
橋本総業ホールディングス	1.6	2	3,468	
日本ライフライン	27.6	29.3	41,107	
タカショー	4.9	4.8	2,184	
エクセル	3.4	—	—	
マルカ	2.9	3.5	7,241	
I D O M	29.9	26.6	16,758	
日本エム・ディ・エム	5.2	—	—	
進和	5.2	5.8	12,649	
エス케이ジャパン	2.2	2.1	888	
ダイトロン	4.1	4.2	8,106	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
シークス	11.3	12.6	17,110	
田中商事	3	3	2,124	
オーハシテクニカ	5.1	5.6	8,299	
白銅	2.7	3.5	4,928	
伊藤忠商事	616.9	691.3	1,800,490	
丸紅	869.7	1,028.7	812,158	
高島	1.2	1.6	3,030	
長瀬産業	49.6	55.6	79,897	
蝶理	5.5	6.3	13,230	
豊田通商	98.4	110.3	407,007	
三共生興	15.9	15	8,235	
兼松	35.1	36.9	47,453	
ツカモトコーポレーション	1.7	1.8	2,037	
三井物産	726.6	868.7	1,676,156	
日本紙パルプ商事	5	5.6	21,616	
日立ハイテク	26.8	34.3	275,086	
カメイ	11.5	12.9	14,151	
東都水産	1.3	1.3	3,712	
OUGホールディングス	1.4	1.6	4,161	
スターゼン	3.2	3.6	15,858	
山善	34.2	38.6	38,831	
椿本興業	2	1.8	7,182	
住友商事	521.6	623.6	1,028,628	
内田洋行	4	4.2	25,284	
三菱商事	618.9	693.5	1,977,862	
第一実業	3.9	4.8	16,944	
キャノンマーケティングジャパン	25.2	28.2	77,014	
西華産業	4.9	5.6	7,280	
佐藤商事	7.8	8.1	7,443	
菱洋エレクトロ	9	10	19,230	
東京産業	9	8.9	5,206	
ユアサ商事	9	9.4	31,208	
神鋼商事	2	2.5	5,977	
小林産業	5.4	5.9	1,681	
阪和興業	15.3	18.5	46,176	
正栄食品工業	4.7	6.4	23,872	
カナデン	8.4	8	10,456	
菱電商事	6.7	7.1	11,672	
フルサト工業	4.9	5.4	8,764	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
岩谷産業	19.6	21.9	79,935	
すてきなイスグループ	4	4.2	4,771	
昭光通商	3.4	3.2	2,176	
ニチモウ	1.4	1.5	2,974	
極東貿易	2.8	2.8	5,306	
イワキ	10.6	12.9	6,488	
三菱石油	23.5	24.3	25,855	
稲畑産業	21.3	21.8	31,370	
G S I クレオス	2.5	2.4	2,901	
明和産業	7.5	9.1	5,187	
クワザワ	—	3.5	2,173	
ワキタ	18.8	21.1	21,522	
東邦ホールディングス	26.1	31.7	71,071	
サンゲツ	26.5	27.2	48,824	
ミツウロコグループホールディングス	12.7	14.6	16,687	
シナネンホールディングス	3.5	4.1	8,831	
伊藤忠エネクス	19.3	21.8	20,056	
サンリオ	27.2	27.7	54,485	
サンワテクノス	5.2	7	6,237	
リョーサン	9.7	10.9	26,301	
新光商事	8.3	15.5	12,276	
トーホー	4	4.5	7,866	
三信電気	7.3	5.3	8,564	
東陽テクニカ	10.3	11.4	11,833	
モスフードサービス	11.5	13	38,844	
加賀電子	8.8	9.8	22,393	
ソーダニッカ	9.3	10.2	5,936	
立花エレテック	6.3	7.3	12,563	
フォーバル	4	4.3	4,871	
PAL TAC	15.9	15.8	79,316	
三谷産業	10.4	13	4,589	
太平洋興発	3.5	3.9	2,971	
西本Wismettacホールディングス	2	1.8	5,661	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	0.9	1,887	
国際紙パルプ商事	15.3	23.4	6,739	
ヤマタネ	4.5	4.9	7,232	
丸紅建材リース	0.8	1	1,829	
日鉄物産	6.2	7	32,025	
泉州電業	2.9	3	8,928	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トラスコ中山	18.3	20.6	48,554
オートバックスセブン	35.1	36.7	56,481
モリト	6.5	7.2	5,702
加藤産業	13.7	15.5	53,707
北恵	1.7	1.9	1,757
イノテック	5.3	5.9	6,407
イエローハット	8.3	18.7	30,761
J Kホールディングス	8.2	8.9	6,612
日伝	7.2	8.9	17,283
北沢産業	7.1	7.4	1,887
杉本商事	4.8	5.3	10,027
因幡電機産業	12.4	28.1	73,481
バイテックホールディングス	4	—	—
東テク	2.9	3.3	8,094
ミスミグループ本社	110.4	123.8	329,431
アルテック	7.2	7.8	1,965
タキヒヨー	2.7	3	5,475
蔵王産業	1.6	1.9	2,755
スズケン	40.2	41.9	167,809
ジェコス	6.1	6.8	7,031
グローセル	8.2	9.9	4,365
小売業 (4.5%)			
ローソン	22.3	25	155,500
サンエー	6.7	8.2	37,392
カワチ薬品	6.8	7.7	16,093
エービーシー・マート	13.8	15.4	104,258
ハードオフコーポレーション	3.4	3.9	3,120
アスクル	9.2	10.3	34,659
ゲオホールディングス	13.4	17.8	21,805
アダストリア	12.2	13.7	28,852
ジーフット	5.9	6	3,678
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	1.3	1.4	924
くら寿司	5.2	5.2	28,080
キャンドゥ	4.3	4.7	7,665
バルグループホールディングス	4.5	5	17,150
エディオン	37.3	45.4	45,944
サーラコーポレーション	18	20.1	12,160
ワッツ	3	4.3	2,614
ハローズ	3.3	3.7	10,115

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
フジオフードシステム	2.9	8.3	13,802	
あみやき亭	1.9	2.1	7,171	
ひらまつ	18.1	18.2	4,422	
大黒天物産	2.1	2.4	8,004	
ハニーズホールディングス	7.8	8.7	11,675	
ファーマライズホールディングス	2.3	2.4	1,564	
アルペン	6.6	7.6	14,440	
ハブ	2.9	2.8	2,828	
クオールホールディングス	13	14.5	20,126	
ジンズホールディングス	6	5.2	38,532	
ビックカメラ	47.1	58.6	63,288	
DCMホールディングス	46.9	53.3	55,645	
ペッパーフードサービス	7	7.9	6,865	
Monotaro	55.7	70.3	185,240	
東京一番フーズ	2.6	2.5	1,520	
DDホールディングス	2	3.9	6,567	
きちりホールディングス	2.5	2.6	1,853	
アークランドサービスホールディングス	6.4	7.2	14,472	
J. フロント リテイリング	112.8	118	151,630	
ドトール・日レスホールディングス	15.3	15.8	32,943	
マツモトキヨシホールディングス	36.5	40.9	158,487	
ブロンコビリー	4.6	5.2	13,156	
ZOZO	95.3	68	117,164	
トレジャー・ファクトリー	2.7	2.9	2,459	
物語コーポレーション	2.2	2.6	21,866	
ココカラファイン	9.9	10.3	52,530	
三越伊勢丹ホールディングス	165	172.7	138,332	
Hamee	2.7	3.5	5,579	
ウエルシアホールディングス	23.3	29.4	183,750	
クリエイトSDホールディングス	13	16.7	45,373	
丸善CH I ホールディングス	9.4	11.5	4,220	
ミサワ	2.5	2	1,548	
ティーライフ	1.3	1.3	1,103	
エー・ピーカンパニー	1.9	1.9	1,124	
チムニー	2.6	3	6,675	
シュッピン	6.1	6.7	6,559	
ネクステージ	13.6	14.1	14,142	
ジョイフル本田	25.7	28.9	36,009	
鳥貴族	3	3.3	8,728	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
キリン堂ホールディングス	3.5	3.9	6,583	
ホットランド	4.8	6.6	8,527	
すかいらくホールディングス	82.2	110.8	205,312	
SFPホールディングス	—	4.2	8,958	
綿半ホールディングス	3.3	3.7	6,771	
ヨシックス	1.4	1.6	4,243	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	25.5	28.7	27,523	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3.7	4.6	3,192	
BEENOS	2.1	3.7	4,110	
あさひ	7.2	7.4	9,361	
日本調剤	3.2	3	11,550	
コスモス薬品	3.9	4.4	103,356	
トーエル	4.4	4.8	3,806	
一六堂	0.6	—	—	
オンリー	1.7	1.7	1,322	
セブン&アイ・ホールディングス	369.7	386.6	1,515,472	
薬王堂	3.8	—	—	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	23.7	26.6	59,929	
ツルハホールディングス	19.2	21.5	272,405	
サンマルクホールディングス	7	7.8	16,918	
フェリシモ	2	2.2	2,072	
トリドールホールディングス	10.9	12.2	33,367	
TOKYO BASE	8	8.9	4,067	
ウイルプラスホールディングス	1	1.2	907	
JMホールディングス	3.3	5	11,330	
サツドラホールディングス	1.3	1.5	2,722	
デファクトスタンダード	0.7	—	—	
アレンザホールディングス	4.8	4.9	4,787	
串カツ田中ホールディングス	—	1.5	3,141	
パロックジャパンリミテッド	7.2	6.9	6,775	
クスリのアオキホールディングス	8.8	8.8	57,728	
力の源ホールディングス	2.5	4.5	4,032	
スシローグローバルホールディングス	9.7	10.8	95,040	
LIXILピバ	7.4	9.8	22,981	
メディカルシステムネットワーク	10	9.5	4,598	
はるやまホールディングス	4.2	4.6	3,873	
ノジマ	15.7	17.6	37,611	
カッパ・クリエイト	12.5	13.9	20,127	
ライトオン	7.5	7.4	4,218	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ジーンズメイト	—	3	831	
良品計画	12.5	131.2	228,419	
三城ホールディングス	10.7	10.5	3,244	
アドヴァン	13.5	15.1	18,814	
アルビス	3.4	3.7	7,962	
コナカ	11.7	11.6	4,640	
ハウス オブ ローゼ	1.2	1.2	2,029	
G-7ホールディングス	2.5	5.8	14,569	
イオン北海道	8.4	9.9	8,226	
コジマ	13.2	17	8,330	
ヒマラヤ	2.8	3.5	2,915	
コーナン商事	11.5	14	33,740	
エコス	3.3	3.6	6,015	
ワタミ	11.8	11.7	13,782	
マルシェ	2.7	2.6	1,991	
バン・バシフィック・インターナショナルホ	52.8	217.2	426,146	
西松屋チェーン	19.5	21.7	19,660	
ゼンショーホールディングス	41.6	47.3	116,452	
幸楽苑ホールディングス	5.7	6.3	11,648	
ハークスレイ	1.7	2.1	2,383	
サイゼリヤ	14.6	16.3	37,196	
VTホールディングス	29.8	40.9	16,932	
魚力	2.3	2.7	4,320	
ボブラ	2.6	2.6	1,271	
フジ・コーポレーション	1.8	2.6	5,226	
ユナイテッドアローズ	10.1	10.4	28,652	
ハイデイ日高	11.6	14.3	27,270	
京都きもの友禅	6.1	6.3	2,047	
コロワイド	29.3	32.8	72,291	
ピーシーデポコーポレーション	11.9	13.1	7,637	
壱番屋	6.2	7	38,010	
トップカルチャー	4	3.6	1,184	
PLANT	1.9	2.5	1,377	
スギホールディングス	19.4	19.7	106,971	
薬王堂ホールディングス	—	4.3	9,374	
ヴィア・ホールディングス	10.9	12.1	7,937	
スクロール	13.8	15.2	5,228	
ヨンドシーホールディングス	9.9	10.1	23,199	
ファミリーマート	24.7	79	198,132	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
本曽路	10.8	12.9	36,726	
SRSホールディングス	10	11.6	12,040	
千趣会	17	17.8	9,220	
タカキュー	7	7.6	1,375	
ケーヨー	16.4	20.3	11,083	
上新電機	10.4	11.7	23,598	
日本瓦斯	14.3	15.6	58,188	
ロイヤルホールディングス	15.4	17.3	36,814	
東天紅	0.7	0.7	875	
いなげや	9.8	12.2	16,555	
島忠	20	18.6	55,893	
チョダ	9.2	10.4	15,173	
ライフコーポレーション	6.7	7.5	19,417	
リンガーハット	10.9	12.2	29,365	
MrMaxHD	12.5	13.6	6,432	
テンアライド	7.9	9.1	3,958	
AOKIホールディングス	17.5	19.8	20,176	
オークワ	12.5	15.5	22,692	
コメリ	13.6	15.3	33,797	
青山商事	15.4	20.4	26,234	
しまむら	10.3	11.5	88,780	
はせがわ	4.8	5.2	2,054	
高島屋	69.2	72	80,352	
松屋	17.8	19.9	15,442	
エイチ・ツー・オー リテイリング	45.3	46.8	43,804	
近鉄百貨店	3.4	3.8	12,996	
パルコ	8.6	9.4	17,333	
丸井グループ	74.6	90.6	214,812	
アクシアル リテイリング	7.3	8.2	30,299	
井筒屋	—	5.4	1,252	
イオン	339.4	380.3	874,690	
イズミ	17.9	20.1	66,832	
平和堂	17.8	20.1	37,365	
フジ	10.6	11.9	21,705	
ヤオコー	10	11.2	64,960	
ゼビオホールディングス	10.4	11.9	13,090	
ケーズホールディングス	91.6	95.4	125,546	
Olympicグループ	5.3	5.1	2,988	
日産東京販売ホールディングス	13.2	14.5	3,726	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数
	千株	千株	千円
シルバーライフ	—	0.7	1,740
Genky DrugStores	4.3	4.3	8,372
ナルミヤ・インターナショナル	—	1.7	1,980
総合メディカルホールディングス	7.7	8.6	21,904
ブックオフグループホールディングス	4.8	5.8	5,370
アインホールディングス	11.8	12.1	82,038
元気寿司	2.5	2.5	7,265
ヤマダ電機	268.7	301.1	178,853
アークランドサカモト	14.8	15.5	18,305
ニトリホールディングス	38.2	42.8	708,768
グルメ杵屋	6.3	7	8,127
愛眼	7.3	7.9	1,911
ケーユーホールディングス	4.4	5.2	4,581
吉野家ホールディングス	30.7	32.5	82,192
松屋フーズホールディングス	4.2	4.8	21,408
サガミホールディングス	12	13.2	17,463
関西スーパーマーケット	6.8	8.2	8,208
王将フードサービス	6.4	7.3	46,939
プレナス	9.9	11.1	21,423
ミニストップ	6.5	7.3	11,110
アークス	16.5	20.2	38,683
パローホールディングス	19	21.9	39,441
藤久	0.8	0.8	551
ベルク	4.3	4.9	27,391
大庄	4.5	5.3	8,617
ファーストリテイリング	11.8	13.2	787,248
サンドラッグ	33.2	37.2	122,574
サックスパー ホールディングス	7.5	8.4	6,736
ヤマザワ	1.8	2.3	3,834
やまや	1.5	2	4,412
バルーナ	21.6	21.2	13,016
銀行業 (5.6%)			
島根銀行	1.9	2	1,218
じもとホールディングス	61.1	66.9	6,890
めぶきフィナンシャルグループ	458.9	514.3	120,346
東京きらぼしフィナンシャルグループ	12.1	13.4	16,147
九州フィナンシャルグループ	144.9	162.4	66,584
ゆうちょ銀行	250.2	280.4	282,643
富山第一銀行	20.4	23.6	7,268

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コンソルディア・フィナンシャルグループ	562.5	582.1	244,482
西日本フィナンシャルホールディングス	56.6	67.5	46,035
関西みらいフィナンシャルグループ	41.3	58.1	32,884
三十三フィナンシャルグループ	7.4	9.2	14,039
第四北越フィナンシャルグループ	15.3	17.2	43,791
新生銀行	64.8	72.6	122,694
あおぞら銀行	49.3	59	178,770
三菱UFJ フィナンシャル・グループ	6,151	6,812.9	3,834,300
りそなホールディングス	969.2	1,086.1	477,123
三井住友トラスト・ホールディングス	173.6	187.1	748,587
三井住友フィナンシャルグループ	622.5	684.5	2,567,559
千葉銀行	312.8	340.4	205,942
群馬銀行	176.7	194.5	69,436
武蔵野銀行	13.1	14.7	24,357
千葉興業銀行	24.8	27.1	8,997
筑波銀行	38	41.2	8,075
七十七銀行	27.6	33.4	52,304
青森銀行	6.9	7.7	19,812
秋田銀行	5.7	6.3	11,894
山形銀行	10	11.1	15,173
岩手銀行	6.2	6.5	16,529
東邦銀行	79.1	88.5	21,505
東北銀行	4.5	4.7	4,775
みちのく銀行	5.4	6.4	8,531
ふくおかフィナンシャルグループ	71.7	83.4	153,956
静岡銀行	222.3	245.1	184,070
十六銀行	11.9	12.4	25,680
スルガ銀行	90.6	101.2	44,123
八十二銀行	159.9	238.8	96,236
山梨中央銀行	10.7	11.5	10,545
大垣共立銀行	13.8	19.5	43,524
福井銀行	7.7	8.5	13,175
北國銀行	9.3	10.2	31,926
清水銀行	3.8	4.1	7,982
富山銀行	1.8	1.9	3,739
滋賀銀行	17.5	19.8	51,955
南都銀行	10.2	16.5	40,837
百五銀行	79.2	89.1	28,155
京都銀行	31.6	35.4	148,680

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
紀陽銀行	31.1	35	55,615
ほくほくフィナンシャルグループ	58.8	65.9	66,427
広島銀行	130.4	146.1	75,972
山陰合同銀行	52	58.7	35,748
中国銀行	57	85.2	80,684
鳥取銀行	3.3	3.4	4,457
伊予銀行	117	141.2	75,542
百十四銀行	9.4	10.5	21,021
四国銀行	12.6	15	13,755
阿波銀行	14.1	16.2	38,426
大分銀行	5.5	5.7	12,956
宮崎銀行	5.9	6.6	15,516
佐賀銀行	5.4	6	9,006
十八銀行	5.4	—	—
沖縄銀行	8	9.1	30,212
琉球銀行	20.1	22.8	23,962
セブン銀行	298.4	330.6	105,461
みずほフィナンシャルグループ	12,001.4	13,448.4	2,134,261
高知銀行	3.9	3.6	2,829
山口フィナンシャルグループ	110.2	123.5	79,904
長野銀行	3	3.2	4,691
名古屋銀行	7.1	8	27,040
北洋銀行	132.1	149.2	33,868
愛知銀行	3.2	3.6	12,222
中京銀行	3.7	4.1	9,028
大光銀行	3.2	3.4	5,433
愛媛銀行	12.2	13.8	14,848
トマト銀行	3.3	3.8	3,944
京葉銀行	38.5	42.2	24,054
栃木銀行	45.1	47.8	9,273
北日本銀行	2.8	3.1	6,401
東和銀行	15.7	17.4	13,467
福島銀行	8.1	9.3	1,971
大東銀行	4.5	5.1	3,146
トモニホールディングス	68.3	76.5	26,010
フィデアホールディングス	87.5	96.1	11,628
池田泉州ホールディングス	93.7	113.8	21,394
証券・商品先物取引業 (0.9%)			
F P G	27.7	30.5	29,585

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マーキュリアインベストメント	3.4	4.4	3,102
SBIホールディングス	105.2	110.5	272,051
日本アジア投資	—	8.4	2,217
ジャフコ	14.5	15.2	71,136
大和証券グループ本社	708.7	794.1	426,590
野村ホールディングス	1,554	1,741.4	982,846
岡三証券グループ	75	84.3	33,129
丸三証券	26.8	29.4	14,847
東洋証券	33.3	35.4	5,274
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	104.9	113.7	36,611
光世証券	2.7	2.4	1,418
水戸証券	26	28.6	6,349
いちよし証券	18.6	18.5	11,377
松井証券	43.1	56.5	50,680
だいこう証券ビジネス	3.9	4.8	3,211
マネックスグループ	82.7	74.7	18,749
カブドットコム証券	66	—	—
極東証券	11.6	13.3	10,041
岩井コスモホールディングス	8.8	9.4	11,909
藍澤證券	16.3	17.8	12,335
マネーパートナーズグループ	11.4	10.5	2,383
スパークス・グループ	—	34.3	8,986
小林洋行	—	2.8	739
保険業 (2.3%)			
かんぽ生命保険	33.4	35.1	63,917
SOMPOホールディングス	155.7	186.1	812,698
アニコム ホールディングス	7.2	8.2	32,062
MS&ADインシュアランスグループホール	230.9	258.8	967,394
ソニーフィナンシャルホールディングス	72.6	81.3	194,063
第一生命ホールディングス	499.7	560	912,520
東京海上ホールディングス	320.1	353.9	2,167,991
T&Dホールディングス	273.2	295.8	359,397
アドバンスクリエイト	2.1	2.3	4,176
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	24.9	27.9	126,945
ジェイリース	2.2	2.7	891
イントラスト	2.7	3.5	2,726
日本モーゲージサービス	1.1	2	4,450
C a s a	3.1	3.4	5,042

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルヒ	8	15.7	28,385
プレミアグループ	1.8	5.4	11,118
クレディセゾン	61.9	69.3	127,096
芙蓉総合リース	10.1	10.4	71,968
みずほリース	16.5	15.3	49,266
東京センチュリー	17.8	19.9	102,087
日本証券金融	38.8	43.6	21,712
アイフル	135.6	151	45,602
リコーリース	6.9	7.8	32,877
イオンフィナンシャルサービス	56.4	60.6	110,231
アコム	180	200.6	104,713
ジャックス	9.9	10.9	26,923
オリエントコーポレーション	243.3	267.7	42,832
日立キャピタル	20.8	23.3	71,880
アプラスフィナンシャル	46.2	47.5	3,895
オリックス	589.2	619	1,191,575
三菱UFJ リース	199.2	251.2	175,588
九州リースサービス	4.8	4.9	2,959
日本取引所グループ	238.6	284.1	562,518
イー・ギャランティ	8.4	10.6	13,727
アサックス	3.8	5.1	3,621
NECキャピタルソリューション	3.6	4	9,740
不動産業 (2.5%)			
いちご	112.5	125.9	49,856
日本駐車場開発	108.3	108.5	15,841
スター・マイカ・ホールディングス	—	5.1	8,226
ヒューリック	184.3	211.3	278,704
三栄建築設計	3.7	4	5,960
スター・マイカ	4	—	—
野村不動産ホールディングス	58.8	60	165,060
三重交通グループホールディングス	18.1	20.1	11,678
サムティ	12.2	14	26,054
ディア・ライフ	11.5	12.7	7,226
コーセーアールイー	2.7	2.9	1,754
エー・ディー・ワークス	146.5	183.6	5,140
日本商業開発	5.8	6.3	11,157
プレサンスコーポレーション	14	16.2	20,687
ユニゾホールディングス	13.4	14.9	87,016
THE グローバル社	4.5	4.7	2,063

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ハウスコム	—	1.3	1,995	
日本管理センター	6.1	6.5	9,152	
サンセイランディック	2.5	2.9	2,378	
エストラスト	1.6	1.3	1,072	
フージャースホールディングス	19.4	19.7	13,730	
オープンハウス	14.4	28.7	88,970	
東急不動産ホールディングス	237.6	269.1	210,436	
飯田グループホールディングス	73.7	82.6	134,307	
イーグランド	1.7	1.6	1,292	
ムゲンエステート	6.4	6.8	4,039	
ビーロット	1.4	2.3	4,406	
ファーストブラザーズ	2.4	2.3	2,587	
ハウストゥ	4.9	4.9	5,831	
シーアールイー	3.1	2.4	2,652	
プロパティエージェント	1	1.6	1,617	
ケイアイスター不動産	2.5	3.1	5,149	
アグレ都市デザイン	1.3	1.6	827	
グッドコムアセット	1.6	2.3	4,386	
ジェイ・エス・ビー	0.3	1.1	5,687	
テンポイノベーション	0.8	2.2	2,096	
グローバル・リンク・マネジメント	0.6	1.6	1,208	
パーク 2 4	51.6	53.1	139,599	
バラカ	2.3	2.6	5,135	
三井不動産	468.6	488.1	1,436,478	
三菱地所	618.8	693.5	1,484,090	
平和不動産	16.8	18.2	62,426	
東京建物	96.5	108.1	186,364	
ダイビル	26.2	25.5	35,241	
京阪神ビルディング	16.1	16.1	23,747	
住友不動産	198.5	222.5	887,775	
テアオーシー	20.4	19.4	16,373	
東京楽天地	1.3	1.6	8,944	
レオパレス 2 1	108.9	129.7	52,398	
スターツコーポレーション	12.1	13.5	34,924	
フジ住宅	11.4	11.5	7,567	
空港施設	10.2	9.9	5,177	
明和地所	5.2	5.4	3,375	
ゴールドクレスト	7	7.8	14,788	
エスリード	3.5	3.9	7,332	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日神グループホールディングス	13	14.6	7,781
日本エスコン	16	17.9	16,038
タカラレーベン	42.1	45.2	22,148
A V A N T I A	5.3	5.6	5,320
イオンモール	44.3	49.6	90,569
毎日コムネット	1.9	2.5	2,265
ファースト住建	3.4	4.2	5,241
ランド	—	538.7	5,387
カチタス	9.9	12.3	48,892
トーセイ	12.3	13.6	18,468
穴吹興産	1	2.2	3,601
サンフロンティア不動産	12.2	13.7	17,316
エフ・ジェー・ネクスト	7.7	8.6	9,537
インテリックス	2.7	2.8	1,864
ランドビジネス	4.7	4.2	3,099
日本社宅サービス	—	2.3	2,357
グランディハウス	8	7.7	3,395
日本空港ビルデング	28.2	31.6	163,372
サービス業 (5.2%)			
日本工営	5.7	6.5	21,580
L I F U L L	33.3	33.5	16,984
ジェイエイシーリクルートメント	6.8	6.4	10,336
日本M&Aセンター	63.8	72.4	266,432
メンバーズ	2.9	2.8	4,466
中広	1.3	1	540
UTグループ	—	11.3	30,385
アイティメディア	—	2.9	3,259
タケエイ	9	9.2	9,328
E・Jホールディングス	1	1.7	2,815
ビーネックスグループ	4.7	11.9	11,673
コシダカホールディングス	22.9	23.1	34,488
アルトナー	1.7	2.3	1,978
パソナグループ	10.4	10.4	13,728
C D S	2.1	2.4	3,319
リンクアンドモチベーション	15.8	21.1	10,697
G C A	9.1	11.5	9,211
エス・エム・エス	31.4	29.8	70,000
サニーサイドアップグループ	0.9	2.5	2,275
パーソルホールディングス	85.6	95.9	167,153

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
リニカル	4.8	4.6	4,567	
クックパッド	26.9	33.5	10,418	
エスクリ	2.4	3	2,232	
アイ・ケイ・ケイ	4.5	4.7	3,482	
学情	3.5	3.4	6,857	
スタジオアリス	4.3	4.8	8,788	
シミックホールディングス	4.8	5.3	8,480	
エプコ	—	1.5	1,720	
N J S	2	2.1	3,765	
総合警備保障	34	38.1	210,693	
カカココム	64.4	71.8	205,204	
アイロムグループ	3.3	3.4	5,161	
セントケア・ホールディング	4.8	6.2	2,845	
サイネックス	1.9	1.6	1,113	
ルネサンス	4.8	5.3	8,972	
ディップ	13.8	13.5	43,740	
オプトホールディング	5.3	5.2	10,082	
新日本科学	11.8	10.4	7,020	
ツクイ	20.3	22.6	14,622	
キャリアデザインセンター	2.2	2.4	2,906	
ベネフィット・ワン	11.8	26.2	51,378	
エムスリー	180.1	211.4	647,941	
ツカダ・グローバルホールディング	5.2	6.1	3,281	
プラス	0.9	1.1	843	
アウトソーシング	45.1	54.9	52,209	
ウェルネット	8.2	9.7	6,460	
ワールドホールディングス	2.3	3.2	6,249	
ディー・エヌ・エー	46.1	47	73,931	
博報堂DYホールディングス	119	133.4	192,496	
ぐるなび	12.4	16.7	14,111	
タカミヤ	8.9	10.2	6,079	
ジャパンベストレスキューシステム	6.8	6.5	5,590	
ファンコミュニケーションズ	23.8	26.4	11,510	
ライク	3.4	3.2	6,099	
ビジネス・ブレークスルー	4	4	1,628	
エスプール	—	18.5	14,929	
WDBホールディングス	3.9	4.4	11,607	
ティア	4.5	5.6	3,360	
CDG	0.9	1	1,410	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
バリューコマース	5.8	5.4	13,132	
インフォマート	46.9	105.1	78,404	
J Pホールディングス	24.9	30.1	9,300	
エコナックホールディングス	—	17.3	2,352	
E P Sホールディングス	13	14.4	18,144	
レッグス	2.2	2.4	3,304	
プレステージ・インターナショナル	16.1	35.9	35,433	
アミューズ	5.2	5.2	13,712	
ドリームインキュペータ	2.6	2.9	4,277	
クイック	5.4	6	8,664	
T A C	5.1	5.8	1,148	
ケネディクス	75.1	89.3	60,009	
電通グループ	104.2	98.8	333,944	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3.3	3.7	3,807	
びあ	2.4	2.7	10,489	
イオンファンタジー	2.8	3.7	8,221	
シーティーエス	9.7	10.8	7,840	
ネクシィーズグループ	2.6	3.3	5,161	
みらかホールディングス	23.9	26.8	75,200	
アルプス技研	7.5	8.5	16,677	
サニックス	—	16.8	6,451	
ダイオーズ	2	1.9	2,508	
日本空調サービス	9.2	10	7,530	
オリエンタルランド	101.1	102	1,407,090	
ダスキン	23	24.6	73,775	
明光ネットワークジャパン	11	11.3	10,350	
ファルコホールディングス	4.5	5.3	10,234	
秀英予備校	2.2	2.1	930	
田谷	—	1.7	1,054	
ラウンドワン	26.6	26.8	25,004	
リゾートトラスト	36.2	44	70,972	
ビー・エム・エル	11	12.3	40,651	
ワタベウエディング	1.5	1.5	778	
りらいあコミュニケーションズ	15.4	17.3	24,998	
リソー教育	43.4	43.8	16,731	
早稲田アカデミー	1.2	3.1	3,230	
ユー・エス・エス	104.5	107.3	202,153	
東京個別指導学院	3.1	3.4	2,335	
サイバーエージェント	52.7	55.1	242,991	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
楽天	398.8	446.9	423,661	
クリーク・アンド・リバー社	5.1	4.9	4,924	
テー・オー・ダブリュー	7.5	7.6	6,528	
山田コンサルティンググループ	2.6	4.6	7,130	
セントラルスポーツ	3.2	3.6	10,713	
フルキャストホールディングス	8.5	9.6	23,644	
エン・ジャパン	9.3	17	59,245	
リソルホールディングス	0.9	1	4,145	
テクノプロ・ホールディングス	17.2	19.1	147,643	
アトラ	1.9	2.2	715	
インターワークス	2	1.8	968	
アイ・アールジャパンホールディングス	2.6	3.9	28,743	
Keeper 技研	3.2	3.5	3,920	
ファーストロジック	1.8	2.2	1,300	
三機サービス	1.8	1.8	1,791	
Gunosy	5.9	6	6,954	
デザインワン・ジャパン	1.7	1.9	535	
イー・ガーディアン	4.1	4.9	9,378	
リブセンス	5.1	6.1	1,714	
ジャパンマテリアル	23.4	29.5	44,751	
ベクトル	10.4	11.9	14,268	
ウチヤマホールディングス	4	4.7	2,100	
チャーム・ケア・コーポレーション	2.1	8.2	7,691	
ライクキッズ	2.1	1.6	1,425	
キャリアリンク	3.7	3.1	1,810	
IBJ	5.9	6.5	7,936	
アサンテ	3.5	3.8	7,125	
N・フィールド	5.6	6.6	3,709	
バリュートHR	1.9	1.9	6,545	
M&Aキャピタルパートナーズ	2.2	6.8	25,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.6	3.6	5,994	
ERIホールディングス	2.5	2.7	2,068	
アビスト	1.3	1.5	3,799	
シグマクシス	4.1	6.5	10,822	
ウィルグループ	5.6	6.3	6,268	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	12	13.2	2,798	
日本ビューホテル	2.7	—	—	
リクルートホールディングス	613	686.9	3,126,768	
エラン	5.9	5.7	9,370	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
土木管理総合試験所	3.9	4.2	1,751	
ネットマーケティング	—	2.8	2,242	
日本郵政	701.3	785.9	789,829	
ベルシステム24ホールディングス	14.3	16.1	24,278	
鎌倉新書	6.3	7.2	11,865	
SMN	—	1.5	1,210	
一蔵	1.1	1	623	
LITALICO	2	3.3	8,170	
グローバルキッズCOMPANY	1.1	1.4	1,023	
エアトリ	2.5	4.3	5,710	
アトラエ	1.6	2.5	7,012	
ストライク	2.2	3.6	17,028	
ソラスト	20.9	26.4	27,984	
セラク	2	3	3,678	
インソース	2.8	4.6	13,307	
ペイカレント・コンサルティング	4.5	5.8	45,704	
Orchestra Holdings	1.1	2	2,028	
アイモバイル	2.1	3	2,217	
キャリアインデックス	2.9	3.9	1,306	
MS-Japan	3.5	3.1	3,915	
船場	1.5	1.6	1,721	
グレイステクノロジー	2.3	4.4	14,102	
ジャパンエレベーターサービスホールディング	5	10.1	22,381	
フルテック	1	1.3	1,469	
グリーンズ	2.4	2.4	2,066	
ツナググループ・ホールディングス	0.9	1.1	642	
GameWith	—	2.1	1,545	
ソウルドアウト	—	1.5	2,751	
MS&Consulting	1	1.3	1,378	
ミダック	—	0.9	1,086	
日総工産	2.1	6.4	5,235	
キュービーネットホールディングス	3.9	3.9	8,892	
RPAホールディングス	—	5.4	5,891	
スプリックス	2.4	3.2	3,136	
マネジメントソリューションズ	—	1	3,615	
and factory	—	0.7	1,291	
アドバンテッジリスクマネジメント	3.4	4.8	4,176	
リログループ	46.8	52.4	135,558	
東祥	5.3	6	11,868	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
エイチ・アイ・エス	15.2	14.9	37,026	
ラックランド	1.7	2.2	4,683	
共立メンテナンス	13.1	15.9	64,236	
イチネンホールディングス	8.9	10.7	14,712	
建設技術研究所	5.9	6.6	14,652	
スペース	5.6	6.2	7,154	
長大	3.6	3.5	3,773	
燦ホールディングス	1.9	4.2	6,568	
スバル興業	0.6	0.6	5,184	
東京テアトル	4	3.7	4,869	
タナベ経営	1.6	1.8	2,329	
ナガワ	2.4	3.1	20,522	
よみうりランド	1.9	2.1	8,599	
東京都競馬	5.6	6.3	23,152	
常磐興産	3.5	3.8	6,159	
カナモト	12.8	15.7	41,667	
東京ドーム	31.9	38.8	37,519	
西尾レントオール	8.7	9.7	28,382	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	—	61.4	1,842	
トランス・コスモス	9.5	9.1	24,133	
乃村工藝社	20	41.1	48,539	
藤田観光	3.4	4.2	10,361	
KNT-CTホールディングス	4.7	6	6,876	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日本管財	9.1	10.3	19,580	
トーカイ	8.2	9.3	22,896	
白洋舎	1	1.1	3,042	
セコム	90.8	101.8	981,453	
セントラル警備保障	4.1	4.6	25,116	
丹青社	16.1	18.1	20,796	
メイテック	10.8	11.9	67,116	
応用地質	9.1	10.3	14,605	
船井総研ホールディングス	17.6	19.8	59,023	
進学会ホールディングス	3.8	3.7	1,887	
オオバ	6.8	6.9	4,926	
いであ	1.9	1.8	3,481	
学究社	2.7	2.8	3,780	
ベネッセホールディングス	31.3	31.9	94,168	
イオンディライト	10.5	11.8	44,368	
ナック	5.5	5.3	5,273	
ニチイ学館	12.3	13.6	18,142	
ダイセキ	14.3	16.1	47,060	
ステップ	3.1	3.5	5,768	
合 計	株 数 ・ 金 額	103,559	118,785	236,764,705
	銘柄数<比率>	2,102	2,157	<99.2%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(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	株式先物取引	TOPIX	百万円 1,694	百万円 —

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2020年2月20日現在)

区 分	当 期 末
	数 量
貸付有価証券＜株式＞総株数 (モルガン・スタンレー M U F G 証券)	株 25,673,600 (20,358,800)

(注) ()内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

(2020年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 236,764,705	% 82.3
コール・ローン等、その他	50,874,607	17.7
投資信託財産総額	287,639,312	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年2月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	287,632,267,517
コール・ローン等	50,401,407,739
株式(評価額)	236,764,705,400
未収入金	636,179
未収配当金	335,066,388
その他未収収益	59,036,811
差入委託証拠金	71,415,000
(B) 負債	49,028,455,020
未払金	10,079,850
未払解約金	191,126,141
未払利息	△ 604,013
受入担保金	48,827,853,042
(C) 純資産総額(A－B)	238,603,812,497
元本	166,600,985,942
次期繰越損益金	72,002,826,555
(D) 受益権総口数	166,600,985,942口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,322円

<注記事項>

- ①期首元本額 154,272,164,277円
期中追加設定元本額 49,885,928,163円
期中一部解約元本額 37,557,106,498円
また、1口当たり純資産額は、期末1.4322円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	48,631,016,614円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	45,556,714,754円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスファンドＶＡ(適格機関投資家限定)	17,684,791,717円
三菱ＵＦＪ ＤＣトピックスオープン	15,408,170,767円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	10,274,868,460円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスオープン	9,336,334,491円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン(確定拠出年金)	4,740,925,866円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	4,354,997,831円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	3,954,346,010円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(８資産)(確定拠出年金)	2,355,876,963円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン	2,048,979,281円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)	1,194,708,487円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド(成長型)	403,182,184円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド(２ヵ月分配型)	185,054,910円
三菱ＵＦＪ トピックスオープンＶＡ(適格機関投資家限定)	180,143,203円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式65)	115,562,350円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式40)	107,930,967円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式15)	36,541,286円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式25)	16,839,659円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス(国内株式)	13,887,915円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)ＶＡ(適格機関投資家限定)	112,227円
合計	166,600,985,942円

○損益の状況 (2019年2月21日～2020年2月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,588,868,958
受取配当金	5,122,113,825
受取利息	240,838
その他収益金	472,707,587
支払利息	△ 6,193,292
(B) 有価証券売買損益	10,856,183,977
売買益	25,668,799,406
売買損	△14,812,615,429
(C) 先物取引等取引損益	161,593,280
取引益	486,390,590
取引損	△ 324,797,310
(D) 保管費用等	△ 157,948
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	16,606,488,267
(F) 前期繰越損益金	53,333,992,446
(G) 追加信託差損益金	16,374,909,933
(H) 解約差損益金	△14,312,564,091
(I) 計(E＋F＋G＋H)	72,002,826,555
次期繰越損益金(I)	72,002,826,555

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

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

(注) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

【お 知 ら せ】

株式等インデックスファンドのベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。

(2019年7月1日)

三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

《第20期》決算日2020年5月20日

[計算期間：2019年5月21日～2020年5月20日]

「三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド」は、5月20日に第20期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とし、ベンチマーク（MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）並びに外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI コクサイ・インデックス （配当込み、円換算ベース）		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 率	（配当込み、円換算ベース）	騰 落 率				
16期(2016年5月20日)	17,145	△15.6	550,658.40	△16.0	95.4	1.8	2.7	114,202
17期(2017年5月22日)	20,708	20.8	663,775.10	20.5	95.7	1.7	2.5	105,751
18期(2018年5月21日)	23,482	13.4	751,162.81	13.2	95.2	2.5	2.2	106,222
19期(2019年5月20日)	24,065	2.5	767,061.93	2.1	94.3	3.1	2.5	97,464
20期(2020年5月20日)	23,411	△ 2.7	744,889.56	△ 2.9	95.4	2.3	2.4	94,605

(注) MSCI コクサイ・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。
MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCI コクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSC I コクサイ・インデックス (配当込み、 円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率
(期 首) 2019年5月20日	円	%		%	%	%	%
	24,065	—	767,061.93	—	94.3	3.1	2.5
5月末	23,325	△ 3.1	743,484.51	△ 3.1	96.6	3.1	2.6
6月末	24,164	0.4	770,156.42	0.4	94.1	2.3	2.5
7月末	24,822	3.1	790,836.41	3.1	93.5	2.4	2.5
8月末	23,591	△ 2.0	751,785.28	△ 2.0	93.9	6.6	2.7
9月末	24,347	1.2	775,713.31	1.1	95.4	1.8	2.7
10月末	25,313	5.2	805,459.07	5.0	94.6	1.8	2.6
11月末	26,255	9.1	835,911.03	9.0	93.4	3.9	2.6
12月末	27,049	12.4	860,793.53	12.2	94.2	2.3	2.5
2020年1月末	27,082	12.5	861,985.05	12.4	92.7	3.9	2.6
2月末	24,951	3.7	794,123.11	3.5	93.8	3.8	2.7
3月末	21,195	△11.9	675,468.96	△11.9	102.9	6.8	2.8
4月末	23,273	△ 3.3	740,391.09	△ 3.5	90.9	3.0	2.4
(期 末) 2020年5月20日	23,411	△ 2.7	744,889.56	△ 2.9	95.4	2.3	2.4

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

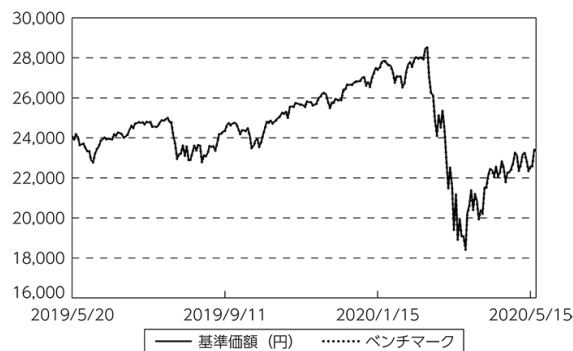
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(－2.9%)を0.2%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎外国株式市況

- ・外国株式市況はほぼ横ばいとなりました。
- ・米国の堅調な企業決算内容などを受けて上昇した一方で、新型肺炎の世界的な感染拡大懸念などを受けて下落し、外国株式市況は期を通して、ほぼ横ばいとなりました。

◎為替市況

- ・米ドル、ユーロは円に対して下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは2.9%の下落となったため、乖離は0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因※によるものです。

※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月21日～2020年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.004	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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
(株 式)	(1)	(0.003)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.008	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(2)	(0.008)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	9	0.039	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(9)	(0.038)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	12	0.051	
期中の平均基準価額は、24,469円です。			

(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

(2019年5月21日～2020年5月20日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 15,327 (1,634)	千アメリカドル 117,804 (4,751)	百株 14,362 (1,084)	千アメリカドル 113,378 (8,363)
	カナダ	2,106 (△ 129)	千カナダドル 9,315 (ー)	2,885 (41)	千カナダドル 8,271 (86)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,212 (18)	4,561 (△ 13)	1,020	4,476
	イタリア	2,543	1,102	2,567	988
	フランス	1,188 (10)	5,409 (△ 3)	1,096	5,203
	オランダ	973	3,595	606	2,441
	スペイン	2,258 (3,904)	1,775 (83)	5,673	1,607
	ベルギー	98	614	75	450
	オーストリア	27 (ー)	77 (△ 9)	28	84
	ルクセンブルク	144	136	89	138
	フィンランド	548 (10)	529 (ー)	414	493
	アイルランド	70 (0.4)	283 (2)	65 (ー)	332 (2)
	ポルトガル	63	82	100	83
	イギリス	14,924 (19,610)	千イギリスポンド 8,201 (△ 33)	12,937 (48,707)	千イギリスポンド 7,457 (125)
	スイス	853 (ー)	千スイスフラン 5,785 (△ 80)	715	千スイスフラン 5,375
	スウェーデン	1,285 (183)	千スウェーデンクローネ 16,581 (318)	1,217 (123)	千スウェーデンクローネ 16,615 (345)
	ノルウェー	275	千ノルウェークローネ 3,135	289	千ノルウェークローネ 3,834
	デンマーク	190	千デンマーククローネ 8,887	182	千デンマーククローネ 7,875
	オーストラリア	3,501 (0.17)	千オーストラリアドル 6,702 (△ 17)	3,167 (9)	千オーストラリアドル 5,859 (1)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ニュージーランド	百株 332	千ニュージーランドドル 186	百株 195	千ニュージーランドドル 78
	香港	5,283 (254)	千香港ドル 18,258 (ー)	5,787	千香港ドル 17,716
	シンガポール	1,195 (629)	千シンガポールドル 850 (ー)	3,609	千シンガポールドル 1,016
	イスラエル	307 (12)	千イスラエルシェケル 469 (ー)	655	千イスラエルシェケル 337

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4	114	2	74
	MACERICH CO/THE	—	—	2	75
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.804	117	0.422	65
	PROLOGIS INC	3 (2)	252 (172)	2	216
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.482	24	0.505	28
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2	294	0.851	108
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2 (2)	265 (—)	0.401	27
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.566	151	0.519	148
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.381	40	0.251	27
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	87	0.813	78
	WELLTOWER INC	2	182	0.83	69
	BOSTON PROPERTIES INC	1	118	0.933	108
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	11	245	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.804	87	0.209	28
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	5	214	—	—
	REALTY INCOME CORP	2	183	2	138
	REGENCY CENTERS CORP	0.518	34	—	—
	SL GREEN REALTY CORP	0.339	27	0.34	28
	SUN COMMUNITIES INC	2	313	0.279	41
	UDR INC	0.573	25	—	—
	VENTAS INC	1	93	1	81
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3	26	3 (33)	27 (313)
	WEYERHAEUSER CO	2	64	1	41
	AMERICAN TOWER CORP	1	449	1	360
	AGNC INVESTMENT CORP	—	—	— (12)	— (216)
	WP CAREY INC	0.797	67	0.633	55
	VEREIT INC	15	86	—	—
	DUKE REALTY CORP	1	52	2	66
	EQUINIX INC	0.496	288	0.294	172
	CROWN CASTLE INTL CORP	1	270	1	217
	EQUITY RESIDENTIAL	2	147	1	101
	INVITATION HOMES INC	5	175	0.917	28
	VICI PROPERTIES INC	10	264	—	—
	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	—	2	50
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.383 (2)	107 (531)	0.173	50
	HOST HOTELS & RESORTS INC	1	25	2	41

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.534 (△ 3)	25 (△ 172)	—	—
	PUBLIC STORAGE	0.85	190	0.692	145
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1	182	1	195
	VORNADO REALTY TRUST	0.389	25	0.799	53
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.524	109	0.448	94
	小 計	97 (3)	5,436 (531)	38 (46)	3,050 (529)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1	93	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3	88	3	87
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	— (4)	— (86)	1	36
	小 計	5 (4)	181 (86)	5	124
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	0.466	56	0.498	66
	KLEPIERRE	0.755	22	1	56
	ICADE	—	—	0.298	22
	小 計	1	79	2	145
	オランダ				
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	100	1	101
	小 計	1	100	1	101
	ユ ー ロ 計	2	180	3	247
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	—	—	5	32
	HAMMERSON PLC	—	—	17	49
	LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	2	18
	小 計	—	—	25	100
	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
	VICINITY CENTRES	—	—	20	54
	SCENTRE GROUP	20	79	23	93
	GPT GROUP	6	37	—	—
	MIRVAC GROUP	12	36	15	46
	STOCKLAND	9	42	—	—
	DEXUS	13	172	7	94
	GOODMAN GROUP	9	109	7	107
	小 計	71	479	74	396
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	9	675	6	515
	小 計	9	675	6	515
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	106 (—)	156 (△0.28038)	58	110

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	45 (-)	111 (△0.01371)	-	-
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	12 (-)	36 (△0.94123)	-	-
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	- (10)	- (-)	10	2
	小 計	164 (10)	303 (△ 1)	69	113

(注) 金額は受渡代金。
(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株式先物取引	百万円 37,238	百万円 37,933	百万円 -	百万円 -

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

○株式売買比率 (2019年5月21日～2020年5月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	36,370,795千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	94,146,450千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.38

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等 (2019年5月21日～2020年5月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 27,533	百万円 20,925	% 76.0	百万円 29,437	百万円 26,347	% 89.5

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銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2020年5月20日現在)

外国株式

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
AMERICAN EXPRESS CO	169	167	1,459	157,616	各種金融	
ABBOTT LABORATORIES	408	424	3,746	404,521	ヘルスケア機器・サービス	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	72	73	602	65,073	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	10	—	—	—	各種金融	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	102	104	1,384	149,513	ソフトウェア・サービス	
AES CORP	157	158	202	21,904	公益事業	
AFLAC INC	175	184	622	67,165	保険	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	204	208	576	62,199	保険	
APACHE CORP	85	85	97	10,540	エネルギー	
ADVANCED MICRO DEVICES	219	254	1,413	152,634	半導体・半導体製造装置	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	12	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ACCENTURE PLC-CL A	148	152	2,890	312,117	ソフトウェア・サービス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	51	52	1,241	134,084	素材	
ANTHEM INC	60	61	1,718	185,579	ヘルスケア機器・サービス	
ANADARKO PETROLEUM CORP	115	—	—	—	エネルギー	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	321	335	1,189	128,456	ヘルスケア機器・サービス	
BAXTER INTERNATIONAL INC	116	116	1,004	108,418	ヘルスケア機器・サービス	
BOEING CO/THE	125	128	1,677	181,174	資本財	
BECTON DICKINSON AND CO	62	65	1,712	184,959	ヘルスケア機器・サービス	
BEST BUY CO INC	57	56	474	51,209	小売	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	379	562	3,528	380,953	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACKROCK INC	27	36	1,830	197,698	各種金融	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	961	988	5,377	580,624	電気通信サービス	
BALL CORP	74	75	484	52,341	素材	
ALLSTATE CORP	80	77	754	81,473	保険	
AVERY DENNISON CORP	21	18	188	20,337	素材	
CHUBB LTD	107	108	1,109	119,756	保険	
ANALOG DEVICES INC	85	88	942	101,772	半導体・半導体製造装置	
AUTOZONE INC	6	5	639	69,048	小売	
CVS HEALTH CORP	300	312	1,987	214,616	ヘルスケア機器・サービス	
CORNING INC	185	201	419	45,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JPMORGAN CHASE & CO	773	750	6,656	718,792	銀行	
CATERPILLAR INC	137	132	1,487	160,574	資本財	
COCA-COLA CO/THE	940	974	4,342	468,895	食品・飲料・タバコ	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	110	112	677	73,170	各種金融	
CAMPBELL SOUP CO	43	37	184	19,931	食品・飲料・タバコ	
CSX CORP	187	177	1,169	126,243	運輸	
CHEVRON CORP	444	454	4,069	439,440	エネルギー	
TAPESTRY INC	61	59	77	8,326	耐久消費財・アパレル	
CONOCOPHILLIPS	268	267	1,142	123,393	エネルギー	
CME GROUP INC	83	86	1,548	167,201	各種金融	
CARDINAL HEALTH INC	70	70	365	39,417	ヘルスケア機器・サービス	
COLGATE-PALMOLIVE CO	191	195	1,355	146,419	家庭用品・パーソナル用品	
DOMINION ENERGY INC	176	197	1,556	168,028	公益事業	
DEVON ENERGY CORP	112	85	104	11,313	エネルギー	
DEERE & CO	71	71	970	104,836	資本財	

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
DANAHER CORP	146	149	2,381	257,108	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	418	432	4,948	534,382	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	28	28	215	23,226	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	166	174	1,457	157,352	公益事業
DR HORTON INC	80	86	447	48,359	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	114	122	1,503	162,338	小売
DAVITA INC	32	22	184	19,885	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	35	35	318	34,408	資本財
DTE ENERGY COMPANY	43	46	476	51,457	公益事業
EXXON MOBIL CORP	985	1,015	4,463	482,008	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	47	50	1,077	116,395	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	134	143	726	78,460	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	145	146	817	88,280	資本財
EXELON CORP	226	233	858	92,692	公益事業
ECOLAB INC	60	62	1,250	134,986	素材
EQUIFAX INC	27	28	421	45,531	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	51	52	922	99,647	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	100	102	781	84,426	資本財
EDISON INTERNATIONAL	77	83	480	51,883	公益事業
ENTERGY CORP	41	51	494	53,404	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	8	9	180	19,499	保険
NEXTERA ENERGY INC	111	116	2,684	289,836	公益事業
MACY'S INC	69	—	—	—	小売
FEDEX CORP	58	59	685	74,035	運輸
FORD MOTOR CO	860	991	525	56,765	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	70	70	126	13,690	各種金融
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	8	256	27,652	各種金融
FIRSTENERGY CORP	121	127	516	55,739	公益事業
FLUOR CORP	32	—	—	—	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	320	321	294	31,763	素材
GENERAL MILLS INC	142	146	888	95,964	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	58	60	829	89,573	資本財
WW GRAINGER INC	10	11	321	34,680	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,021	2,102	1,305	141,011	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	36	72	1,295	139,891	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	32	35	274	29,591	小売
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	58	—	—	—	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	56	—	—	—	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	77	76	1,360	146,876	各種金融
HALLIBURTON CO	199	196	218	23,608	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	172	171	2,257	243,796	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	40	42	92	9,951	自動車・自動車部品
HP INC	364	368	616	66,587	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	82	88	302	32,671	保険
HERSHEY CO/THE	32	35	465	50,252	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	262	261	6,232	673,011	小売
HASBRO INC	29	29	202	21,900	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	58	56	452	48,848	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	211	212	2,550	275,429	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	92	91	292	31,540	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	69	76	1,241	134,025	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	92	92	148	16,051	メディア・娯楽

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
IDEX CORP		17	18	282	30,536	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		21	23	303	32,735	素材
JOHNSON & JOHNSON		624	631	9,407	1,015,803	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN		23	26	379	40,979	運輸
KELLOGG CO		58	61	382	41,296	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP		80	82	1,113	120,269	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		338	344	1,718	185,580	食品・飲料・タバコ
KROGER CO		189	188	599	64,693	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP		37	37	65	7,078	小売
ELI LILLY & CO		208	207	3,253	351,268	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS		24	21	364	39,403	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		29	27	76	8,291	運輸
LENNAR CORP-A		67	69	403	43,603	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC		187	185	2,162	233,538	小売
LEGGETT & PLATT INC		27	27	78	8,487	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC		59	—	—	—	小売
LAS VEGAS SANDS CORP		89	82	395	42,743	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP		59	60	2,251	243,121	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP		50	51	180	19,466	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC		8	8	154	16,676	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC		17	—	—	—	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		67	68	617	66,683	消費者サービス
MCDONALD'S CORP		179	180	3,245	350,454	消費者サービス
S&P GLOBAL INC		58	58	1,824	196,980	各種金融
MEDTRONIC PLC		312	321	3,115	336,436	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.		605	611	4,739	511,725	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC		263	265	1,199	129,479	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC		79	—	—	—	耐久消費財・アパレル
3M CO		135	138	2,048	221,200	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC		38	41	566	61,139	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL		113	112	170	18,409	消費者サービス
MASCO CORP		68	70	319	34,471	資本財
M & T BANK CORP		31	33	306	33,142	銀行
MARSH & MCLENNAN COS		117	120	1,270	137,163	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC		15	13	114	12,364	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY		299	289	1,137	122,776	各種金融
MCKESSON CORP		46	39	564	60,906	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC		194	183	595	64,280	保険
MANPOWERGROUP INC		16	13	90	9,821	商業・専門サービス
MOODY'S CORP		40	40	1,023	110,550	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP		63	62	1,046	113,022	運輸
BANK OF AMERICA CORP		2,168	2,047	4,546	490,945	銀行
NISOURCE INC		83	93	214	23,164	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP		38	38	1,256	135,671	資本財
NEWMONT CORP		191	195	1,317	142,312	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		27	29	508	54,861	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP		3	3	280	30,256	保険
NUCOR CORP		72	74	302	32,612	素材
NEWELL BRANDS INC		115	85	107	11,639	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC		109	102	94	10,169	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		175	210	301	32,605	エネルギー
OMNICOM GROUP		52	53	277	29,959	メディア・娯楽

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
PEPSICO INC	328	333	4,398	474,960	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	23	20	186	20,135	素材
ALTRIA GROUP INC	436	449	1,667	180,037	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	27	27	198	21,469	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	579	597	6,722	725,878	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	107	104	1,057	114,212	銀行
PFIZER INC	1,345	1,328	5,006	540,561	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	95	98	542	58,565	保険
PULTEGROUP INC	56	63	198	21,414	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	31	30	498	53,859	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	39	46	414	44,810	エネルギー
CITIGROUP INC	568	524	2,328	251,444	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	67	61	217	23,460	保険
PPG INDUSTRIES INC	55	55	521	56,288	素材
PENTAIR PLC	42	34	119	12,949	資本財
PPL CORP	162	172	437	47,201	公益事業
PROGRESSIVE CORP	135	140	1,063	114,808	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	115	120	582	62,896	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	39	40	171	18,473	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	66	—	—	—	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	54	58	474	51,233	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	237	214	206	22,325	銀行
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	10	10	170	18,384	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	23	24	891	96,226	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	115	111	190	20,587	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	29	24	117	12,675	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	28	568	61,439	資本財
SCHLUMBERGER LTD	322	375	642	69,387	エネルギー
STRYKER CORP	78	81	1,531	165,411	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	281	275	909	98,225	各種金融
SEMPRA ENERGY	63	67	847	91,501	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19	19	1,116	120,588	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	35	40	488	52,791	資本財
SUNTRUST BANKS INC	103	—	—	—	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	60	64	602	65,020	保険
SOUTHERN CO/THE	239	250	1,339	144,612	公益事業
AT&T INC	1,692	1,751	5,071	547,570	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	64	71	297	32,076	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	86	88	500	54,019	各種金融
SYSCO CORP	113	117	604	65,244	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	37	37	113	12,230	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	223	224	2,534	273,664	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	26	25	328	35,474	小売
TERADYNE INC	—	39	243	26,240	半導体・半導体製造装置
GLOBE LIFE INC	26	23	168	18,144	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	213	186	540	58,310	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	93	96	3,298	356,179	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	54	54	145	15,720	資本財
UNION PACIFIC CORP	171	166	2,652	286,448	運輸
UNUM GROUP	46	46	67	7,323	保険
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	190	362	2,101	226,911	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	223	227	6,570	709,502	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
US BANCORP		358	356	1,141	123,227	銀行
MARATHON OIL CORP		199	170	99	10,694	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		161	168	1,624	175,461	運輸
VALERO ENERGY CORP		97	97	627	67,722	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		19	22	259	28,045	ヘルスケア機器・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B		79	145	286	30,939	メディア・娯楽
VF CORP		77	80	441	47,621	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO		31	31	313	33,811	素材
WILLIAMS COS INC		281	314	610	65,935	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		187	179	715	77,281	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC		75	74	649	70,131	公益事業
WALMART INC		338	340	4,253	459,271	食品・生活必需品小売り
WELLCARE HEALTH PLANS INC		11	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO		1,040	961	2,303	248,722	銀行
WASTE MANAGEMENT INC		99	100	992	107,132	商業・専門サービス
WATERS CORP		18	16	296	31,966	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP		15	13	163	17,616	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP		45	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC		123	126	753	81,353	公益事業
KEYCORP		246	229	234	25,279	銀行
CARMAX INC		39	41	325	35,106	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		48	48	599	64,698	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC		74	76	667	72,078	消費者サービス
TJX COMPANIES INC		288	292	1,468	158,573	小売
CLOROX COMPANY		30	29	601	64,974	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP		31	27	227	24,572	素材
CADENCE DESIGN SYS INC		67	66	571	61,674	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP		98	93	131	14,224	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV		76	147	2,002	216,257	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC		108	117	388	41,969	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC		70	81	574	62,017	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP		178	193	329	35,551	銀行
INTEL CORP		1,061	1,044	6,295	679,786	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC		1,047	1,017	4,540	490,280	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP		21	21	507	54,809	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP		26	—	—	—	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP		102	105	3,220	347,754	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC		227	221	1,230	132,826	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC		70	68	817	88,281	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A		69	69	404	43,664	食品・飲料・タバコ
NORTONLIFELOCK INC		155	147	297	32,152	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC		85	90	814	87,968	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		54	57	504	54,429	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B		296	299	2,741	296,062	耐久消費財・アパレル
EXACT SCIENCES CORP		—	36	305	32,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC		148	142	3,242	350,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC		38	32	105	11,445	銀行
NORTHERN TRUST CORP		50	47	350	37,869	各種金融
MICROSOFT CORP		1,696	1,737	31,909	3,445,595	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC		19	20	533	57,605	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP		98	141	947	102,312	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP		288	284	2,156	232,831	消費者サービス

銘柄	株数	期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ORACLE CORP	617	550	2,882	311,277	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	101	105	4,745	512,456	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18	18	761	82,212	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	167	184	1,347	145,539	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	42	41	461	49,840	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	33	31	181	19,552	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	27	26	287	31,030	小売
LAM RESEARCH CORP	36	34	904	97,617	半導体・半導体製造装置
COPART INC	51	49	417	45,041	商業・専門サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	20	241	26,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WYNN RESORTS LTD	22	20	172	18,592	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,055	1,088	4,160	449,258	メディア・娯楽
XILINX INC	58	60	523	56,551	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	82	81	560	60,548	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	49	63	262	28,313	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	17	18	408	44,069	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	300	304	2,200	237,611	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	30	30	414	44,790	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	26	27	1,482	160,085	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	57	62	1,797	194,077	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	12	12	232	25,093	銀行
PAYCHEX INC	77	83	546	59,012	ソフトウェア・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	104	88	136	14,783	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	14	12	116	12,628	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	30	32	340	36,750	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13	20	318	34,340	運輸
AUTODESK INC	50	53	1,037	111,978	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	47	37	81	8,784	メディア・娯楽
SALESFORCE.COM INC	177	200	3,525	380,632	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	28	—	—	—	小売
ALPHABET INC-CL A	69	71	9,879	1,066,754	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	12	302	32,624	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EAST WEST BANCORP INC	34	34	113	12,229	銀行
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	9	440	47,540	各種金融
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	28	32	262	28,386	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	60	54	212	22,939	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	281	274	2,142	231,344	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	67	59	313	33,878	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	34	35	577	62,369	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	64	65	360	38,911	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	96	101	24,757	2,673,350	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	54	58	670	72,390	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	29	29	329	35,585	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	37	37	643	69,503	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	57	50	121	13,154	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	58	49	200	21,691	各種金融
CERNER CORP	70	74	507	54,752	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	40	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	25	25	536	57,959	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	61	64	595	64,250	商業・専門サービス
EBAY INC	212	183	779	84,191	小売

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
IAC/INTERACTIVECORP		17	19	496	53,639	メディア・娯楽
NVIDIA CORP		134	139	4,918	531,126	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC		56	55	443	47,937	小売
BOOKING HOLDINGS INC		10	10	1,567	169,277	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		301	314	5,422	585,491	各種金融
TRUIST FINANCIAL CORP		178	322	1,044	112,783	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		230	207	695	75,097	各種金融
BORGWARNER INC		50	44	127	13,772	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC		43	—	—	—	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE		25	27	304	32,860	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP		35	37	336	36,312	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC		12	13	128	13,870	保険
AMEREN CORPORATION		56	63	446	48,168	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER		114	118	911	98,413	公益事業
AON PLC		56	—	—	—	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		130	141	492	53,190	食品・飲料・タバコ
HESS CORP		64	60	277	29,964	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC		74	73	170	18,412	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP		66	66	226	24,426	各種金融
RED HAT INC		40	—	—	—	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC		14	13	185	19,997	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A		55	55	147	15,964	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC		36	39	385	41,679	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC		59	54	242	26,235	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP		40	44	420	45,415	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		138	152	416	44,928	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC		46	43	1,350	145,782	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC		34	35	1,216	131,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC		113	116	4,326	467,170	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		59	62	1,757	189,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		223	251	302	32,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELGENE CORP		162	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		134	133	687	74,249	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC		39	39	282	30,543	運輸
FASTENAL CO		66	135	522	56,418	資本財
FISERV INC		91	138	1,423	153,759	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD		126	105	105	11,348	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEKTAR THERAPEUTICS		41	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIRIUS XM HOLDINGS INC		391	338	184	19,916	メディア・娯楽
APPLE INC		1,103	1,065	33,370	3,603,334	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP		37	41	218	23,573	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC		241	250	197	21,279	銀行
ZIONS BANCORP NA		42	43	125	13,598	銀行
COSTAR GROUP INC		8	9	621	67,094	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		50	52	535	57,851	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		34	29	225	24,327	運輸
CENTURYLINK INC		213	239	229	24,746	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC		31	31	142	15,395	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV		115	123	198	21,445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC		94	97	343	37,047	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY		64	56	282	30,478	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD		29	34	120	13,011	食品・飲料・タバコ

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
ADVANCE AUTO PARTS INC		16	16	225	24,389	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC		93	83	100	10,819	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A		38	40	687	74,282	食品・飲料・タバコ
NVR INC		0.75	0.98	307	33,196	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE		11	11	356	38,466	ヘルスケア機器・サービス
AMPHENOL CORP-CL A		68	74	666	72,000	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP		34	34	175	18,957	保険
DISCOVERY INC - A		31	29	61	6,625	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP		99	95	638	68,904	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC		28	33	258	27,906	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		56	47	130	14,066	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C		119	103	217	23,471	メディア・娯楽
AMERIPRISE FINANCIAL INC		32	30	396	42,777	各種金融
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL		61	58	159	17,207	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		132	133	1,239	133,824	各種金融
NASDAQ INC		27	28	315	34,101	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		41	41	32	3,503	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN		36	32	146	15,823	メディア・娯楽
VIACOM INC-CLASS B		76	—	—	—	メディア・娯楽
AUTOLIV INC		21	17	113	12,281	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A		74	75	287	31,000	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		5	6	630	68,100	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		62	72	489	52,820	食品・飲料・タバコ
QURATE RETAIL INC-SERIES A		94	—	—	—	小売
ARROW ELECTRONICS INC		17	17	113	12,259	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN & BROWN INC		—	56	215	23,272	保険
CUMMINS INC		34	35	555	60,025	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		27	29	219	23,749	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN		57	57	75	8,150	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS		13	14	258	27,923	素材
CIMAREX ENERGY CO		22	—	—	—	エネルギー
RALPH LAUREN CORP		11	11	81	8,802	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP		52	60	281	30,409	公益事業
HANESBRANDS INC		88	88	81	8,835	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A		213	215	6,259	675,923	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO		112	99	186	20,188	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC		34	32	321	34,750	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV		25	26	73	7,973	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A		25	21	43	4,691	資本財
IPG PHOTONICS CORP		9	7	117	12,734	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE		80	81	90	9,755	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		60	47	73	7,933	消費者サービス
HEICO CORP		—	10	89	9,671	資本財
TRANSIGM GROUP INC		10	11	405	43,838	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO		28	28	342	37,029	ソフトウェア・サービス
INSULET CORP		—	13	272	29,430	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC		31	30	612	66,107	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		91	118	130	14,111	銀行
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A		—	159	841	90,828	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD		81	84	646	69,773	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		77	86	341	36,917	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC		22	26	659	71,180	耐久消費財・アパレル

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
WABCO HOLDINGS INC		10	10	146	15,794	資本財
MERCADOLIBRE INC		9	10	863	93,206	小売
VMWARE INC-CLASS A		18	17	247	26,700	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP		61	64	200	21,659	保険
SEATTLE GENETICS INC		28	28	452	48,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC		13	13	281	30,372	小売
LKQ CORP		69	68	170	18,427	小売
HORMEL FOODS CORP		69	68	323	34,980	食品・飲料・タバコ
ESSENTIAL UTILITIES INC		—	50	199	21,576	公益事業
EASTMAN CHEMICAL CO		31	31	197	21,359	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC		27	52	947	102,308	資本財
HUMANA INC		31	31	1,252	135,238	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC		68	54	193	20,864	公益事業
INVESCO LTD		100	83	60	6,545	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		40	43	404	43,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY		32	26	134	14,520	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		37	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC		47	44	255	27,535	エネルギー
MSCI INC		20	21	712	76,938	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		21	—	—	—	エネルギー
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B		42	46	175	19,002	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		361	373	2,556	276,001	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES		409	410	7,771	839,210	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP		97	97	177	19,136	エネルギー
FLOWERVE CORP		26	32	78	8,428	資本財
HELMERICH & PAYNE		22	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC		80	102	1,009	108,991	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C		71	85	163	17,692	メディア・娯楽
RESMED INC		34	35	576	62,230	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC		20	21	242	26,180	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC		55	60	505	54,609	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD		90	97	236	25,520	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC		55	59	427	46,142	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		21	18	191	20,700	運輸
PERRIGO CO PLC		31	31	170	18,423	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP		32	32	288	31,200	素材
WABTEC CORP		31	44	246	26,645	資本財
EVERSOURCE ENERGY		74	78	613	66,277	公益事業
INGREDION INC		17	14	112	12,094	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC		78	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC		32	32	205	22,154	素材
EATON VANCE CORP		30	29	102	11,112	各種金融
DELTA AIR LINES INC		36	41	91	9,861	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC		41	45	551	59,559	公益事業
VERISK ANALYTICS INC		36	37	586	63,319	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP		60	61	1,117	120,614	小売
FORTINET INC		35	34	503	54,372	ソフトウェア・サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC		14	—	—	—	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		5	5	416	44,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC		21	—	—	—	銀行
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR		6	—	—	—	運輸
GENERAL MOTORS CO		296	307	759	82,017	自動車・自動車部品

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
NXP SEMICONDUCTORS NV		79	69	683	73,801	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A		76	64	375	40,500	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		10	9	157	16,992	資本財
HCA HEALTHCARE INC		63	64	670	72,436	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP		36	31	93	10,128	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP		161	158	546	59,038	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP		28	29	287	31,039	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		29	34	205	22,160	資本財
DEXCOM INC		21	22	899	97,112	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP		13	13	84	9,130	資本財
XYLEM INC		41	41	252	27,220	資本財
ABIOMED INC		9	10	199	21,507	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC		25	25	47	5,103	メディア・娯楽
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		12	12	141	15,291	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA		37	40	395	42,739	銀行
ALLEGHANY CORP		3	3	155	16,777	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS		18	19	1,088	117,589	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66		102	108	818	88,410	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A		558	577	12,527	1,352,687	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP		66	69	381	41,209	公益事業
ALBEMARLE CORP		24	24	156	16,897	素材
PVH CORP		18	15	62	6,795	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC		475	489	751	81,146	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC		75	86	115	12,419	商業・専門サービス
APTIV PLC		59	61	431	46,629	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		36	36	131	14,211	資本財
SPLUNK INC		34	39	622	67,241	ソフトウェア・サービス
HEICO CORP-CLASS A		—	19	143	15,503	資本財
OGE ENERGY CORP		51	45	137	14,855	公益事業
POLARIS INC		13	13	110	11,891	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC		349	423	3,859	416,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC		—	8	278	30,124	資本財
SAREPTA THERAPEUTICS INC		—	15	230	24,926	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC		29	32	2,628	283,820	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC		52	51	220	23,760	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		29	29	184	19,880	各種金融
ZOETIS INC		111	114	1,540	166,326	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		—	17	361	39,088	ヘルスケア機器・サービス
NEWS CORP - CLASS A		102	103	115	12,443	メディア・娯楽
SPRINT CORP		155	—	—	—	電気通信サービス
SNAP-ON INC		13	12	159	17,259	資本財
PERKINELMER INC		—	25	234	25,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAPRI HOLDINGS LTD		35	35	47	5,126	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC		159	175	525	56,769	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		17	18	354	38,296	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A		69	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		34	39	625	67,499	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC		41	45	1,737	187,616	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		18	20	202	21,879	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		20	20	475	51,316	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC		20	23	216	23,417	資本財
ALPHABET INC-CL C		73	74	10,189	1,100,303	メディア・娯楽

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
UNITED RENTALS INC		18	18	224	24,273	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		29	—	—	—	運輸
VOYA FINANCIAL INC		39	34	142	15,413	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP		9	9	39	4,228	素材
IQVIA HOLDINGS INC		36	42	597	64,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC		94	81	130	14,041	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		63	69	526	56,819	消費者サービス
CDK GLOBAL INC		30	25	97	10,581	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC		35	33	138	14,976	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN		42	46	445	48,067	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C		26	25	326	35,206	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE		24	27	389	42,037	メディア・娯楽
OWENS CORNING		28	22	99	10,726	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		51	47	58	6,333	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC		21	23	542	58,547	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL		153	138	244	26,444	各種金融
QORVO INC		29	25	253	27,372	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC		—	30	163	17,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO		44	44	398	43,039	保険
ACUITY BRANDS INC		9	9	79	8,592	資本財
JONES LANG LASALLE INC		9	11	109	11,806	不動産
ARAMARK		59	53	132	14,355	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP		111	104	216	23,401	銀行
LEAR CORP		14	14	152	16,452	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		22	27	393	42,457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		43	55	115	12,492	素材
TARGA RESOURCES CORP		58	51	86	9,288	エネルギー
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL		—	8	82	8,859	ソフトウェア・サービス
GRUBHUB INC		22	22	128	13,828	小売
CHEMOURS CO/THE		42	—	—	—	素材
WESTROCK CO		62	54	136	14,748	素材
KRAFT HEINZ CO/THE		144	159	477	51,565	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC		260	267	3,891	420,236	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC		—	12	275	29,723	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC		—	11	316	34,157	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A		17	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C		28	28	145	15,667	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		332	314	315	34,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO		1	1	56	6,048	運輸
CDW CORP/DE		36	34	367	39,667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SABRE CORP		68	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A		123	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC		11	12	284	30,682	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP		40	40	244	26,348	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION		41	44	349	37,787	商業・専門サービス
GODADDY INC - CLASS A		40	40	300	32,458	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC		—	13	112	12,190	メディア・娯楽
WAYFAIR INC- CLASS A		14	14	225	24,397	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		48	48	34	3,684	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		41	41	136	14,774	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP -RIGHT		—	5	4	459	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		15	16	54	5,921	メディア・娯楽

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		50	51	167	18,116	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC		8	10	189	20,419	消費者サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A		—	5	237	25,688	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC		8	9	343	37,116	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		37	36	1,876	202,646	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC		20	20	594	64,151	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP		34	28	120	12,996	資本財
UGI CORP		40	44	135	14,580	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		49	50	182	19,753	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP		70	74	440	47,583	資本財
IHS MARKIT LTD		92	93	630	68,099	商業・専門サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		54	57	321	34,700	ソフトウェア・サービス
COTY INC-CL A		126	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC		—	18	182	19,692	ソフトウェア・サービス
HOWMET AEROSPACE INC		108	86	104	11,252	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC		36	35	195	21,141	食品・飲料・タバコ
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A		58	—	—	—	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		13	13	117	12,656	保険
TELEFLEX INC		10	11	389	42,026	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC		50	—	—	—	電気通信サービス
BEIGENE LTD-ADR		8	8	135	14,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TECHNIPFMC PLC		91	89	62	6,729	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		29	31	608	65,685	ヘルスケア機器・サービス
TWILIO INC - A		—	27	510	55,104	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC		26	26	262	28,343	各種金融
SNAP INC - A		—	184	321	34,754	メディア・娯楽
DXC TECHNOLOGY CO		66	62	100	10,825	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		39	30	80	8,701	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		18	18	102	11,042	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC		44	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC		38	34	102	11,089	資本財
ROLLINS INC		33	33	132	14,315	商業・専門サービス
XPO LOGISTICS INC		29	21	144	15,597	運輸
BAKER HUGHES CO		125	160	233	25,186	エネルギー
OKTA INC		—	25	468	50,636	ソフトウェア・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC		20	—	—	—	保険
DUPONT DE NEMOURS INC		532	178	853	92,134	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION		25	26	103	11,195	運輸
BLACK KNIGHT INC		—	34	257	27,855	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A		70	85	673	72,772	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP		71	84	165	17,899	公益事業
INGERSOLL-RAND INC		—	86	245	26,539	資本財
TYLER TECHNOLOGIES INC		—	8	316	34,214	ソフトウェア・サービス
PTC INC		24	26	185	20,030	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC		96	95	2,596	280,319	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC		62	56	325	35,170	公益事業
ALTICE USA INC- A		79	34	84	9,112	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A		—	5	100	10,890	保険
DOCUSIGN INC		—	23	300	32,488	ソフトウェア・サービス
LINDE PLC		128	129	2,458	265,438	素材
WIX.COM LTD		11	11	210	22,767	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC		57	97	167	18,087	各種金融

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BURLINGTON STORES INC	16	15	271	29,363	小売
KKR & CO INC	104	119	308	33,350	各種金融
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	67	89	173	18,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIGNA CORP	88	90	1,729	186,706	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	34	33	148	16,011	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MONGODB INC	—	10	213	23,089	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	76	84	231	25,033	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	35	46	124	13,439	メディア・娯楽
DOW INC	177	181	647	69,921	素材
DROPBOX INC-CLASS A	—	48	104	11,280	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	—	19	307	33,194	ヘルスケア機器・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	—	104	348	37,619	運輸
CORTEVA INC	—	192	460	49,746	素材
AMCOR PLC	—	382	359	38,861	素材
XEROX HOLDINGS CORP	—	45	79	8,600	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROKU INC	—	22	262	28,375	メディア・娯楽
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	32	234	25,343	ソフトウェア・サービス
PINTEREST INC- CLASS A	—	65	122	13,266	メディア・娯楽
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	17	473	51,124	ソフトウェア・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	—	30	210	22,689	素材
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	—	338	211	22,788	各種金融
AGNC INVESTMENT CORP	—	124	161	17,491	各種金融
AON PLC	—	55	1,084	117,142	保険
OTIS WORLDWIDE CORP	—	93	489	52,869	資本財
CARRIER GLOBAL CORP	—	187	332	35,920	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	280	280	109	11,821	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	53	53	113	12,229	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	51	51	223	24,170	資本財
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	80	80	37	4,085	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	70,489	72,003	598,708	64,648,535
銘柄数<比率>		598	602	—	<68.3%>
(カナダ)			千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	336	342	2,863	222,155	銀行
IMPERIAL OIL LTD	69	60	125	9,700	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	44	44	418	32,457	商業・専門サービス
TC ENERGY CORP	215	224	1,374	106,665	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	82	94	521	40,473	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	135	154	709	55,065	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	114	113	152	11,808	素材
BARRICK GOLD CORP	408	424	1,660	128,812	素材
BCE INC	33	33	182	14,162	電気通信サービス
BOMBARDIER INC-B	530	—	—	—	資本財
BANK OF MONTREAL	150	160	1,043	80,956	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	195	305	1,272	98,751	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	286	292	1,491	115,713	銀行
BAUSCH HEALTH COS INC	76	67	167	12,989	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	60	60	124	9,635	資本財
CAMECO CORP	106	75	102	7,948	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	44	45	67	5,264	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	102	108	884	68,595	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	278	301	754	58,519	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	170	172	1,950	151,291	運輸

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		13	13	126	9,833	小売
ENBRIDGE INC		472	489	2,185	169,576	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		6	6	221	17,147	保険
CGI INC		59	60	509	39,514	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC		91	—	—	—	エネルギー
IGM FINANCIAL INC		23	23	67	5,254	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD		41	44	302	23,450	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP		459	470	747	57,975	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC		73	66	352	27,311	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA		78	80	427	33,185	銀行
ONEX CORPORATION		17	21	131	10,231	各種金融
POWER CORP OF CANADA		70	138	290	22,525	保険
POWER FINANCIAL CORP		58	—	—	—	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		112	112	251	19,541	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY INC		371	380	910	70,664	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD		16	16	166	12,952	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		34	34	1,098	85,185	運輸
ENCANA CORP		330	—	—	—	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD		57	58	549	42,638	素材
FINNING INTERNATIONAL INC		46	—	—	—	資本財
KINROSS GOLD CORP		232	328	345	26,794	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC		45	—	—	—	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC		70	56	113	8,841	保険
METHANEX CORP		13	13	30	2,362	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		281	—	—	—	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC		44	42	77	5,979	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC		49	57	196	15,242	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD		131	131	82	6,372	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP		57	114	258	20,049	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		163	163	136	10,571	素材
FORTIS INC		98	104	536	41,632	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		102	220	905	70,284	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP		162	162	107	8,357	素材
TORONTO-DOMINION BANK		427	431	2,419	187,715	銀行
FRANCO-NEVADA CORP		45	46	953	73,985	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		97	109	708	54,999	素材
EMPIRE CO LTD 'A'		37	37	114	8,918	食品・生活必需品小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A		34	34	106	8,224	公益事業
METRO INC/CN		60	69	408	31,700	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP		65	67	370	28,780	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP		31	34	452	35,071	保険
CENOVUS ENERGY INC		254	224	125	9,731	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		96	—	—	—	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP		62	—	—	—	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		117	125	439	34,069	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		26	—	—	—	エネルギー
DOLLARAMA INC		70	70	305	23,677	小売
KEYERA CORP		51	51	111	8,649	エネルギー
ALTAGAS LTD		63	63	98	7,605	公益事業
ATCO LTD -CLASS I		21	14	50	3,953	公益事業
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		41	—	—	—	不動産
INTER PIPELINE LTD		98	98	117	9,131	エネルギー

銘柄		株数	期首(前期末)	当期		業種等
				株数	評価額	
					外貨建金額	
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		58	36	35	2,730	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		68	—	—	—	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		5	5	744	57,773	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN		56	70	514	39,944	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD		9	15	58	4,525	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B		37	31	129	10,079	素材
HYDRO ONE LTD		65	80	204	15,869	公益事業
EMERA INC		17	58	309	24,019	公益事業
SHOPIFY INC - CLASS A		21	25	2,623	203,517	ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD		141	142	641	49,745	素材
WSP GLOBAL INC		24	24	212	16,479	資本財
AURORA CANNABIS INC		163	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANOPY GROWTH CORP		49	49	117	9,138	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STARS GROUP INC/THE		43	47	176	13,669	消費者サービス
IA FINANCIAL CORP INC		20	22	87	6,789	保険
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		—	60	338	26,225	素材
CRONOS GROUP INC		44	44	34	2,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUEBECOR INC -CL B		—	40	115	8,943	メディア・娯楽
AIR CANADA		—	30	50	3,893	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		—	116	222	17,251	公益事業
PARKLAND FUEL CORP		—	33	120	9,316	エネルギー
小計	株数・金額	9,825	8,875	40,516	3,143,243	
	銘柄数<比率>	88	80	—	<3.3%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG		217	253	83	9,807	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		456	522	344	40,637	各種金融
SIEMENS AG-REG		177	184	1,714	202,424	資本財
RWE AG		114	139	394	46,556	公益事業
BASF SE		213	220	1,009	119,168	素材
VOLKSWAGEN AG		6	6	88	10,395	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		211	219	680	80,359	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		41	47	369	43,601	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE		496	559	527	62,261	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		75	79	396	46,808	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG		216	236	1,430	168,979	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANZ SE-REG		98	99	1,565	184,843	保険
CONTINENTAL AG		25	25	208	24,659	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG		258	294	547	64,642	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		37	37	173	20,434	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		58	58	47	5,585	運輸
HUGO BOSS AG -ORD		16	—	—	—	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG		227	243	675	79,739	運輸
SAP SE		228	235	2,542	300,278	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE		62	—	—	—	メディア・娯楽
DEUTSCHE BOERSE AG		44	47	721	85,175	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		50	51	377	44,616	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		9	9	37	4,443	運輸
ADIDAS AG		42	43	946	111,839	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		776	795	1,085	128,226	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		34	34	643	76,008	保険
THYSSENKRUPP AG		109	91	47	5,601	素材
BEIERSDORF AG		23	23	222	26,312	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
HEIDELBERGCEMENT AG		33	37	157	18,546	素材
MERCK KGAA		28	30	319	37,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF		43	45	607	71,695	自動車・自動車部品
PUMA SE		2	17	106	12,540	耐久消費財・アパレル
LANXESS AG		21	21	98	11,623	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA		94	98	411	48,558	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG		5	5	38	4,496	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE		80	85	328	38,812	不動産
GEA GROUP AG		36	36	93	11,005	資本財
SYMRISE AG		29	29	284	33,551	素材
HENKEL AG & CO KGAA		22	23	164	19,471	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		29	20	76	9,089	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		13	13	55	6,583	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE		14	14	198	23,389	保険
BRENNTAG AG		36	36	163	19,282	資本財
AXEL SPRINGER SE		13	—	—	—	メディア・娯楽
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		—	9	85	10,126	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB SE-PREF		14	14	50	5,914	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		199	199	55	6,578	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG		20	—	—	—	資本財
VONOVIA SE		117	129	634	74,922	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG		41	54	120	14,232	素材
ZALANDO SE		24	30	166	19,611	小売
COVESTRO AG		41	41	126	14,974	素材
UNIPER SE		50	42	108	12,804	公益事業
INNOGY SE		32	—	—	—	公益事業
METRO AG		48	48	39	4,654	食品・生活必需品小売り
KION GROUP AG		18	14	65	7,781	資本財
I&I DRILLISCH AG		12	—	—	—	電気通信サービス
MTU AERO ENGINES AG		11	15	205	24,318	資本財
WIRECARD AG		26	27	229	27,088	ソフトウェア・サービス
DELIVERY HERO SE		22	24	203	24,078	小売
SARTORIUS AG-VORZUG		8	8	259	30,637	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		37	32	142	16,781	ヘルスケア機器・サービス
KNORR-BREMSE AG		—	11	98	11,637	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	5,573	5,783	22,573	2,665,983	
	銘柄 数 < 比 率 >	61	57	—	<2.8%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		271	248	303	35,860	保険
INTESA SANPAOLO		3,467	3,511	502	59,339	銀行
TELECOM ITALIA SPA		2,968	2,070	71	8,491	電気通信サービス
ENI SPA		597	623	523	61,775	エネルギー
UNICREDIT SPA		457	528	343	40,530	銀行
ENEL SPA		1,909	1,942	1,172	138,529	公益事業
RECORDATI SPA		22	22	93	10,995	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLANTIA SPA		117	105	142	16,872	運輸
MEDIOBANCA SPA		154	154	78	9,328	銀行
SNAM SPA		553	581	232	27,496	公益事業
TELECOM ITALIA-RSP		871	1,411	49	5,844	電気通信サービス
LEONARDO SPA		89	89	48	5,710	資本財
TERNA SPA		312	343	188	22,311	公益事業
PRYSMIAN SPA		45	58	105	12,414	資本財

銘柄		期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		148	139	94	11,142	食品・飲料・タバコ
POSTE ITALIANE SPA		113	116	86	10,162	保険
FINECOBANK SPA		—	128	126	14,922	銀行
MONCLER SPA		44	43	139	16,463	耐久消費財・アパレル
PIRELLI & C SPA		94	94	32	3,831	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	12,238	12,215	4,335	512,025	
銘 柄 数 < 比 率 >		18	19	—	<0.5%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)		39	40	355	41,978	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		64	66	2,384	281,654	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA		138	141	164	19,415	自動車・自動車部品
AXA SA		451	455	714	84,355	保険
DANONE		143	147	909	107,418	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA		127	140	175	20,728	食品・生活必需品小売り
VIVENDI		238	198	388	45,877	メディア・娯楽
INGENICO GROUP		15	12	156	18,492	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA		182	189	234	27,648	銀行
AIR LIQUIDE SA		99	112	1,307	154,456	素材
TOTAL SA		562	577	1,903	224,750	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		115	117	292	34,559	資本財
VINCI SA		118	123	959	113,371	資本財
SANOFI		262	270	2,349	277,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		122	123	225	26,663	公益事業
L'OREAL		58	60	1,490	176,033	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA		44	36	78	9,268	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		127	131	1,091	128,952	資本財
BNP PARIBAS		261	265	751	88,742	銀行
ESSILORLUXOTTICA		65	67	760	89,775	耐久消費財・アパレル
CAPGEMINI SE		37	38	332	39,259	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		14	14	45	5,423	食品・生活必需品小売り
VALEO SA		54	54	101	11,968	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL		7	7	547	64,620	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA		19	28	160	18,896	消費者サービス
KERING		17	18	793	93,753	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA		30	33	463	54,781	ソフトウェア・サービス
ATOS SE		23	23	147	17,474	ソフトウェア・サービス
ORANGE		457	499	507	59,962	電気通信サービス
CNP ASSURANCES		36	36	33	3,928	保険
IMERYS SA		9	—	—	—	素材
SAFRAN SA		77	76	604	71,339	資本財
RENAULT SA		42	40	68	8,132	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE		46	56	140	16,548	メディア・娯楽
JCDECAUX SA		20	20	37	4,394	メディア・娯楽
SOCIETE BIC SA		7	—	—	—	商業・専門サービス
BOUYGUES SA		52	52	133	15,806	資本財
THALES SA		23	24	158	18,665	資本財
PERNOD RICARD SA		48	51	679	80,243	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA		258	255	179	21,221	銀行
ENGIE		415	430	419	49,505	公益事業
ALSTOM		39	47	182	21,497	資本財
ARKEMA		14	17	131	15,577	素材
LEGRAND SA		61	70	405	47,904	資本財

銘柄		株数	期首(前期末)	当期		業種等
			株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SCOR SE		40	32	76	9,019	保険
ADP		6	6	54	6,414	運輸
EDF		151	130	96	11,370	公益事業
NATIXIS		225	225	43	5,165	各種金融
WENDEL		6	6	51	6,090	各種金融
BUREAU VERITAS SA		54	66	123	14,570	商業・専門サービス
EURAZEO SE		13	9	38	4,572	各種金融
SUEZ		88	71	67	7,928	公益事業
EIFPAGE		19	24	184	21,847	資本財
ILIAD SA		7	5	72	8,534	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		30	44	40	4,742	メディア・娯楽
BIOMERIEUX		10	10	129	15,298	ヘルスケア機器・サービス
GETLINK SE		95	91	102	12,061	運輸
EDENRED		51	59	208	24,644	ソフトウェア・サービス
REMY COINTREAU		5	5	60	7,197	食品・飲料・タバコ
REXEL SA		66	—	—	—	資本財
BOLLORE		169	225	56	6,636	メディア・娯楽
DASSAULT AVIATION SA		0.63	0.63	43	5,137	資本財
SEB SA		5	6	65	7,769	耐久消費財・アパレル
IPSEN		8	8	56	6,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA		15	15	91	10,854	各種金融
FAURECIA		18	18	60	7,161	自動車・自動車部品
TELEPERFORMANCE		12	13	295	34,855	商業・専門サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		20	20	137	16,182	メディア・娯楽
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		7	7	157	18,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDLINE SA		19	28	180	21,369	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	6,210	6,312	25,463	3,007,204	
	銘柄数<比率>	70	67	—	<3.2%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.		49	56	221	26,147	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV		248	252	130	15,395	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		247	245	182	21,537	自動車・自動車部品
FERRARI NV		28	28	418	49,451	自動車・自動車部品
EXOR NV		25	25	116	13,720	各種金融
AIRBUS SE		135	137	748	88,370	資本財
STMICROELECTRONICS NV		161	164	366	43,254	半導体・半導体製造装置
WOLTERS KLUWER		67	66	442	52,217	商業・専門サービス
UNILEVER NV		—	352	1,563	184,619	家庭用品・パーソナル用品
KONINKLIJKE KPN NV		834	834	173	20,473	電気通信サービス
AKZO NOBEL N.V.		52	46	332	39,320	素材
HEINEKEN NV		58	61	465	54,921	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV		214	218	870	102,816	ヘルスケア機器・サービス
AEGON NV		436	372	84	9,998	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		269	276	622	73,468	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD NV		27	27	102	12,054	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV		27	25	174	20,619	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		41	42	475	56,109	素材
ING GROEP NV		904	1,002	520	61,474	銀行
ASML HOLDING NV		95	102	2,906	343,265	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA		358	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		14	15	75	8,875	エネルギー
NN GROUP NV		75	90	235	27,781	保険

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ALTICE EUROPE NV		—	154	58	6,957	メディア・娯楽
ABN AMRO BANK NV-CVA		91	87	55	6,603	銀行
ADYEN NV		2	2	262	30,942	ソフトウェア・サービス
JUST EAT TAKEAWAY		—	28	277	32,797	小売
PROSUS NV		—	115	940	111,035	小売
小 計	株 数 ・ 金 額	4,470	4,837	12,821	1,514,232	
	銘 柄 数 < 比 率 >	24	27	—	<1.6%>	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		64	48	63	7,480	資本財
ENDESA SA		72	72	146	17,267	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		55	62	129	15,313	資本財
IBERDROLA SA		1,451	1,459	1,300	153,590	公益事業
TELEFONICA SA		1,081	1,140	444	52,516	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		3,784	4,098	747	88,257	銀行
BANKINTER SA		176	150	52	6,152	銀行
REPSOL SA		323	336	287	33,936	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,542	1,670	434	51,260	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		76	62	96	11,404	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		250	262	605	71,456	小売
MAPFRE SA		297	335	49	5,847	保険
FERROVIAL SA		108	113	258	30,483	資本財
FERROVIAL SA-RTS		108	—	—	—	資本財
ENAGAS SA		60	51	104	12,331	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		94	101	159	18,848	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,253	1,272	34	4,105	銀行
CAIXABANK SA		792	784	121	14,353	銀行
GRIFOLS SA		72	70	204	24,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA		101	104	450	53,221	ソフトウェア・サービス
BANKIA SA		331	331	26	3,163	銀行
AENA SME SA		16	16	187	22,129	運輸
CELLNEX TELECOM SA		—	60	300	35,493	電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	12,117	12,607	6,204	732,733	
	銘 柄 数 < 比 率 >	22	22	—	<0.8%>	
(ユーロ…ベルギー)						
GALAPAGOS NV		—	10	205	24,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGEAS		39	45	137	16,271	保険
UCB SA		29	29	246	29,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		19	19	130	15,437	各種金融
UMICORE		52	44	153	18,134	素材
COLRUYT SA		16	12	67	8,012	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV		57	61	260	30,779	銀行
SOLVAY SA		17	23	160	18,897	素材
PROXIMUS		28	37	66	7,839	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		14	10	33	3,991	メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		176	180	683	80,662	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	452	474	2,146	253,508	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		66	73	134	15,914	銀行
VERBUND AG		17	17	64	7,635	公益事業
OMV AG		35	35	105	12,466	エネルギー
VOESTALPINE AG		18	27	46	5,541	素材

銘柄		期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	資本財 銀行
ANDRITZ AG		19	13	40	4,771	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		40	29	44	5,306	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	197	196	437	51,636	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP		10	—	—	—	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		192	270	128	15,130	不動産
TENARIS SA		110	110	62	7,400	エネルギー
SES		94	81	48	5,762	メディア・娯楽
EUROFINS SCIENTIFIC		2	2	142	16,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL		153	154	132	15,671	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	564	619	514	60,806	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		1,278	1,403	476	56,270	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		132	132	140	16,599	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ		29	29	52	6,200	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		120	129	329	38,876	素材
FORTUM OYJ		97	97	152	17,951	公益事業
KONE OYJ-B		78	81	467	55,222	資本財
METSO OYJ		29	21	57	6,841	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		105	119	356	42,052	保険
WARTSILA OYJ ABP		104	104	72	8,548	資本財
ELISA OYJ		31	32	170	20,188	電気通信サービス
NESTE OYJ		89	95	316	37,434	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		27	21	94	11,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,124	2,268	2,686	317,317	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		37	37	384	45,451	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		37	33	167	19,724	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		20	19	233	27,595	消費者サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW		—	0.4	4	554	消費者サービス
BANK OF IRELAND GROUP PLC		233	233	36	4,304	銀行
AIB GROUP PLC		200	200	20	2,385	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		47	57	165	19,598	素材
CRH PLC		189	188	516	61,001	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	766	771	1,529	180,615	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		634	574	233	27,628	公益事業
JERONIMO MARTINS		54	54	79	9,391	食品・生活必需品小売り
GALP ENERGIA SGPS SA		109	133	139	16,476	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	799	762	452	53,495	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	45,514	46,849	79,166	9,349,559	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		3,989	4,413	462	61,202	銀行
BP PLC		4,671	4,871	1,530	202,682	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		16,655	17,613	521	69,008	銀行
ASTRAZENECA PLC		295	315	2,734	362,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
SMITHS GROUP PLC		87	101	127	16,844	資本財
NEXT PLC		31	28	126	16,800	小売
DIAGEO PLC		565	563	1,601	212,098	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC		759	745	370	49,113	資本財
UNILEVER PLC		258	267	1,101	145,888	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC		2,252	2,366	561	74,420	食品・生活必需品小売り
RELX PLC		459	462	850	112,671	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		375	377	32	4,284	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		156	170	1,201	159,178	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC		—	95	210	27,884	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRUDENTIAL PLC		603	618	693	91,847	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		1,425	1,570	301	39,991	保険
SAGE GROUP PLC/THE		261	262	174	23,128	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC		4,669	4,866	2,002	265,222	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		533	551	1,679	222,424	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC		146	165	148	19,673	公益事業
SCHRODERS PLC		28	28	80	10,651	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		1,095	1,197	127	16,917	銀行
BHP GROUP PLC		493	502	774	102,616	素材
IMPERIAL BRANDS PLC		218	229	355	47,016	食品・飲料・タバコ
WPP PLC		286	280	163	21,665	メディア・娯楽
CENTRICA PLC		1,333	1,333	49	6,571	公益事業
BT GROUP PLC		1,966	1,966	218	28,976	電気通信サービス
SSE PLC		233	242	296	39,322	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC		656	636	261	34,601	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		387	409	109	14,510	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT		29,619	—	—	—	資本財
COMPASS GROUP PLC		375	380	424	56,160	消費者サービス
KINGFISHER PLC		522	420	70	9,288	小売
PEARSON PLC		195	204	89	11,881	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC		49	51	123	16,379	公益事業
RIO TINTO PLC		269	270	1,155	152,988	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,156	1,197	1,989	263,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC		234	235	191	25,330	各種金融
VODAFONE GROUP PLC		6,210	6,387	811	107,485	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS		462	559	104	13,902	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC		433	433	79	10,538	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC		927	938	224	29,758	保険
JOHNSON MATTHEY PLC		46	46	93	12,341	素材
RENTOKIL INITIAL PLC		—	436	212	28,182	商業・専門サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC		244	244	90	12,032	保険
WHITBREAD PLC		40	32	94	12,550	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC		780	828	757	100,307	公益事業
BUNZL PLC		74	84	151	20,107	資本財
ANGLO AMERICAN PLC		240	266	428	56,728	素材
INTERTEK GROUP PLC		36	38	185	24,539	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		90	88	125	16,590	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		38	51	189	25,126	消費者サービス
CARNIVAL PLC		41	—	—	—	消費者サービス
PERSIMMON PLC		70	73	160	21,249	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC		201	321	88	11,714	資本財
ITV PLC		728	758	58	7,683	メディア・娯楽

銘柄		期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		74	78	649	85,985	各種金融
G4S PLC		405	—	—	—	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		30	30	124	16,422	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		232	232	116	15,480	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC		199	208	336	44,519	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		667	780	113	15,022	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		1,052	984	1,288	170,679	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		868	914	1,142	151,326	エネルギー
INVESTEC PLC		182	—	—	—	各種金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		610	517	120	15,993	各種金融
EXPERIAN PLC		213	225	569	75,468	商業・専門サービス
MONDI PLC		79	103	140	18,636	素材
WEIR GROUP PLC/THE		59	59	58	7,721	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		88	77	129	17,102	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC		101	108	90	12,023	素材
ADMIRAL GROUP PLC		42	42	97	12,883	保険
FRESNILLO PLC		59	—	—	—	素材
BABCOCK INTL GROUP PLC		69	—	—	—	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC		110	128	107	14,175	各種金融
GLENCORE PLC		2,625	2,603	400	53,100	素材
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		—	17	163	21,598	資本財
EVRAZ PLC		—	117	30	4,092	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC		67	67	112	14,852	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC		32	29	146	19,384	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC		1,101	1,130	107	14,296	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI		49	49	91	12,118	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC		44	—	—	—	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		273	335	89	11,837	保険
ROYAL MAIL PLC		200	—	—	—	運輸
AVEVA GROUP PLC		—	15	59	7,836	ソフトウェア・サービス
ASHTREAD GROUP PLC		108	112	253	33,619	資本財
MERLIN ENTERTAINMENT		154	—	—	—	消費者サービス
TUI AG-DI		104	—	—	—	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		81	—	—	—	ソフトウェア・サービス
NMC HEALTH PLC		25	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC		—	105	206	27,359	小売
AUTO TRADER GROUP PLC		186	221	113	14,969	メディア・娯楽
DCC PLC		24	25	153	20,318	資本財
GVC HOLDINGS PLC		136	136	107	14,247	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC		322	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
JOHN WOOD GROUP PLC		176	—	—	—	エネルギー
INFORMA PLC		278	310	134	17,876	メディア・娯楽
FERGUSON PLC		53	54	334	44,282	資本財
M&G PLC		—	539	65	8,680	各種金融
JD SPORTS FASHION PLC		—	102	57	7,591	小売
小計	株数・金額	99,182	72,072	34,487	4,567,119	
	銘柄数<比率>	93	87	—	<4.8%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		712	711	7,501	834,631	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		120	131	720	80,117	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		588	624	513	57,160	各種金融
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		116	126	472	52,614	素材

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		163	168	5,866	652,720	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG		2	2	759	84,531	素材
SONOVA HOLDING AG-REG		13	13	272	30,293	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		35	34	1,007	112,087	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG		2	2	167	18,603	ヘルスケア機器・サービス
LONZA GROUP AG-REG		17	17	840	93,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWATCH GROUP AG/THE-REG		9	14	51	5,686	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		8	10	223	24,916	資本財
GEBERIT AG-REG		8	9	445	49,574	資本財
SWISS RE AG		73	73	458	51,065	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR		7	6	117	13,047	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR		5	9	61	6,876	各種金融
NOVARTIS AG-REG		504	514	4,260	474,031	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG		39	39	169	18,873	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG		6	6	292	32,504	電気通信サービス
ABB LTD-REG		422	454	834	92,891	資本財
CLARIANT AG-REG		50	50	85	9,529	素材
SGS SA-REG		1	1	349	38,860	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		6	3	77	8,667	資本財
TEMENOS AG - REG		12	15	212	23,630	ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		12	12	176	19,615	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG		11	10	140	15,621	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		8	7	256	28,588	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.02	0.03	250	27,870	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD		54	55	216	24,079	各種金融
SIKA AG-REG		29	30	520	57,905	素材
SWISS PRIME SITE-REG		14	18	164	18,325	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.26	0.26	207	23,055	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG		3	4	327	36,398	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.59	0.72	134	14,988	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		1	1	124	13,883	素材
UBS GROUP AG-REG		892	911	884	98,418	各種金融
DUFREY AG-REG		8	—	—	—	小売
VIFOR PHARMA AG		9	10	157	17,563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALCON INC		98	105	618	68,760	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	4,075	4,213	29,943	3,331,477	
	銘 柄 数 < 比 率 >	39	38	—	< 3.5% >	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B		62	51	742	8,276	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS		709	756	6,349	70,796	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS		83	95	3,073	34,266	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		371	387	2,925	32,620	銀行
INVESTOR AB-B SHS		105	105	5,081	56,655	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		350	365	3,159	35,228	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS		159	158	5,667	63,188	資本財
SKF AB-B SHARES		90	90	1,434	15,992	資本財
ASSA ABLOY AB-B		239	236	4,308	48,041	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		195	193	2,533	28,244	小売
SANDVIK AB		261	292	4,355	48,562	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES		204	217	2,334	26,025	銀行
SECURITAS AB-B SHS		58	73	857	9,555	商業・専門サービス
SKANSKA AB-B SHS		80	80	1,413	15,760	資本財

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円	
SWEDISH MATCH AB		42	41	2,613	29,141	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		122	103	1,272	14,191	電気通信サービス
TELIA CO AB		618	593	1,870	20,854	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS		367	349	4,450	49,624	資本財
ALFA LAVAL AB		60	73	1,345	15,005	資本財
LUNDIN ENERGY AB		44	44	1,031	11,506	エネルギー
BOLIDEN AB		63	63	1,309	14,601	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		107	107	675	7,533	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		11	24	484	5,402	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS		63	63	3,012	33,592	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B		60	49	1,080	12,043	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		41	41	821	9,165	各種金融
ICA GRUPPEN AB		20	20	852	9,501	食品・生活必需品小売り
LUNDBERGS AB-B SHS		20	20	862	9,620	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B		143	142	4,375	48,791	家庭用品・パーソナル用品
EPIROC AB-B		95	95	970	10,822	資本財
EPIROC AB-A		137	159	1,633	18,216	資本財
NORDEA BANK ABP		730	753	4,396	49,025	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	5,722	5,850	77,296	861,856	
	銘 柄 数 < 比 率 >	32	32	—	<0.9%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		224	210	2,522	27,315	銀行
NORSK HYDRO ASA		311	311	754	8,168	素材
ORKLA ASA		165	185	1,599	17,327	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA		264	244	3,575	38,717	エネルギー
TELENOR ASA		172	173	2,520	27,294	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		42	42	1,380	14,950	素材
MOWI ASA		104	92	1,737	18,822	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		37	50	890	9,640	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		25	25	552	5,980	メディア・娯楽
AKER BP ASA		26	26	428	4,643	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	1,374	1,361	15,961	172,861	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B		423	426	18,934	299,916	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S-B SHARES		48	48	1,702	26,960	素材
DANSKE BANK A/S		167	149	1,117	17,695	銀行
DEMANT A/S		26	26	436	6,918	ヘルスケア機器・サービス
H LUNDBECK A/S		18	18	483	7,655	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		45	49	3,074	48,698	資本財
CARLSBERG AS-B		26	29	2,439	38,641	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B		28	27	3,017	47,800	ヘルスケア機器・サービス
DSV PANALPINA A/S		43	50	3,655	57,898	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		1	1	1,011	16,026	運輸
TRYG A/S		30	30	560	8,885	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		0.92	0.92	598	9,486	運輸
PANDORA A/S		26	21	628	9,956	耐久消費財・アパレル
ISS A/S		32	40	431	6,833	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		23	26	1,702	26,963	素材
GENMAB A/S		13	15	3,073	48,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄		期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(デンマーク)		百株	百株	千円		
ORSTED A/S		41	44	3,214	50,914	公益事業
小計	株数・金額	998	1,007	46,081	729,931	
銘柄数<比率>		17	17	—	<0.8%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BHP GROUP LTD		686	711	2,492	176,364	素材
CSL LTD		105	109	3,311	234,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD		460	616	90	6,437	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		223	230	520	36,844	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP		668	683	1,055	74,651	銀行
RIO TINTO LTD		84	86	819	57,952	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		297	287	223	15,791	保険
LENLEASE GROUP		146	144	168	11,955	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		412	427	2,551	180,516	銀行
WESTPAC BANKING CORP		800	898	1,368	96,841	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		639	763	1,182	83,644	銀行
BRAMBLES LTD		389	378	418	29,575	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		—	168	58	4,161	運輸
BORAL LTD		277	277	71	5,069	素材
WOOLWORTHS GROUP LTD		301	306	1,073	75,958	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD		1,017	912	283	20,077	電気通信サービス
AMP LTD		715	715	105	7,493	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD		458	461	150	10,618	消費者サービス
AMCOR LIMITED		287	—	—	—	素材
COMPUTERSHARE LTD		94	115	140	9,933	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		127	122	329	23,316	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD		74	83	882	62,463	各種金融
CIMIC GROUP LTD		27	19	46	3,270	資本財
ASX LTD		43	47	398	28,208	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD		119	119	103	7,292	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		14	12	229	16,214	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		91	111	265	18,785	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		159	159	46	3,312	小売
NEWCREST MINING LTD		187	188	604	42,771	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		508	568	309	21,927	保険
ORIGIN ENERGY LTD		430	383	217	15,362	エネルギー
ORICA LTD		73	91	153	10,880	素材
SONIC HEALTHCARE LTD		106	106	289	20,511	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD		377	383	195	13,825	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD		321	401	352	24,939	保険
TRANSURBAN GROUP		612	673	930	65,853	運輸
WESFARMERS LTD		260	281	1,091	77,194	小売
BLUESCOPE STEEL LTD		130	105	108	7,641	素材
CHALLENGER LTD		134	134	59	4,228	各種金融
SYDNEY AIRPORT		261	261	146	10,357	運輸
AMPOL LTD		62	50	131	9,337	エネルギー
OIL SEARCH LTD		332	332	107	7,573	エネルギー
WORLEY LTD		77	—	—	—	エネルギー
AGL ENERGY LTD		164	165	275	19,517	公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD		367	340	472	33,398	素材
AUSNET SERVICES		572	543	104	7,361	公益事業
CROWN RESORTS LTD		83	83	79	5,590	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD		376	376	73	5,194	素材

銘柄		株数	株数	当期		業種等
				期末		
				評価額	評価額	
		株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		127	127	73	5,203	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD		527	432	200	14,170	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD		167	167	167	11,835	食品・飲料・タバコ
APA GROUP		—	288	332	23,554	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD		32	38	258	18,307	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L		14	14	15	1,101	消費者サービス
SEEK LTD		66	84	151	10,747	メディア・娯楽
BANK OF QUEENSLAND LTD		110	—	—	—	銀行
REA GROUP LTD		9	13	132	9,407	メディア・娯楽
TPG TELECOM LTD		104	104	75	5,357	電気通信サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		687	687	197	13,955	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		17	—	—	—	消費者サービス
SOUTH32 LTD		1,200	1,061	211	14,945	素材
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		—	31	174	12,359	各種金融
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		27	27	49	3,516	エネルギー
COLES GROUP LTD		280	311	475	33,645	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD		—	32	67	4,741	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,542	17,868	26,676	1,887,386	
		61	61	—	<2.0%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD		482	483	223	14,745	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		170	216	124	8,216	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		138	138	415	27,414	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		177	177	60	3,980	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD		70	104	131	8,693	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD		356	265	127	8,399	公益事業
MERCURY NZ LTD		—	145	72	4,760	公益事業
A2 MILK CO LTD		182	182	353	23,309	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,578	1,714	1,509	99,519	
		7	8	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD		320	—	—	—	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		100	120	591	8,232	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		611	641	3,530	49,180	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES		375	375	3,720	51,819	不動産
MTR CORP		380	365	1,536	21,405	運輸
HONG KONG & CHINA GAS		2,111	2,433	3,377	47,053	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,340	1,520	1,377	19,183	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		345	315	1,508	21,018	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		270	286	7,584	105,655	各種金融
HANG LUNG GROUP LTD		240	—	—	—	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD		450	450	757	10,556	不動産
CLP HOLDINGS LTD		375	400	3,222	44,882	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		281	353	1,072	14,940	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		329	329	523	7,286	銀行
HANG SENG BANK LTD		181	180	2,415	33,649	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO		170	—	—	—	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD		360	—	—	—	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		71	71	546	7,615	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO		842	682	705	9,823	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		210	120	157	2,189	耐久消費財・アパレル
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		150	150	672	9,360	公益事業

銘柄		株数	期首(前期末)	当期		業種等
			株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		835	885	2,168	30,203	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		335	330	2,244	31,258	資本財
PCCW LTD		1,240	800	356	4,970	電気通信サービス
KERRY PROPERTIES LTD		185	185	391	5,450	不動産
MINTH GROUP LTD		180	—	—	—	自動車・自動車部品
NWS HOLDINGS LTD		310	310	237	3,307	資本財
SANDS CHINA LTD		528	692	2,148	29,930	消費者サービス
WHEELLOCK & CO LTD		210	210	1,186	16,527	不動産
WYNN MACAU LTD		308	316	450	6,277	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD		580	580	489	6,819	消費者サービス
AIA GROUP LTD		2,796	2,908	20,472	285,179	保険
SWIRE PROPERTIES LTD		250	250	530	7,382	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		560	530	2,811	39,166	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD		264	—	—	—	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		960	780	934	13,016	電気通信サービス
WH GROUP LTD		2,120	2,195	1,492	20,791	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD		616	616	2,936	40,905	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		—	650	514	7,162	公益事業
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		260	300	985	13,728	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD		—	180	634	8,838	食品・飲料・タバコ
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		—	291	644	8,978	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	22,051	21,801	74,928	1,043,750	
	銘柄数<比率>	39	36	—	<1.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		752	746	671	51,200	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		306	306	45	3,435	メディア・娯楽
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		293	293	45	3,463	資本財
CAPITALAND LTD		612	612	179	13,721	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		61	102	79	6,036	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		27	27	54	4,194	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD		411	409	802	61,164	銀行
KEPPEL CORP LTD		348	348	212	16,215	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD		302	285	565	43,120	銀行
VENTURE CORP LTD		70	70	109	8,380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TECH ENGINEERING		294	385	128	9,776	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,916	1,934	522	39,839	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD		141	141	52	3,989	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		212	187	186	14,189	各種金融
UOL GROUP LTD		138	88	58	4,435	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		562	562	87	6,685	運輸
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		1,857	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD		444	444	171	13,069	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE LTD		1,397	1,397	107	8,203	消費者サービス
SATS LTD		188	210	59	4,548	運輸
YANGZIJANG SHIPBUILDING		635	635	60	4,576	資本財
小計	株数・金額	10,968	9,182	4,199	320,247	
	銘柄数<比率>	21	20	—	<0.3%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
ICL GROUP LTD		189	141	167	5,148	素材
BANK HAPOLIM BM		251	251	550	16,910	銀行
NICE LTD		15	13	851	26,174	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL		316	354	655	20,131	銀行

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエルシェケル	千円		
ELBIT SYSTEMS LTD		5	5	275	8,463	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		—	269	290	8,912	銀行	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		593	—	—	—	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		38	38	262	8,061	銀行	
AZRIELI GROUP LTD		11	11	210	6,483	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,421	1,086	3,263	100,285		
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.1%>		
合 計	株 数 ・ 金 額	290,745	263,885	—	90,255,775		
	銘 柄 数 < 比 率 >	1,252	1,236	—	<95.4%>		

(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) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	10	12	289	31,207	0.0
MACERICH CO/THE	2	—	—	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	2	434	46,961	0.0
PROLOGIS INC	14	17	1,494	161,405	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2	200	21,701	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3	3	121	13,127	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	4	6	822	88,855	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	3	236	25,495	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	362	39,109	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	3	276	29,848	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	142	15,367	0.0
WELLTOWER INC	8	10	468	50,549	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	3	3	291	31,477	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	11	206	22,306	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	3	341	36,860	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	5	154	16,705	0.0
REALTY INCOME CORP	7	7	408	44,145	0.0
REGENCY CENTERS CORP	3	3	162	17,553	0.0
SL GREEN REALTY CORP	1	1	71	7,773	0.0
SUN COMMUNITIES INC	—	2	285	30,799	0.0
UDR INC	6	6	237	25,612	0.0
VENTAS INC	8	8	284	30,752	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	33	—	—	—	—
WEYERHAEUSER CO	16	17	328	35,518	0.0
AMERICAN TOWER CORP	10	10	2,440	263,543	0.3
AGNC INVESTMENT CORP	12	—	—	—	—
WP CAREY INC	3	4	249	26,963	0.0
VEREIT INC	20	35	175	19,003	0.0
DUKE REALTY CORP	8	8	267	28,924	0.0
IRON MOUNTAIN INC	6	6	157	16,957	0.0
EQUINIX INC	1	2	1,330	143,701	0.2
CROWN CASTLE INTL CORP	9	9	1,521	164,256	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	8	9	532	57,508	0.1
INVITATION HOMES INC	7	12	327	35,356	0.0
VICI PROPERTIES INC	—	10	185	20,021	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	2	—	—	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	2	770	83,193	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	16	15	180	19,523	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	3	3	691	74,712	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	7	420	45,429	0.0
VORNADO REALTY TRUST	4	3	141	15,289	0.0
KIMCO REALTY CORP	9	9	101	10,977	0.0

銘		柄	期首(前期末)		当 期 末		
			口 数	口 数	評 価 額		比 率
			千口	千口	千アメリカドル	千円	
(アメリカ)			3	3	508	54,923	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC							
小 計	口 数 ・ 金 額	279	295	17,627	1,903,421		
	銘 柄 数 < 比 率 >	38	39	—	<2.0%>		
(カナダ)					千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1	1	35	2,746	0.0	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		—	1	80	6,276	0.0	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3	3	33	2,589	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		4	4	61	4,807	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		—	2	30	2,398	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	9	13	242	18,817		
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	5	—	<0.0%>		
(ユーロ…フランス)					千ユーロ		
GECINA SA		1	1	118	13,967	0.0	
KLEPIERRE		5	4	59	7,015	0.0	
COVIVIO		1	1	58	6,917	0.0	
ICADE		0.932	0.634	39	4,720	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	8	7	276	32,620		
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>		
(ユーロ…オランダ)							
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3	3	157	18,648	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	3	3	157	18,648		
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>		
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	11	10	434	51,269		
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>		
(イギリス)					千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		22	17	61	8,165	0.0	
HAMMERSON PLC		17	—	—	—	—	
LAND SECURITIES GROUP PLC		17	15	88	11,655	0.0	
SEGRO PLC		25	25	206	27,365	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	83	58	356	47,186		
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	3	—	<0.0%>		
(オーストラリア)					千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		83	63	97	6,927	0.0	
SCENTRE GROUP		121	117	263	18,671	0.0	
GPT GROUP		39	45	186	13,217	0.0	
MIRVAC GROUP		94	91	200	14,196	0.0	
STOCKLAND		47	57	171	12,115	0.0	
DEXUS		21	27	247	17,475	0.0	
GOODMAN GROUP		39	40	594	42,056	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	447	444	1,762	124,661		
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<0.1%>		
(香港)					千香港ドル		
LINK REIT		50	54	3,731	51,978	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	50	54	3,731	51,978		
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>		

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
SUNTEC REIT		53	100	143	10,915	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		58	58	93	7,121	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	45	87	6,691	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		64	64	121	9,261	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		51	63	194	14,813	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	227	333	639	48,803	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	5	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,110	1,209	—	2,246,139	
	銘 柄 数 < 比 率 >	62	65	—	<2.4%>	

(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) 比率および合計欄の< >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	当期期末	
	買建額	売建額
外 国	百万円	百万円
株式先物取引	1,528	—
SP EMINI	55	—
SP/TSE60	65	—
SWISS IX	290	—
EURO ST	98	—
SPI 200	119	—
FTSE100		

(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。

○投資信託財産の構成

(2020年5月20日現在)

項目	当期期末	
	評価額	比率
株式	千円	%
	90,255,775	95.4
投資証券	2,246,139	2.4
コール・ローン等、その他	2,127,205	2.2
投資信託財産総額	94,629,119	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (94,539,008千円) の投資信託財産総額 (94,629,119千円) に対する比率は99.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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=107.98円	1 カナダドル=77.58円	1 ユーロ=118.10円	1 イギリスポンド=132.43円
1 スイスフラン=111.26円	1 スウェーデンクローネ=11.15円	1 ノルウェークローネ=10.83円	1 デンマーククローネ=15.84円
1 オーストラリアドル=70.75円	1 ニュージーランドドル=65.95円	1 香港ドル=13.93円	1 シンガポールドル=76.26円
1 イスラエルシェケル=30.73円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	94,749,856,192
コール・ローン等	1,284,046,649
株式(評価額)	90,255,775,015
投資証券(評価額)	2,246,139,687
未収入金	301,712,948
未収配当金	129,750,837
差入委託証拠金	532,431,056
(B) 負債	144,286,080
未払金	121,583,443
未払解約金	22,702,472
未払利息	165
(C) 純資産総額(A－B)	94,605,570,112
元本	40,411,414,293
次期繰越損益金	54,194,155,819
(D) 受益権総口数	40,411,414,293口
1万口当たり基準価額(C／D)	23,411円

<注記事項>

- ①期首元本額 40,500,882,275円
期中追加設定元本額 13,150,569,171円
期中一部解約元本額 13,240,037,153円
また、1口当たり純資産額は、期末2,3411円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	14,336,178,889円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	12,746,538,230円
三菱ＵＦＪ 外国株式ファンドV A(適格機関投資家限定)	5,478,324,998円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,838,660,799円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,737,539,100円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	1,309,453,142円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	1,105,799,032円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)	336,571,364円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	224,512,997円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	109,191,063円
三菱ＵＦＪ D C年金インデックス(先進国株式)	62,521,115円
三菱ＵＦＪ D C年金バランス(株式65)	51,538,048円
三菱ＵＦＪ D C年金バランス(株式40)	42,315,079円
三菱ＵＦＪ D C年金バランス(株式25)	26,160,337円
三菱ＵＦＪ D C年金バランス(株式15)	6,076,633円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)V A(適格機関投資家限定)	33,467円
合計	40,411,414,293円

○損益の状況 (2019年5月21日～2020年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,996,315,000
受取配当金	1,978,930,739
受取利息	14,402,508
その他収益金	6,139,107
支払利息	△ 3,157,354
(B) 有価証券売買損益	△ 2,738,364,349
売買益	11,630,380,501
売買損	△14,368,744,850
(C) 先物取引等取引損益	△ 104,594,138
取引益	783,933,647
取引損	△ 888,527,785
(D) 保管費用等	△ 38,247,342
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 884,890,829
(F) 前期繰越損益金	56,963,568,624
(G) 追加信託差損益金	17,005,324,635
(H) 解約差損益金	△18,889,846,611
(I) 計(E+F+G+H)	54,194,155,819
次期繰越損益金(I)	54,194,155,819

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

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

(注) (H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

【お 知 ら せ】

株式等インデックスファンドのベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2019年7月1日)

三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド

《第20期》決算日2020年5月20日

[計算期間：2019年5月21日～2020年5月20日]

「三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド」は、5月20日に第20期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	わが国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク（NOMURA—BPI 総合）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 運 用 対 象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA—BPI 総合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
16期(2016年5月20日)	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3	219,902
17期(2017年5月22日)	13,798	△2.0	379.387	△2.0	99.3	0.3	212,031
18期(2018年5月21日)	13,877	0.6	381.504	0.6	99.2	0.4	225,098
19期(2019年5月20日)	14,116	1.7	388.062	1.7	99.3	0.2	239,103
20期(2020年5月20日)	14,135	0.1	388.555	0.1	99.5	0.2	242,398

(注) NOMURA—BPI 総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額 円	騰 落 率 %	N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 %	債 先 物 比 %
				騰 落 率 %		
(期 首) 2019年5月20日	14,116	—	388.062	—	99.3	0.2
5月末	14,200	0.6	390.322	0.6	97.4	0.2
6月末	14,286	1.2	392.695	1.2	100.4	0.1
7月末	14,302	1.3	393.155	1.3	100.3	0.1
8月末	14,495	2.7	398.496	2.7	97.2	0.2
9月末	14,342	1.6	394.271	1.6	101.9	0.2
10月末	14,284	1.2	392.608	1.2	101.2	0.2
11月末	14,234	0.8	391.325	0.8	100.6	0.2
12月末	14,190	0.5	390.136	0.5	100.6	0.2
2020年1月末	14,251	1.0	391.771	1.0	98.7	0.2
2月末	14,362	1.7	394.745	1.7	97.4	0.2
3月末	14,130	0.1	388.450	0.1	97.2	0.2
4月末	14,179	0.4	389.790	0.4	100.9	0.2
(期 末) 2020年5月20日	14,135	0.1	388.555	0.1	99.5	0.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(0.1%)とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎国内債券市況

- ・国内債券市況は上昇しました。
- ・期の前半は、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことなどから国内債券市況は上昇しましたが、その後下落しました。また、期の後半は、新型肺炎による景気後退懸念などから上昇後、すぐに財政拡張による国債増発懸念などから下落しましたが、期を通して見ると国内債券市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券(先物を含む)に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました※。

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは0.1%の上昇となったため、乖離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

(2019年５月21日～2020年５月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、14,250円です。			

(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

(2019年５月21日～2020年５月20日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 67,966,209	千円 63,390,384
	地方債証券	4,812,010	5,403,873
	特殊債券	6,586,648	5,105,895 (294,070)
	社債券	5,118,093	4,789,017 (100,000)

(注) 金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 2,006	百万円 2,004	百万円 －	百万円 －

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月21日～2020年5月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 84,482	百万円 23,379	% 27.7	百万円 78,689	百万円 27,600	% 35.1

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 703	百万円 302	百万円 1,209

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 2,200

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銀行、三菱ＵＦＪ信託銀行、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券、三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ、三菱ＵＦＪリース、アコム、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2020年5月20日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちＢＢ格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	183,704,000	200,679,370	82.8	—	56.9	17.8	8.0
地方債証券	10,936,350	11,612,991	4.8	—	2.6	1.3	0.9
	(10,936,350)	(11,612,991)	(4.8)	(—)	(2.6)	(1.3)	(0.9)
特殊債券	13,677,761	14,517,823	6.0	—	3.8	1.6	0.6
(除く金融債)	(13,677,761)	(14,517,823)	(6.0)	(—)	(3.8)	(1.6)	(0.6)
金融債券	1,400,000	1,400,135	0.6	—	—	0.4	0.2
	(1,400,000)	(1,400,135)	(0.6)	(—)	(—)	(0.4)	(0.2)
普通社債券	12,771,000	12,912,480	5.3	—	1.7	3.1	0.5
	(12,771,000)	(12,912,480)	(5.3)	(—)	(1.7)	(3.1)	(0.5)
合 計	222,489,111	241,122,801	99.5	—	65.0	24.3	10.2
	(38,785,111)	(40,443,430)	(16.7)	(—)	(8.1)	(6.4)	(2.2)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第401回利付国債 (2年)		0.1	970,000	972,793	2021/6/1
第402回利付国債 (2年)		0.1	300,000	300,936	2021/7/1
第403回利付国債 (2年)		0.1	500,000	501,675	2021/8/1
第404回利付国債 (2年)		0.1	950,000	953,410	2021/9/1
第405回利付国債 (2年)		0.1	450,000	451,845	2021/10/1
第406回利付国債 (2年)		0.1	800,000	803,312	2021/11/1
第407回利付国債 (2年)		0.1	480,000	482,064	2021/12/1
第408回利付国債 (2年)		0.1	200,000	200,890	2022/1/1
第411回利付国債 (2年)		0.1	1,170,000	1,176,013	2022/4/1
第128回利付国債 (5年)		0.1	2,310,000	2,316,999	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)		0.1	2,350,000	2,358,624	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)		0.1	1,030,000	1,034,408	2021/12/20
第131回利付国債 (5年)		0.1	1,810,000	1,818,959	2022/3/20
第132回利付国債 (5年)		0.1	2,170,000	2,182,455	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)		0.1	980,000	986,311	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)		0.1	1,920,000	1,933,689	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)		0.1	900,000	906,903	2023/3/20
第136回利付国債 (5年)		0.1	460,000	463,845	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)		0.1	1,860,000	1,876,200	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)		0.1	3,800,000	3,834,884	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)		0.1	200,000	201,926	2024/3/20
第140回利付国債 (5年)		0.1	3,180,000	3,211,990	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)		0.1	1,270,000	1,283,004	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)		0.1	550,000	555,830	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)		0.1	980,000	990,711	2025/3/20
第1回利付国債 (40年)		2.4	220,000	331,848	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)		2.2	415,000	610,456	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)		2.2	285,000	423,407	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)		2.2	470,000	705,089	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)		2.0	480,000	698,817	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)		1.9	490,000	704,311	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)		1.7	470,000	651,091	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)		1.4	540,000	700,795	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)		0.4	790,000	770,676	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)		0.9	900,000	1,027,953	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)		0.8	640,000	710,112	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)		0.5	740,000	744,839	2059/3/20
第315回利付国債 (10年)		1.2	780,000	791,622	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)		1.1	400,000	405,528	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)		1.1	250,000	254,262	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)		1.0	550,000	558,640	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)		1.1	790,000	805,989	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)		1.0	640,000	651,936	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)		1.0	870,000	888,678	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)		0.9	420,000	428,248	2022/3/20

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323回利付国債 (10年)		0.9	470,000	480,556	2022/ 6 /20
第324回利付国債 (10年)		0.8	980,000	999,962	2022/ 6 /20
第325回利付国債 (10年)		0.8	1,390,000	1,421,761	2022/ 9 /20
第326回利付国債 (10年)		0.7	100,000	102,257	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)		0.8	880,000	902,149	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)		0.6	1,770,000	1,808,745	2023/ 3 /20
第329回利付国債 (10年)		0.8	1,530,000	1,575,731	2023/ 6 /20
第330回利付国債 (10年)		0.8	1,450,000	1,496,661	2023/ 9 /20
第331回利付国債 (10年)		0.6	640,000	656,300	2023/ 9 /20
第332回利付国債 (10年)		0.6	1,680,000	1,725,696	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)		0.6	700,000	720,223	2024/ 3 /20
第334回利付国債 (10年)		0.6	1,160,000	1,195,484	2024/ 6 /20
第335回利付国債 (10年)		0.5	1,520,000	1,562,408	2024/ 9 /20
第336回利付国債 (10年)		0.5	180,000	185,270	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)		0.3	980,000	999,423	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)		0.4	1,350,000	1,384,776	2025/ 3 /20
第339回利付国債 (10年)		0.4	2,160,000	2,218,557	2025/ 6 /20
第340回利付国債 (10年)		0.4	2,420,000	2,488,873	2025/ 9 /20
第341回利付国債 (10年)		0.3	1,450,000	1,485,061	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)		0.1	2,130,000	2,158,137	2026/ 3 /20
第343回利付国債 (10年)		0.1	1,430,000	1,449,705	2026/ 6 /20
第344回利付国債 (10年)		0.1	1,810,000	1,835,991	2026/ 9 /20
第345回利付国債 (10年)		0.1	1,690,000	1,714,657	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)		0.1	1,390,000	1,410,572	2027/ 3 /20
第347回利付国債 (10年)		0.1	2,770,000	2,812,519	2027/ 6 /20
第348回利付国債 (10年)		0.1	1,600,000	1,624,832	2027/ 9 /20
第349回利付国債 (10年)		0.1	1,140,000	1,157,863	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)		0.1	1,860,000	1,888,606	2028/ 3 /20
第351回利付国債 (10年)		0.1	1,090,000	1,106,404	2028/ 6 /20
第352回利付国債 (10年)		0.1	2,680,000	2,719,315	2028/ 9 /20
第353回利付国債 (10年)		0.1	2,530,000	2,564,914	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)		0.1	1,600,000	1,620,560	2029/ 3 /20
第355回利付国債 (10年)		0.1	1,650,000	1,670,295	2029/ 6 /20
第356回利付国債 (10年)		0.1	2,540,000	2,569,692	2029/ 9 /20
第357回利付国債 (10年)		0.1	1,500,000	1,515,825	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)		0.1	1,190,000	1,201,697	2030/ 3 /20
第 1 回利付国債 (30年)		2.8	120,000	151,574	2029/ 9 /20
第 2 回利付国債 (30年)		2.4	170,000	209,895	2030/ 2 /20
第 3 回利付国債 (30年)		2.3	190,000	233,453	2030/ 5 /20
第 4 回利付国債 (30年)		2.9	125,000	162,555	2030/11/20
第 5 回利付国債 (30年)		2.2	180,000	222,325	2031/ 5 /20
第 6 回利付国債 (30年)		2.4	170,000	215,192	2031/11/20
第 7 回利付国債 (30年)		2.3	225,000	284,017	2032/ 5 /20
第 8 回利付国債 (30年)		1.8	160,000	193,358	2032/11/22
第 9 回利付国債 (30年)		1.4	90,000	104,345	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)		1.1	263,000	295,377	2033/ 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11回利付国債 (30年)		1.7	100,000	120,195	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	205,000	257,762	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	390,000	486,369	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	380,000	495,508	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	440,000	581,394	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	345,000	457,483	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	350,000	460,414	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	360,000	469,562	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	290,000	379,436	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	260,000	348,969	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	250,000	328,842	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	285,000	384,695	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)		2.5	140,000	189,579	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)		2.5	230,000	312,192	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	205,000	272,350	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	430,000	579,777	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	400,000	549,072	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	415,000	572,915	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	480,000	658,032	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	625,000	850,818	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	725,000	979,409	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	570,000	784,838	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)		2.0	623,000	825,973	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	765,000	1,048,929	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	790,000	1,056,103	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	790,000	1,060,804	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	820,000	1,087,787	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	605,000	792,132	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	560,000	746,967	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	450,000	591,394	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)		1.7	250,000	323,525	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	570,000	738,440	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)		1.7	560,000	727,098	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	620,000	805,882	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)		1.5	550,000	690,046	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	680,000	853,767	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)		1.6	650,000	832,546	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	600,000	740,574	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	770,000	950,911	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	770,000	839,153	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	480,000	464,275	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	570,000	578,749	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)		0.6	610,000	634,735	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	400,000	436,124	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)		0.8	700,000	762,825	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)		0.8	620,000	676,103	2047/9/20

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57回利付国債 (30年)		0.8	580,000	632,136	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)		0.8	780,000	850,675	2048/ 3 /20
第59回利付国債 (30年)		0.7	310,000	330,143	2048/ 6 /20
第60回利付国債 (30年)		0.9	1,000,000	1,118,700	2048/ 9 /20
第61回利付国債 (30年)		0.7	660,000	703,566	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)		0.5	190,000	192,422	2049/ 3 /20
第63回利付国債 (30年)		0.4	380,000	374,148	2049/ 6 /20
第64回利付国債 (30年)		0.4	1,280,000	1,260,147	2049/ 9 /20
第66回利付国債 (30年)		0.4	380,000	374,018	2050/ 3 /20
第51回利付国債 (20年)		2.0	140,000	143,325	2021/ 6 /21
第52回利付国債 (20年)		2.1	260,000	267,943	2021/ 9 /21
第53回利付国債 (20年)		2.1	80,000	82,883	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)		2.2	530,000	549,943	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)		2.0	240,000	249,573	2022/ 3 /21
第56回利付国債 (20年)		2.0	370,000	386,816	2022/ 6 /20
第57回利付国債 (20年)		1.9	160,000	166,937	2022/ 6 /20
第58回利付国債 (20年)		1.9	350,000	367,020	2022/ 9 /20
第59回利付国債 (20年)		1.7	590,000	618,709	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)		1.4	230,000	239,400	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	260,000	268,650	2023/ 3 /20
第62回利付国債 (20年)		0.8	560,000	576,738	2023/ 6 /20
第63回利付国債 (20年)		1.8	275,000	291,739	2023/ 6 /20
第64回利付国債 (20年)		1.9	480,000	513,057	2023/ 9 /20
第65回利付国債 (20年)		1.9	430,000	461,759	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)		1.8	170,000	181,942	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)		1.9	80,000	86,300	2024/ 3 /20
第68回利付国債 (20年)		2.2	395,000	430,672	2024/ 3 /20
第69回利付国債 (20年)		2.1	120,000	130,375	2024/ 3 /20
第70回利付国債 (20年)		2.4	510,000	563,182	2024/ 6 /20
第71回利付国債 (20年)		2.2	200,000	219,214	2024/ 6 /20
第72回利付国債 (20年)		2.1	645,000	707,848	2024/ 9 /20
第73回利付国債 (20年)		2.0	200,000	219,642	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)		2.1	380,000	419,071	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	230,000	254,867	2025/ 3 /20
第76回利付国債 (20年)		1.9	210,000	230,664	2025/ 3 /20
第77回利付国債 (20年)		2.0	260,000	286,847	2025/ 3 /20
第79回利付国債 (20年)		2.0	100,000	110,868	2025/ 6 /20
第80回利付国債 (20年)		2.1	370,000	412,106	2025/ 6 /20
第82回利付国債 (20年)		2.1	620,000	694,077	2025/ 9 /20
第83回利付国債 (20年)		2.1	182,000	204,768	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	410,000	458,986	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)		2.1	230,000	260,054	2026/ 3 /20
第86回利付国債 (20年)		2.3	532,000	607,762	2026/ 3 /20
第87回利付国債 (20年)		2.2	170,000	193,211	2026/ 3 /20
第88回利付国債 (20年)		2.3	460,000	528,204	2026/ 6 /20
第89回利付国債 (20年)		2.2	130,000	148,478	2026/ 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90回利付国債 (20年)		2.2	470,000	539,597	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)		2.3	80,000	92,356	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)		2.1	650,000	745,504	2026/12/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	260,000	299,540	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)		2.3	490,000	574,289	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)		2.1	120,000	138,928	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)		2.2	330,000	386,218	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)		2.1	340,000	395,409	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)		2.1	635,000	741,749	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	370,000	436,814	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)		2.4	350,000	418,722	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)		2.4	190,000	228,330	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)		2.3	320,000	381,952	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)		2.1	310,000	364,972	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)		2.1	350,000	413,668	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)		2.2	210,000	249,960	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)		2.1	240,000	284,604	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)		1.9	500,000	584,300	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)		1.9	60,000	70,314	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)		2.1	280,000	333,096	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)		2.2	450,000	541,386	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)		2.1	610,000	728,321	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)		2.1	360,000	431,571	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)		2.1	580,000	697,392	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)		2.2	290,000	351,477	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)		2.2	215,000	261,495	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)		2.1	510,000	615,279	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)		2.0	444,000	532,990	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)		1.8	240,000	283,267	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)		1.6	520,000	603,272	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)		1.9	690,000	823,777	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)		2.1	500,000	608,870	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)		2.0	340,000	410,444	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	810,000	998,122	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)		2.0	330,000	399,531	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)		1.9	90,000	107,992	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	440,000	529,416	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	580,000	693,221	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)		1.7	420,000	497,259	2031/9/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	1,030,000	1,234,032	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	890,000	1,068,765	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	50,000	59,457	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	60,000	70,646	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)		1.7	620,000	738,860	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)		1.5	130,000	151,816	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	100,000	117,977	2032/6/20

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140回利付国債 (20年)		1.7	480,000	573,220	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)		1.7	820,000	981,818	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	480,000	580,680	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	1,380,000	1,638,060	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	240,000	281,848	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	1,320,000	1,586,574	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	900,000	1,083,780	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	720,000	858,974	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	760,000	897,795	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	1,190,000	1,407,662	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	1,210,000	1,416,268	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	330,000	377,295	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	930,000	1,063,938	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	1,240,000	1,438,635	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	1,100,000	1,260,842	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	810,000	904,510	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	960,000	982,675	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	840,000	832,860	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	750,000	778,200	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	1,020,000	1,074,274	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	910,000	972,990	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	820,000	862,771	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	1,210,000	1,272,956	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	880,000	925,636	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	1,010,000	1,044,178	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	1,360,000	1,405,437	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	480,000	512,918	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	1,000,000	1,032,470	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	590,000	598,378	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)		0.3	770,000	766,535	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)		0.3	1,020,000	1,014,430	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)		0.3	370,000	367,957	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)		0.4	320,000	324,166	2040/3/20
小 計			183,704,000	200,679,370	
地方債証券					
第5回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	110,032	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	111,166	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	70,000	95,777	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (20年)		2.33	100,000	114,174	2026/9/18
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	135,207	2039/9/20
第700回東京都公募公債		1.02	100,000	101,315	2021/9/17
第710回東京都公募公債		0.81	100,000	101,625	2022/6/20
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	204,726	2023/3/20
第730回東京都公募公債		0.664	100,000	102,425	2024/3/19
第3回東京都公募公債 (20年)		2.26	100,000	108,531	2024/3/19
平成24年度第9回北海道公募公債		0.79	50,000	50,911	2022/10/31

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26年度第13回北海道公募公債		0.461	100,000	101,887	2024/12/26
平成29年度第13回北海道公募公債		0.21	108,000	108,773	2027/12/28
第2回神奈川県公募公債（30年）		2.87	100,000	138,890	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債（30年）		2.62	100,000	137,738	2038/3/19
第227回神奈川県公募公債		0.18	100,000	100,633	2027/6/18
第5回大阪府公募公債（20年）		2.16	100,000	119,609	2030/5/28
第348回大阪府公募公債		1.32	50,000	50,550	2021/3/30
第358回大阪府公募公債		0.97	70,000	71,155	2022/2/28
第419回大阪府公募公債		0.196	200,000	201,392	2027/4/27
第423回大阪府公募公債		0.185	130,000	130,750	2027/8/30
第435回大阪府公募公債		0.2	130,000	130,851	2028/8/30
第451回大阪府公募公債		0.063	140,000	138,793	2029/12/26
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）		2.19	100,000	119,058	2029/9/20
平成23年度第2回京都府公募公債		1.2	66,000	66,841	2021/6/22
平成26年度第5回京都府公募公債（20年）		1.455	100,000	115,602	2034/8/10
平成29年度第4回京都府公募公債		0.19	100,000	100,704	2027/6/21
第2回兵庫県公募公債（30年）		2.36	50,000	68,351	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債（12年）		0.73	200,000	207,844	2026/8/6
平成23年度第11回兵庫県公募公債		0.95	50,000	50,767	2022/1/27
第27回兵庫県公募公債（20年）		0.387	200,000	200,064	2036/5/12
平成28年度第3回兵庫県公募公債		0.08	100,000	99,910	2026/5/22
平成29年度第1回兵庫県公募公債		0.187	200,000	201,278	2027/5/21
第3回静岡県公募公債（15年）		1.368	100,000	109,449	2027/10/29
平成25年度第7回静岡県公募公債		0.801	100,000	102,572	2023/9/20
平成25年度第8回静岡県公募公債		0.699	29,800	30,483	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債（20年）		2.04	200,000	232,932	2028/12/20
平成23年度第11回愛知県公募公債		1.03	70,000	71,007	2021/10/28
平成23年度第13回愛知県公募公債		1.529	200,000	218,696	2026/11/13
平成23年度第20回愛知県公募公債		1.082	100,000	101,952	2022/3/29
平成24年度第8回愛知県公募公債		0.835	200,000	203,680	2022/8/29
平成28年度第13回愛知県公募公債		0.13	100,000	100,324	2026/11/30
平成26年度第7回広島県公募公債		0.46	260,000	265,408	2025/3/25
平成27年度第5回広島県公募公債		0.41	200,000	203,966	2026/1/26
平成30年度第4回広島県公募公債		0.259	200,000	202,596	2028/11/22
第8回埼玉県公募公債（20年）		2.19	100,000	119,058	2029/9/20
第10回埼玉県公募公債（20年）		1.94	100,000	118,107	2030/11/12
第14回埼玉県公募公債（20年）		1.546	200,000	233,428	2034/5/8
平成22年度第11回埼玉県公募公債		1.28	40,000	40,384	2021/2/25
平成23年度第6回埼玉県公募公債		1.02	100,000	101,422	2021/10/27
平成22年度第10回福岡県公募公債		1.36	50,000	50,511	2021/2/25
平成24年度第6回福岡県公募公債		0.8	100,000	101,884	2022/10/25
平成22年度第12回千葉県公募公債		1.28	80,000	80,769	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債		1.33	80,000	80,880	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債		1.06	80,000	81,248	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	80,000	81,431	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	80,000	81,574	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27年度第3回千葉県公募公債		0.524	200,000	204,716	2025/6/25
平成28年度第1回岐阜県公募公債		0.06	100,000	99,871	2026/10/30
第96回共同発行市場公募地方債		1.29	20,000	20,213	2021/3/25
第104回共同発行市場公募地方債		1.03	600,000	609,096	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債		1.01	70,000	71,264	2022/3/25
第116回共同発行市場公募地方債		0.8	300,000	305,850	2022/11/25
第125回共同発行市場公募地方債		0.82	100,000	102,583	2023/8/25
第130回共同発行市場公募地方債		0.76	100,000	102,687	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	102,420	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	200,000	205,174	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	200,000	204,286	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	200,000	202,944	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債		0.47	200,000	204,258	2025/3/25
平成22年度第10回大阪市公募公債		1.31	20,000	20,211	2021/3/17
平成26年度第7回大阪市公募公債		0.535	100,000	102,282	2024/11/28
第1回名古屋市公募公債（20年）		1.99	100,000	107,021	2023/12/20
第9回名古屋市公募公債（20年）		2.07	100,000	116,721	2028/12/20
第9回名古屋市公募公債（30年）		2.095	90,000	120,292	2042/9/19
第3回京都市公募公債（20年）		2.09	100,000	111,296	2025/12/19
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）		2.54	110,000	126,377	2026/6/19
平成23年度第5回神戸市公募公債		1.025	100,000	101,408	2021/10/19
第5回横浜市公募公債（20年）		2.17	100,000	110,696	2025/6/20
第7回横浜市公募公債（20年）		2.06	250,000	277,822	2025/12/19
第11回横浜市公募公債（20年）		2.2	200,000	227,756	2026/12/18
第27回横浜市公募公債（20年）		1.599	40,000	46,675	2033/5/20
第35回横浜市公募公債（20年）		0.443	200,000	201,640	2036/10/28
第7回川崎市公募公債（20年）		2.08	100,000	117,756	2029/7/17
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	50,000	50,698	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	71,327	2022/10/31
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	50,607	2021/5/31
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	162,550	165,012	2021/11/30
平成28年度第1回岡山県公募公債		0.18	140,000	140,931	2027/1/29
小	計		10,936,350	11,612,991	
特殊債券（除く金融債）					
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.2	100,000	134,668	2040/5/31
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	126,752	2040/8/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	118,343	2030/9/30
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	14,000	14,194	2021/6/30
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	200,000	202,748	2021/7/30
第158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	131,398	2042/2/28
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	100,000	101,881	2022/6/30
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.791	100,000	101,937	2022/10/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.815	30,000	30,679	2023/2/28
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	340,000	346,232	2023/5/31
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	208,000	213,162	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	100,000	102,468	2024/3/29

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215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	100,000	102,619	2024/4/30
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	102,624	2024/6/28
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.495	100,000	102,219	2024/11/29
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	100,000	102,123	2024/12/27
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.45	200,000	204,328	2025/3/31
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.509	133,000	136,265	2025/5/30
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.484	101,000	103,392	2025/6/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	100,000	101,707	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.145	100,000	100,721	2026/2/27
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.12	108,000	108,683	2028/4/28
第12回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	102,380	2021/6/28
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)		0.576	110,000	110,928	2021/9/24
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	11,000	11,101	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	20,000	20,218	2021/3/12
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.0	124,500	126,347	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	200,000	203,610	2021/12/14
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.9	35,000	35,604	2022/3/14
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.819	100,000	101,912	2022/9/16
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.734	200,000	203,780	2022/12/16
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	38,850	2023/2/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.541	100,000	101,580	2023/4/21
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	102,694	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	305,000	312,512	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.645	100,000	102,444	2024/3/15
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	500,000	500,000	2026/3/13
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	102,000	102,000	2026/4/17
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	125,000	126,070	2027/7/16
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	92,136	2023/10/20
第211回政府保証預金保険機構債券		0.1	100,000	100,212	2021/10/19
第4回政府保証新関西国際空港債券		0.484	104,000	106,441	2025/6/13
第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債		0.001	200,000	200,202	2022/5/20
第19回政府保証日本政策投資銀行		0.668	100,000	101,883	2023/3/15
第13回政府保証中部国際空港債券		1.3	72,000	72,796	2021/3/15
第6回神奈川県住宅供給公社債券		0.215	100,000	99,347	2029/4/23
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)		2.23	30,000	34,431	2027/5/28
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.99	100,000	156,156	2045/9/20
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	140,000	159,254	2026/3/19
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	153,007	2047/3/20
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.28	350,000	402,143	2027/4/20
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	110,000	166,426	2047/3/20
第28回道路債券(財投機関債)		2.83	100,000	133,294	2033/12/20
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.773	100,000	118,356	2032/9/17
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	100,000	102,836	2023/6/20
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.133	200,000	222,264	2035/3/20
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	100,000	102,879	2023/3/22
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)		2.95	100,000	135,319	2034/3/24

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5回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.22	100,000	119,726	2030/1/28
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.2	100,000	108,340	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.25	100,000	108,532	2024/3/22
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.132	100,000	120,542	2031/1/28
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.29	100,000	117,049	2028/4/25
第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.034	100,000	101,301	2021/8/27
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	204,174	2023/1/27
第47回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.576	200,000	203,266	2023/4/28
第104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.255	200,000	202,058	2028/1/28
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	70,000	80,315	2031/7/30
F151回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.348	100,000	109,083	2027/11/5
F197回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.052	100,000	106,955	2027/10/29
F203回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.063	100,000	107,266	2028/2/28
F438回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.123	200,000	200,500	2026/3/27
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.1	100,000	104,335	2022/6/20
第29回福祉医療機構債券(財投機関債)		1.145	100,000	101,799	2021/12/20
第4回中部国際空港(財投機関債)		0.305	200,000	202,074	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	25,890	26,694	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	28,654	29,976	2042/6/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.82	22,730	23,140	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	35,592	36,258	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	12,279	12,658	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	36,981	38,109	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	14,532	15,122	2042/12/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券		0.92	10,482	10,532	2038/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	15,251	15,961	2043/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	29,346	29,916	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	29,466	30,052	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	14,834	15,117	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	11,566	11,776	2039/6/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.95	27,450	29,553	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	12,893	13,227	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	28,216	30,306	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	14,048	14,488	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	57,400	60,884	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	57,902	61,281	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	26,480	27,398	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	32,933	34,512	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	26,088	27,262	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	26,282	27,370	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	111,690	119,372	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	62,852	66,926	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	59,490	63,333	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	29,589	31,417	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	30,400	32,205	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	32,824	34,786	2046/8/10

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52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	29,290	30,857	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	35,499	37,534	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	37,087	39,216	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	41,066	43,481	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	42,090	44,568	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	43,829	46,254	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	84,906	89,286	2047/6/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	142,215	148,870	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	50,368	52,572	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	98,886	103,069	2049/5/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.863	100,000	118,559	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	112,790	116,832	2049/11/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	69,531	71,596	2050/5/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	200,000	238,660	2032/4/16
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	245,856	247,707	2051/6/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	171,806	174,245	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	172,020	174,588	2052/3/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	87,888	89,032	2052/7/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	89,957	90,848	2052/12/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	90,492	91,760	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	90,657	91,705	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	91,139	92,048	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	91,017	91,926	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	182,946	185,035	2053/6/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	93,640	95,023	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	94,239	95,836	2053/11/10
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	97,098	96,533	2054/8/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	97,948	97,327	2054/11/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	98,861	99,172	2055/1/10
第161回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.713	100,000	104,235	2027/6/18
第194回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.075	100,000	99,808	2026/10/20
第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.24	100,000	100,881	2027/3/19
第17回東京都住宅供給公社債券		1.17	100,000	101,406	2021/9/17
第18回韓国輸出入銀行		0.27	100,000	99,814	2021/6/28
小	計		13,677,761	14,517,823	
金融債券					
い第804号商工債券		0.06	300,000	299,817	2022/5/27
第321回信金中金債		0.03	200,000	199,948	2021/8/27
第333回信金中金債		0.09	100,000	100,076	2022/8/26
第337回信金中金債		0.11	100,000	100,143	2022/12/27
第338回信金中金債		0.11	200,000	200,294	2023/1/27
第341回信金中金債		0.11	100,000	100,161	2023/4/27
第230号商工債券(3年)		0.09	200,000	200,034	2022/3/25
第239号商工債券(3年)		0.02	200,000	199,662	2022/12/27
小	計		1,400,000	1,400,135	

銘柄	利 率	当 期		末	
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
普通社債券	%	千円	千円		
第548回東京電力	2.347	100,000	109,885	2028/9/29	
第499回中部電力	1.194	50,000	51,646	2023/6/23	
第528回中部電力	0.13	100,000	99,895	2023/11/24	
第510回関西電力	0.49	100,000	100,208	2027/7/23	
第518回関西電力	0.44	100,000	99,495	2028/6/20	
第532回関西電力	0.18	100,000	99,730	2024/7/25	
第383回中国電力	0.764	100,000	102,410	2024/10/25	
第393回中国電力	0.26	100,000	99,648	2026/11/25	
第494回東北電力	0.425	200,000	200,830	2027/6/25	
第427回九州電力	1.024	100,000	103,258	2024/5/24	
第468回九州電力	0.435	100,000	100,079	2028/8/25	
第469回九州電力	0.3	100,000	99,946	2025/10/24	
第482回九州電力	0.17	300,000	299,364	2024/8/23	
第484回九州電力	0.375	200,000	198,644	2029/11/22	
第488回九州電力	0.07	100,000	99,984	2023/5/25	
第5回目揮	0.2	300,000	299,595	2022/10/13	
第7回明治ホールディングス	0.22	100,000	99,654	2024/9/13	
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,347	2026/2/13	
第12回日本たばこ産業	0.11	200,000	199,154	2023/9/8	
第6回ヒューリック	0.494	200,000	199,090	2028/10/20	
第7回ヒューリック	0.2	100,000	99,229	2024/6/25	
第4回トヨタ紡織	0.21	200,000	199,628	2024/12/20	
第22回森ビル	0.18	100,000	99,689	2023/3/8	
第31回東レ	0.25	100,000	99,897	2024/7/19	
第1回電通	0.11	200,000	199,136	2023/10/25	
第2回電通	0.24	100,000	99,567	2025/10/24	
第2回大塚ホールディングス	0.26	100,000	99,455	2026/3/6	
第11回ヤフー	0.18	100,000	98,075	2024/7/31	
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	101,743	2022/12/2	
第11回ブリヂストン	0.295	200,000	198,974	2027/4/21	
第13回ブリヂストン	0.23	200,000	198,714	2026/4/17	
第10回日本特殊陶業	0.11	100,000	99,389	2024/6/20	
第1回日本製鉄	0.14	100,000	99,150	2024/6/20	
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	99,014	2027/5/20	
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	101,271	2021/9/17	
第48回日本精工	0.16	100,000	99,697	2023/11/29	
第51回日本精工	0.19	100,000	98,736	2026/9/2	
第53回日本電気	0.26	100,000	99,869	2023/9/21	
第56回日本電気	0.28	100,000	100,086	2023/4/21	
第17回パナソニック	0.47	100,000	100,117	2026/9/18	
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	99,703	2021/8/2	
第60回日産自動車	0.22	200,000	195,476	2023/3/20	
第16回アイシン精機	0.16	100,000	98,844	2026/9/25	
第1回明治安田生命2018基金	0.315	100,000	98,895	2023/9/25	
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	98,725	2024/8/2	
第51回住友商事	1.241	100,000	106,374	2029/4/23	

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1回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ		0.94	100,000	101,033	2024/6/26
第17回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ		0.535	100,000	98,218	2028/5/31
第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）		1.62	100,000	101,924	2021/10/29
第88回三菱東京ＵＦＪ銀行		2.34	100,000	114,446	2027/4/20
第12回住友信託銀行（劣後特約付）		1.373	100,000	100,525	2020/11/11
第15回住友信託銀行（劣後特約付）		1.62	100,000	102,429	2022/3/22
第23回三井住友銀行（劣後特約付）		1.61	100,000	100,795	2020/12/17
第18回みずほ銀行（劣後特約付）		2.14	100,000	108,698	2026/9/11
第20回東京センチュリーリース		0.19	100,000	99,780	2022/10/18
第53回ホンダファイナンス		0.05	200,000	199,630	2021/12/20
第77回トヨタファイナンス		0.145	100,000	99,503	2024/7/25
第30回リコーリース		0.16	100,000	99,914	2022/1/21
第35回リコーリース		0.04	100,000	99,634	2022/7/12
第37回リコーリース		0.02	100,000	99,484	2022/10/11
第7回イオンフィナンシャルサービス		0.19	100,000	99,350	2023/3/20
第79回アコム		0.29	100,000	98,122	2025/2/28
第70回日立キャピタル		0.2	100,000	99,841	2022/12/20
第82回日立キャピタル		0.09	200,000	198,896	2023/2/20
第194回オリックス		0.19	200,000	199,266	2023/11/8
第21回三井住友ファイナンス&リース		0.18	100,000	99,698	2023/11/27
第63回三菱ＵＦＪリース		0.19	100,000	99,825	2023/10/18
第66回三菱ＵＦＪリース		0.21	300,000	299,292	2024/4/11
第75回三菱ＵＦＪリース		0.22	100,000	99,580	2025/1/23
第24回野村ホールディングス		2.329	100,000	109,437	2025/6/24
第76回三井不動産		0.21	100,000	100,038	2023/4/28
第72回三菱地所		2.28	100,000	108,611	2024/9/20
第125回三菱地所		0.19	100,000	99,425	2025/3/14
第36回京王電鉄		0.325	100,000	99,815	2027/9/17
第32回東日本旅客鉄道		2.26	100,000	108,179	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道		2.53	100,000	109,819	2024/6/20
第100回東日本旅客鉄道		1.981	100,000	128,117	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道		2.28	100,000	104,084	2022/3/25
第6回東海旅客鉄道		2.39	21,000	21,851	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道		2.312	100,000	117,547	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道		1.797	100,000	114,737	2030/10/25
第50回阪急阪神ホールディングス		0.345	100,000	99,794	2028/9/13
第16回三菱倉庫		0.21	100,000	99,457	2024/12/6
第63回日本電信電話		0.69	200,000	202,788	2023/3/20
第21回ＫＤＤＩ		0.669	100,000	101,488	2024/9/20
第1回ソフトバンク		0.13	200,000	199,708	2023/3/17
第20回エス・ティ・ティ・ドコモ		0.73	100,000	101,582	2023/9/20
第8回電源開発		2.11	100,000	108,355	2024/12/20
第38回電源開発		0.978	100,000	102,801	2023/12/20
第50回電源開発		0.415	200,000	199,848	2027/7/20
第4回東京電力パワーグリッド		0.69	200,000	202,484	2024/6/20
第12回東京電力パワーグリッド		0.44	100,000	100,442	2023/4/19

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15回東京電力パワーグリッド		0.89	100,000	98,168	2030/7/24
第28回東京電力パワーグリッド		1.01	100,000	100,333	2029/7/10
第30回東京電力パワーグリッド		0.58	100,000	100,685	2024/10/9
第31回東京電力パワーグリッド		0.98	100,000	99,955	2029/10/9
第23回東京ガス		1.01	100,000	102,818	2023/6/9
第13回広島ガス		0.405	100,000	99,995	2028/9/13
第6回ＳＣＳＫ		0.14	100,000	99,706	2022/7/21
第4回ファーストリテイリング		0.749	100,000	102,234	2025/12/18
第14回フランス相互信用連合銀行		0.563	100,000	99,903	2021/10/15
第26回フランス相互信用連合銀行		0.443	100,000	99,427	2023/10/12
第29回フランス相互信用連合銀行		0.25	100,000	98,187	2024/10/10
第8回新韓銀行		0.52	300,000	300,027	2022/11/2
第1回韓国石油公社債		0.24	100,000	99,437	2022/1/21
小	計		12,771,000	12,912,480	
合	計		222,489,111	241,122,801	

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円 456	百万円 —

○投資信託財産の構成 (2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 241,122,801	% 99.3
コール・ローン等、その他	1,581,932	0.7
投資信託財産総額	242,704,733	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	242,704,733,025
コール・ローン等	795,705,527
公社債(評価額)	241,122,801,233
未収入金	251,638,000
未収利息	511,876,525
前払費用	11,101,740
差入委託証拠金	11,610,000
(B) 負債	305,764,927
未払金	109,813,300
未払解約金	195,950,153
未払利息	1,474
(C) 純資産総額(A－B)	242,398,968,098
元本	171,486,959,342
次期繰越損益金	70,912,008,756
(D) 受益権総口数	171,486,959,342口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,135円

<注記事項>

- ①期首元本額 169,381,679,941円
 期中追加設定元本額 44,209,423,557円
 期中一部解約元本額 42,104,144,156円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,135円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	58,154,450,424円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	39,034,764,006円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	28,076,386,911円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	14,231,472,089円
三菱ＵＦＪ 日本債券ファンドＶＡ(適格機関投資家限定)	11,508,739,055円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	5,990,944,211円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	5,311,854,467円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)	4,628,158,477円
三菱ＵＦＪ 国内債券インデックスファンド	2,289,247,486円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	1,234,615,945円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式25)	272,033,561円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式15)	222,826,982円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式40)	194,540,017円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	169,005,961円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	114,505,079円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式65)	53,278,913円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)ＶＡ(適格機関投資家限定)	135,758円
合計	171,486,959,342円

○損益の状況 (2019年5月21日～2020年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,059,680,963
受取利息	2,060,273,030
支払利息	△ 592,067
(B) 有価証券売買損益	△ 1,736,999,171
売買益	576,169,788
売買損	△ 2,313,168,959
(C) 先物取引等取引損益	△ 2,858,320
取引益	15,241,520
取引損	△ 18,099,840
(D) 保管費用等	△ 1,928
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	319,821,544
(F) 前期繰越損益金	69,721,588,450
(G) 追加信託差損益金	18,838,180,338
(H) 解約差損益金	△17,967,581,576
(I) 計(E＋F＋G＋H)	70,912,008,756
次期繰越損益金(I)	70,912,008,756

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

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

(注) (H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

《第20期》決算日2020年5月20日

[計算期間：2019年5月21日～2020年5月20日]

「三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド」は、5月20日に第20期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク（ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ＦＴＳＥ世界国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(除く日本、円ベース)	期 騰 落	中 率		
	円	%		%	%	%	百万円
16期(2016年5月20日)	25,716	△6.5	436.8953	△6.3	98.7	—	73,559
17期(2017年5月22日)	25,920	0.8	441.3251	1.0	98.9	—	54,433
18期(2018年5月21日)	26,312	1.5	446.7912	1.2	98.7	—	48,418
19期(2019年5月20日)	26,691	1.4	453.5333	1.5	98.6	—	51,055
20期(2020年5月20日)	28,109	5.3	479.0346	5.6	98.3	—	46,870

(注) ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	F T S E 世界国債インデックス (除く日本、 円 ベ ー ス)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019年 5月20日	円 26,691	% —	453.5333	% —	% 98.6	% —
5 月 末	26,639	△0.2	455.6393	0.5	97.5	—
6 月 末	26,987	1.1	459.5523	1.3	98.7	—
7 月 末	27,069	1.4	460.6900	1.6	97.6	—
8 月 末	27,245	2.1	464.2836	2.4	97.0	—
9 月 末	27,377	2.6	467.4782	3.1	99.1	—
10月 末	27,644	3.6	470.0589	3.6	99.0	—
11月 末	27,658	3.6	470.8993	3.8	98.4	—
12月 末	27,783	4.1	472.8141	4.3	98.8	—
2020年 1 月 末	28,004	4.9	475.3494	4.8	97.6	—
2 月 末	28,336	6.2	484.7936	6.9	96.3	—
3 月 末	28,373	6.3	480.5834	6.0	96.2	—
4 月 末	27,831	4.3	472.8751	4.3	99.6	—
(期 末) 2020年 5月20日	28,109	5.3	479.0346	5.6	98.3	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

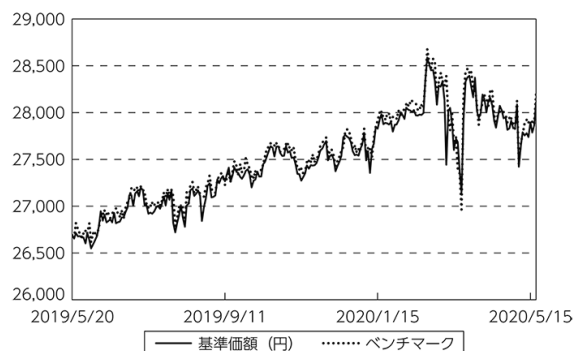
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ5.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(5.6%)を0.3%下回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因
(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は上昇しました。
- ・先進国の債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことや世界的な金融緩和スタンス等を背景に、期首との比較では上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドル、ユーロ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

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは5.6%の上昇となったため、乖離は△0.3%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

主なマイナス要因：評価時価差異要因※によるものです。

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月21日～2020年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 7	% 0.025	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(7)	(0.025)	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
(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	7	0.025	
期中の平均基準価額は、27,486円です。			

(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

(2019年5月21日～2020年5月20日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 100,369	千アメリカドル 139,912
	カナダ	国債証券	千カナダドル 3,768	千カナダドル 5,224
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 21,548	千メキシコペソ 23,215
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	20,049	18,998
	イタリア	国債証券	11,670	13,730
	フランス	国債証券	20,639	23,176
	オランダ	国債証券	2,014	3,089
	スペイン	国債証券	21,314	22,142
	ベルギー	国債証券	2,291	3,370
	オーストリア	国債証券	1,534	1,663
	フィンランド	国債証券	869	1,004
	アイルランド	国債証券	720	867
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 9,203	千イギリスポンド 12,175
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 1,568	千スウェーデンクローネ 4,991
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 2,117	千ノルウェークローネ 1,958
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 3,483	千デンマーククローネ 4,195
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 2,271	千ポーランドズロチ 3,299
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 3,643	千オーストラリアドル 3,762
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 525	千シンガポールドル 587
マレーシア	国債証券	千マレーシアリングット 2,170	千マレーシアリングット 2,012	
イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 5,673	千イスラエルシェケル ー	
南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 7,218	千南アフリカランド 39,483	

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月21日～2020年5月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	14,598	10,696	73.3	21,485	12,717	59.2

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

○組入資産の明細

(2020年5月20日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 176,800	千アメリカドル 199,196	千円 21,509,212	% 45.9	% —	% 20.8	% 17.1	% 8.0
カナダ	千カナダドル 9,280	千カナダドル 10,982	851,988	1.8	—	1.0	0.6	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 70,150	千メキシコペソ 77,001	351,897	0.8	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	22,520	28,129	3,322,117	7.1	—	4.4	2.3	0.3
イタリア	30,970	35,057	4,140,303	8.8	—	5.2	2.4	1.2
フランス	31,050	38,675	4,567,546	9.7	—	6.9	2.5	0.4
オランダ	5,970	7,380	871,672	1.9	—	1.2	0.4	0.2
スペイン	19,320	23,019	2,718,608	5.8	—	3.8	1.3	0.7
ベルギー	7,650	9,584	1,131,947	2.4	—	1.9	0.3	0.2
オーストリア	4,650	5,725	676,215	1.4	—	1.0	0.3	0.2
フィンランド	1,980	2,251	265,896	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	2,630	2,996	353,926	0.8	—	0.5	0.2	0.1
イギリス	千イギリスポンド 15,640	千イギリスポンド 22,998	3,045,723	6.5	—	5.3	1.2	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 10,040	千スウェーデンクローネ 11,450	127,670	0.3	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 9,250	千ノルウェークローネ 10,010	108,412	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 11,410	千デンマーククローネ 14,562	230,662	0.5	—	0.4	0.0	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 8,890	千ポーランドズロチ 9,852	255,579	0.5	—	0.3	0.1	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 11,460	千オーストラリアドル 13,346	944,239	2.0	—	1.4	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,310	千シンガポールドル 2,677	204,158	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 8,270	千マレーシアリンギット 8,961	222,331	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 4,300	千イスラエルシェケル 5,667	174,158	0.4	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	46,074,269	98.3	—	56.0	30.1	12.2

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄			当 期 末				
			利 率	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	0.5 T-NOTE 230315	0.5	1,900	1,915	206,804	2023/ 3 /15
		1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,100	1,114	120,336	2021/ 9 /30
		1.25 T-NOTE 211031	1.25	800	812	87,733	2021/10/31
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,700	1,755	189,546	2023/ 7 /31
		1.375 T-NOTE 221015	1.375	3,000	3,084	333,114	2022/10/15
		1.375 T-NOTE 230831	1.375	500	518	56,001	2023/ 8 /31
		1.375 T-NOTE 230930	1.375	950	986	106,515	2023/ 9 /30
		1.375 T-NOTE 250131	1.375	2,340	2,452	264,852	2025/ 1 /31
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	200	204	22,076	2022/ 1 /31
		1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,700	1,762	190,349	2023/ 3 /31
		1.5 T-NOTE 241130	1.5	800	842	90,959	2024/11/30
		1.5 T-NOTE 260815	1.5	2,400	2,548	275,146	2026/ 8 /15
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	2,050	2,116	228,492	2022/ 8 /15
		1.625 T-NOTE 220831	1.625	1,500	1,548	167,259	2022/ 8 /31
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,050	2,134	230,524	2023/ 4 /30
		1.625 T-NOTE 230531	1.625	600	625	67,531	2023/ 5 /31
		1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,050	1,099	118,746	2023/10/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	2,400	2,560	276,442	2026/ 2 /15
		1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,400	2,563	276,826	2026/ 5 /15
		1.625 T-NOTE 260930	1.625	1,430	1,530	165,280	2026/ 9 /30
		1.625 T-NOTE 261130	1.625	1,210	1,296	139,995	2026/11/30
		1.625 T-NOTE 290815	1.625	2,820	3,061	330,529	2029/ 8 /15
		1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,550	1,587	171,383	2021/11/30
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,100	2,158	233,100	2022/ 2 /28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	3,150	3,242	350,128	2022/ 3 /31
		1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,900	1,958	211,429	2022/ 4 /30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,250	2,319	250,490	2022/ 5 /15
		1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,600	1,650	178,247	2022/ 5 /31
		1.75 T-NOTE 230131	1.75	1,550	1,614	174,312	2023/ 1 /31
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,200	1,254	135,467	2023/ 5 /15
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	750	769	83,095	2021/11/30
		1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,700	1,753	189,331	2022/ 3 /31
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	3,650	3,775	407,644	2022/ 5 /31
		1.875 T-NOTE 220731	1.875	2,350	2,437	263,149	2022/ 7 /31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	750	778	84,110	2022/ 8 /31
		1.875 T-NOTE 220930	1.875	950	987	106,628	2022/ 9 /30
		2 T-NOTE 210531	2.0	450	458	49,509	2021/ 5 /31
		2 T-NOTE 210831	2.0	1,100	1,125	121,557	2021/ 8 /31
		2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,128	121,905	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,540	166,392	2021/11/15
2 T-NOTE 211231	2.0	450	463	50,010	2021/12/31		
2 T-NOTE 220215	2.0	1,200	1,237	133,630	2022/ 2 /15		
2 T-NOTE 230215	2.0	1,900	1,992	215,179	2023/ 2 /15		
2 T-NOTE 240531	2.0	1,950	2,083	224,987	2024/ 5 /31		

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2 T-NOTE 250215	2.0	1,900	2,047	221,142	2025/ 2 /15	
	2 T-NOTE 250815	2.0	2,200	2,383	257,358	2025/ 8 /15	
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,650	1,806	195,106	2026/11/15	
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,150	1,175	126,883	2021/ 6 /30	
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,100	1,126	121,636	2021/ 8 /15	
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,100	1,129	121,914	2021/ 9 /30	
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,550	1,598	172,612	2021/12/31	
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,050	1,102	119,047	2022/12/31	
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,150	2,292	247,519	2023/11/30	
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	1,200	1,283	138,585	2024/ 2 /29	
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	1,350	1,445	156,102	2024/ 3 /31	
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	1,400	1,506	162,710	2024/ 7 /31	
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	1,800	1,941	209,594	2024/ 9 /30	
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	1,250	1,358	146,711	2025/ 5 /15	
	2.125 T-NOTE 260531	2.125	1,000	1,098	118,592	2026/ 5 /31	
	2.25 T-BOND 460815	2.25	1,050	1,243	134,283	2046/ 8 /15	
	2.25 T-BOND 490815	2.25	60	71	7,754	2049/ 8 /15	
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,300	1,332	143,899	2021/ 7 /31	
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	1,520	1,628	175,887	2023/12/31	
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	750	804	86,900	2024/ 1 /31	
	2.25 T-NOTE 240430	2.25	2,100	2,261	244,243	2024/ 4 /30	
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	2,500	2,714	293,085	2024/11/15	
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	800	891	96,250	2027/ 2 /15	
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	1,350	1,513	163,413	2027/ 8 /15	
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	1,000	1,123	121,325	2027/11/15	
	2.375 T-NOTE 220315	2.375	2,100	2,183	235,784	2022/ 3 /15	
	2.375 T-NOTE 230131	2.375	1,200	1,270	137,137	2023/ 1 /31	
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	2,990	3,249	350,933	2024/ 8 /15	
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	950	1,069	115,531	2027/ 5 /15	
	2.5 T-BOND 450215	2.5	1,020	1,255	135,609	2045/ 2 /15	
	2.5 T-BOND 460215	2.5	950	1,175	126,923	2046/ 2 /15	
	2.5 T-BOND 460515	2.5	950	1,176	127,052	2046/ 5 /15	
	2.5 T-NOTE 220215	2.5	300	312	33,691	2022/ 2 /15	
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	1,100	1,180	127,463	2023/ 8 /15	
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	1,500	1,632	176,243	2024/ 5 /15	
	2.5 T-NOTE 260228	2.5	900	1,005	108,562	2026/ 2 /28	
	2.625 T-NOTE 210715	2.625	1,600	1,645	177,660	2021/ 7 /15	
	2.625 T-NOTE 230228	2.625	800	853	92,154	2023/ 2 /28	
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	600	644	69,611	2023/ 6 /30	
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	1,010	1,120	121,013	2025/ 3 /31	
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	1,600	1,794	193,783	2025/12/31	
	2.75 T-BOND 420815	2.75	650	828	89,444	2042/ 8 /15	
	2.75 T-BOND 421115	2.75	590	751	81,168	2042/11/15	
	2.75 T-BOND 470815	2.75	1,180	1,536	165,900	2047/ 8 /15	
	2.75 T-BOND 471115	2.75	630	821	88,658	2047/11/15	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.75 T-NOTE 210815	2.75	1,000	1,032	111,447	2021/8/15	
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	1,900	2,064	222,889	2023/11/15	
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	1,100	1,201	129,718	2024/2/15	
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	1,630	1,815	196,055	2025/2/28	
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	1,600	1,792	193,554	2025/6/30	
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	950	1,066	115,195	2025/8/31	
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	2,610	3,038	328,065	2028/2/15	
	2.875 T-BOND 430515	2.875	1,050	1,366	147,583	2043/5/15	
	2.875 T-BOND 450815	2.875	1,400	1,842	198,962	2045/8/15	
	2.875 T-BOND 461115	2.875	950	1,261	136,240	2046/11/15	
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	2,300	2,708	292,475	2028/5/15	
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	1,800	2,126	229,653	2028/8/15	
	3 T-BOND 420515	3.0	400	530	57,242	2042/5/15	
	3 T-BOND 441115	3.0	1,320	1,764	190,488	2044/11/15	
	3 T-BOND 450515	3.0	1,490	1,997	215,712	2045/5/15	
	3 T-BOND 451115	3.0	1,200	1,615	174,482	2045/11/15	
	3 T-BOND 470215	3.0	950	1,292	139,574	2047/2/15	
	3 T-BOND 470515	3.0	1,410	1,918	207,157	2047/5/15	
	3 T-BOND 480215	3.0	950	1,296	139,991	2048/2/15	
	3 T-BOND 480815	3.0	500	684	73,959	2048/8/15	
	3 T-NOTE 250930	3.0	850	967	104,446	2025/9/30	
	3 T-NOTE 251031	3.0	1,700	1,936	209,150	2025/10/31	
	3.125 T-BOND 411115	3.125	440	592	63,976	2041/11/15	
	3.125 T-BOND 420215	3.125	500	674	72,848	2042/2/15	
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,300	1,756	189,620	2043/2/15	
	3.125 T-BOND 440815	3.125	770	1,047	113,154	2044/8/15	
	3.125 T-BOND 480515	3.125	600	838	90,500	2048/5/15	
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	750	771	83,354	2021/5/15	
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	2,980	3,594	388,097	2028/11/15	
	3.375 T-BOND 440515	3.375	930	1,312	141,770	2044/5/15	
	3.375 T-BOND 481115	3.375	500	731	79,021	2048/11/15	
	3.5 T-BOND 390215	3.5	380	535	57,842	2039/2/15	
	3.625 T-BOND 430815	3.625	950	1,383	149,395	2043/8/15	
	3.625 T-BOND 440215	3.625	1,410	2,060	222,448	2044/2/15	
	3.75 T-BOND 410815	3.75	400	586	63,303	2041/8/15	
	3.75 T-BOND 431115	3.75	930	1,381	149,125	2043/11/15	
	3.875 T-BOND 400815	3.875	450	667	72,036	2040/8/15	
	4.25 T-BOND 390515	4.25	460	708	76,461	2039/5/15	
	4.25 T-BOND 401115	4.25	500	777	83,903	2040/11/15	
	4.375 T-BOND 380215	4.375	310	479	51,730	2038/2/15	
	4.375 T-BOND 391115	4.375	440	689	74,410	2039/11/15	
	4.375 T-BOND 400515	4.375	470	739	79,874	2040/5/15	
	4.375 T-BOND 410515	4.375	350	553	59,819	2041/5/15	
	4.5 T-BOND 380515	4.5	250	392	42,350	2038/5/15	
	4.75 T-BOND 410215	4.75	500	824	89,032	2041/2/15	

銘 柄			当 期 末					
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
	国債証券	5.25 T-BOND 281115	5.25	400	553	59,790	2028/11/15	
		5.25 T-BOND 290215	5.25	800	1,115	120,438	2029/2/15	
		5.5 T-BOND 280815	5.5	220	306	33,120	2028/8/15	
		6 T-BOND 260215	6.0	850	1,119	120,845	2026/2/15	
		6.125 T-BOND 271115	6.125	400	564	60,951	2027/11/15	
		6.25 T-BOND 230815	6.25	1,100	1,314	141,976	2023/8/15	
		8 T-BOND 211115	8.0	500	558	60,310	2021/11/15	
小 計						21,509,212		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	300	301	23,371	2022/3/1	
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	600	603	46,851	2021/9/1	
		1 CAN GOVT 220901	1.0	950	965	74,902	2022/9/1	
		1 CAN GOVT 270601	1.0	300	310	24,083	2027/6/1	
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	850	881	68,396	2023/6/1	
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	200	212	16,493	2026/6/1	
		2 CAN GOVT 280601	2.0	350	390	30,302	2028/6/1	
		2 CAN GOVT 511201	2.0	230	282	21,914	2051/12/1	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	750	818	63,514	2025/6/1	
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	160	184	14,280	2029/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,150	1,248	96,852	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	250	262	20,369	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	350	485	37,641	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	160	249	19,325	2064/12/1	
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	750	773	60,012	2021/6/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	360	545	42,303	2045/12/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	320	495	38,433	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	320	523	40,615	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	270	394	30,581	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	510	825	64,053	2033/6/1	
			8 CAN GOVT 270601	8.0	150	227	17,688	2027/6/1
小 計						851,988		
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	7,650	9,107	41,622	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	1,400	1,871	8,553	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	6,200	6,271	28,660	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	7,000	7,103	32,462	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	5,600	5,755	26,304	2022/6/9	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	2,500	2,607	11,916	2023/3/9	
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	3,450	3,561	16,274	2021/12/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,100	5,605	25,619	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	4,100	4,578	20,921	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	1,700	1,902	8,694	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	5,650	6,100	27,879	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	6,700	7,321	33,458	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	1,800	1,999	9,139	2047/11/7	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	7,200	8,412	38,444	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	4,100	4,802	21,946	2038/11/18
小 計						351,897	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	690	718	84,832	2026/8/15
		0 BUND 290815	—	600	628	74,204	2029/8/15
		0 BUND 500815	—	180	182	21,535	2050/8/15
		0 OBL 230414	—	260	265	31,332	2023/4/14
		0 OBL 240405	—	1,170	1,201	141,898	2024/4/5
		0 OBL 241018	—	600	618	72,986	2024/10/18
		0.25 BUND 270215	0.25	860	911	107,684	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	700	747	88,296	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	430	460	54,353	2029/2/15
		0.5 BUND 250215	0.5	600	634	74,895	2025/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	720	778	91,954	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	500	542	64,090	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	400	429	50,669	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,110	1,208	142,766	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	430	591	69,831	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	1,400	1,470	173,706	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,100	1,167	137,833	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	500	533	62,966	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	400	435	51,428	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	740	778	91,921	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	720	786	92,924	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,200	1,252	147,924	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	450	489	57,846	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	620	1,020	120,578	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	620	1,047	123,729	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	340	602	71,105	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	550	950	112,239	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	500	936	110,624	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	570	819	96,798	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	480	834	98,576	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	780	1,576	186,131	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	620	1,021	120,595	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	570	844	99,706	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	350	438	51,826	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	360	598	70,730	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	400	606	71,594	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	100	100	11,815	2021/11/1
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	210	202	23,960	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	500	501	59,241	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	800	796	94,104	2023/10/15
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	150	151	17,850	2022/8/1

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	350	352	41,617	2023/3/15
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	450	455	53,821	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	400	397	46,989	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	450	456	53,969	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	250	255	30,117	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	850	864	102,064	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	750	763	90,177	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	480	473	55,882	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	400	413	48,856	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,100	1,146	135,345	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	1,040	1,079	127,431	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	200	208	24,584	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	150	154	18,206	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	330	346	40,961	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	740	754	89,160	2036/9/1
		2.3 ITALY GOVT 211015	2.3	500	513	60,661	2021/10/15
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	380	402	47,477	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	550	584	69,007	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	420	448	52,920	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	460	478	56,531	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	490	538	63,595	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	460	473	55,885	2067/3/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	530	593	70,035	2029/8/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	410	467	55,193	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	330	383	45,263	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	390	459	54,264	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	650	756	89,310	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	250	258	30,535	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,000	1,041	123,039	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	500	556	65,713	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	290	365	43,129	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	770	959	113,308	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	750	832	98,268	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	900	1,018	120,265	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	500	589	69,624	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	650	687	81,155	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	470	528	62,461	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	650	811	95,782	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	380	532	62,941	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	650	702	82,934	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	820	967	114,274	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	690	938	110,885	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	750	1,059	125,148	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	470	665	78,651	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	700	920	108,693	2029/11/1

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	750	833	98,381	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,370	1,531	180,814	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	550	783	92,576	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	540	764	90,302	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	650	876	103,538	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	350	476	56,309	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	383	45,262	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 220525	—	950	960	113,400	2022/5/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	600	619	73,117	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	1,220	1,274	150,509	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	650	681	80,428	2026/5/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	1,200	1,285	151,814	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	1,250	1,341	158,400	2028/11/25
		1 O.A.T 251125	1.0	800	859	101,450	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	1,100	1,192	140,885	2027/5/25
		1.25 O.A.T 340525	1.25	290	329	38,912	2034/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	660	752	88,827	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	950	1,100	129,912	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	2,340	2,501	295,441	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	900	988	116,798	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	800	990	116,960	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	510	699	82,594	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	660	882	104,244	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	1,170	1,250	147,642	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	1,050	1,165	137,626	2024/5/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	1,090	1,363	160,979	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	1,150	1,403	165,748	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	1,400	1,495	176,647	2022/4/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	660	1,063	125,587	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	830	1,018	120,268	2026/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	500	817	96,513	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	500	1,001	118,320	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	440	927	109,567	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	1,390	1,619	191,294	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	740	1,326	156,706	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	930	1,539	181,788	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	1,310	1,967	232,303	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	860	1,455	171,893	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	1,000	1,347	159,097	2025/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	1,150	1,455	171,860	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	450	454	53,657	2022/1/15
		0 NETH GOVT 240115	—	380	387	45,817	2024/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	300	311	36,844	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	350	370	43,800	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	150	165	19,520	2040/1/15

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	0.75 NETH GOVT 270715	0.75	450	487	57,600	2027/ 7 /15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	350	381	45,098	2028/ 7 /15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	350	376	44,409	2023/ 7 /15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	250	276	32,701	2024/ 7 /15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	400	424	50,169	2022/ 7 /15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	490	656	77,583	2033/ 1 /15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	390	670	79,229	2047/ 1 /15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	350	365	43,145	2021/ 7 /15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	200	223	26,375	2023/ 1 /15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	350	635	75,084	2042/ 1 /15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	370	623	73,587	2037/ 1 /15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	390	567	67,047	2028/ 1 /15
スペイン	国債証券	0.05 SPAIN GOVT 211031	0.05	1,000	1,005	118,755	2021/10/31
		0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	600	609	71,967	2023/ 7 /30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	450	458	54,092	2022/10/31
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	680	670	79,243	2030/ 4 /30
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	900	912	107,737	2021/ 7 /30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	210	186	21,971	2050/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	660	708	83,673	2028/ 4 /30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	700	751	88,798	2028/ 7 /30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	610	656	77,520	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	650	700	82,687	2029/ 4 /30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	500	540	63,807	2027/ 4 /30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	710	763	90,144	2025/ 4 /30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	860	948	112,011	2026/ 4 /30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	600	676	79,846	2030/ 7 /30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	740	820	96,899	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	490	579	68,451	2033/ 7 /30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	330	426	50,428	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,030	1,155	136,483	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	420	558	65,958	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	260	409	48,399	2066/ 7 /30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	240	276	32,666	2024/ 4 /30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	650	963	113,770	2037/ 1 /31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	500	578	68,322	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	410	506	59,835	2025/ 7 /30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	500	821	97,017	2041/ 7 /30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	500	590	69,740	2024/ 1 /31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	410	680	80,413	2040/ 7 /30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	550	760	89,867	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	310	554	65,443	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	550	633	74,847	2023/ 1 /31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	530	836	98,740	2032/ 7 /30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	700	773	91,345	2022/ 1 /31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	520	700	82,687	2026/ 7 /30

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	6 SPAIN GOVT 290131	6.0	550	804	95,030	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	420	443	52,409	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	350	373	44,109	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	650	697	82,318	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	370	400	47,347	2029/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	370	405	47,891	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	390	453	53,517	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	300	367	43,391	2047/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	220	330	39,070	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	450	488	57,684	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	180	264	31,199	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	500	561	66,352	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	220	302	35,692	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	220	377	44,638	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	400	433	51,241	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	260	376	44,516	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	350	372	44,004	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	300	334	39,467	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	390	669	79,051	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	450	576	68,033	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	490	820	96,923	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	370	534	63,084	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 300220	—	200	201	23,819	2030/2/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	250	263	31,109	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	250	264	31,188	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	190	203	23,981	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	210	225	26,630	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	250	271	32,076	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	194	23,004	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	120	174	20,650	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	300	328	38,779	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	380	409	48,412	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	130	248	29,375	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	170	224	26,481	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	160	268	31,712	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	400	440	51,986	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	400	421	49,786	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	250	270	31,939	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	80	181	21,388	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	300	499	58,947	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	250	326	38,565	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	210	308	36,380	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	50	50	6,007	2023/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	100	100	11,818	2036/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	100	105	12,411	2026/4/15

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	190	200	23,718	2028/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	120	130	15,421	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	130	138	16,395	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	110	126	14,889	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	60	77	9,156	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	120	127	15,022	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	250	262	31,036	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	220	241	28,537	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	120	183	21,674	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	200	248	29,312	2028/7/4
アイルランド	国債証券	4 FINNISH GOVT 250704	4.0	210	258	30,494	2025/7/4
		0 IRISH GOVT 221018	—	100	100	11,921	2022/10/18
		0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	280	286	33,814	2022/3/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	360	384	45,421	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	200	213	25,162	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	200	217	25,717	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	180	201	23,778	2033/5/15
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	100	117	13,920	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	210	249	29,448	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	180	234	27,691	2045/2/18
小 計		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	250	304	36,003	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	120	136	16,179	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	168	19,858	2023/3/20
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	300	381	45,010	2025/3/13
						18,048,234	
		イギリス			千イギリスポンド	千イギリスポンド	
	国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	800	809	107,179	2022/7/22
		0.75 GILT 230722	0.75	1,050	1,074	142,352	2023/7/22
		1.25 GILT 270722	1.25	420	454	60,196	2027/7/22
		1.5 GILT 260722	1.5	920	1,002	132,768	2026/7/22
		1.625 GILT 281022	1.625	670	753	99,786	2028/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	310	477	63,244	2071/10/22
		1.75 GILT 220907	1.75	720	749	99,225	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	590	704	93,346	2037/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	750	805	106,702	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	490	880	116,607	2065/7/22
		3.25 GILT 440122	3.25	420	658	87,200	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	810	1,333	176,654	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	450	1,024	135,641	2068/7/22
		3.75 GILT 520722	3.75	410	787	104,313	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	50	53	7,101	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	400	896	118,674	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	460	601	79,691	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	330	480	63,698	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	530	831	110,113	2036/3/7

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	4.25 GILT 390907	4.25	320	533	70,679	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	330	561	74,398	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	850	1,593	211,059	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	480	946	125,283	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	460	1,002	132,786	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	320	499	66,148	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	400	725	96,030	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	510	749	99,223	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	360	625	82,867	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	620	766	101,542	2025/3/7
	6 GILT 281207	6.0	410	613	81,204	2028/12/7	
小 計						3,045,723	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	1,550	1,659	18,504	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	900	968	10,794	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	1,600	1,725	19,238	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	1,640	1,744	19,450	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,250	1,423	15,872	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	1,900	2,047	22,833	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,200	1,881	20,977	2039/3/30
小 計						127,670	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	1,000	1,089	11,797	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	700	752	8,146	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	950	1,023	11,084	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,000	1,099	11,905	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	600	672	7,282	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,851	20,055	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	750	846	9,170	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	1,100	1,222	13,240	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	1,400	1,452	15,729	2021/5/25
小 計						108,412	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	2,300	2,448	38,779	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	2,050	2,197	34,813	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	900	962	15,251	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	1,460	1,638	25,947	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	1,800	1,892	29,980	2021/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	2,900	5,422	85,889	2039/11/15
小 計						230,662	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.75 POLAND 210725	1.75	600	609	15,800	2021/7/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	700	723	18,761	2022/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	1,150	1,247	32,352	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	750	816	21,177	2027/7/25

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	2.75 POLAND 280425	2.75	700	776	20,137	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	600	675	17,533	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	990	1,103	28,624	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	1,600	1,779	46,161	2023/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	500	537	13,945	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	800	896	23,255	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	500	687	17,827	2029/4/25
小 計						255,579	
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	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	550	559	39,611	2032/5/21
		2 AUST GOVT 211221	2.0	350	359	25,442	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 221121	2.25	150	157	11,142	2022/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	700	777	55,025	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	540	618	43,727	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,100	1,204	85,218	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	540	618	43,780	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	650	750	53,063	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	550	640	45,292	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	239	16,944	2035/6/21
		2.75 AUST GOVT 410521	2.75	180	214	15,193	2041/5/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	290	367	25,996	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	650	780	55,228	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	210	267	18,951	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	280	377	26,680	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,160	1,411	99,855	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	610	857	60,682	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	600	765	54,177	2027/4/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	650	749	52,997	2023/4/21
5.75 AUST GOVT 210515	5.75	750	790	55,923	2021/5/15		
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	750	838	59,301	2022/7/15
小 計						944,239	
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	2.125 SINGAPORG V 260601	2.125	120	131	10,038	2026/6/1
		2.25 SINGAPORG V 210601	2.25	220	224	17,137	2021/6/1
		2.25 SINGAPORG V 360801	2.25	150	176	13,429	2036/8/1
		2.75 SINGAPORG V 230701	2.75	350	376	28,724	2023/7/1
		2.75 SINGAPORG V 420401	2.75	200	263	20,086	2042/4/1
		2.75 SINGAPORG V 460301	2.75	150	203	15,499	2046/3/1
		2.875 SINGAPORG V 290701	2.875	200	238	18,165	2029/7/1
		2.875 SINGAPORG V 300901	2.875	120	144	11,027	2030/9/1
		3 SINGAPORG V 240901	3.0	250	277	21,197	2024/9/1
		3.125 SINGAPORG V 220901	3.125	230	245	18,695	2022/9/1
		3.375 SINGAPORG V 330901	3.375	120	156	11,944	2033/9/1
		3.5 SINGAPORG V 270301	3.5	200	238	18,210	2027/3/1
小 計						204,158	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
マレーシア			%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
	国債証券	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	350	358	8,906	2022/ 8 /15
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	250	257	6,399	2023/ 3 /15
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	314	7,805	2027/ 5 /31
		3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	350	357	8,876	2021/11/30
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	500	529	13,143	2028/ 6 /15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	250	258	6,421	2022/ 9 /30
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	350	365	9,071	2023/ 8 /17
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	317	7,887	2033/ 4 /15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	550	590	14,651	2027/11/16
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	210	224	5,573	2026/ 7 /15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	400	428	10,623	2025/ 9 /15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	480	492	12,219	2021/ 9 /30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	200	218	5,420	2032/ 4 /15
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	100	102	2,539	2021/ 7 /15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	400	426	10,585	2024/ 7 /15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	1,030	1,134	28,153	2031/ 6 /30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	221	5,492	2035/ 5 /31
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	328	8,150	2026/ 4 /15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	250	281	6,981	2030/ 4 /15
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	200	228	5,675	2033/11/ 7
4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	400	458	11,371	2046/ 3 /15		
4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	550	647	16,074	2037/ 4 / 7		
4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	415	10,305	2043/ 9 /30		
小 計						222,331	
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券	2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	600	684	21,025	2028/ 9 /28
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	800	909	27,954	2024/ 3 /31
		5.5 ISRAEL FIXED 220131	5.5	1,000	1,108	34,058	2022/ 1 /31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	850	1,496	45,994	2042/ 1 /31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	1,050	1,468	45,126	2026/10/30
小 計						174,158	
合 計						46,074,269	

(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。

○投資信託財産の構成

(2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 46,074,269	% 98.1
コール・ローン等、その他	890,264	1.9
投資信託財産総額	46,964,533	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（46,788,998千円）の投資信託財産総額（46,964,533千円）に対する比率は99.6%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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=107.98円	1 カナダドル=77.58円	1 メキシコペソ=4.57円	1 ユーロ=118.10円
1 イギリスポンド=132.43円	1 スウェーデンクローネ=11.15円	1 ノルウェークローネ=10.83円	1 デンマーククローネ=15.84円
1 ポーランドズロチ=25.94円	1 オーストラリアドル=70.75円	1 シンガポールドル=76.26円	1 マレーシアリングgit=24.81円
1 イスラエルシェケル=30.73円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	47,073,274,557
コール・ローン等	521,094,893
公社債(評価額)	46,074,269,151
未収入金	169,109,777
未収利息	267,997,521
前払費用	40,803,215
(B) 負債	202,920,964
未払金	167,933,756
未払解約金	34,986,994
未払利息	214
(C) 純資産総額(A－B)	46,870,353,593
元本	16,674,794,007
次期繰越損益金	30,195,559,586
(D) 受益権総口数	16,674,794,007口
1万口当たり基準価額(C／D)	28,109円

<注記事項>

- ①期首元本額 19,128,732,358円
 期中追加設定元本額 4,991,395,696円
 期中一部解約元本額 7,445,334,047円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,8109円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	3,532,857,578円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	2,135,961,536円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,125,384,692円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ(適格機関投資家限定)	1,991,985,057円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,486,513,245円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,295,600,495円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	1,036,950,391円
三菱ＵＦＪ 外国債券オープン	1,020,606,287円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	436,288,764円
三菱ＵＦＪ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	364,609,247円
三菱ＵＦＪ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	363,947,965円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型)	322,692,321円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(成長型)	185,300,113円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定型)	176,248,811円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド(成長型)	58,883,225円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式25)	36,531,005円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式40)	35,454,608円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式15)	25,456,956円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス(株式65)	23,989,485円
三菱ＵＦＪ 外国債券ファンドＶＡ2(適格機関投資家限定)	19,523,979円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド(安定成長型) ＶＡ(適格機関投資家限定)	8,247円
合計	16,674,794,007円

○損益の状況 (2019年5月21日～2020年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,125,776,960
受取利息	1,126,689,612
その他収益金	10,773
支払利息	△ 923,425
(B) 有価証券売買損益	1,554,022,374
売買益	3,542,533,193
売買損	△ 1,988,510,819
(C) 保管費用等	△ 12,201,576
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	2,667,597,758
(E) 前期繰越損益金	31,926,812,910
(F) 追加信託差損益金	8,748,712,439
(G) 解約差損益金	△13,147,563,521
(H) 計(D＋E＋F＋G)	30,195,559,586
次期繰越損益金(H)	30,195,559,586

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

MUAM J-REITマザーファンド

《第16期》決算日2020年3月10日

[計算期間：2019年3月12日～2020年3月10日]

「MUAM J-REITマザーファンド」は、3月10日に第16期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券への分散投資を行います。東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果をめざします。 銘柄選定およびポートフォリオの構築は、定性的評価・定量的評価を経て行います。定性的評価については、事業内容および財務内容等の分析を行います。定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、PBR（株価純資産倍率）等の分析を行います。不動産投資信託証券の組入比率は高位（通常の状態で90%以上）を基本とします。
主 要 運 用 対 象	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式及び外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資に制限を設けません。

- ファンドは特化型運用を行います。一般社団法人投資信託協会は信用リスク集中回避を目的とした投資制限（分散投資規制）を設けており、投資対象に支配的な銘柄（寄与度が10%を超える又は超える可能性の高い銘柄）が存在し、又は存在することとなる可能性が高いものを、特化型としています。
- ファンドは、東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとして運用しております。東証REIT指数（配当込み）には、指数に対する寄与度が10%を超える又は超える可能性の高い支配的な銘柄が存在するため、特定の銘柄への投資が集中することがあり、当該支配的な銘柄に経営破綻や経営・財務状況の悪化が生じた場合には、大きな損失が発生することがあります。

* 寄与度とは、投資対象候補銘柄の時価総額の合計額における一発行体あたりの時価総額が占める比率または運用管理等に用いる指数における一発行体あたりの構成比率を指します。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準		価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 信 託 証 券 組 入 比	純 資 産 額
	円	騰 落	期 中 率	（配当込み）	期 中 率	（配当込み）		
12期(2016年3月10日)	28,097		6.4	3,332.09	5.2	97.4	百万円	15,042
13期(2017年3月10日)	26,870	△	4.4	3,310.28	△ 0.7	97.8		16,702
14期(2018年3月12日)	26,458	△	1.5	3,203.75	△ 3.2	96.7		11,617
15期(2019年3月11日)	31,019		17.2	3,730.52	16.4	97.7		12,917
16期(2020年3月10日)	33,369		7.6	3,981.30	6.7	95.1		14,957

(注) 東証REIT指数（配当込み）とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。
東証REIT指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	東 証 R E I T 指 数 (配 当 込 み)	騰 落 率	投 資 信 託 証 組 入 比	信 託 券 率
(期 首) 2019年3月11日	円 31,019	% —	3,730.52	% —		% 97.7
3月末	32,000	3.2	3,851.10	3.2		97.4
4月末	31,763	2.4	3,822.76	2.5		97.4
5月末	32,256	4.0	3,889.57	4.3		97.3
6月末	32,793	5.7	3,947.76	5.8		97.3
7月末	34,195	10.2	4,120.33	10.4		97.9
8月末	35,521	14.5	4,275.94	14.6		96.8
9月末	37,081	19.5	4,477.77	20.0		98.2
10月末	38,259	23.3	4,625.77	24.0		98.0
11月末	37,978	22.4	4,584.30	22.9		97.6
12月末	36,847	18.8	4,450.34	19.3		97.4
2020年1月末	38,228	23.2	4,608.85	23.5		98.1
2月末	35,187	13.4	4,218.40	13.1		97.3
(期 末) 2020年3月10日	33,369	7.6	3,981.30	6.7		95.1

(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

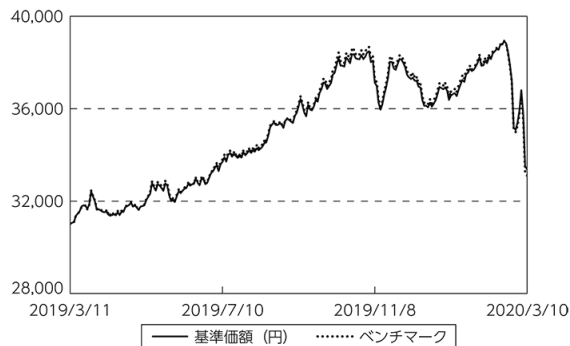
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ7.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークである東証REIT指数(配当込み)の騰落率(6.7%)を0.9%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

米国での利下げなどを背景に国内外の長期金利が低下し、高い配当利回りが期待できるJ-REITに対する投資魅力が高まったことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

米中貿易摩擦に関する懸念の後退などから、国内外の長期金利が上昇したことや、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念などが、基準価額の一時的な下落要因となりました。

(銘柄要因)

上位5銘柄…日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本プロロジスリート投資法人、オリックス不動産投資法人、ラサールロジポート投資法人

下位5銘柄…日本リテールファンド投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、平和不動産リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人

●投資環境について

◎J-REIT市況

J-REIT市況は上昇しました。

- ・期首から2019年10月末にかけては、米国での利下げなどを背景に国内外の長期金利が低下し、高い配当利回りが期待できるJ-REITに対する投資魅力が高まったことなどから、上昇基調で推移しました。11月上旬以降は、米中貿易摩擦に関する懸念の後退などから、国内外の長期金利が上昇したことや、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念を受けて下落する展開となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・銘柄選定およびポートフォリオの構築は主に、定性的評価・定量的評価を経て行っています。
- ・定性的評価については、事業内容および財務内容などの分析を中心に行い、定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、投資口価格純資産倍率(PBR)などの分析を行いました。
- ・組入銘柄数は47~54銘柄程度で推移させました。
- ・主な売買動向については、配当利回り水準や日本ヘルスケア投資法人との合併計画を評価して日本賃貸住宅投資法人のウェイトを引き上げたことや、業績動向と各種バリュエーションの相対的な割安度を勘案してフロンティア不動産投資法人のウェイトを引き下げたことなどが挙げられます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について(プラス要因)

- ・ラサールロジポート投資法人をベンチマークに対してオーバーウェイトとしていたことや、ジャパン・ホテル・リート投資法人をベンチマークに対して概ねアンダーウェイトとしていたことがプラスに寄与しました。

(マイナス要因)

- ・フロンティア不動産投資法人をベンチマークに対して概ねオーバーウェイトとしていたことや、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人をベンチマークに対してアンダーウェイトとしていたことがマイナスに影響しました。

○今後の運用方針

- ・REITの組入比率については、高水準（90%以上）を維持する方針です。
- ・配当利回りやPBR等のバリュエーション、また物件ポートフォリオのクオリティ等に着目し、安定した分配金が見込め相対的に割安と思われる銘柄への投資ウェイトを高めた運用を行います。
- ・今後のJ-REIT市況は徐々に落ち着きを取り戻していくとみています。新型コロナウイルスの感染拡大による世界景気への下押し圧力などに注意を払う必要はあるものの、景況感の悪化が続けば

国内外の中央銀行による金融緩和策の強化も想定されることに加えて、国内においてはオフィスを中心とした賃料上昇などを背景とした緩やかな業績拡大傾向に大きな変化はないと考えるためです。このような市場環境に対する想定のもと、物流や小売など大口テナントの業界動向に加えて、スポンサーのサポート体制にも着目しつつ、REIT各社に対する綿密な調査を継続することにより、個別銘柄ごとの業績動向や中長期的な成長性を慎重に見極めて選別投資を行い、パフォーマンスの向上に努めてまいります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年3月12日～2020年3月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 18 (18)	% 0.053 (0.053)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	18	0.053	
期中の平均基準価額は、35,114円です。			

(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

(2019年3月12日~2020年3月10日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	エスコンジャパンリート投資法人	千口 0.439 (0.061)	千円 57,006 (7,565)	千口 —	千円 —
	サンケイリアルエステート投資法人	1	191,309	0.9	108,819
	S O S i L A物流リート投資法人	0.5	57,975	—	—
	日本アコモデーションファンド投資法人	0.1	68,659	—	—
	MCUBS M i d C i t y投資法人	0.3	34,009	1	163,940
	森ヒルズリート投資法人	2	346,496	—	—
	産業ファンド投資法人	1	236,330	—	—
	アドバンス・レジデンス投資法人	0.4	140,370	0.3	97,489
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.3	57,992	0.2	36,993
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	0.49	253,040	0.24	123,359
	GLP投資法人	1	168,571	0.6	78,953
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.1	34,949	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	0.55	152,061	0.05	13,888
	星野リゾート・リート投資法人	0.1	55,672	0.35	194,543
	O n e リート投資法人	0.25	87,700	—	—
	イオンリート投資法人	—	—	1	176,120
	ヒューリックリート投資法人	1	187,257	0.2	41,480
	日本リート投資法人	—	—	0.25	104,638
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4	85,674	—	—
	積水ハウス・リート投資法人	1	93,837	1	84,575
	ケネディクス商業リート投資法人	0.35	98,176	0.2	52,135
	ヘルスケア&メディカル投資法人	—	—	0.57	65,571
	野村不動産マスターファンド投資法人	1	226,623	0.5	88,517
	ラサールロジポート投資法人	1	147,789	0.1	12,899
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.181 (0.019)	87,394 (9,419)	—	—
	さくら総合リート投資法人	0.8	74,871	0.7	67,775
	投資法人みらい	1	66,409	0.2	10,157
	三菱地所物流リート投資法人	—	—	0.25	76,709
	CREロジスティクスファンド投資法人	1	138,855	0.48	59,748
	ザイマックス・リート投資法人	0.6	76,732	1	154,106
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1 (0.09)	125,122 (10,471)	0.15	13,370
	日本ビルファンド投資法人	0.26	210,739	0.26	199,284
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.4	295,800	0.25	169,071	
日本リテールファンド投資法人	0.5	125,589	0.9	197,723	
オリックス不動産投資法人	0.9	191,668	0.8	171,183	
日本プライムリアルティ投資法人	0.25	123,898	0.25	114,545	

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国	プレミアム投資法人	千口 0.6	千円 88,089	千口 0.3	千円 41,915
	東急リアル・エステート投資法人	0.5	88,760	—	—
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.9	118,732	2	277,434
	ユナイテッド・アーバン投資法人	1	316,934	1	269,752
	森トラスト総合リート投資法人	0.5	97,815	—	—
	インヴィンシブル投資法人	5	314,055	4	219,699
	フロンティア不動産投資法人	0.15	68,237	1	456,114
	平和不動産リート投資法人	1	144,631	0.4	52,472
	日本ロジスティクスファンド投資法人	—	—	0.4	101,240
	ケネディクス・オフィス投資法人	—	—	0.07	56,901
	いちごオフィスリート投資法人	0.3	30,458	1	116,633
	大和証券オフィス投資法人	0.02	15,843	0.12	95,306
	阪急阪神リート投資法人	0.5	76,732	1	215,324
	大和ハウスリート投資法人	0.728 (0.072)	200,539 (20,424)	0.2	57,731
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	0.5	45,534	3	284,515
内	日本賃貸住宅投資法人	2	266,177	0.8	76,730
	ジャパンエクセレント投資法人	1	209,906	0.6	101,596
	エスコンジャパンリート投資法人（新）	0.061 (△0.061)	7,565 (△ 7,565)	—	—
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人（新）	0.019 (△0.019)	9,419 (△ 9,419)	—	—
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人（新）	0.09 (△ 0.09)	10,471 (△ 10,471)	—	—
	大和ハウスリート投資法人（新）	0.072 (△0.072)	20,424 (△ 20,424)	—	—
	合 計	42	6,428,916	31	5,100,970

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2019年3月12日～2020年3月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	6,428	1,462	22.7	5,100	1,080	21.2

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 464

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	7,903千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,896千円
(B) / (A)	24.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2020年3月10日現在)

国内投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	—	0.5	51,200	0.3
サンケイリアルエステート投資法人	0.618	1	163,650	1.1
S O S i L A 物流リート投資法人	—	0.5	57,550	0.4
日本アコモデーションファンド投資法人	0.5	0.6	363,600	2.4
MCUBS M i d C i t y 投資法人	2	1	125,710	0.8
森ヒルズリート投資法人	0.5	2	418,600	2.8
産業ファンド投資法人	0.8	2	347,520	2.3
アドバンス・レジデンス投資法人	1	1	468,000	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1	1	185,240	1.2
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.75	1	472,500	3.2
G L P 投資法人	2	3	418,240	2.8
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.7	0.8	252,400	1.7
日本プロロジスリート投資法人	1	2	684,480	4.6
星野リゾート・リート投資法人	0.3	0.05	20,700	0.1
O n e リート投資法人	—	0.25	74,225	0.5
イオンリート投資法人	2	1	140,280	0.9
ヒューリックリート投資法人	0.5	1	216,060	1.4
日本リート投資法人	0.55	0.3	124,350	0.8
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	2	6	116,760	0.8
積水ハウス・リート投資法人	4	4	352,800	2.4
ケネディクス商業リート投資法人	0.05	0.2	42,840	0.3
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.6	0.03	3,270	0.0
野村不動産マスターファンド投資法人	4	4	748,710	5.0
ラサールロジポート投資法人	1	2	353,280	2.4
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.4	0.6	291,000	1.9
さくら総合リート投資法人	—	0.1	8,100	0.1
投資法人みらい	—	1	44,700	0.3
三菱地所物流リート投資法人	0.3	0.05	18,050	0.1
C R E ロジスティクスファンド投資法人	—	0.6	71,100	0.5
ザイマックス・リート投資法人	0.8	0.2	21,780	0.1
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.2	1	139,100	0.9
日本ビルファンド投資法人	1	1	1,156,400	7.7
ジャパンリアルエステイト投資法人	1	1	1,156,300	7.7
日本リテールファンド投資法人	2	2	416,240	2.8
オリックス不動産投資法人	2	2	576,520	3.9
日本プライムリアルティ投資法人	0.8	0.8	352,400	2.4
プレミアム投資法人	1	1	200,250	1.3
東急リアル・エステート投資法人	0.8	1	221,260	1.5
グローバル・ワン不動産投資法人	3	2	306,250	2.0
ユナイテッド・アーバン投資法人	2	2	436,590	2.9
森トラスト総合リート投資法人	—	0.5	85,450	0.6
インヴィンシブル投資法人	3	4	157,400	1.1
フロンティア不動産投資法人	1	0.15	54,300	0.4

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	%
平和不動産リート投資法人	0.4	1	119,300	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.7	0.3	72,900	0.5
福岡リート投資法人	0.05	0.05	7,320	0.0
ケネディクス・オフィス投資法人	0.5	0.43	330,240	2.2
いちごオフィスリート投資法人	1	1	94,900	0.6
大和証券オフィス投資法人	0.5	0.4	312,800	2.1
阪急阪神リート投資法人	1	0.3	42,930	0.3
大和ハウスリート投資法人	1	2	545,160	3.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人	5	1	108,680	0.7
日本賃貸住宅投資法人	1	3	308,480	2.1
ジャパンエクセレント投資法人	1	2	361,240	2.4
合 計	66	78	14,219,105	
銘 柄 数<比 率>	47	54	<95.1%>	

(注) 比率および合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) エスコンジャパンリート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、MCUBS Midcity投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、Oneリート投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、ヘルスケア&メディカル投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、ラサールロジポート投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、さくら総合リート投資法人、投資法人みらい、三菱地所物流リート投資法人、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本リテールファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、プレミアム投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急阪神リート投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUF証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている2019年7月31日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容
当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

○投資信託財産の構成 (2020年3月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	14,219,105	94.9
コール・ローン等、その他	766,855	5.1
投資信託財産総額	14,985,960	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年3月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,985,960,265
コール・ローン等	582,355,915
投資証券(評価額)	14,219,105,000
未収配当金	184,499,350
(B) 負債	28,216,770
未払金	21,988,266
未払解約金	6,227,404
未払利息	1,100
(C) 純資産総額(A-B)	14,957,743,495
元本	4,482,527,378
次期繰越損益金	10,475,216,117
(D) 受益権総口数	4,482,527,378口
1万口当たり基準価額(C/D)	33,369円

<注記事項>

- ①期首元本額 4,164,352,947円
 期中追加設定元本額 1,373,823,999円
 期中一部解約元本額 1,055,649,568円
 また、1口当たり純資産額は、期末33,369円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ <DC> J-REITファンド	4,083,747,949円
MUAM J-REITファンド(適格機関投資家転売制限付)	264,864,178円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	72,943,794円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	50,625,992円
ファンド・マネジャー(国内リート)	10,345,465円
合計	4,482,527,378円

○損益の状況 (2019年3月12日～2020年3月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	538,661,395
受取配当金	538,780,550
受取利息	1,112
その他収益金	5
支払利息	△ 120,272
(B) 有価証券売買損益	276,494,314
売買益	920,884,447
売買損	△ 644,390,133
(C) 保管費用等	△ 432
(D) 当期損益金(A+B+C)	815,155,277
(E) 前期繰越損益金	8,753,163,166
(F) 追加信託差損益金	3,455,993,674
(G) 解約差損益金	△ 2,549,096,000
(H) 計(D+E+F+G)	10,475,216,117
次期繰越損益金(H)	10,475,216,117

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

MUAM G-REITマザーファンド

《第15期》決算日2021年1月5日

[計算期間：2020年1月7日～2021年1月5日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月5日に第15期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主としてS & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。組入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。市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主 要 運 用 対 象	S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		S & P 先 進 国 R E I T イ ン デ ッ ク ス (除く日本、配当込み、円換算ベース)		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
	円	%		%	%	百万円
11期(2017年1月5日)	16,039	6.2	41,801.16	5.5	98.8	18,949
12期(2018年1月5日)	16,420	2.4	42,522.26	1.7	98.0	18,551
13期(2019年1月7日)	15,011	△ 8.6	38,602.62	△ 9.2	98.8	19,712
14期(2020年1月6日)	18,377	22.4	47,161.24	22.2	99.0	30,217
15期(2021年1月5日)	15,806	△14.0	40,236.52	△14.7	99.0	40,409

(注) S & P先進国REITインデックスとは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS & Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託（REIT）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。なお、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）は、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み）をもとに、委託会社が計算したものです。S & P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJII」）の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJII、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REITインデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任を負いません。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P R E I T イ (除く日本、配当込 み、円換算ベース)	先 進 国 司 ン デ ッ ク ス 騰 落 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	円	騰 落 率			
(期 首) 2020年1月6日	18,377	% —	47,161.24	% —	% 99.0
1月末	18,923	3.0	48,553.04	3.0	99.0
2月末	17,805	△ 3.1	45,640.42	△ 3.2	98.8
3月末	13,378	△27.2	34,126.01	△27.6	99.0
4月末	14,298	△22.2	36,418.41	△22.8	99.4
5月末	14,433	△21.5	36,769.78	△22.0	99.3
6月末	14,590	△20.6	37,151.26	△21.2	98.8
7月末	14,857	△19.2	37,787.41	△19.9	99.3
8月末	15,317	△16.7	39,001.97	△17.3	99.3
9月末	14,683	△20.1	37,350.97	△20.8	99.1
10月末	14,203	△22.7	36,104.61	△23.4	99.5
11月末	15,983	△13.0	40,687.85	△13.7	99.7
12月末	16,149	△12.1	41,107.17	△12.8	98.7
(期 末) 2021年1月5日	15,806	△14.0	40,236.52	△14.7	99.0

(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

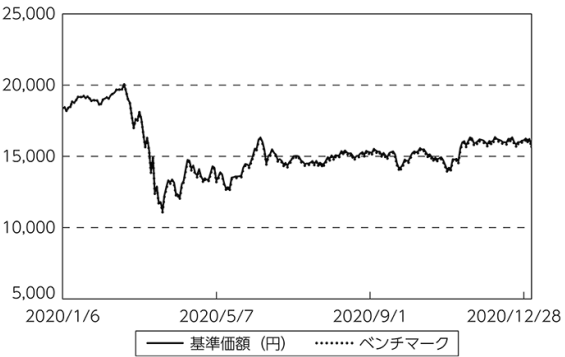
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.0%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率
(-14.7%) を0.7%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎外国REIT市況

- ・外国REIT市況は下落しました。
- ・外国REIT市況は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念などを受けて下落しました。

◎為替市況

- ・米ドルは円に対して下落、ユーロは円に対して上昇しました。
- ・為替市況は、期首に比べて4.6%の円高・米ドル安、4.7%の円安・ユーロ高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして、運用を行いました。
- ・不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは14.7%の下落になったため、カイ離は0.7%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・その他の要因によるものです。

※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 1 月 7 日～2021年 1 月 5 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 4	% 0.025	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(4)	(0.025)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.022	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(3)	(0.022)	
(c) そ の 他 費 用	19	0.120	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(6)	(0.037)	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
(そ の 他)	(13)	(0.082)	信託事務の処理等に要するその他諸費用（権利割当にかかる現地徴収税等）
合 計	26	0.167	
期中の平均基準価額は、15,486円です。			

(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

(2020年1月7日～2021年1月5日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 —	千アメリカドル —	百株 32	千アメリカドル 10

(注) 金額は受渡代金。

投資信託証券

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	SITE CENTERS CORP	23	188	7	68
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	78	2,064	12	352
	MACERICH CO/THE	9 (1)	96 (10)	—	—
	ACADIA REALTY TRUST	8	117	—	—
	AGREE REALTY CORP	9	592	0.629	42
	ALEXANDER'S INC	0.21	50	—	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20	3,182	5	789
	PROLOGIS INC	100 (22)	8,906 (2,013)	18	1,794
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	20	692	4	158
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	— (△ 13)	— (—)	1	3
	BRANDYWINE REALTY TRUST	19	205	2	27
	CAMDEN PROPERTY TRUST	13	1,215	2	248
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	—	—	31	6
	CEDAR REALTY TRUST INC	—	—	17	12
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	25	902	4	169
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14	337	2	55
	COUSINS PROPERTIES INC	21	650	3	125
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	20	107	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	51	7,063	5	743
	EASTGROUP PROPERTIES INC	5	603	0.545	77
	EPR PROPERTIES	11	339	4	114
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25	1,524	8	554
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9	2,107	1	469
	EXTRA SPACE STORAGE INC	16	1,629	3	366
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	9	784	2	178
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16	611	1	61
	GETTY REALTY CORP	5	135	0.993	30
	WELLTOWER INC	58	3,118	9	585
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	13	504	2	99
	SERVICE PROPERTIES TRUST	26	233	7	55
	EQUITY COMMONWEALTH	18	573	5	151
	KILROY REALTY CORP	14	883	2	128
	KITE REALTY GROUP TRUST	19	235	9	127
	LEXINGTON REALTY TRUST	40	414	3	33
	LTC PROPERTIES INC	4	173	0.778	29
	MACK-CALI REALTY CORP	13	207	3	58
	BOSTON PROPERTIES INC	20	1,879	4	410
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	76	1,360	12	237
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	15	1,801	3	388
	NATL HEALTH INVESTORS INC	6	382	1	93
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32	948	4	149

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1 (0.075)	25 (1)	—	—
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	—	—	12	6
	RPT REALTY	11	104	—	—
	REALTY INCOME CORP	50	2,956	6	374
	REGENCY CENTERS CORP	22	972	5	235
	SAUL CENTERS INC	2	57	1	37
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	25	103	—	—
	SL GREEN REALTY CORP	11	608	5	262
	LIFE STORAGE INC	6	681	0.737	80
	SUN COMMUNITIES INC	16	2,312	2	275
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	31	273	8	83
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12	121	—	—
	TAUBMAN CENTERS INC	7	314	1 (19)	59 (664)
	CUBESMART	29	843	6	193
	UDR INC	42	1,556	8	323
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	115	0.309	31
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	4	51	—	—
	VENTAS INC	52	1,880	9	397
	WASHINGTON REIT	10	236	1	36
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17	326	3	74
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	9	51	4	26
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	2	306	0.192	27
	UMH PROPERTIES INC	4	55	—	—
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4	81	—	—
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	13	167	4	52
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	18	526	4	127
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5	27	—	—
	CENTERSPACE	1	115	—	—
	DOUGLAS EMMETT INC	20	604	3	87
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	14	186	—	—
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14	243	2	37
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17	408	1	39
	CORESITE REALTY CORP	6	793	1	141
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	6	170	—	—
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25	168	15	130
	OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7	176	1	31
	RLJ LODGING TRUST	26	239	9	80
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	13	139	—	—
	STAG INDUSTRIAL INC	20	551	2	74
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	30	434	4	64
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	26	172	4	32
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	32	847	5	162
	WP CAREY INC	24	1,628	4	305
	WHITESTONE REIT	8	55	4	27

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6	211	0.845	30
	CHATHAM LODGING TRUST	4	49	—	—
	TERRENO REALTY CORP	7	396	—	—
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	18	630	3	139
	CORECIVIC INC	15	154	40	270
	GEO GROUP INC/THE	13	168	2	28
	VEREIT INC	143 (△ 270)	953 (—)	22	148
	DUKE REALTY CORP	49	1,707	9	354
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	18	163	—	—
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22	947	3	142
	PHYSICIANS REALTY TRUST	28	481	1	32
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	39	1,021	5	141
	CYRUSONE INC	17	1,209	2	197
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	—	—	6	15
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	15	135	2	26
	QTS REALTY TRUST INC-CL A	8	537	0.497	31
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	46	590	12	170
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	12	156	—	—
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	— (△ 35)	— (—)	—	—
	CARETRUST REIT INC	12	206	3	67
	PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	10	63	5	39
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	27 (2)	916 (82)	3	136
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	9	106	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	41	1,111	9	245
	STORE CAPITAL CORP	33	843	1	51
	NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	8	26	—	—
	URBAN EDGE PROPERTIES	18	197	8	96
	EQUINIX INC	12	8,463	1	1,403
	PARAMOUNT GROUP INC	18	162	10	87
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	10	242	—	—
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	13	147	—	—
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9	293	1	37
	NEXPOINT RESIDENTIAL	2	86	—	—
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	27	260	6	56
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2	24	—	—
	GLOBAL NET LEASE INC	13	209	3	53
	CITY OFFICE REIT INC	5	50	2	28
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5	81	—	—
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8	213	—	—
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2	115	—	—
	FARMLAND PARTNERS INC	3	23	—	—
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	195 (—)	152 (△ 5)	44	33

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	PARK HOTELS & RESORTS INC	32	379	6	89
	EQUITY RESIDENTIAL	46	2,794	10	605
	COLONY CAPITAL INC	73	179	24	68
	INVITATION HOMES INC	81	2,121	13	369
	JBG SMITH PROPERTIES	13	408	2	78
	ALEXANDER & BALDWIN INC	22	290	—	—
	GLADSTONE LAND CORP	1	24	—	—
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	7	79	2	29
	VICI PROPERTIES INC	85	1,753	10	228
	AMERICOLD REALTY TRUST	30	1,023	4	155
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	8	157	—	—
	RETAIL VALUE INC	2 (0.124)	29 (4)	—	—
	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	13	157	15	217
	FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	6	65	2	39
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4	475	—	—
	SAFEHOLD INC	1	77	—	—
	AMERICAN FINANCE TRUST INC	18	145	3	29
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17	315	—	—
	ARA US HOSPITALITY TRUST	52 (—)	16 (△ 1)	149	44
	COREPOINT LODGING INC	6	23	—	—
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2	36	—	—
	PRIME US REIT	64 (—)	49 (△ 2)	38	30
	NETSTREIT CORP	4	82	—	—
	CIM COMMERCIAL TRUST CORP	3	32	—	—
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	203	149	—	—
	APARTMENT INCOME REIT CO	— (47)	— (—)	—	—
	CTO REALTY GROWTH INC	1	62	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	94	1,092	17	209
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.772 (△ 33)	48 (△ 2,013)	—	—
	PUBLIC STORAGE	20	4,204	3	744
	SIMON PROPERTY GROUP INC	48	3,508	7	489
	VORNADO REALTY TRUST	20	814	4	153
	KIMCO REALTY CORP	50	593	2	30
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	18	3,018	3	519
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	19 (10)	715 (340)	2 (11)	89 (—)
	小計	3,658 (△ 268)	116,968 (429)	901 (30)	21,209 (664)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2	79	—	—
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11	249	3	74

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11	550	1	45
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	11	98	—	—
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1	32	—	—
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16	196	—	—
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3	109	—	—
				(9)	(305)
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25	425	7	121
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9	393	2	88
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8	69	4	48
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9	127	3	44
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12	131	—	—
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5	347	1	76
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11	152	2	43
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	10	107	—	—
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1	27	—	—
	CHOICE PROPERTIES REIT	26	331	5	79
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2	40	—	—
	PLAZA RETAIL REIT	14	53	—	—
	SLATE GROCERY REIT	3	43	—	—
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8	135	2	41
	SLATE OFFICE REIT	7	29	—	—
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13	147	3	39
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6	39	—	—
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1	25	—	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	34	627	—	—
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	12	234	—	—
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	5	55	—	—
	小計	290	4,863	37 (9)	703 (305)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ				
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	27	361	3	52
		(—)	(△ 28)		
	HAMBORNER REIT AG	5	46	—	—
	小計	33 (—)	407 (△ 28)	3	52
	イタリア				
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	5	19	—	—
	小計	5	19	—	—
	フランス				
	GEcina SA	7	920	1	203
	KLEPIERRE	25	449	4	92
		(—)	(△ 48)		
	COVIVIO	6	393	0.341	22
	MERCIALYS	11	64	3	26
	ICADE	5	314	0.502	30

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	フランス				
	ALTAREA	0.582	71	0.126	18
		(－)	(△4)	(－)	(4)
	CARMILA	14	98	－	－
	小計	70	2,311	10	392
		(－)	(△52)	(－)	(4)
	オランダ				
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	6	69	4	53
	NSI NV	2	77	0.58	23
	VASTNED RETAIL NV	2	44	－	－
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18	1,043	3	210
	WERELDHAVE NV	5	61	－	－
	小計	35	1,297	9	287
	スペイン				
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10	44	5	26
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	40	331	10	68
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	30	242	－	－
		(－)	(△2)		
	小計	82	617	15	95
		(－)	(△2)		
	ベルギー				
	BEFIMMO	3	120	－	－
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3	70	－	－
	RETAIL ESTATES	1	75	－	－
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	16	422	1	36
	AEDIFICA	5	526	0.274	27
	AEDIFICA SA-RTS	－	－	8	7
		(8)	(－)		
	MONTEA	2	219	1	123
	CARE PROPERTY INVEST	7	199	－	－
	XIOR STUDENT HOUSING NV	4	207	－	－
	COFINIMMO	3	456	0.394	50
	小計	47	2,298	11	245
		(8)	(－)		
	アイルランド				
	HIBERNIA REIT PLC	49	47	－	－
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	71	95	33	49
	小計	121	142	33	49
	ユーロ計	396	7,094	84	1,122
		(8)	(△83)	(－)	(4)
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	130	514	26	119
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	28	180	3	24
	HAMMERSON PLC	1,276	369	25	30
		(△170)	(－)		

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
	HAMMERSON PLC-NIL PAID-RTS	— (1,024)	— (—)	1,024	82
	LAND SECURITIES GROUP PLC	93	583	7	46
	INTU PROPERTIES PLC	329	23	530	20
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	176	267	15	25
	SEGRO PLC	177	1,524	28	253
	WORKSPACE GROUP PLC	20	145	3	28
	SHAFESBURY PLC	53	303	3	20
	BIG YELLOW GROUP PLC	20	203	—	—
	DERWENT LONDON PLC	15	451	1	45
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	132	277	20	47
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	—	—	90	105
	RDI REIT PLC	27	25	—	—
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	24	170	2	20
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	247	338	48	79
	ASSURA PLC	357	278	—	—
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	117	50	—	—
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	94	65	27	20
	REGIONAL REIT LTD	83	65	—	—
	CAPITAL & REGIONAL PLC	— (△ 68)	— (—)	7	3
	NEWRIVER REIT PLC	109	82	85	64
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	69	66	—	—
	UNITE GROUP PLC/THE	50	456	—	—
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	108	112	—	—
	LXI REIT PLC	57	66	—	—
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	149	93	77	50
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46	41	—	—
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	136	96	80	61
	AEW UK REIT PLC	29	18	39	25
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	288	465	17	33
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	307	217	41	25
	CUSTODIAN REIT PLC	125	116	—	—
	GCP STUDENT LIVING PLC	147	197	—	—
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	223	242	27	29
	STANDARD LIFE INV PROP INC	126	67	—	—
	小計	5,383 (785)	8,181 (—)	2,239	1,262
	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
	VICINITY CENTRES	768	1,206	197	276
	ABACUS PROPERTY GROUP	67	181	20	54
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	71	324	27	129
	CHARTER HALL GROUP	56	567	1	21
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	58	138	15	52
	CROMWELL PROPERTY GROUP	176	167	—	—
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	158	364	—	—

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	36	120	—	—
	NATIONAL STORAGE REIT	164	295	24	45
	GDI PROPERTY GROUP	60	61	—	—
	APN INDUSTRIA REIT	39	94	17	43
	SCENTRE GROUP	705	1,640	144	347
	ARENA REIT	36	87	—	—
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25	77	—	—
	AVENTUS GROUP	115	286	—	—
	WAYPOINT REIT	153	400	—	—
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	77	364	3	15
	CENTURIA OFFICE REIT	47	86	—	—
	RURAL FUNDS GROUP	48	96	—	—
	IRONGATE GROUP	160	209	—	—
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	152	482	—	—
	HOME CONSORTIUM	44	174	—	—
	CENTURIA CAPITAL GROUP	163	366	—	—
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	77	94	—	—
		(22)	(—)		
	GPT GROUP	248	1,061	22	95
	MIRVAC GROUP	545	1,276	117	294
	STOCKLAND	310	1,078	57	232
	DEXUS	115	1,119	—	—
	BWP TRUST	69	255	13	43
	CHARTER HALL RETAIL REIT	82	275	—	—
	GOODMAN GROUP	232	3,552	27	444
	小計	5,070 (22)	16,509 (—)	691	2,096
国	ニュージーランド		千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	41	121	—	—
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	170	183	—	—
	GOODMAN PROPERTY TRUST	126	281	—	—
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	115	190	—	—
	ARGOSY PROPERTY LTD	162	197	77	102
	小計	615	974	77	102
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	283	18,972	58	3,884
	CHAMPION REIT	191	818	—	—
	PROSPERITY REIT	93	244	—	—
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	175	658	—	—
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	198	782	68	261
	FORTUNE REIT	296	2,067	108	752
	小計	1,236	23,544	234	4,898
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	259	368	48	69
		(—)	(△ 1)		

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	356	594	119 (820)	197 (1,529)
	KEPPEL REIT	218 (-)	233 (△ 2)	53	58
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	52 (-)	73 (△0.80723)	- (181)	- (285)
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	231 (-)	224 (△ 1)	- (-)	- (1)
	ESR-REIT	248 (-)	94 (△0.62301)	-	-
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	130 (-)	126 (△ 1)	83	96
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	265	652	-	-
	STARHILL GLOBAL REIT	351 (-)	168 (△0.32712)	209	109
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	385 (-)	701 (△ 13)	183	357
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	211 (-)	265 (△ 5)	39 (-)	52 (2)
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	123 (-)	67 (△ 4)	-	-
	AIMS APAC REIT	111 (-)	131 (△ 0.5395)	67	76
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	1,675 (-)	118 (△ 2)	-	-
	LIPPO MALLS INDONESIA RE-RTS	- (1,136)	- (-)	-	-
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	57 (-)	198 (△ 2)	11	47
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	278 (-)	784 (△0.53177)	47	141
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	152 (-)	90 (△0.38498)	-	-
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	268 (-)	534 (△ 3)	-	-
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	181	98	82	51
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	118	52	-	-
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	270 (-)	239 (△ 14)	45	43
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	108 (-)	35 (△0.70826)	-	-
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	399 (-)	151 (△0.35317)	127	46
	SPH REIT	189	163	55	48
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	174 (-)	73 (△0.03654)	96	34

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	KEPPEL DC REIT	203	523	46	122
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	367 (223)	457 (243)	62 (—)	79 (7)
	EC WORLD REIT	76	51	—	—
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	40	31	—	—
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	261 (—)	189 (△ 1)	—	—
	IREIT GLOBAL	158	106	—	—
	IREIT GLOBAL-RIGHTS	— (44)	— (5)	44 (—)	4 (5)
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	439 (590)	876 (1,317)	160	323
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	507 (—)	1,528 (△ 22)	123	386
国	小計	8,877 (1,995)	10,012 (1,483)	1,708 (1,002)	2,349 (1,831)
	韓国		千韓国ウォン		千韓国ウォン
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	9	62,665	—	—
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	— (0.798)	— (—)	0.798	270
	LOTTE REIT CO LTD	23	136,630	—	—
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	24	96,035	—	—
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9	42,987	—	—
	JR REIT XXVII	34	183,469	—	—
	小計	100 (0.798)	521,788 (—)	0.798	270
	イスラエル		千イスラエルシェケル		千イスラエルシェケル
	REIT 1 LTD	21	343	—	—
	小計	21	343	—	—

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○株式売買比率

(2020年1月7日～2021年1月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	1,141千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	—千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	—

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年1月7日～2021年1月5日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	16,830	570	3.4	3,658	21	0.6

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銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2021年1月5日現在)

外国株式

2021年1月5日現在の組入れはございません。

銘 柄		期首(前期末)
		株 数
(アメリカ)		百株
FIVE STAR SENIOR LIVING INC		32
合 計	株 数	32
	銘 柄 数	1

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
SITE CENTERS CORP	29	45	444	45,869	0.1
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	103	170	4,911	506,609	1.3
MACERICH CO/THE	22	33	359	37,034	0.1
ACADIA REALTY TRUST	18	26	364	37,608	0.1
AGREE REALTY CORP	8	17	1,130	116,662	0.3
ALEXANDER'S INC	0.451	0.661	180	18,636	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24	39	6,740	695,296	1.7
PROLOGIS INC	130	234	22,556	2,326,666	5.8
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	28	44	1,817	187,473	0.5
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15	—	—	—	—
BRANDYWINE REALTY TRUST	36	54	624	64,436	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	19	30	2,974	306,791	0.8
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	31	—	—	—	—
CEDAR REALTY TRUST INC	17	—	—	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	35	55	2,196	226,607	0.6
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	22	34	877	90,464	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	30	48	1,567	161,676	0.4
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	41	61	496	51,175	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	43	89	12,053	1,243,349	3.1
EASTGROUP PROPERTIES INC	7	12	1,647	169,931	0.4
EPR PROPERTIES	16	23	726	74,927	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37	53	3,246	334,927	0.8
ESSEX PROPERTY TRUST INC	13	20	4,747	489,691	1.2
EXTRA SPACE STORAGE INC	27	40	4,505	464,726	1.2
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14	21	1,775	183,139	0.5
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25	41	1,675	172,844	0.4
GETTY REALTY CORP	7	11	313	32,378	0.1
WELLTOWER INC	83	132	8,180	843,841	2.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	21	32	1,254	129,367	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	33	53	582	60,124	0.1
EQUITY COMMONWEALTH	25	38	1,041	107,383	0.3
KILROY REALTY CORP	20	33	1,824	188,182	0.5
KITE REALTY GROUP TRUST	17	27	398	41,092	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	49	86	883	91,125	0.2
LTC PROPERTIES INC	8	12	454	46,927	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	18	28	337	34,808	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	29	45	4,112	424,196	1.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	107	171	3,560	367,227	0.9
MID-AMERICA APARTMENT COMM	23	36	4,437	457,683	1.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	8	14	948	97,817	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	45	72	2,545	262,560	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3	4	97	10,042	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12	—	—	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
RPT REALTY	15	27	229	23,628	0.1
REALTY INCOME CORP	67	111	6,696	690,698	1.7
REGENCY CENTERS CORP	34	50	2,244	231,560	0.6
SAUL CENTERS INC	2	3	108	11,233	0.0
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	48	73	290	29,922	0.1
SL GREEN REALTY CORP	17	23	1,349	139,179	0.3
LIFE STORAGE INC	9	15	1,799	185,657	0.5
SUN COMMUNITIES INC	19	33	4,965	512,221	1.3
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45	68	748	77,169	0.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	18	30	303	31,354	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	12	—	—	—	—
CUBESMART	39	62	2,026	209,084	0.5
UDR INC	60	94	3,468	357,749	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2	3	240	24,775	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	10	145	15,042	0.0
VENTAS INC	77	119	5,594	577,108	1.4
WASHINGTON REIT	16	25	535	55,218	0.1
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	24	38	795	82,018	0.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7	12	94	9,757	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4	6	810	83,610	0.2
UMH PROPERTIES INC	7	12	179	18,483	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5	10	190	19,620	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	20	29	501	51,717	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	29	43	1,252	129,144	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	22	28	119	12,292	0.0
CENTERSPACE	2	3	272	28,156	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	34	51	1,453	149,896	0.4
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	26	41	758	78,265	0.2
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	25	38	589	60,768	0.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	32	48	1,107	114,240	0.3
CORESITE REALTY CORP	7	13	1,632	168,399	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	9	16	439	45,348	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	21	31	270	27,862	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9	15	344	35,519	0.1
RLJ LODGING TRUST	35	52	707	72,980	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	23	36	466	48,113	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	29	47	1,431	147,615	0.4
SABRA HEALTH CARE REIT INC	40	66	1,127	116,333	0.3
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	43	66	551	56,895	0.1
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	42	69	1,824	188,169	0.5
WP CAREY INC	35	55	3,804	392,388	1.0
WHITESTONE REIT	8	13	103	10,630	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11	17	1,107	114,223	0.3
CHATHAM LODGING TRUST	9	14	146	15,144	0.0
TERRENO REALTY CORP	14	21	1,211	125,008	0.3

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20	35	1,354	139,734	0.3
CORECIVIC INC	25	—	—	—	—
GEO GROUP INC/THE	25	36	323	33,322	0.1
VEREIT INC	219	69	2,485	256,420	0.6
DUKE REALTY CORP	76	117	4,508	465,007	1.2
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	—	18	199	20,530	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22	41	1,980	204,282	0.5
PHYSICIANS REALTY TRUST	37	65	1,091	112,563	0.3
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	52	85	2,500	257,884	0.6
CYRUSONE INC	23	38	2,689	277,457	0.7
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6	—	—	—	—
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	30	43	391	40,336	0.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	11	20	1,228	126,673	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	60	94	1,493	154,067	0.4
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	24	36	509	52,525	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	39	4	28	2,959	0.0
CARETRUST REIT INC	19	29	625	64,479	0.2
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9	14	102	10,610	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	42	68	2,767	285,500	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	18	28	369	38,139	0.1
IRON MOUNTAIN INC	58	91	2,622	270,478	0.7
STORE CAPITAL CORP	43	75	2,425	250,237	0.6
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	16	25	127	13,136	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	23	32	415	42,821	0.1
EQUINIX INC	17	28	19,609	2,022,683	5.0
PARAMOUNT GROUP INC	42	50	443	45,752	0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	15	25	585	60,382	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	23	36	535	55,186	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12	20	704	72,652	0.2
NEXPOINT RESIDENTIAL	4	6	272	28,110	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	42	64	807	83,265	0.2
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3	6	73	7,533	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	18	28	489	50,533	0.1
CITY OFFICE REIT INC	11	14	140	14,515	0.0
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	6	11	165	17,115	0.0
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13	22	645	66,598	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3	6	304	31,382	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	4	8	70	7,241	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	292	443	330	34,106	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC	49	76	1,263	130,321	0.3
EQUITY RESIDENTIAL	72	109	6,274	647,174	1.6
COLONY CAPITAL INC	100	149	690	71,183	0.2
INVITATION HOMES INC	110	178	5,108	526,948	1.3
JBG SMITH PROPERTIES	24	34	1,051	108,430	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	—	22	375	38,761	0.1

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカドル	千円	%
CLIPPER REALTY INC		2	2	20	2,099	0.0
GLADSTONE LAND CORP		4	5	83	8,606	0.0
GLOBAL MEDICAL REIT INC		7	12	162	16,723	0.0
VICI PROPERTIES INC		94	169	4,182	431,418	1.1
AMERICOLD REALTY TRUST		39	65	2,344	241,878	0.6
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT		12	20	471	48,647	0.1
RETAIL VALUE INC		3	5	83	8,581	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A		14	12	216	22,290	0.1
BRT APARTMENTS CORP		2	2	32	3,324	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP		10	15	245	25,327	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		2	7	1,272	131,276	0.3
SAFEHOLD INC		2	4	297	30,692	0.1
AMERICAN FINANCE TRUST INC		21	36	272	28,065	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		16	33	689	71,072	0.2
ARA US HOSPITALITY TRUST		97	—	—	—	—
COREPOINT LODGING INC		7	13	85	8,867	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		4	7	104	10,789	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST		202	202	27	2,854	0.0
PRIME US REIT		111	137	110	11,363	0.0
NETSTREIT CORP		—	4	83	8,616	0.0
CIM COMMERCIAL TRUST CORP		—	3	46	4,813	0.0
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		—	203	142	14,672	0.0
APARTMENT INCOME REIT CO		—	47	1,794	185,127	0.5
CTO REALTY GROWTH INC		—	1	61	6,384	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		149	225	3,195	329,621	0.8
LIBERTY PROPERTY TRUST		32	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE		31	48	10,653	1,098,862	2.7
SIMON PROPERTY GROUP INC		63	104	8,645	891,820	2.2
VORNADO REALTY TRUST		32	49	1,812	187,001	0.5
KIMCO REALTY CORP		87	135	1,943	200,484	0.5
AVALONBAY COMMUNITIES INC		28	44	6,915	713,302	1.8
APARTMENT INVT & MGMT CO -A		30	47	238	24,651	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	5,292	7,750	279,047	28,783,798	
	銘 柄 数 < 比 率 >	158	156	—	<71.2%>	
(カナダ)				千カナダドル		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		4	7	246	19,902	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		14	22	522	42,141	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		16	27	1,343	108,418	0.3
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		18	30	241	19,509	0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		6	7	150	12,142	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		29	45	590	47,658	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST		6	—	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		30	48	802	64,741	0.2
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		12	19	729	58,851	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		14	18	192	15,559	0.0

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		9	15	222	17,969	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		13	26	322	26,011	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		5	9	742	59,931	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		12	21	281	22,743	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		12	23	299	24,135	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		4	6	99	8,056	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		30	50	649	52,426	0.1
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		13	16	250	20,217	0.1
PLAZA RETAIL REIT		—	14	54	4,411	0.0
SLATE GROCERY REIT		5	8	101	8,149	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		10	16	276	22,321	0.1
SLATE OFFICE REIT		5	13	56	4,530	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		14	24	327	26,427	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		9	16	101	8,219	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		3	5	99	8,043	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		—	34	463	37,412	0.1
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I		—	12	233	18,873	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E		—	5	58	4,752	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	306	549	9,464	763,558	
	銘 柄 数 < 比 率 >	24	27	—	<1.9%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		32	56	812	102,727	0.3
HAMBORNER REIT AG		15	21	191	24,160	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	47	77	1,003	126,888	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		8	13	49	6,260	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	8	13	49	6,260	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)						
GECINA SA		11	17	2,187	276,513	0.7
KLEPIERRE		43	63	1,143	144,575	0.4
COVIVIO		9	15	1,117	141,319	0.3
MERCIALYS		5	13	96	12,155	0.0
ICADE		5	10	630	79,660	0.2
ALTAREA		0.785	1	174	22,089	0.1
CARMILA		—	14	169	21,481	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	75	136	5,519	697,796	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	7	—	<1.7%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		8	10	162	20,597	0.1
NSI NV		3	5	182	23,019	0.1
VASTNED RETAIL NV		4	6	151	19,189	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		28	43	2,659	336,245	0.8

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	
(ユーロ…オランダ)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV		7	13	144	18,215	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	52	79	3,300	417,268	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<1.0%>	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		14	19	92	11,695	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		74	105	797	100,782	0.2
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		50	80	644	81,489	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	139	206	1,534	193,966	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.5%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		4	7	278	35,188	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS		4	7	165	20,906	0.1
RETAIL ESTATES		2	3	198	25,055	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA		26	41	1,206	152,473	0.4
AEDIFICA		4	10	1,021	129,136	0.3
MONTEA		2	3	317	40,177	0.1
CARE PROPERTY INVEST		—	7	204	25,797	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		—	4	204	25,897	0.1
COFINIMMO		5	8	1,033	130,663	0.3
小 計	口 数 ・ 金 額	49	94	4,629	585,296	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	9	—	<1.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
HIBERNIA REIT PLC		149	198	224	28,392	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		84	122	182	23,046	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	233	320	406	51,439	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	607	927	16,444	2,078,915	
	銘 柄 数 < 比 率 >	26	29	—	<5.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		195	299	1,422	199,114	0.5
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		55	79	526	73,697	0.2
HAMMERSON PLC		159	1,239	286	40,107	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC		154	240	1,598	223,677	0.6
INTU PROPERTIES PLC		201	—	—	—	—
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		244	405	618	86,615	0.2
SEGRO PLC		231	379	3,709	519,036	1.3
WORKSPACE GROUP PLC		26	43	325	45,551	0.1
SHAFTESBURY PLC		44	94	516	72,255	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC		30	51	566	79,281	0.2
DERWENT LONDON PLC		21	35	1,091	152,757	0.4
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		172	285	666	93,262	0.2
HANSTEEN HOLDINGS PLC		90	—	—	—	—
RDI REIT PLC		61	89	80	11,292	0.0
SAFESTORE HOLDINGS PLC		43	65	512	71,750	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC		351	550	925	129,552	0.3

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		千口	千口	千イギリスポンド	千円	%
ASSURA PLC		479	836	646	90,403	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		99	216	83	11,718	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		131	198	147	20,652	0.1
REGIONAL REIT LTD		78	161	129	18,177	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC		75	—	—	—	—
NEWRIVER REIT PLC		59	83	66	9,365	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		130	200	209	29,371	0.1
UNITE GROUP PLC/THE		74	125	1,264	176,888	0.4
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		—	108	118	16,535	0.0
LXI REIT PLC		99	156	187	26,247	0.1
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		176	248	172	24,198	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		68	114	126	17,655	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD		117	173	132	18,543	0.0
AEW UK REIT PLC		65	55	43	6,030	0.0
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE		—	270	372	52,192	0.1
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS		—	265	215	30,203	0.1
CUSTODIAN REIT PLC		—	125	110	15,433	0.0
GCP STUDENT LIVING PLC		—	147	209	29,376	0.1
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		—	196	209	29,310	0.1
STANDARD LIFE INV PROP INC		—	126	74	10,484	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	3,739	7,669	17,371	2,430,741	
	銘 柄 数 < 比 率 >	29	33	—	< 6.0% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		657	1,227	1,964	155,331	0.4
ABACUS PROPERTY GROUP		76	122	354	27,993	0.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP		47	91	457	36,149	0.1
CHARTER HALL GROUP		95	150	2,273	179,739	0.4
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		52	95	306	24,269	0.1
CROMWELL PROPERTY GROUP		384	561	493	39,041	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		196	355	892	70,575	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		55	92	323	25,602	0.1
NATIONAL STORAGE REIT		155	295	570	45,091	0.1
GDI PROPERTY GROUP		104	165	202	16,050	0.0
APN INDUSTRIA REIT		23	45	129	10,214	0.0
SCENTRE GROUP		1,099	1,660	4,615	364,919	0.9
ARENA REIT		68	104	300	23,755	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		24	50	162	12,829	0.0
AVENTUS GROUP		—	115	317	25,107	0.1
WAYPOINT REIT		97	251	690	54,586	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		86	160	751	59,416	0.1
CENTURIA OFFICE REIT		79	126	273	21,607	0.1
RURAL FUNDS GROUP		57	105	276	21,860	0.1
IRONGATE GROUP		—	160	206	16,308	0.0
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		—	152	470	37,219	0.1
HOME CONSORTIUM		—	44	176	13,976	0.0

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリアドル	千円	%
CENTURIA CAPITAL GROUP		—	163	422	33,393	0.1
HOMEEO DAILY NEEDS REIT		—	99	125	9,952	0.0
GPT GROUP		400	626	2,845	225,008	0.6
MIRVAC GROUP		819	1,247	3,304	261,302	0.6
STOCKLAND		502	756	3,236	255,904	0.6
DEXUS		225	341	3,211	253,923	0.6
BWP TRUST		100	157	699	55,343	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT		77	159	585	46,288	0.1
GOODMAN GROUP		330	535	10,360	819,232	2.0
小 計	口 数 ・ 金 額	5,818	10,219	41,001	3,241,998	
	銘柄 数 < 比 率 >	25	31	—	< 8.0% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		78	120	394	29,167	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD		320	491	599	44,355	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		225	351	819	60,656	0.2
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		228	343	605	44,791	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		160	245	389	28,834	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	1,014	1,552	2,808	207,804	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.5% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		433	657	47,189	627,626	1.6
CHAMPION REIT		407	598	2,732	36,347	0.1
PROSPERITY REIT		239	332	793	10,553	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		305	480	1,848	24,578	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		198	328	1,243	16,533	0.0
FORTUNE REIT		295	483	3,525	46,894	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	1,877	2,878	57,333	762,533	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 1.9% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		471	682	1,038	81,120	0.2
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		584	—	—	—	—
KEPPEL REIT		386	552	618	48,315	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		128	—	—	—	—
ASCOTT RESIDENCE TRUST		359	590	644	50,332	0.1
ESR-REIT		458	707	286	22,377	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		174	221	290	22,696	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		150	416	1,033	80,761	0.2
STARHILL GLOBAL REIT		272	414	211	16,528	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		676	877	1,746	136,483	0.3
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		156	327	455	35,597	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		119	243	63	4,949	0.0
AIMS APAC REIT		92	137	172	13,490	0.0
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		444	2,120	131	10,272	0.0
LIPPO MALLS INDONESIA RE-RTS		—	1,136	1	88	0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		76	121	475	37,122	0.1

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		比 率
		口 数	口 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		303	533	1,542	120,560	0.3
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST		221	373	224	17,522	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		436	705	1,508	117,904	0.3
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		189	288	178	13,968	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		133	251	89	6,969	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC		436	660	640	50,084	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		153	262	141	11,065	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		504	776	295	23,063	0.1
SPH REIT		167	301	258	20,236	0.1
FRASERS HOSPITALITY TRUST		139	217	114	8,923	0.0
KEPPEL DC REIT		248	406	1,132	88,523	0.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		306	835	1,203	94,076	0.2
EC WORLD REIT		—	76	53	4,214	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		130	170	140	10,951	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		—	261	194	15,219	0.0
IREIT GLOBAL		—	158	103	8,108	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		578	1,448	3,172	247,948	0.6
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		619	1,004	2,993	233,934	0.6
小 計	口 数 ・ 金 額	9,120	17,282	21,156	1,653,414	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	32	—	<4.1%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		5	14	103,923	9,883	0.0
LOTTE REIT CO LTD		—	23	126,900	12,068	0.0
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		—	24	95,673	9,098	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		—	9	43,054	4,094	0.0
JR REIT XXVII		—	34	175,723	16,711	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	5	105	545,273	51,855	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	5	—	<0.1%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD		34	56	914	29,367	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	34	56	914	29,367	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	27,814	48,992	—	40,003,986	
	銘 柄 数 < 比 率 >	305	325	—	<99.0%>	

(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) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2021年1月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 40,003,986	% 97.9
コール・ローン等、その他	845,640	2.1
投資信託財産総額	40,849,626	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（40,358,023千円）の投資信託財産総額（40,849,626千円）に対する比率は98.8%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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=103.15円	1 カナダドル=80.68円	1 ユーロ=126.42円	1 イギリスポンド=139.93円
1 オーストラリアドル=79.07円	1 ニュージーランドドル=74.00円	1 香港ドル=13.30円	1 シンガポールドル=78.15円
100韓国ウォン=9.51円	1 イスラエルシェケル=32.11円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	41,060,789,921
コール・ローン等	661,709,220
投資証券(評価額)	40,003,986,615
未収入金	235,128,151
未収配当金	159,965,905
未収利息	30
(B) 負債	651,285,191
未払金	625,088,683
未払解約金	26,196,508
(C) 純資産総額(A-B)	40,409,504,730
元本	25,565,793,193
次期繰越損益金	14,843,711,537
(D) 受益権総口数	25,565,793,193口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,806円

<注記事項>

- ①期首元本額 16,442,762,098円
 期中追加設定元本額 13,706,779,891円
 期中一部解約元本額 4,583,748,796円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.5806円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

eMAXIS 先進国リートインデックス	6,981,777,259円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	5,555,743,465円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	2,840,039,051円
つみたて8資産均等バランス	2,550,743,839円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,511,509,624円
eMAXIS Slim 先進国リートインデックス	2,405,919,151円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	673,061,333円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	476,461,028円
eMAXIS バランス(波乗り型)	298,377,658円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	267,297,291円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	198,793,316円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	160,490,092円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	115,228,632円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	99,763,442円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	78,786,627円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	62,035,935円
三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド	54,647,878円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	53,819,914円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	50,324,107円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	45,606,685円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	42,536,035円
ファンド・マネジャー(海外リート)	17,929,761円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	15,506,780円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	7,051,165円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,152,320円

○損益の状況 (2020年1月7日～2021年1月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,198,995,735
受取配当金	1,198,641,257
受取利息	426,504
その他収益金	12,954
支払利息	△ 84,980
(B) 有価証券売買損益	△ 4,011,110,789
売買益	1,975,326,879
売買損	△ 5,986,437,668
(C) 保管費用等	△ 40,183,533
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,852,298,587
(E) 前期繰越損益金	13,774,762,297
(F) 追加信託差損益金	6,242,207,860
(G) 解約差損益金	△ 2,320,960,033
(H) 計(D+E+F+G)	14,843,711,537
次期繰越損益金(H)	14,843,711,537

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

eMAXIS マイマネージャー 1970s	895,570円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	295,235円
合計	25,565,793,193円