

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	2021年7月5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、信託財産の成長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30%、30%、10%、10%、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70%未満とします。外貨建資産への実質投資割合は信託財産の純資産総額の60%以下とします。
	三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	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（成長型）

第28期（決算日：2020年1月6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（成長型）」は、去る1月6日に第28期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。  
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
 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）

お客様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5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税金分配	み騰落率						
	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
24期(2018年1月5日)	10,724	600	8.9	58.9	1.0	19.5	0.0	19.6	2,088
25期(2018年7月5日)	10,188	100	△4.1	57.2	1.2	20.0	0.0	20.4	2,033
26期(2019年1月7日)	9,528	0	△6.5	57.8	1.1	20.3	0.0	19.5	1,826
27期(2019年7月5日)	10,394	150	10.7	58.0	1.1	19.6	0.0	20.4	1,964
28期(2020年1月6日)	10,527	450	5.6	57.5	1.0	18.9	0.0	20.0	1,862

(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。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率					
(期首)	円	%	%	%	%	%	%
2019年7月5日	10,394	—	58.0	1.1	19.6	0.0	20.4
7月末	10,349	△0.4	57.7	0.9	19.8	0.0	20.4
8月末	10,135	△2.5	57.4	2.1	19.7	0.0	20.8
9月末	10,484	0.9	57.4	1.1	19.5	0.0	20.8
10月末	10,832	4.2	58.0	1.0	19.2	0.0	20.6
11月末	10,994	5.8	57.7	1.7	19.3	0.0	20.5
12月末	11,091	6.7	56.1	1.0	18.2	0.0	19.2
(期末)							
2020年1月6日	10,977	5.6	57.5	1.0	18.9	0.0	20.0

(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28期：2019年7月6日～2020年1月6日

## ▶ 当期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第28期首	10,394円
第28期末	10,527円
既払分配金	450円
騰落率	5.6%

(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はありません。

※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**

基準価額は期首に比べ5.6%（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**

主に内外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	2.4%程度
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	2.3%程度
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	△0.1%程度
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	0.1%程度
MUAM J-REITマザーファンド	1.0%程度
MUAM G-REITマザーファンド	0.3%程度
その他（信託報酬等）	△0.4%程度

第28期：2019年7月6日～2020年1月6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。**

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。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て終わりました。

### ▶ 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、米国の堅調な企業決算内容などを受けて上昇しました。

### ▶ 国内債券市況

**国内債券市況は下落しました。**

国内債券市況は、世界的な景気の先行きに対する不透明感から上昇する局面もありましたが、日本銀行による追加緩和期待の後退や米中貿易交渉の進展などから、期を通して見ると下落しました。

### ▶ 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などから、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。**

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ため、やや調整する展開となりました。

### ▶ 外国REIT市況

**外国REIT市況は上昇しました。**

外国REIT市況は、米国の堅調な企業決算内容などを受けて上昇しました。

### ▶ 為替市況

**米ドルは円に対して上昇、ユーロは円に対して下落しました。**

為替市況は、期首に比べて0.2%の円安・米ドル高、0.8%の円高・ユーロ安となりました。

## 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（成長型）

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	30%
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	30%
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	10%
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）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

### ▶ 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

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が。

### ▶ 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。

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49～52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。

#### ▶ 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28期
	2019年7月6日～2020年1月6日
当期分配金（対基準価額比率）	450 (4.099%)
当期の収益	267
当期の収益以外	182
翌期繰越分配対象額	1,608

（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（成長型）

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、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。

今後の国内REIT市況は、引き続き堅調に推移するとみています。中東などにおける地政学リスクの高まりや、米中貿易交渉を巡る状況などによって変化するグローバルな景況感や金利動向などに注意を払う必要はあるものの、国内では日銀の金融緩和策を背景とした低金利環境が当面続くとみられることや、オフィス賃料の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。

### ▶ 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。

2019年7月6日～2020年1月6日

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	58	0.551	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(24)	(0.232)	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）	(30)	(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	0.004	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.004)	
（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 = 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)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	1	0.011	(d) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.008)	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）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	59	0.567	

期中の平均基準価額は、10,547円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

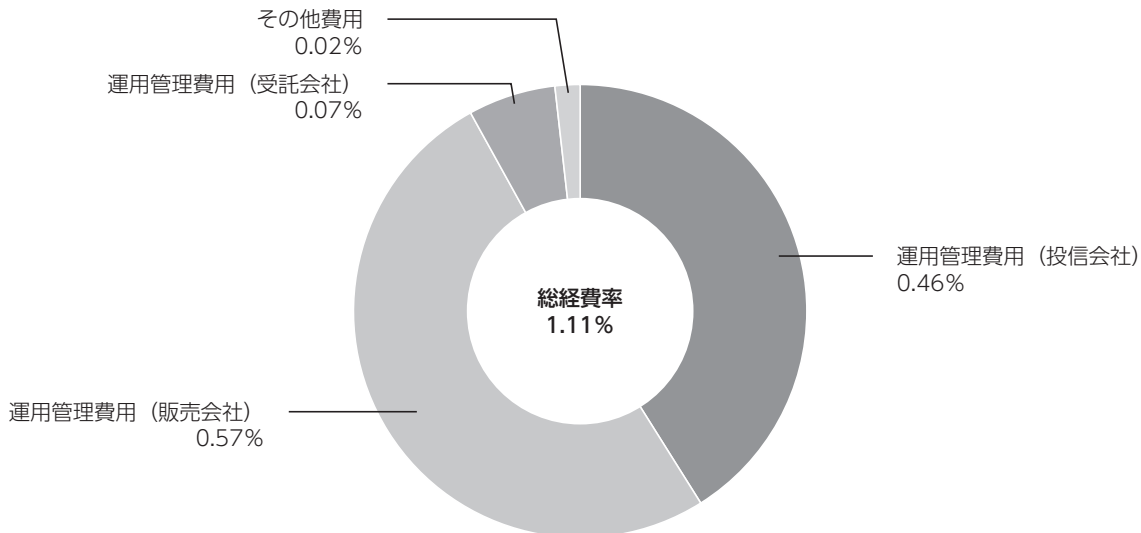
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

## （参考情報）

### ■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.11%**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

(2019年7月6日～2020年1月6日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	10,454	13,714	79,016	114,173
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	2,655	3,794	22,508	32,105
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	1,316	3,573	4,463	12,226
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	4,697	11,316	29,290	76,575
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	652	1,141	4,306	7,884
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	463	1,548	12,966	47,305

## ○株式売買比率

(2019年7月6日～2020年1月6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		
	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	MUAM G-R-E-I-T マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	39,856,672千円	14,231,225千円	132千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	234,580,653千円	96,851,995千円	127千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16	0.14	1.03

(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7月6日～2020年1月6日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）&gt;

該当事項はございません。

&lt;三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド&gt;

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	14,224	6,211	43.7	25,632	1,701	6.6
新株予約権証券	—	—	—	0.674	0.674	100.0
貸付有価証券(株式)	330,952	194,897	58.9	351,638	198,079	56.3

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。

## ＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 52,046	百万円 13,211	% 25.4	百万円 32,941	百万円 7,866	% 23.9

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	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 7,371	百万円 5,130	% 69.6	百万円 9,060	百万円 3,481	% 38.4

平均保有割合 0.4%

※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	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 7,088	百万円 3,847	% 54.3	百万円 13,825	百万円 12,739	% 92.1

平均保有割合 0.6%

※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	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 3,982	百万円 111	% 2.8	百万円 662	百万円 10	% 1.5

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	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	$\frac{D}{C}$ %

平均保有割合 1.2%

※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。

## 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	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 215	百万円 348	百万円 4,308

## ＜三菱UFJ 国内債券マザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 203	百万円 100	百万円 822

## 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 国内債券マザーファンド＞

種 類	買 付 額
公社債	百万円 800

## ＜MUAM J-REITマザーファンド＞

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 135

### 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)	81千円
うち利害関係人への支払額 (B)	13千円
(B) / (A)	16.0%

(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、auカブコム証券、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MUF G証券、日立キャピタルです。

### ○組入資産の明細

(2020年1月6日現在)

#### 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	436,116	367,553	533,541
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	136,840	116,987	166,181
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	72,020	68,873	189,339
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	238,377	213,784	569,691
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	109,190	105,535	193,943
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	58,784	46,281	170,885

### ○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、2020年1月6日現在における貸付株数の総株数は23,750,000株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券に対する貸付は、16,399,200株です。

## ○投資信託財産の構成

(2020年1月6日現在)

項 目	当 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	533,541	27.3
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	166,181	8.5
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	189,339	9.7
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	569,691	29.2
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	193,943	9.9
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	170,885	8.7
コール・ローン等、その他	130,262	6.7
投資信託財産総額	1,953,842	100.0

(注) 三菱UFJ 外国債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（49,620,382千円）の投資信託財産総額（51,642,904千円）に対する比率は96.1%です。

(注) 三菱UFJ 外国株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（104,650,245千円）の投資信託財産総額（104,758,012千円）に対する比率は99.9%です。

(注) MUAM G-R-E-I-Tマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（29,993,436千円）の投資信託財産総額（30,416,007千円）に対する比率は98.6%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=108.11円	1 カナダドル=83.26円	1 メキシコペソ=5.71円	1 ユーロ=120.69円
1 イギリスポンド=141.45円	1 スイスフラン=111.29円	1 スウェーデンクローネ=11.49円	1 ノルウェークローネ=12.24円
1 デンマーククローネ=16.15円	1 ポーランドズロチ=28.44円	1 オーストラリアドル=75.18円	1 ニューゼーランドドル=72.04円
1 香港ドル=13.89円	1 シンガポールドル=80.13円	1 マレーシアリンギット=26.36円	100韓国ウォン=9.27円
1 イスラエルシェケル=31.05円	1 南アフリカランド=7.56円		



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年1月6日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,953,842,606
コール・ローン等	15,119,138
三菱UFJトピックスインデックスマザーファンド(評価額)	533,541,303
三菱UFJ国内債券マザーファンド(評価額)	166,181,262
三菱UFJ外国債券マザーファンド(評価額)	189,339,127
三菱UFJ外国株式マザーファンド(評価額)	569,691,960
MUAM G-REITマザーファンド(評価額)	193,943,376
MUAM J-REITマザーファンド(評価額)	170,885,968
未収入金	115,140,472
(B) 負債	91,543,924
未払収益分配金	79,611,270
未払解約金	1,081,584
未払信託報酬	10,812,187
未払利息	23
その他未払費用	38,860
(C) 純資産総額(A-B)	1,862,298,682
元本	1,769,139,334
次期繰越損益金	93,159,348
(D) 受益権総口数	1,769,139,334口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,527円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 1,889,691,887円  
 期中追加設定元本額 59,780,658円  
 期中一部解約元本額 180,333,211円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0527円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2019年7月6日～ 2020年1月6日
費用控除後の配当等収益額	18,858,104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	28,441,113円
収益調整金額	207,900,662円
分配準備積立金額	108,982,312円
当ファンドの分配対象収益額	364,182,191円
1万口当たり収益分配対象額	2,058円
1万口当たり分配金額	450円
収益分配金金額	79,611,270円

## ○損益の状況（2019年7月6日～2020年1月6日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,092
受取利息	34
支払利息	△ 2,126
(B) 有価証券売買損益	113,378,902
売買益	120,649,846
売買損	△ 7,270,944
(C) 信託報酬等	△ 10,851,059
(D) 当期損益金(A+B+C)	102,525,751
(E) 前期繰越損益金	53,755,778
(F) 追加信託差損益金	16,489,089
(配当等相当額)	( 207,825,374)
(売買損益相当額)	(△191,336,285)
(G) 計(D+E+F)	172,770,618
(H) 収益分配金	△ 79,611,270
次期繰越損益金(G+H)	93,159,348
追加信託差損益金	16,489,089
(配当等相当額)	( 207,900,662)
(売買損益相当額)	(△191,411,573)
分配準備積立金	76,670,259

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

## ○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金（税込み）	450円
----------------	------

◆分配金は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、2020年1月6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。
- ・2020年1月1日以降の分配時において、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19期》決算日2019年2月20日

[計算期間：2018年2月21日～2019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19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19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）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		東証株価指数 (TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	期騰落	率	期騰落	率			
	円	%		%	%	%	百万円
15期(2015年2月20日)	11,495	28.2	1,500.33	25.6	99.1	0.5	276,171
16期(2016年2月22日)	10,155	△11.7	1,300.00	△13.4	99.0	1.0	199,359
17期(2017年2月20日)	12,356	21.7	1,547.01	19.0	98.6	1.3	209,506
18期(2018年2月20日)	14,375	16.3	1,762.45	13.9	99.0	1.0	206,265
19期(2019年2月20日)	13,457	△6.4	1,613.47	△8.5	99.4	0.5	207,606

(注) 東証株価指数（TOPIX）とは、東京証券取引所第一部に上場する国内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代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産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、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの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。

(注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。

(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)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2018年2月20日	円 14,375	% —	(TOPIX) 1,762.45	% —	% 99.0	% 1.0
2月末	14,426	0.4	1,768.24	0.3	100.0	0.6
3月末	14,132	△ 1.7	1,716.30	△ 2.6	99.4	1.5
4月末	14,636	1.8	1,777.23	0.8	98.1	1.3
5月末	14,399	0.2	1,747.45	△ 0.9	99.4	1.4
6月末	14,282	△ 0.6	1,730.89	△ 1.8	99.5	0.9
7月末	14,467	0.6	1,753.29	△ 0.5	99.0	0.6
8月末	14,325	△ 0.3	1,735.35	△ 1.5	100.0	0.6
9月末	15,121	5.2	1,817.25	3.1	97.3	1.3
10月末	13,700	△ 4.7	1,646.12	△ 6.6	102.4	1.6
11月末	13,881	△ 3.4	1,667.45	△ 5.4	98.8	1.3
12月末	12,459	△13.3	1,494.09	△15.2	102.4	1.0
2019年1月末	13,072	△ 9.1	1,567.49	△11.1	98.5	0.7
(期 末) 2019年2月20日	13,457	△ 6.4	1,613.47	△ 8.5	99.4	0.5

(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

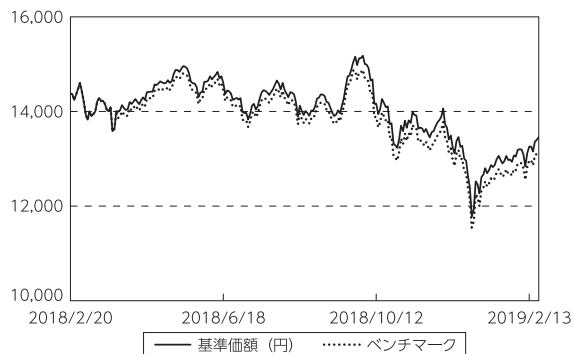
## ◎基準価額の動き

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(－8.5%)を2.1%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。

## ●投資環境について

## ◎国内株式市況

- ・米国長期金利上昇や景気後退懸念の台頭等による米国株式の下落や、国内企業の業績上方修正期待がしぼんだこと等を受け、国内株式市況は下落しました。

## ●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）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8.5%の下落となったため、乖離は2.1%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）

- ・ 配当要因※ 2.2%

※ベンチマークが配当相当分を含まないインデックスであることによって生じるプラス要因です。

（主なマイナス要因）

- ・ 取引要因

## ○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

(2018年2月21日～2019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 ( 株 式 ) (先物・オプション)	円 0 (0) (0)	% 0.001 (0.000) (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
(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	0.001	
期中の平均基準価額は、14,000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

(2018年2月21日～2019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		22,548	44,909,406	12,018	25,872,094
		(△ 4,746)	( - )		

(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 — (7,900)	千円 — (—)	証券 7,900	千円 1,532

(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 33,139	百万円 34,089	百万円 —	百万円 —

## ○株式売買比率

(2018年2月21日～2019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	70,781,501千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	206,220,312千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.34

(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

(2018年2月21日～2019年2月20日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
株式	百万円 44,909	百万円 9,000	20.0	百万円 25,872	百万円 7,457	28.8
新株予約権証券	—	—	—	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	644,059	360,206	55.9	660,834	365,680	55.3

## 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 744	百万円 432	百万円 3,911

## 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 162

## 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)	2,722千円
うち利害関係人への支払額 (B)	47千円
(B) / (A)	1.7%

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、カブドットコム証券、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

(2019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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
極洋	3.6	3.9	11,661	
日本水産	102.1	121.6	88,281	
マルハニチロ	17.2	17.6	65,120	
カネコ種苗	3.1	3.7	4,913	
サカタのタネ	13.4	14.8	55,130	
ホクト	9.1	10.2	19,859	
ホクリヨウ	1.3	2	1,254	
<b>鉱業 (0.3%)</b>				
住石ホールディングス	26.1	27	2,727	
日鉄鉱業	2.5	2.8	12,754	
三井松島ホールディングス	4.7	5	7,735	
国際石油開発帝石	441.2	487.9	558,645	
日本海洋掘削	3.3	—	—	
石油資源開発	14.4	17.4	40,350	
K&Oエナジーグループ	5.3	5.8	8,821	
<b>建設業 (2.9%)</b>				
ヒノキヤグループ	—	2.5	5,755	
ショーボンドホールディングス	8.6	8.7	68,817	
ミライト・ホールディングス	27.8	34.1	57,697	
タマホーム	7	5.9	6,661	
サンヨーホームズ	1.9	1.9	1,635	
日本アクア	—	3.2	1,692	
ファーストコーポレーション	3	3.7	2,723	
ベストテラ	1.3	2.4	3,254	
TATERU	8	14.8	4,099	
スペースバリューホールディングス	—	15	13,245	
ダイセキ環境ソリューション	2.1	2.4	1,531	
第一カッター興業	0.9	1.5	2,625	
安藤・間	69.9	77.8	59,672	
東急建設	34.9	35.4	34,515	
コムシスホールディングス	31.9	43.1	126,196	
ミサワホーム	7.7	9.5	7,001	
ビーアールホールディングス	9.1	10.4	3,712	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
高松コンストラクショングループ	5.8	7.6	20,527	
東建コーポレーション	3.4	3.8	25,536	
ソネック	1.1	1.4	1,002	
ヤマウラ	4.5	4.6	4,512	
大成建設	90.3	99.9	502,497	
大林組	272.1	300.9	319,555	
清水建設	277.6	306.9	290,020	
飛鳥建設	84.1	8.8	13,068	
長谷工コーポレーション	105.9	125.4	168,913	
松井建設	10	11	8,107	
銭高組	1.3	1.2	6,396	
鹿島建設	399	235.2	374,908	
不動テトラ	69.2	6.9	10,929	
大末建設	2.9	3.6	3,380	
鉄建建設	5.6	6.1	16,512	
西松建設	21	21.6	54,172	
三井住友建設	65.3	72	50,400	
大豊建設	33	6.8	21,148	
前田建設工業	64.7	71.5	82,868	
佐田建設	6.1	6.4	2,406	
ナカノフドー建設	7	7.7	3,957	
奥村組	14.9	16.5	56,182	
東鉄工業	11	12	36,480	
イチケン	1.7	1.9	3,701	
富士ビー・エス	—	3.4	1,662	
浅沼組	32	3.5	9,313	
戸田建設	105	116.6	82,319	
熊谷組	14.3	14.3	46,689	
青木あすなろ建設	5.8	4.7	4,845	
北野建設	19	2.1	6,468	
植木組	1.1	1.5	3,522	
三井ホーム	11	—	—	
矢作建設工業	12.5	13.4	10,103	
ビーエス三菱	11.1	10.7	6,687	

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	17.6	19.7	8,608
大東建託	32.9	35.7	559,954
新日本建設	10.8	11.9	11,673
N I P P O	21	26.6	56,072
東亜道路工業	1.8	1.9	5,852
前田道路	28	31.4	66,819
日本道路	2.4	2.7	17,712
東亜建設工業	7.4	8.8	14,247
若築建設	4.9	5	7,485
東洋建設	28.8	36.5	15,293
五洋建設	107.9	119.3	64,899
世紀東急工業	12.5	14.6	9,241
福田組	2.9	3.3	14,305
住友林業	58	71.1	101,957
日本基礎技術	10.9	10.6	3,922
日成ビルド工業	13.3	—	—
ヤマダ・エスバイエルホーム	49	—	—
巴コーポレーション	11.6	12.6	4,825
大和ハウス工業	268	277.8	941,464
ライト工業	17.5	19.2	28,992
積水ハウス	295.2	307.2	499,968
日特建設	7.8	8.4	5,132
北陸電気工事	5	4.8	4,502
ユアテック	14.3	15.9	14,087
西部電気工業	1.6	—	—
四電工	1.3	1.5	4,035
中電工	11.7	12.9	30,121
関電工	36	45.5	47,365
きんでん	60.3	66.7	120,793
東京エネシス	10.1	10.2	9,955
トーエネック	2.5	2.7	8,748
住友電設	7.1	6.9	12,813
日本電設工業	14	17.1	39,569
協和エクシオ	32.6	39.3	114,677
新日本空調	6.9	8.4	15,934
N D S	1.4	—	—
九電工	17.9	19.8	76,230
三機工業	19.1	22.6	26,826
日揮	78.2	86.4	146,966

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中外炉工業	2.7	2.8	4,961
ヤマト	7.4	8.8	4,162
太平電業	6.2	6.7	17,058
高砂熱学工業	24.9	25.1	45,180
三晃金属工業	0.9	1.2	3,577
朝日工業社	1.9	2.1	6,174
明星工業	16.2	18	13,212
大気社	12	13.6	43,452
ダイダグ	6.1	6.7	16,830
日比谷総合設備	10.1	9.5	17,755
東芝プラントシステム	19.6	21.6	44,388
OSJBホールディングス	40.6	44.9	12,572
東洋エンジニアリング	10.8	12	9,228
千代田化工建設	59.2	72.7	22,464
新興プランテック	17.6	17.9	22,178
<b>食料品 (4.3%)</b>			
日本製粉	26.6	29.8	56,977
日清製粉グループ本社	99.5	101.5	240,758
日東富士製粉	0.6	0.6	3,846
昭和産業	7.3	8.3	25,149
鳥越製粉	7.3	8.3	6,515
中部飼料	9.9	10.9	11,848
フィード・ワン	54.8	60.2	10,896
東洋精糖	1.7	1.4	1,432
日本甜菜製糖	4.6	5.2	9,490
三井製糖	6.4	7.1	20,440
塩水港精糖	10.9	11	2,475
日新製糖	3.7	4.3	8,896
森永製菓	19.1	22.6	111,644
中村屋	2.1	2.3	9,786
江崎グリコ	22.7	27	152,820
名糖産業	4	4.3	6,071
井村屋グループ	3.2	3.8	9,545
不二家	5.2	4.8	10,809
山崎製パン	66.5	73.5	140,973
第一屋製パン	1.5	1.9	1,932
モロゾフ	1.4	1.5	7,545
亀田製菓	5.1	5.6	29,232
寿スビリッツ	7.8	9.5	41,562

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カルビー	37	41	127,100
森永乳業	16.3	18	62,190
六甲バター	4.1	6.6	13,153
ヤクルト本社	48.7	66.6	494,172
明治ホールディングス	53.7	63.7	556,101
雪印メグミルク	19.6	21.6	58,687
ブリマハム	57	12.7	27,444
日本ハム	70	38.9	166,297
丸大食品	44	9.7	18,730
S Foods	5.7	8	33,080
伊藤ハム米久ホールディングス	52	57.5	38,467
サッポロホールディングス	29.7	32.9	80,802
アサヒグループホールディングス	170.2	188.2	908,817
キリンホールディングス	390.7	406.6	1,051,467
宝ホールディングス	60.9	67.3	83,653
オエノンホールディングス	23.5	26	9,932
養命酒製造	2.4	2.7	5,691
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	57.1	68.8	205,436
サントリー食品インターナショナル	62.2	60.1	299,899
ダイドーグループホールディングス	4.2	5.1	27,693
伊藤園	26.9	27.3	140,595
キーコーヒー	8.1	8.9	18,209
ユニカフェ	2.7	2.8	2,839
ジャパンフーズ	1.2	1.4	1,757
日清オイリオグループ	9.6	11.5	39,100
不二製油グループ本社	22	21.9	85,957
かどや製油	0.9	1	5,040
J-オイルミルズ	4.2	4.6	18,653
キッコーマン	63.5	59.3	331,487
味の素	186.9	198.5	331,892
キュービー	45.3	50	128,200
ハウス食品グループ本社	31	34.3	152,292
カゴメ	32.6	36	106,668
焼津水産化学工業	4.2	4.5	5,278
アリアケジャパン	7.4	8.2	48,298
ピエトロ	1.1	1.4	2,297
エバラ食品工業	1.6	2.2	4,668
ニチレイ	38.7	46.7	129,125
東洋水産	44.6	46.2	193,578

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イトアンド	2	3.2	5,420
大冷	1	1.3	2,260
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1.5	2.6	1,622
日清食品ホールディングス	35.4	38.2	295,668
永谷園ホールディングス	9	4.6	11,040
一正蒲鉾	3.4	3.8	4,172
フジッコ	8.8	9.6	22,156
ロック・フィールド	8.8	9.6	15,513
日本たばこ産業	502.9	519	1,467,213
ケンコーマヨネーズ	5.4	5.1	11,306
わらべや日洋ホールディングス	5.4	6	11,928
なとり	4.6	5.2	8,793
イフジ産業	1.7	1.9	1,314
ビックスコーポレーション	1.2	2.2	4,164
北の達人コーポレーション	23.4	35.3	15,602
ユーグレナ	31.8	38.5	25,217
ミヨシ油脂	3.5	3.1	3,301
理研ビタミン	3.1	4.3	15,501
<b>繊維製品 (0.6%)</b>			
片倉工業	9.9	10.9	13,439
グンゼ	6.4	5.9	29,972
東洋紡	31.3	37.1	60,435
ユニチカ	24.9	26.2	13,021
富士紡ホールディングス	4.8	4.6	13,188
倉敷紡績	86	8.3	18,675
シキボウ	4.4	5	5,165
日本毛織	23.8	29.3	25,637
トーア紡コーポレーション	3.7	4.2	1,932
ダイドーリミテッド	11.2	11.3	3,921
帝国繊維	9	9.9	24,492
帝人	69.3	71.5	133,633
東レ	615.3	680.4	534,862
サカイオーベックス	2.2	2.2	4,019
住江織物	2.2	2.6	6,884
日本フェルト	4.5	4.6	2,106
イチカワ	6	1.1	1,542
アツギ	5.7	7.2	6,912
ダイニック	3.5	3.5	2,667
セーレン	19.5	21.6	41,256

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ソトー	3.3	4.1	4,013	
東海染工	1.5	1.6	1,664	
小松マテール	13.4	14.6	11,913	
ワコールホールディングス	23.4	25.5	71,349	
ホギメディカル	5.3	10.9	41,038	
クラウディアホールディングス	2.7	2.4	1,135	
T S I ホールディングス	32.2	32.6	22,722	
マツオカコーポレーション	1.5	2.8	9,436	
ワールド	—	8.7	17,634	
三陽商会	4.6	5.4	9,050	
ナイガイ	3.9	3.5	1,879	
オンワードホールディングス	50.9	52.7	35,150	
ルックホールディングス	15	3.3	4,484	
ゴールドウイン	2.4	7.9	108,151	
デサント	19.4	21.6	52,077	
キング	4.9	4.9	2,768	
ヤマトインターナショナル	7.5	6.3	2,696	
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>				
特種東海製紙	4.6	5.6	22,372	
王子ホールディングス	357	394.8	261,357	
日本製紙	38	42	86,142	
三菱製紙	12.2	14.7	8,364	
北越コーポレーション	47.4	58.1	37,009	
中越パルプ工業	3.3	4	5,484	
巴川製紙所	14	3.2	3,270	
大王製紙	33.7	42.7	55,808	
阿波製紙	2.3	2.7	1,258	
レンゴー	81.8	90.4	83,077	
トーモク	4.7	5.3	8,729	
ザ・バック	6	6.6	21,351	
<b>化学 (7.3%)</b>				
クラレ	142.8	148	227,328	
旭化成	529	623.9	757,102	
共和レザー	4.9	5.2	4,061	
昭和電工	56.5	58.3	228,536	
住友化学	624	690.4	388,695	
住友精化	3.5	4.3	18,898	
日産化学	49.4	53.9	309,925	
ラサ工業	3.1	3.1	4,746	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クレハ	7.3	8.1	55,971	
多木化学	1.2	2.6	14,638	
テイカ	6.5	7.2	15,386	
石原産業	15.3	16.9	20,584	
片倉コープアグリ	2	2.6	2,969	
日東エフシー	5	5.5	4,257	
日本曹達	59	13.8	40,903	
東ソー	122.6	135.6	225,367	
トクヤマ	24.6	25.3	71,852	
セントラル硝子	17.2	19.1	48,915	
東亜合成	49.8	55	69,355	
大阪ソーダ	7.5	9.5	26,372	
関東電化工業	20.3	21	18,690	
デンカ	31.2	34.5	118,507	
信越化学工業	141.2	154.5	1,482,582	
日本カーバイド工業	2.8	3	4,578	
堺化学工業	5.8	5.8	14,163	
第一稀元素化学工業	—	7.3	6,621	
エア・ウォーター	69.9	71.8	131,537	
大陽日酸	65.3	72.2	113,931	
日本化学工業	3.2	3	7,116	
東邦アセチレン	1.2	1.3	1,783	
日本パーカライズン	43.3	47.9	69,981	
高圧ガス工業	12.2	13.7	11,028	
チタン工業	1	1.1	2,574	
四国化成工業	12.2	14.7	19,227	
戸田工業	1.7	1.9	4,282	
ステラ ケミファ	4.4	5.2	16,406	
保土谷化学工業	2.8	3.1	8,624	
日本触媒	13.3	14.7	111,720	
大日精化工業	6.5	7.2	22,824	
カネカ	114	23.4	104,715	
三菱瓦斯化学	69.9	90.2	161,638	
三井化学	77.1	79.6	226,143	
J S R	85.3	88	161,920	
東京応化工業	14.7	15	51,300	
大阪有機化学工業	5.6	8.1	9,833	
三菱ケミカルホールディングス	568.1	586.3	489,091	
KHネオケム	13	13.4	39,932	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダイセル	114.4	136.2	156,493	
住友ベークライト	69	15.2	66,272	
積水化学工業	176.2	191.7	335,283	
日本ゼオン	71.5	79.1	91,914	
アイカ工業	23.8	26.3	101,518	
宇部興産	42.7	44.3	114,072	
積水樹脂	13.1	14.4	30,571	
タキロンシーアイ	17	18.9	11,453	
旭有機材	5	6.1	10,345	
日立化成	41.9	40.6	84,285	
ニチバン	4.2	4.6	10,317	
リケンテクノス	18.1	24.2	11,567	
大倉工業	20	4.5	7,960	
積水化成成品工業	10.9	13.2	12,777	
群栄化学工業	2	2.2	6,100	
タイガースポリマー	4.1	4.7	2,899	
ミライアル	2.9	2.7	3,218	
ダイキアクシス	2.9	3.2	3,292	
ダイキョーニシカワ	16.6	18.6	23,566	
竹本容器	0.9	3.2	4,646	
森六ホールディングス	3.2	4.6	11,794	
日本化薬	55.1	55.8	72,651	
カーリットホールディングス	8.1	9.4	7,867	
日本精化	7	7	8,505	
扶桑化学工業	6.1	8.9	19,375	
トリケミカル研究所	—	2	10,060	
ADEKA	36.5	43.2	74,606	
日油	32.8	33.8	129,285	
新日本理化	14.2	16.6	3,170	
ハリマ化成グループ	6.4	7.1	7,717	
花王	199.1	217.4	1,810,507	
第一工業製薬	16	3.3	10,197	
石原ケミカル	—	2.2	4,059	
日華化学	2.7	2.9	2,746	
ニイタカ	1.2	1.5	2,224	
三洋化成工業	5.3	5.8	31,900	
有機合成薬品工業	5.7	7.5	1,470	
大日本塗料	9.6	9.9	11,444	
日本ペイントホールディングス	65.5	72.4	300,460	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
関西ペイント	89.1	98.5	209,017	
神東塗料	5.2	6.6	1,141	
中国塗料	24.6	28.8	28,972	
日本特殊塗料	5.3	6.6	8,995	
藤倉化成	10.1	12	7,404	
太陽ホールディングス	6.5	7.3	27,338	
D I C	33.5	39.7	141,133	
サカタインクス	17.3	19.2	23,712	
東洋インキSCホールディングス	84	18.3	48,421	
T&K TOKA	5.5	6.6	6,864	
富士フィルムホールディングス	168.2	186	936,510	
資生堂	150.9	177.9	1,283,548	
ライオン	112.8	124.7	278,205	
高砂香料工業	5	6.2	22,692	
マンダム	15.8	20.1	55,797	
ミルボン	10.8	11	54,285	
ファンケル	19.7	39.9	100,468	
コーセー	13.7	15.2	276,640	
コタ	3.5	4.4	6,622	
シーズ・ホールディングス	11	2.7	15,876	
シーボン	1	1.1	2,937	
ポーラ・オルビスホールディングス	34.6	38.2	120,712	
ノエビアホールディングス	5.1	5.7	30,495	
アジupanコスメジャパン	2.1	2.1	2,055	
エステー	5.9	6.4	12,288	
アグロ カネショウ	3.4	3.6	7,509	
コニシ	13.2	16	27,152	
長谷川香料	10.8	10.7	18,543	
星光PMC	4.8	6	4,944	
小林製薬	22.7	25.1	224,143	
荒川化学工業	7.3	8	11,312	
メック	5.6	6.2	7,161	
日本高純度化学	2.4	2.5	5,947	
タカラバイオ	21.3	23.4	55,434	
J C U	5	11.6	21,703	
新田ゼラチン	5.8	5.6	4,009	
OATアグリオ	1.3	1.3	2,207	
デクセリアルズ	20.8	23	18,745	
アース製薬	6.1	6.7	33,466	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北興化学工業	8.5	9.4	5,160
大成ラミック	2.3	2.8	8,047
クミアイ化学工業	37	37.1	26,415
日本農薬	21.5	21.4	10,550
アキレス	6.2	6.6	13,523
有沢製作所	13.6	14.1	11,505
日東電工	61.2	67.6	409,723
レック	4.8	9.5	15,646
三光合成	—	7.7	2,849
きもと	14.5	15.7	2,967
藤森工業	6.8	8	24,760
前澤化成工業	5.7	6.1	6,118
未来工業	—	4.8	11,553
ウェーブロックホールディングス	—	1.9	1,573
J S P	4.7	5.3	13,027
エフピコ	6.6	7.4	48,470
天馬	6.3	6.1	12,370
信越ポリマー	16.5	16	13,360
東リ	20.2	21.9	6,066
ニフコ	14.9	35.9	100,125
バルカー	6.6	7.3	16,833
ユニ・チャーム	171.7	189.9	672,246
ショーエイコーポレーション	—	0.5	470
<b>医薬品 (5.4%)</b>			
協和発酵キリン	101.5	112.2	240,669
武田薬品工業	298.3	567.6	2,549,659
アステラス製薬	832.3	825.6	1,409,299
大日本住友製薬	60	66.4	184,127
塩野義製薬	115.9	117.2	819,931
田辺三菱製薬	98.8	93.7	150,388
わかもと製薬	10	11.6	3,236
あすか製薬	9.3	11.1	13,408
日本新薬	21.2	23.4	160,056
ピオフェルミン製薬	1.3	1.4	3,350
中外製薬	84.4	93.4	682,754
科研製薬	14.6	16.2	85,698
エーザイ	96.9	107.2	955,044
ロート製薬	44.5	45.9	138,159
小野薬品工業	191.3	211.5	482,325

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
久光製薬	23.9	26.5	147,605
持田製薬	5.6	6.8	78,132
参天製薬	153.3	169.8	266,416
扶桑薬品工業	2.9	3.1	7,982
日本ケミファ	1	1.2	3,540
ツムラ	29	27.7	98,196
日医工	21.3	22.9	36,479
キッセイ薬品工業	15	15.7	45,844
生化学工業	16	17.6	24,147
栄研化学	6.6	15.8	40,606
日水製薬	3.2	3.7	4,377
鳥居薬品	5.1	4.8	11,217
J C R ファーマ	5.7	6.3	35,910
東和薬品	3.9	4.3	37,840
富士製薬工業	2.8	6	11,064
沢井製薬	16.3	18.4	110,584
ゼリア新薬工業	17.4	17.7	33,612
第一三共	231.8	256.3	1,000,595
キョーリン製薬ホールディングス	22.5	19.7	44,226
大幸薬品	4.4	4.1	7,523
ダイト	4.7	5.2	14,742
大塚ホールディングス	168.3	170.6	773,329
大正製薬ホールディングス	18.1	20	226,800
パプチドリーム	36	44.6	225,676
<b>石油・石炭製品 (0.7%)</b>			
日本コークス工業	69.5	72.1	7,282
昭和シェル石油	75.8	69.7	122,184
ニチレキ	10.3	11.6	13,108
ユシロ化学工業	4.4	4.3	5,650
ビービー・カストロール	3.5	3.1	4,225
富士石油	19.9	21.9	6,394
MORESCO	3	3.4	5,501
出光興産	68	75	312,000
J X T G ホールディングス	1,292.5	1,506.2	856,124
コスモエネルギーホールディングス	23.4	25.9	63,170
<b>ゴム製品 (0.8%)</b>			
横浜ゴム	46.9	51.9	120,096
TOYO TIRE	48	46	65,412
ブリヂストン	286.2	275.2	1,210,054

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友ゴム工業	83.4	80.4	114,570
藤倉ゴム工業	7.4	8.1	3,531
オカモト	28	6.2	36,146
フコク	3.3	4.1	3,579
ニッタ	8.3	10	39,050
住友理工	15.3	17.3	17,663
三ツ星ベルト	20	11.8	25,653
バンドー化学	15.3	17.2	20,364
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>			
日東紡績	12.1	13.4	26,290
AGC	82.8	88.5	346,477
日本板硝子	41	42.7	41,547
石塚硝子	1.1	1.3	2,258
日本山村硝子	32	3.6	5,367
日本電気硝子	35	38.7	117,261
オハラ	3.2	3.6	6,271
住友大阪セメント	157	18.1	85,341
太平洋セメント	51.2	56.6	209,420
日本ヒューム	8.2	8.6	7,009
日本コンクリート工業	17.9	19.4	5,509
三谷セキサン	4.2	4.2	11,886
アジアバイルホールディングス	10.6	12.9	8,088
東海カーボン	73.5	81.3	123,169
日本カーボン	4.2	4.3	22,145
東洋炭素	5.3	5.3	11,432
ノリタケカンパニーリミテド	4.8	5.3	28,090
TOTO	62.3	68.9	298,681
日本碍子	98.8	109.3	184,498
日本特殊陶業	69.5	75.5	179,614
MARUWA	2.8	3.1	19,592
品川リフラクトリーズ	2.1	2.4	8,268
黒崎播磨	1.6	1.8	10,260
ヨータイ	4	7.8	4,664
イソライト工業	4.2	4.7	2,660
東京窯業	10.7	11.5	4,519
ニッカトー	3	4.1	4,259
フジミインコーポレーテッド	7.3	7.9	18,430
クニミネ工業	—	3	2,475
エーアンドエーマテリアル	1.8	1.8	1,994

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニチアス	44	24.4	50,752
ニチハ	12.2	12.4	38,874
<b>鉄鋼 (1.0%)</b>			
新日鐵住金	358.4	411.5	835,345
神戸製鋼所	146.6	162.1	144,106
中山製鋼所	11	12.4	6,162
合同製鐵	4.3	4.3	7,482
ジェイ エフ イー ホールディングス	216.3	239.2	462,732
日新製鋼	22.1	—	—
東京製鐵	43	47.5	41,800
共英製鋼	9.1	10	17,160
大和工業	17	18.8	57,152
東京鐵鋼	3.4	3.8	4,601
大阪製鐵	5.3	5.9	11,009
淀川製鋼所	11.7	11.9	26,810
東洋鋼板	20.4	—	—
丸一鋼管	28.4	31.4	104,405
モリ工業	2.6	2.7	6,966
大同特殊鋼	14.2	14.5	68,585
日本高周波鋼業	3.1	3.4	1,849
日本冶金工業	66.8	73.5	17,934
山陽特殊製鋼	9.3	11.2	28,067
愛知製鋼	4.5	5	17,700
日立金属	86.3	95.4	108,279
日本金属	2.1	2.1	2,725
大太平洋金属	5	6	17,652
新日本電工	48.3	53.2	12,555
栗本鐵工所	4.1	4.4	6,639
虹技	1.2	1.3	1,805
日本鑄鉄管	9	1.1	969
三菱製鋼	5.8	6.6	10,850
日亜鋼業	11.8	12.7	4,241
日本精線	1.3	1.3	4,400
エンビプロ・ホールディングス	—	2.5	1,402
シンニッタン	6	14.1	5,005
新家工業	1.8	2	3,264
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	13.4	14.4	9,057
日本軽金属ホールディングス	233.8	241.3	59,118

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井金属鉱業	21.6	23.9	64,171
東邦亜鉛	4.5	4.9	15,533
三菱マテリアル	52.9	58.5	180,180
住友金属鉱山	102.4	121.3	388,402
DOWAホールディングス	20.3	20.7	72,864
古河機械金属	13.2	14.7	21,476
大阪チタニウムテクノロジーズ	8.4	10.3	19,137
東邦チタニウム	14.5	15.9	15,677
UACJ	12.1	13.4	29,734
CKサンエツ	—	1.7	5,933
古河電気工業	26.7	25.5	90,142
住友電気工業	299.5	331.1	513,536
フジクラ	96.7	106.8	52,652
昭和電線ホールディングス	10.2	10.5	7,497
東京特殊電線	1	1.2	2,509
タツタ電線	15.9	17.7	9,257
沖電線	0.3	—	—
カナレ電気	1.1	1.4	2,571
平河ヒューテック	4	3.7	6,156
リョービ	9.8	10.9	30,007
アーレスティ	9.9	10.9	7,640
アサヒホールディングス	12.9	16.6	36,022
<b>金属製品 (0.6%)</b>			
稲葉製作所	4.5	5.2	6,687
宮地エンジニアリンググループ	2.3	2.7	5,678
トーカロ	5.6	22.8	21,500
アルファCo	2.9	3.2	4,412
SUMCO	73.7	97.8	152,568
川田テクノロジーズ	1.6	2	13,680
RS Technologies	1.1	1.8	5,751
東洋製織グループホールディングス	54.8	56.4	129,550
ホッカンホールディングス	20	4.5	7,929
コロナ	4.4	4.7	4,902
横河ブリッジホールディングス	14.9	16.5	32,323
駒井ハルテック	1.8	1.7	3,243
高田機工	0.7	0.8	2,114
三和ホールディングス	76.8	91.5	119,041
文化シャッター	23.8	26.3	22,013
三協立山	11.1	12.4	18,128

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルインコ	6.2	6.9	6,872
東洋シャッター	2.3	2.3	1,642
LIXILグループ	118.1	130.7	209,512
日本フィルコン	6.4	7.2	3,996
ノーリツ	17.9	19.7	32,367
長府製作所	9	9.1	20,120
リンナイ	14.3	15.8	116,446
ダイニチ工業	4.2	4.9	3,581
日東精工	11.1	12.4	6,857
三洋工業	0.9	1.4	2,636
岡部	16	18	17,496
ジーテクト	8.8	9.7	16,616
中国工業	1.2	1.5	844
東ブレ	14.8	16.4	40,344
高周波熱錬	15.3	17.2	15,187
東京製綱	5.8	5.6	5,807
サンコール	4.4	5.1	3,564
モリテック スチール	4.8	7.1	3,152
パイオラックス	11.9	14.2	33,710
エイチワン	5.9	8.7	9,778
日本発條	79.8	88.2	92,786
中央発條	0.8	1	2,954
アドパネクス	1.3	1.2	2,114
立川ブラインド工業	3.5	3.9	4,687
三益半導体工業	6.2	7.9	11,723
<b>機械 (4.9%)</b>			
日本ドライケミカル	1	2.4	2,904
日本製鋼所	26.2	26.9	55,898
三浦工業	34.7	38.3	97,626
タクマ	27.1	32.2	47,237
ツガミ	21	20	15,280
オークマ	9.3	11.3	68,139
東芝機械	45	10	23,150
アマダホールディングス	123.6	136.7	157,478
アイダエンジニアリング	20.4	24.8	20,410
滝澤鉄工所	2.6	2.9	4,996
FUJI	24	26.4	41,659
牧野フライス製作所	40	10.4	47,580
オーエスジー	36.9	43.6	97,838



銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダイジェット工業	1	1.1	1,805	
旭ダイヤモンド工業	23.9	23.3	18,873	
DMG森精機	44.3	56	84,784	
ソディック	17.5	19.5	16,282	
ディスコ	10.8	12	195,960	
日東工器	5	4.8	11,380	
日進工具	2.1	2.6	6,502	
パンチ工業	6.8	6.2	3,961	
富士ダイス	3.1	3.9	2,811	
豊和工業	4.5	5	4,470	
OKK	3.2	3.8	3,271	
石川製作所	2.1	2.2	2,635	
東洋機械金属	6.3	6.3	3,836	
津田駒工業	20	1.9	3,771	
島精機製作所	10.1	12.2	47,031	
オプトラン	5.9	8.7	19,940	
NCホールディングス	2.9	3.6	1,764	
ブリュー	5.7	7.3	7,584	
ヤマシンフィルタ	11	15.5	11,020	
日阪製作所	11.5	10.9	9,799	
やまびこ	15.5	17	17,748	
平田機工	2.2	4.2	28,602	
ベガサスミシン製造	7.5	8.4	5,854	
マルマエ	—	2.4	1,716	
タツモ	—	2.8	2,212	
ナブテスコ	44.1	48.7	146,343	
三井海洋開発	8.5	9.4	28,623	
レオン自動車	7.2	8.7	13,876	
SMC	25.4	26.2	1,032,542	
新川	6.6	6.6	3,702	
ホソカワミクロン	3.1	3.1	14,973	
ユニオンツール	3.7	3.8	11,495	
オイレス工業	10.3	12.3	23,886	
日精エー・エス・ビー機械	2.7	2.6	10,517	
サトーホールディングス	10.6	10.7	28,997	
技研製作所	4.1	6.2	21,142	
日本エアータック	3.2	3	1,788	
カワタ	—	1.8	2,507	
日精樹脂工業	6.8	7.5	6,990	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
オカダアイオン	2.4	3	4,443	
ワイエイシイホールディングス	2.7	3.3	2,623	
小松製作所	391	405.5	1,108,231	
住友重機械工業	46.4	51.3	198,018	
日立建機	37.9	35.9	103,858	
日工	2.2	2.5	5,367	
巴工業	3.4	3.8	9,066	
井関農機	8.1	9	14,904	
TOWA	6.3	7.6	5,418	
丸山製作所	1.9	1.9	2,470	
北川鉄工所	3.9	4	9,812	
ローツェ	4	3.9	6,727	
タカキタ	2.9	3.2	1,977	
クボタ	434.4	479.7	737,298	
荏原実業	2.4	2.7	6,007	
三菱化工機	2.9	3.1	4,817	
月島機械	16.1	17.7	24,815	
帝国電機製作所	5.8	6.3	7,591	
新東工業	19.2	21.5	21,758	
澁谷工業	7.1	7.8	26,091	
アイチ コーポレーション	13.9	15.2	10,837	
小森コーポレーション	20.4	24.1	29,064	
鶴見製作所	6.8	7	12,579	
住友精密工業	13	1.5	4,326	
酒井重工業	1.5	1.7	4,018	
荏原製作所	33.3	39.7	126,444	
石井鐵工所	1.5	1.5	2,733	
西島製作所	8.2	9.2	8,703	
北越工業	9.1	9.2	10,782	
ダイキン工業	110.6	122.2	1,509,170	
オルガノ	2.9	3.2	10,096	
トーヨーカネツ	3.4	3.4	7,939	
栗田工業	43.8	48.5	143,899	
椿本チエイン	48	11.6	47,502	
大同工業	3	4.2	3,805	
木村化工機	7.1	7.4	2,804	
アネスト岩田	13.6	14	13,902	
ダイフク	41.2	49.3	278,052	
サムコ	2.2	2.6	2,493	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
加藤製作所	3.9	4.6	12,553	
油研工業	1.7	1.6	3,035	
タダノ	39.1	43.2	51,192	
フジテック	25.8	32.4	39,560	
CKD	22.5	24.9	26,643	
キトー	6.2	6.8	12,342	
平和	25.3	25	55,100	
理想科学工業	8.1	8	15,584	
SANKYO	20.3	22.4	90,832	
日本金銭機械	7.7	10.2	11,077	
マースグループホールディングス	5.2	5.8	12,742	
福島工業	5	5.5	21,560	
オーイズミ	3.9	4.5	1,656	
ダイコク電機	4	4.4	6,582	
竹内製作所	13.6	15	30,420	
アマノ	25.1	25.6	60,902	
JUKI	12.1	12.5	16,637	
サンデンホールディングス	10	11.2	9,475	
蛇の目ミシン工業	7.5	8.1	3,928	
マックス	12.4	13.8	20,879	
グローリー	24.2	24.8	65,472	
新晃工業	8.2	8.4	13,020	
大和冷機工業	13	13	16,445	
セガサミーホールディングス	80.3	88.8	114,463	
日本ビストンリング	3	3.3	5,580	
リケン	3.7	4.1	21,361	
TPR	9	12	29,748	
ツバキ・ナカシマ	8.1	13.6	27,268	
ホシザキ	25.5	26.2	194,142	
大豊工業	6.5	7.4	7,873	
日本精工	166.3	183.9	194,014	
NTN	187.4	192.4	68,302	
ジェイテクト	86.3	85.9	123,610	
不二越	75	8.3	37,267	
日本トムソン	26	26.7	15,058	
THK	50.5	55.8	157,858	
ユースン精機	3.6	7.1	7,405	
前澤給装工業	3	3.5	6,496	
イーグル工業	10.1	11.1	14,430	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
前澤工業	5.9	6	2,160	
日本ビラー工業	8.2	9	12,627	
キッツ	36	36.2	30,842	
マキタ	105.6	109	442,540	
日立造船	64.4	71.4	25,204	
三菱重工業	135.7	150.1	652,935	
I H I	62.2	68.8	224,632	
スター精密	12.9	15.2	26,128	
<b>電気機器 (13.0%)</b>				
日清紡ホールディングス	49.5	49.6	47,616	
イビデン	49.6	54.8	86,419	
コニカミノルタ	189.6	195.7	212,725	
ブラザー工業	98.9	116.6	246,142	
ミネベアミツミ	150.3	166.2	298,162	
日立製作所	1,945	403.1	1,403,594	
三菱電機	809.9	895.4	1,286,242	
富士電機	244	58.1	202,769	
東洋電機製造	3.2	3.6	4,870	
安川電機	93.9	103.8	332,160	
シンフォニアテクノロジー	53	12.5	17,350	
明電舎	69	17.7	28,603	
オリジン電気	2.5	2.5	5,737	
山洋電気	3.9	4.3	17,458	
デンヨー	7.4	8.3	11,893	
東芝テック	58	11.3	33,628	
芝浦メカトロニクス	12	1.6	5,648	
マブチモーター	22.6	24.8	95,480	
日本電産	97.5	107.8	1,444,520	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3	4.8	8,750	
トレックス・セミコンダクター	—	3	3,441	
東光高岳	4.1	4.6	6,518	
ダブル・スコープ	11.8	13.1	17,540	
ダイヘン	44	9.8	27,459	
田淵電機	12.3	—	—	
ヤーマン	11.7	13	17,381	
JVCケンウッド	59.9	69.8	18,985	
ミマキエンジニアリング	7.5	8.2	6,314	
第一精工	3.8	3.7	3,918	
日新電機	19	21	21,273	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大崎電気工業	17.4	18	12,654
オムロン	86.1	95.2	471,240
日東工業	13.1	14.4	32,155
I D E C	10	12	25,200
正興電機製作所	—	1.6	1,292
不二電機工業	0.6	0.9	1,170
ジーエス・ユアサ コーポレーション	146	32.2	73,963
サクサホールディングス	2.2	2.4	4,478
メルコホールディングス	3.9	3.7	14,763
テクノメディア	2	2	4,204
日本電気	104.8	115.9	435,204
富士通	833	86.3	648,803
沖電気工業	33	38.8	50,711
岩崎通信機	3.6	4.6	3,776
電気興業	4.7	4.8	12,768
サンケン電気	48	10.5	23,929
ナカヨ	1.6	2.1	2,965
アイホン	4.6	5.1	8,965
ルネサスエレクトロニクス	41.9	92.8	64,032
セイコーエプソン	120.6	111.1	186,648
ワコム	63.2	65.1	30,792
アルバック	18.5	17.8	57,672
アクセル	3.7	3.8	1,953
E I Z O	7.4	8.2	38,540
ジャパンディスプレイ	167.2	213.4	15,364
日本信号	22.2	22.8	22,366
京三製作所	19	19.1	7,640
能美防災	10.7	11.9	23,752
ホーチキ	5.9	5.7	6,577
星和電機	—	3.7	1,653
エレコム	7	8.3	27,763
パナソニック	925.2	1,023	1,067,500
シャープ	55.6	88.8	120,945
アンリツ	59	57.6	123,552
富士通ゼネラル	24.7	27.4	41,045
ソニー	540.8	600.6	3,167,564
TDK	42.4	46.8	410,904
帝国通信工業	3.7	4.1	4,924
タムラ製作所	31.3	35.1	20,849

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルプスアルパイン	69.8	93.2	215,105
バイオニア	135.9	155.5	10,263
日本電波工業	7.5	8.5	3,153
鈴木	3.4	4.8	3,230
日本トリム	1.8	1.7	9,469
ローランド ディー、ジー、	4.2	4.7	10,509
フォスター電機	9.5	10.6	16,684
クラリオン	43	7.3	18,250
SMK	21	2.5	6,577
ヨコオ	5.3	6.4	10,560
ホシデン	20.5	26.4	24,499
ヒロセ電機	13.1	12.8	149,376
日本航空電子工業	21	20.6	30,941
T O A	8.8	9.7	10,088
マクセルホールディングス	16.1	19.3	32,211
古野電気	10.1	11.6	11,356
ユニデンホールディングス	23	2.7	6,215
アルパイン	19.3	—	—
スミダコーポレーション	8.3	7.7	11,665
アイコム	4.6	5.1	11,454
リオン	3.5	4.2	8,114
本多通信工業	6.4	7.9	4,384
船井電機	8.5	9.6	7,353
横河電機	81.1	89.6	191,564
新電元工業	2.9	3.2	14,272
アズビル	24.3	57.8	139,240
東亜ディーケーケー	4.1	4.5	3,811
日本光電工業	33.8	39.5	134,892
チノー	2.9	3.2	4,128
共和電業	8.7	9.7	3,627
日本電子材料	3.2	3.6	2,563
堀場製作所	16	17.7	103,368
アドバンテス	45.2	61	164,944
小野測器	3.4	4.2	2,583
エスペック	7.2	8	16,520
キーエンス	39.8	44	2,753,080
日置電機	4.2	4.7	20,962
シスメックス	63	69.8	466,194
日本マイクロニクス	14.3	14.7	12,024

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メガチップス	6.4	7.1	16,074
OBARA GROUP	4.7	5.2	20,384
澤藤電機	0.9	1.1	1,755
原田工業	—	2.8	2,646
コーセル	11.2	11.5	13,478
イリソ電子工業	6.8	8.2	39,606
新日本無線	5	—	—
オブテックスグループ	6.6	15.8	33,764
千代田インテグレ	3.9	3.8	8,147
アイ・オー・データ機器	3.4	3.3	3,999
レーザーテック	16.6	18.3	75,762
スタンレー電気	62	63.3	203,826
岩崎電気	3.2	3.5	4,812
ウシオ電機	49.2	54.3	71,241
岡谷電機産業	4.6	6.6	2,554
ヘリオス テクノ ホールディング	7	8.3	5,868
エノモト	—	1.9	1,675
日本セラミック	8.2	9.1	25,343
遠藤照明	4.1	4.6	3,275
古河電池	6	6.4	4,640
双信電機	3.7	4.6	2,037
山一電機	5.9	6.5	7,858
函研	5.4	5.9	9,434
日本電子	30	17.7	33,559
カシオ計算機	65.1	79.2	119,829
ファナック	77	85.1	1,651,791
日本シイエムケイ	14.3	22.9	15,434
エンプラス	3.7	4.1	12,505
大真空	3	3.4	3,046
ローム	36.3	43.3	327,348
浜松ホトニクス	59	64.2	255,837
三井ハイテック	10.7	10	10,140
新光電気工業	30.7	30.1	25,133
京セラ	132.9	136.5	851,760
太陽誘電	36.4	39.8	94,166
村田製作所	85	93.9	1,640,902
ユーシン	12.3	13.6	13,368
双葉電子工業	13.3	14.8	25,988
北陸電気工業	3.3	3.5	3,710

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニチコン	25.4	28.3	28,328
日本ケミコン	6.6	6.4	13,766
KOA	11.2	13.5	21,397
市光工業	12.2	13.4	9,179
小糸製作所	48.5	53.6	367,696
ミツバ	15	16.7	11,873
SCREENホールディングス	15.3	15.5	72,152
キャノン電子	7.4	8.2	15,104
キャノン	436	482.1	1,554,290
リコー	243.5	269.2	304,734
象印マホービン	—	16.8	20,496
MUTOHホールディングス	1.3	1.3	2,434
東京エレクトロン	54	59.7	935,200
<b>輸送用機器 (8.1%)</b>			
トヨタ紡織	23.6	31.3	57,654
芦森工業	1.7	1.9	3,254
ユニプレス	15.6	17.3	34,478
豊田自動織機	65.5	72.5	407,450
モリタホールディングス	12.8	15.6	29,156
三櫻工業	10.3	11.6	6,461
デンソー	179.7	197.2	953,067
東海理化電機製作所	21.1	23.4	47,268
三井E&Sホールディングス	29.2	32.4	41,083
川崎重工業	63	69.7	198,854
名村造船所	24.7	27.3	11,793
サノヤスホールディングス	10.2	13.1	2,318
日本車輛製造	30	3.3	8,692
三菱ロジスネクスト	9.7	10.7	14,680
近畿車輛	1.2	1.3	2,723
日産自動車	955.2	1,056.1	1,001,182
いすゞ自動車	234.7	283.1	458,338
トヨタ自動車	984.6	997.9	6,775,741
日野自動車	115.6	111.8	115,713
三菱自動車工業	299.8	331.5	209,176
エフテック	5.2	6.2	6,231
レシップホールディングス	3.2	3.7	2,689
GMB	1.4	1.8	1,695
ファルテック	1.3	1.9	1,698
武蔵精密工業	8.7	21.7	34,155

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日産車体	31.6	17.5	17,587	
新明和工業	35.1	40.2	53,023	
極東開発工業	15	17.7	26,514	
日信工業	16.5	16.7	26,168	
トビー工業	6.7	7.4	17,560	
ティラド	2.9	3.3	7,632	
曙ブレーキ工業	38.1	50.6	8,703	
タチエス	13.8	15.1	25,368	
NOK	43.5	48.1	86,916	
フタバ産業	24.8	25.3	15,483	
KYB	8.4	9.3	28,411	
大同メタル工業	10.1	14.6	11,694	
プレス工業	43	44.3	28,174	
ミクニ	10.5	11.6	5,742	
太平洋工業	16.9	18.9	31,941	
ケーヒン	18.6	20.5	39,770	
河西工業	9.9	10.9	9,515	
アイシン精機	66.7	73.7	322,069	
マツダ	254.2	281	362,490	
今仙電機製作所	7.6	8.4	8,736	
本田技研工業	728.8	755.4	2,291,128	
スズキ	160.5	163.8	946,436	
SUBARU	251.4	278	784,794	
安永	3.9	4.4	6,912	
ヤマハ発動機	114.4	126.5	284,119	
ショーワ	21.1	21.1	33,485	
TBK	10.2	10.3	4,398	
エクセディ	9.7	12.1	32,718	
豊田合成	29.4	28.9	71,989	
愛三工業	14.3	14.1	10,589	
盟和産業	1.4	1.7	1,786	
日本プラスト	3.3	7.2	5,954	
ヨロズ	8.2	8.2	13,439	
エフ・シー・シー	13.2	16.1	42,471	
シマノ	32.6	36.1	619,115	
ティ・エス テック	18.8	20.8	67,288	
ジャムコ	4.1	4.5	11,709	
精密機器 (2.0%)				
テルモ	124.1	126.7	850,790	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
クリエートメディック	2.6	3	2,991	
日機装	28.2	28.8	34,185	
島津製作所	96.8	115.2	321,177	
JMS	6.5	8.4	5,359	
長野計器	6.5	7.1	5,601	
プイ・テクノロジー	1.9	2.1	30,933	
東京計器	5.3	5.8	6,472	
愛知時計電機	1.1	1.2	4,644	
インターアクション	3.2	4.2	7,459	
オーバル	8.9	8.8	2,200	
東京精密	14.6	16.2	48,924	
マニー	9.8	10.9	55,808	
ニコン	141.1	156	273,468	
トプコン	43.5	48.1	74,458	
オリンパス	120.6	133.4	638,986	
理研計器	7.7	7.9	17,743	
タムロン	6.5	8.1	15,940	
HOYA	164.9	180.3	1,220,631	
シード	0.9	3.8	5,065	
ノーリツ鋼機	8.2	7	15,190	
エー・アンド・デイ	7.6	8.3	6,125	
朝日インテック	—	38	208,620	
シチズン時計	96.7	98	62,132	
リズム時計工業	3	2.9	4,805	
大研医器	7.5	7.2	4,233	
メニコン	11.1	12.2	35,123	
シンシア	0.6	1.4	670	
松風	3.7	4.1	5,317	
セイコーホールディングス	12.5	13.9	35,889	
ニプロ	56	62	92,132	
その他製品 (2.0%)				
中本ボックス	0.8	2.4	4,089	
スノーピーク	2.6	3.5	4,865	
パラマウントベッドホールディングス	8.5	10.2	51,102	
トランザクション	3.7	4.9	3,532	
SHO-BI	3.4	3.3	1,201	
ニホンフラッシュ	3.8	3.9	8,034	
前田工業	8.3	9.8	26,959	
永大産業	10	12.3	5,387	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アートネイチャー	8.6	10.1	6,383
バンダイナムコホールディングス	83.7	92.6	444,480
アイフィスジャパン	2.1	2.3	1,324
共立印刷	12.2	13.4	2,988
SHOEI	3.7	4.3	17,372
フランスベッドホールディングス	9.4	12.5	10,825
パイロットコーポレーション	14.1	15.6	81,900
萩原工業	4.6	5	8,255
トッパン・フォームズ	17.4	19	17,955
フジシールインターナショナル	18.2	20.1	83,716
タカラトミー	33.9	37.5	42,375
廣済堂	8	8.6	6,080
エステールホールディングス	2.4	2.5	1,677
アーク	35.4	34.7	3,261
タカノ	3.4	3.1	2,662
プロネクサス	7.5	7.6	9,188
ホクシン	6.7	8.1	1,125
ウッドワン	2.8	3.1	3,540
大建工業	6.3	6.8	13,049
凸版印刷	229	126.4	220,694
大日本印刷	106	126.2	323,450
図書印刷	5.2	8.4	7,887
共同印刷	2.4	2.6	6,463
NISSHA	16.6	18.5	25,419
光村印刷	0.6	0.8	1,766
宝印刷	4.3	4.4	7,290
アシックス	80.4	88.9	132,194
ツツミ	2.6	2.8	5,572
小松ウオール工業	2.8	2.6	5,036
ヤマハ	54.6	53.3	291,551
河合楽器製作所	2.7	2.8	9,394
クリナップ	7.6	8.3	5,270
ビジョン	48.9	54.1	253,188
兼松サステック	0.7	0.7	1,092
キングジム	7.1	7.6	6,270
リンテック	19.3	21.2	53,360
イトーキ	17.1	16.6	9,578
任天堂	49.9	55.1	1,635,092
三菱鉛筆	13.3	14.7	33,677

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
タカラスタンダード	16.7	18.5	31,875
コクヨ	38.8	43	72,842
ナカバヤシ	7.7	9	4,914
グローブライド	3.6	4.3	12,207
オカムラ	28.3	31.2	40,872
美津濃	8	8.9	23,193
<b>電気・ガス業 (2.0%)</b>			
東京電力ホールディングス	646.5	714.9	478,983
中部電力	247.8	274	486,213
関西電力	330.5	365.4	606,198
中国電力	112	123.8	182,109
北陸電力	79.3	87.7	81,385
東北電力	189.7	209.7	312,033
四国電力	72.9	80.6	116,225
九州電力	178.8	184.6	246,810
北海道電力	81.2	83.8	68,464
沖縄電力	13.1	16.5	34,056
電源開発	64.4	71.2	201,282
エフオン	4.1	4.2	3,523
イーレックス	12.8	15.6	13,369
レノバ	—	11	11,825
東京瓦斯	172.8	175.7	537,642
大阪瓦斯	157.2	173.8	392,440
東邦瓦斯	40.1	44.4	220,002
北海道瓦斯	21	4.8	7,003
広島ガス	15.7	18	6,210
西部瓦斯	9.7	10.1	25,270
静岡ガス	22.9	27.7	25,068
メタウォーター	4.5	4.3	13,351
<b>陸運業 (4.8%)</b>			
SBSホールディングス	8.1	8.8	17,133
東武鉄道	86.5	94.4	295,472
相鉄ホールディングス	25.9	30.7	102,384
東京急行電鉄	220	243.2	458,675
京浜急行電鉄	110.9	122.7	228,222
小田急電鉄	120.5	143.4	364,236
京王電鉄	45.3	50	321,000
京成電鉄	56.4	67.1	253,302
富士急行	11.1	12.2	48,434

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新京成電鉄	1.8	2.2	4,573
東日本旅客鉄道	145.5	159.2	1,690,704
西日本旅客鉄道	73.1	80.3	662,635
東海旅客鉄道	72.5	80.2	1,991,767
西武ホールディングス	103.2	114.1	230,025
鴻池運輸	11.5	14.1	24,872
西日本鉄道	22.4	24.8	67,679
ハマキョウレックス	5.8	6.9	29,325
サカイ引越センター	4.3	4.7	30,973
近鉄グループホールディングス	76.7	84.8	420,608
阪急阪神ホールディングス	102.3	113.1	466,537
南海電気鉄道	36.4	37.8	113,248
京阪ホールディングス	34.2	37.8	172,935
神戸電鉄	1.7	2.2	8,723
名古屋鉄道	59.2	67.9	205,737
山陽電気鉄道	5.9	6.6	14,447
日本通運	30.1	33.3	234,432
ヤマトホールディングス	134.5	148.7	444,241
山九	19.7	23.6	129,564
丸運	3.4	5.3	1,611
丸全昭和運輸	27	6.8	19,380
センコーグループホールディングス	46	46.7	43,757
トナミホールディングス	1.8	2	12,980
ニッコンホールディングス	29.2	32.3	92,797
日本石油輸送	1	1.1	3,270
福山通運	11.1	10.8	48,600
セイノーホールディングス	57.4	63.5	99,187
エスライン	—	2.4	2,745
神奈川中央交通	1.8	2.1	7,864
日立物流	16.8	18.6	60,729
丸和運輸機関	4	4.5	15,975
C&Fロジホールディングス	8.4	8.6	11,137
九州旅客鉄道	64.4	71.2	263,440
SGホールディングス	53.6	80.1	255,118
<b>海運業 (0.2%)</b>			
日本郵船	64.1	70.9	127,194
商船三井	48.5	50.3	133,244
川崎汽船	35.4	26.3	42,343
NSユナイテッド海運	3.6	4.7	12,393

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
明治海運	8.6	9.2	3,220
飯野海運	40	40.8	16,197
共栄タンカー	0.6	0.9	1,413
乾汽船	6.1	7.7	5,559
<b>空運業 (0.6%)</b>			
日本航空	142.3	155.3	632,071
ANAホールディングス	150.3	155	643,095
バスコ	8	1.9	1,751
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
トランコム	2.1	2.4	16,344
日新	6.7	7.3	14,286
三菱倉庫	26.5	29.3	80,985
三井倉庫ホールディングス	44	10.4	20,654
住友倉庫	53	31.7	45,838
澁澤倉庫	4.2	4.5	7,452
東陽倉庫	13.9	16.2	5,167
日本トランスシテイ	18	18.6	8,239
ケイヒン	1.6	1.8	2,512
中央倉庫	4.8	5.1	5,380
川西倉庫	1.6	1.8	2,181
安田倉庫	7.1	7	6,328
ファイズ	—	1.1	961
東洋埠頭	2.3	2.5	3,727
宇徳	6.8	7.5	4,102
上組	48.3	52.3	131,848
サンリツ	2.1	2.2	1,551
キムラユニティ	1.8	2.1	2,337
キューソー流通システム	2.2	2.1	4,319
近鉄エクスプレス	14.5	15.9	29,240
東海運	4.5	5.8	1,641
エーアイテイ	5.7	5.7	6,121
内外トランスライン	2.8	2.6	3,941
日本コンセプト	1.5	2.4	2,517
<b>情報・通信業 (8.3%)</b>			
NECネットエスアイ	8.8	9.6	24,393
クロスキャット	—	1.7	1,701
システナ	6.4	31.3	35,963
デジタルアーツ	3.9	4.7	39,104
新日鉄住金ソリューションズ	12.4	13.1	39,195

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キューブシステム	4.6	4.6	4,061
エイジア	1.2	1.8	2,408
コア	3.4	3.7	4,980
ソリトンシステムズ	2.6	5	5,265
ソフトクリエイトホールディングス	3.8	3.9	6,037
T I S	26.5	29.3	154,118
ネオス	2.8	3.3	3,412
電算システム	2.8	3.4	8,551
グリー	42.6	60.9	28,318
コーエーテクモホールディングス	13.8	18	33,354
三菱総合研究所	3.3	3.4	11,271
ボルテージ	1.6	1.6	924
電算	0.8	0.9	1,997
A G S	4.6	5.1	3,590
ファインデックス	6.8	7.6	6,110
ヒト・コミュニケーションズ	1.8	2	3,252
ブレインバッド	1.8	1.7	8,755
K L a b	15.5	15.9	12,847
ポルトカウイン・ビットクルーホールディ	5.8	11.7	10,307
イーブックイニシアティブジャパン	1.3	1.4	2,191
ネクソン	88.5	223.8	366,584
アイスタイル	19.8	22.5	15,412
エムアップ	2.7	3	6,429
エイチーム	5.5	5.5	10,411
テクノスジャパン	7.4	7.5	5,857
コロブラ	26	25.5	18,003
モバイルクリエイト	7.1	—	—
ブロードリーフ	19.8	43.4	24,911
クロス・マーケティンググループ	—	2.5	1,072
デジタルハーツホールディングス	4.2	4	5,280
メディアドゥホールディングス	2.6	2.7	6,455
じげん	—	9.3	6,175
ブイキューブ	5.1	5	2,105
サイバーリンクス	1.3	1.5	1,422
ディー・エル・イー	5.1	—	—
フィックスターズ	1.4	8.4	10,836
CART A H O L D I N G S	4.1	4.7	4,944
オブティム	1.4	1.9	7,486
セレス	2.5	2.9	5,466

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ベリサーブ	1.1	0.9	6,012
ティーガイア	7.8	8.7	17,591
セック	0.8	1.4	5,208
日本アジアグループ	8.8	9.2	3,385
豆蔵ホールディングス	5.9	6	6,300
テクマトリックス	4.4	6.2	11,222
プロシップ	1.2	2.5	3,392
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	215.5	211.8	64,175
GMOペイメントゲートウェイ	5.6	14.5	92,220
ザッパラス	4.5	4.6	1,821
システムリサーチ	0.8	1.2	3,702
インターネットイニシアティブ	12.9	14.3	36,164
さくらインターネット	9.5	10.9	5,711
ヴィンクス	0.3	3	3,423
GMOクラウド	1.8	2	6,860
S R Aホールディングス	4.2	4.6	12,245
M i n o r i ソリューションズ	1.5	1.7	2,782
システムインテグレータ	1.4	2.5	1,720
朝日ネット	6.9	6.9	3,560
e B A S E	1.6	2.6	4,583
アバント	—	3.1	4,507
アドソル日進	3.1	3.1	5,443
フリービット	5.3	5.2	5,075
コムチュア	4	4.9	15,116
サイバーコム	1.5	1.6	4,048
アステリア	—	4.5	3,771
マークライنز	—	3	4,455
メディカル・データ・ビジョン	3	7.8	8,876
g u m i	9.4	11.3	6,644
ショーケース・ティービー	1.6	2	1,566
モバイルファクトリー	1.5	2.5	3,617
テラスカイ	—	0.5	1,955
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1.3	3.9	5,865
P C Iホールディングス	1.4	1.6	3,656
パイプドHD	1.3	1.4	1,177
アイビーシー	0.9	1.5	1,794
ネオジャパン	—	1.7	1,747
P R T I M E S	—	0.6	1,411
ランドコンピュータ	—	1.1	1,255



銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ダブルスタンダード	—	0.6	—	3,006
オープンドア	3.3	4.4	—	13,860
マイネット	1.6	2.9	—	3,250
アカツキ	1.6	3.1	—	17,639
ベネフィットジャパン	—	0.6	—	499
Ubicomホールディングス	0.8	1.6	—	2,022
LINE	23.8	26.7	—	108,001
カナミックネットワーク	—	1.3	—	2,579
ノムラシステムコーポレーション	—	0.8	—	580
チェンジ	—	1.1	—	4,196
シンクロ・フード	0.7	3.8	—	2,838
オークネット	2.4	4.6	—	4,595
AOI TYO Holdings	6.6	9.7	—	7,575
マクロミル	7.4	15.6	—	21,606
ビーグリー	—	1.7	—	1,659
オロ	—	0.9	—	4,329
ソルクシーズ	3.1	3.8	—	2,458
フェイス	2.8	3.4	—	2,580
ハイマックス	0.9	1	—	1,833
野村総合研究所	53.1	55.9	—	247,637
サイバネットシステム	6.6	7.6	—	4,537
CEホールディングス	2.4	2.5	—	1,830
日本システム技術	1	1.4	—	1,936
インテージホールディングス	9.2	11.3	—	9,627
東邦システムサイエンス	2.4	2.7	—	2,459
ソースネクスト	11.2	34.1	—	18,038
インフォコム	—	3.6	—	14,418
FIG	—	8.2	—	2,812
アルテリア・ネットワークス	—	7.3	—	9,336
フォーカスシステムズ	4.6	5.9	—	6,130
クレスコ	1.8	2.7	—	9,261
フジ・メディア・ホールディングス	83.2	91.2	—	149,659
オービック	25	30.5	—	315,065
ジャストシステム	12.9	12.5	—	33,612
TDCソフト	3.4	7.6	—	7,197
ヤフー	573	572.9	—	177,026
トレンドマイクロ	38.8	46.8	—	246,636
インフォメーション・ディベロプメント	2.5	2.5	—	3,465
日本オラクル	12.9	17.8	—	147,740

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
アルファシステムズ	2.5	2.7	—	7,241
フューチャー	10.6	11.8	—	20,803
CAC Holdings	5.9	6.3	—	7,560
ソフトバンク・テクノロジー	3.3	3.7	—	7,799
トーセ	2.2	2.5	—	2,030
オービックビジネスコンサルタント	4	8.9	—	39,026
伊藤忠テクノソリューションズ	18.1	40	—	104,920
アイティフォー	9.8	10.7	—	8,988
東計電算	1.4	1.3	—	3,984
エクスネット	1.2	1.8	—	1,522
大塚商会	23.9	47.5	—	193,087
サイボウズ	10.8	10.2	—	6,609
ソフトブレーン	6.4	7	—	3,654
電通国際情報サービス	4.9	5.4	—	20,115
デジタルガレージ	14.3	17.1	—	49,743
EMシステムズ	2.7	7.2	—	9,086
ウェザーニューズ	2.7	2.9	—	9,077
CIJ	6.2	7	—	5,677
東洋ビジネスエンジニアリング	0.7	0.9	—	1,778
日本エンタープライズ	9.3	10	—	1,780
WOWOW	3.8	4.2	—	12,684
スカラ	6.3	6.2	—	5,245
IMAGICA GROUP	6.8	7.6	—	3,845
ネットワンシステムズ	32.6	31.1	—	79,118
システムソフト	19.6	23.4	—	2,340
アルゴグラフィックス	3.7	3.7	—	18,407
マーベラス	13.7	13.5	—	12,244
エイベックス	15	15.2	—	21,568
日本ユニシス	21.9	27.4	—	78,583
兼松エレクトロニクス	5	4.8	—	15,816
東京放送ホールディングス	47.9	58.3	—	112,577
日本テレビホールディングス	73	80.7	—	145,017
朝日放送グループホールディングス	7.7	8.9	—	6,879
テレビ朝日ホールディングス	21.7	24.1	—	48,151
スカパーJ SATホールディングス	59.9	66.7	—	33,216
テレビ東京ホールディングス	6.4	7.2	—	17,956
日本BS放送	2.7	2.7	—	2,878
ビジョン	2	2.7	—	12,825
スマートバリュー	—	1.9	—	1,645

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
USEN-NEXT HOLDINGS	2.1	3.4	3,199	
ワイヤレスゲート	3.8	4	1,716	
コネクシオ	5.6	6.2	8,946	
日本通信	74	76.8	9,984	
クロップス	1.8	1.7	1,132	
日本電信電話	570.3	601	2,823,498	
KDDI	715.6	774.3	2,104,934	
ソフトバンク	—	698.7	943,245	
光通信	9.6	10.4	211,016	
NTTドコモ	588.3	630.9	1,645,071	
エムティーアイ	10.7	10.3	6,489	
GMOインターネット	28.9	32	58,400	
アйдママーケティングコミュニケーション	1.3	2	1,012	
カドカワ	23.4	25.8	28,896	
学研ホールディングス	2.6	3	16,110	
ゼンリン	9.6	17.5	54,687	
昭文社	3.9	4.7	2,303	
インプレスホールディングス	8.6	8.3	1,294	
アイネット	4.5	5	7,065	
松竹	5.3	5.8	66,294	
東宝	52.3	57.8	233,801	
東映	3	3.7	49,950	
エス・ティ・ティ・データ	246.9	234	284,778	
ビー・シー・エー	1.1	1.2	2,816	
ビジネスブレイン太田昭和	1.4	1.5	3,232	
DTS	8.3	9.7	39,673	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	36.9	40.9	129,653	
シーイーシー	4.7	9.4	21,742	
カブコン	17	37.7	84,410	
アイ・エス・ビー	1.6	1.7	3,751	
ジャステック	4.6	5.1	4,992	
SCSK	18.3	23.2	112,752	
日本システムウェア	2.6	2.9	5,736	
アイネス	9.9	11.2	14,660	
TKC	7.3	7.4	28,009	
富士ソフト	11	13.1	59,146	
NSD	13.1	14.2	35,230	
コナミホールディングス	32.5	35.9	159,934	
福井コンピュータホールディングス	2.3	2.9	5,611	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
J BCCホールディングス	6.4	6.9	11,295	
ミロク情報サービス	7	8.7	24,516	
ソフトバンクグループ	359.8	367.2	3,818,880	
<b>卸売業 (5.1%)</b>				
ハウスイ	0.8	1	903	
高千穂交易	3	3.5	3,542	
伊藤忠食品	1.9	2.2	10,736	
エレマテック	3.7	4.1	7,638	
JALUX	2.3	2.4	6,050	
あらた	3.9	4.9	21,731	
トーマンデバイス	1.1	1.3	3,194	
東京エレクトロン デバイス	2.7	3.1	5,744	
フィールズ	6.6	8.1	5,848	
双日	472	487.1	207,017	
アルフレッサ ホールディングス	88.6	98	315,070	
横浜冷凍	19.1	23.3	21,622	
ラサ商事	3.5	4.8	4,161	
ラクーンホールディングス	4.9	4.2	2,847	
アルコニックス	8.5	9.4	11,947	
神戸物産	5.2	13.3	48,678	
ベッパーフードサービス	4.3	—	—	
あい ホールディングス	12.7	12.7	24,853	
ディーブイエックス	2.9	3.3	3,847	
ダイワボウホールディングス	6.8	8	51,280	
マクニカ・富士エレホールディングス	14.7	24.4	39,015	
ラクト・ジャパン	1.1	1.9	16,131	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14.7	16.4	17,908	
八洲電機	6	6.5	5,395	
メディアスホールディングス	1.5	5	3,725	
UKCホールディングス	5.2	5.7	11,707	
ジュアテックホールディングス	1.9	2.1	2,173	
大光	2	2.8	1,716	
OCHIホールディングス	2.4	2.6	3,226	
TOKAIホールディングス	42	46.5	43,012	
黒谷	—	1.7	793	
Cominix	1.3	1.6	1,350	
三洋貿易	4.4	4.4	9,191	
ビューティガレージ	1.1	1.4	2,098	
ウイン・パートナーズ	5.8	5.7	6,549	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ミタチ産業	1.9	2.7	1,987	
シップヘルスケアホールディングス	16.6	18.4	79,396	
明治電機工業	2.8	2.8	5,101	
デリカフーズホールディングス	1.7	1.7	2,286	
スターティアホールディングス	2	1.9	1,098	
コメダホールディングス	14.7	20.2	43,167	
富士興産	2.9	3.4	2,274	
協栄産業	1	1.1	1,758	
小野建	6.8	7.7	12,350	
南陽	—	1.8	4,046	
佐島電機	5.9	6.6	6,580	
エコートレーディング	1.8	1.7	1,018	
伯東	4.8	6	7,404	
コンドーテック	6.3	6.7	6,968	
中山福	4.1	5.1	2,830	
ナガイレーベン	10.6	12.8	30,105	
三菱食品	8.7	9.6	27,724	
松田産業	5.7	6.4	9,414	
第一興商	11.9	13.1	72,574	
メディバルホールディングス	79.9	95.2	252,280	
S P K	1.7	1.9	4,390	
萩原電気ホールディングス	2.7	3.2	9,776	
アズワン	6.2	6.3	52,479	
スズデン	2.9	3.1	5,304	
尾家産業	2.4	2.8	3,567	
シモジマ	4.9	5.5	6,248	
ドウシシャ	8.5	8.4	14,506	
小津産業	1.9	2	3,742	
高速	4.6	5.3	6,275	
たけびし	2.9	3.3	4,785	
黒田電気	6	—	—	
リックス	1.8	2	3,326	
丸文	6.7	7.4	5,261	
ハピネット	5.5	7.5	11,040	
橋本総業ホールディングス	1.7	1.6	2,385	
日本ライフライン	22.7	27.6	48,548	
タカショー	—	4.9	2,097	
エクセル	3.2	3.4	7,922	
マルカキカイ	2.6	2.9	6,171	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
I DOM	24.4	29.9	10,853	
日本エム・ディ・エム	5.5	5.2	5,985	
進和	4.8	5.2	11,450	
エスケイジャパン	2.2	2.2	1,526	
ダイترون	3.7	4.1	6,961	
シークス	5	11.3	19,763	
田中商事	2.4	3	1,830	
オーハシテクニカ	4.5	5.1	7,323	
白銅	2.9	2.7	4,536	
伊藤忠商事	585.4	616.9	1,252,615	
丸紅	655.5	869.7	714,197	
高島	1.3	1.2	2,208	
長瀬産業	48.1	49.6	82,385	
蝶理	4.9	5.5	8,717	
豊田通商	89	98.4	355,716	
三共生興	14.4	15.9	6,980	
兼松	34	35.1	45,981	
ツカモトコーポレーション	1.9	1.7	1,735	
三井物産	677.6	726.6	1,310,059	
日本紙パルプ商事	4.1	5	21,125	
日立ハイテクノロジーズ	27.7	26.8	115,240	
カメイ	10.4	11.5	14,294	
東都水産	1.1	1.3	3,318	
OUGホールディングス	1.1	1.4	3,508	
スターゼン	3.1	3.2	12,864	
山善	31.1	34.2	40,937	
椿本興業	1.7	2	7,230	
住友商事	503.1	521.6	863,248	
内田洋行	3.6	4	9,412	
三菱商事	559.7	618.9	2,013,900	
第一実業	3.7	3.9	13,611	
キャノンマーケティングジャパン	22.8	25.2	53,222	
西華産業	4.9	4.9	7,531	
佐藤商事	7	7.8	7,503	
菱洋エレクトロ	7.4	9	13,959	
東京産業	8	9	4,914	
ユアサ商事	7.5	9	30,735	
神鋼商事	1.8	2	5,036	
小林産業	5.5	5.4	1,571	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
阪和興業	14.9	15.3	50,566	
正栄食品工業	4.4	4.7	14,405	
カナデン	7.6	8.4	10,911	
菱電商事	5.7	6.7	9,922	
フルサト工業	4.2	4.9	8,183	
岩谷産業	17.7	19.6	71,638	
すてきなイスグループ	3.3	4	3,564	
昭光通商	31	3.4	2,121	
ニチモウ	1.2	1.4	2,417	
極東貿易	12	2.8	4,863	
イワキ	12	10.6	4,441	
三愛石油	21.3	23.5	23,194	
稲畑産業	19.2	21.3	33,632	
G S I クレオス	2.3	2.5	3,035	
明和産業	7.6	7.5	3,487	
ワキタ	17.2	18.8	22,860	
東邦ホールディングス	23.6	26.1	70,887	
サンゲツ	27	26.5	55,385	
ミツウロコグループホールディングス	11.5	12.7	10,388	
シナネンホールディングス	3.7	3.5	7,756	
伊藤忠エネクス	17.6	19.3	18,296	
サンリオ	22.5	27.2	63,784	
サンワテクノス	4.7	5.2	5,080	
リョーサン	10	9.7	30,167	
新光商事	8.8	8.3	15,770	
トーヨー	3.7	4	8,384	
三信電気	7.4	7.3	13,687	
東陽テクニカ	9.2	10.3	9,187	
モスフードサービス	10.4	11.5	31,728	
加賀電子	7.2	8.8	18,744	
ソーダニッカ	8	9.3	5,208	
立花エレテック	5.2	6.3	10,634	
フォーバル	3.5	4	3,356	
PAL TAC	11.1	15.9	90,630	
三谷産業	8.3	10.4	2,922	
太平洋興発	3.4	3.5	2,737	
西本Wismettacホールディングス	1.6	2	8,820	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.6	0.9	1,079	
国際紙バルブ商事	—	15.3	4,299	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ヤマタネ	4.2	4.5	7,492	
丸紅建材リース	8	0.8	1,628	
日鉄住金物産	6.2	6.2	29,481	
泉州電業	2.7	2.9	7,795	
トラスコ中山	16.6	18.3	56,913	
オートバックスセブン	31.7	35.1	65,075	
モリト	6.8	6.5	5,122	
加藤産業	12.4	13.7	50,347	
北恵	—	1.7	1,596	
イノテック	7	5.3	5,586	
イエローハット	7.5	8.3	24,368	
J Kホールディングス	7.8	8.2	4,936	
日伝	6.6	7.2	11,210	
北沢産業	7.5	7.1	1,846	
杉本商事	4.2	4.8	8,520	
因幡電機産業	10.4	12.4	56,048	
パイテックホールディングス	3.5	4	8,136	
東テク	2.6	2.9	6,614	
ミスミグループ本社	92.6	110.4	304,262	
アルテック	7.5	7.2	1,648	
タキヒヨー	2.6	2.7	4,903	
蔵王産業	1.4	1.6	2,118	
スズケン	36.4	40.2	241,602	
ジェコス	5.4	6.1	6,514	
ルネサスイーストン	7.3	8.2	3,665	
<b>小売業 (4.9%)</b>				
ローソン	20.2	22.3	151,417	
サンエー	6	6.7	29,781	
カワチ薬品	6.3	6.8	14,137	
エービーシー・マート	14.5	13.8	88,182	
ハードオフコーポレーション	3.5	3.4	2,767	
アスクル	6.9	9.2	21,767	
ゲオホールディングス	14.6	13.4	21,989	
アダストリア	12.3	12.2	23,924	
ジーフット	4.9	5.9	4,035	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1.4	1.3	1,012	
くらコーポレーション	4.7	5.2	29,276	
キャンドウ	4	4.3	6,785	
バルグループホールディングス	4.1	4.5	13,905	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エディオン	30.7	37.3	36,442
サーラコーポレーション	13.9	18	10,512
ワッツ	3.4	3	2,217
ハローズ	3.1	3.3	7,078
フジオフードシステム	—	2.9	6,870
あみやき亭	1.7	1.9	7,001
ひらまつ	11.7	18.1	6,335
大黒天物産	1.9	2.1	8,610
ハニーズホールディングス	7.8	7.8	7,449
ファーマライズホールディングス	2.1	2.3	1,301
アルペン	6.1	6.6	10,863
ハブ	1.5	2.9	2,775
クオールホールディングス	8.8	13	19,188
ジンズ	5.4	6	32,460
ビックカメラ	46	47.1	58,639
DCMホールディングス	42.5	46.9	52,340
ベッパーフードサービス	—	7	19,082
Monotaro	28.3	55.7	138,470
東京一番フーズ	2.4	2.6	1,591
DDホールディングス	1.8	2	4,298
きちりホールディングス	2.4	2.5	1,815
アークランドサービスホールディングス	6.7	6.4	13,062
J. フロント リテイリング	95.2	112.8	139,082
ドトール・日レスホールディングス	13.9	15.3	33,522
マツモトキヨシホールディングス	33	36.5	141,255
ブロンコピリー	4.2	4.6	12,420
ZOZO	78.4	95.3	164,964
トレジャー・ファクトリー	2.3	2.7	2,025
物語コーポレーション	2.3	2.2	20,944
ココカラファイン	8.3	9.9	49,302
三越伊勢丹ホールディングス	149.1	165	181,665
Hamee	2	2.7	2,216
ウエルシアホールディングス	21.1	23.3	94,481
クリエイトSDホールディングス	11.8	13	37,622
丸善CHIホールディングス	9.3	9.4	3,158
ミサワ	1.8	2.5	1,077
ティーライブ	1.2	1.3	1,332
エー・ピーカンパニー	1.5	1.9	946
チムニー	2.3	2.6	6,905

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シュッピン	4.9	6.1	4,703
ネクステージ	8.5	13.6	13,749
ジョイフル本田	11.7	25.7	37,290
鳥貴族	3	3	5,451
キリン堂ホールディングス	3	3.5	5,446
ホットランド	4.8	4.8	6,547
すかいらくホールディングス	49.5	82.2	140,233
綿半ホールディングス	3	3.3	7,639
ヨシックス	1.3	1.4	4,389
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	26.6	25.5	29,937
ブックオフコーポレーション	4.5	—	—
ゴルフダイジェスト・オンライン	3.2	3.7	2,275
BEENOS	1.3	2.1	2,461
あさひ	5.9	7.2	10,864
日本調剤	2.8	3.2	12,592
コスモス薬品	4	3.9	82,251
トーエル	4	4.4	3,115
一六堂	2.4	0.6	308
オンリー	1.3	1.7	1,683
セブン&アイ・ホールディングス	334.3	369.7	1,839,627
薬王堂	3.5	3.8	9,959
クリエイト・レストランツ・ホールディング	21.5	23.7	30,501
ツルハホールディングス	17.1	19.2	189,312
サンマルクホールディングス	5.8	7	17,983
フェリシモ	2.3	2	2,270
トリドールホールディングス	9.8	10.9	24,612
TOKYO BASE	1.7	8	7,208
ウイルプラスホールディングス	—	1	750
ジャパンミート	—	3.3	5,844
サツドラホールディングス	1.3	1.3	2,467
デファクトスタンダード	—	0.7	273
ダイユー・リックホールディングス	3.8	4.8	4,862
パロックジャパンリミテッド	6.5	7.2	6,588
クスリのアオキホールディングス	6.3	8.8	67,760
力の源ホールディングス	—	2.5	2,000
スシローグローバルホールディングス	7.7	9.7	69,840
LIXILピバ	7.5	7.4	10,804
メディカルシステムネットワーク	9.3	10	4,400
総合メディカル	3.5	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
はるやまホールディングス	3.5	4.2	3,595
ノジマ	13.9	15.7	31,965
カッパ・クリエイト	10.2	12.5	17,650
ライトオン	6.8	7.5	6,075
良品計画	10.6	12.5	333,750
三城ホールディングス	10.2	10.7	4,312
アドヴァン	8.1	13.5	13,635
アルビス	1.8	3.4	7,979
コナカ	10	11.7	5,124
ハウス オブ ローゼ	1	1.2	2,197
G-7ホールディングス	2.3	2.5	5,645
イオン北海道	7.1	8.4	6,610
コジマ	14.1	13.2	8,646
ヒマラヤ	2.4	2.8	2,783
コーナン商事	11.3	11.5	32,970
エコス	3.3	3.3	5,619
ワタミ	9.5	11.8	19,068
マルシェ	2.6	2.7	2,087
パン・パシフィック・インターナショナルホ	51.7	52.8	360,624
西松屋チェーン	17.4	19.5	17,764
ゼンショーホールディングス	41.4	41.6	104,332
幸楽苑ホールディングス	5.3	5.7	13,246
ハークスレイ	1.5	1.7	1,934
サイゼリヤ	11.8	14.6	30,090
V Tホールディングス	27.1	29.8	12,545
魚力	2	2.3	3,362
ポプラ	2.5	2.6	1,487
フジ・コーポレーション	1.4	1.8	3,803
ユナイテッドアローズ	9.9	10.1	36,107
ハイデイ日高	8.8	11.6	26,923
京都市の友禅	5.4	6.1	2,684
コロワイド	26.5	29.3	69,235
ピーシーデポコーポレーション	12	11.9	5,450
壺番屋	5.6	6.2	30,008
トップカルチャー	2.2	4	1,196
PLANT	1.9	1.9	1,911
スギホールディングス	17.5	19.4	92,344
ヴィア・ホールディングス	7.5	10.9	7,259
スクロール	12.7	13.8	5,451

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヨンドシーホールディングス	8.2	9.9	21,364
ユニー・ファミリーマートホールディングス	25.5	24.7	315,419
木曾路	9.8	10.8	27,864
SRSホールディングス	9.2	10	10,160
千趣会	15.4	17	4,114
タカキュー	7.8	7	1,309
ケーヨー	15	16.4	8,921
上新電機	9.4	10.4	24,138
日本瓦斯	14.7	14.3	57,700
ロイヤルホールディングス	14.1	15.4	41,426
東天紅	0.6	0.7	926
いなげや	9.1	9.8	13,259
島忠	19.3	20	59,820
チヨダ	9.4	9.2	17,397
ライフコーポレーション	6	6.7	16,388
リンガーハット	9.8	10.9	25,942
さが美グループホールディングス	8	—	—
MrMaxHD	10.2	12.5	6,350
テナライド	8.2	7.9	3,270
AOKIホールディングス	15.7	17.5	22,155
オークワ	11	12.5	14,087
コメリ	12.3	13.6	37,903
青山商事	15.3	15.4	42,735
しまむら	9.3	10.3	94,451
はせがわ	3.9	4.8	1,876
高島屋	125	69.2	103,177
松屋	16.3	17.8	19,366
エイチ・ツー・オー リテイリング	37.8	45.3	70,668
近鉄百貨店	3	3.4	11,730
パルコ	7.7	8.6	9,881
丸井グループ	76.4	74.6	150,542
アクシアル リテイリング	6.7	7.3	25,550
イオン	306.9	339.4	811,166
イズミ	14.4	17.9	96,660
東武ストア	1.1	—	—
平和堂	16.2	17.8	44,873
フジ	9.1	10.6	19,800
ヤオコー	9	10	59,800
ゼビオホールディングス	10.9	10.4	13,530

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ケーズホールディングス	33.8	91.6	91,783	
Olympicグループ	5	5.3	4,065	
日産東京販売ホールディングス	11.5	13.2	4,342	
Genky DrugStores	3.1	4.3	11,231	
総合メディカルホールディングス	—	7.7	14,753	
ブックオフグループホールディングス	—	4.8	3,792	
アインホールディングス	10.7	11.8	88,028	
元気寿司	2.1	2.5	9,675	
ヤマダ電機	267.3	268.7	143,217	
アークランドサカモト	13.3	14.8	21,371	
ニトリホールディングス	31.7	38.2	536,710	
グルメ杵屋	6	6.3	7,427	
愛眼	6.7	7.3	2,277	
ケーユーホールディングス	4	4.4	3,722	
吉野家ホールディングス	26.1	30.7	56,917	
松屋フーズホールディングス	3.8	4.2	15,477	
サガミホールディングス	10.6	12	16,404	
関西スーパーマーケット	6.2	6.8	6,840	
王将フードサービス	5.8	6.4	47,232	
ブレナス	8.9	9.9	17,859	
ミニストップ	6	6.5	12,460	
アークス	14.9	16.5	42,322	
パローホールディングス	18.5	19	52,003	
藤久	0.7	0.8	596	
ベルク	3.5	4.3	21,801	
大庄	4.3	4.5	7,033	
ファーストリテイリング	13.3	11.8	594,012	
サンドラッグ	33.8	33.2	115,868	
サックスパー ホールディングス	7.6	7.5	8,370	
ヤマザワ	1.5	1.8	3,214	
やまや	1.7	1.5	3,601	
ペルーナ	19.5	21.6	19,634	
<b>銀行業 (6.3%)</b>				
島根銀行	1.9	1.9	1,331	
じもとホールディングス	54.1	61.1	7,515	
めぶきフィナンシャルグループ	415.1	458.9	140,423	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10.8	12.1	19,747	
九州フィナンシャルグループ	131.1	144.9	66,654	
ゆうちょ銀行	226.3	250.2	315,252	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
富山第一銀行	20.2	20.4	7,915	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	485.7	562.5	257,062	
西日本フィナンシャルホールディングス	54.2	56.6	56,543	
関西みらいフィナンシャルグループ	—	41.3	33,907	
三十三フィナンシャルグループ	—	7.4	11,832	
第四北越フィナンシャルグループ	—	15.3	53,932	
新生銀行	69.2	64.8	98,949	
あおぞら銀行	47.6	49.3	159,485	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,643.6	6,151	3,610,637	
りそなホールディングス	876.6	969.2	493,807	
三井住友トラスト・ホールディングス	157	173.6	730,856	
三井住友フィナンシャルグループ	604.6	622.5	2,515,522	
第四銀行	9.7	—	—	
北越銀行	8	—	—	
千葉銀行	286	312.8	212,391	
群馬銀行	162.2	176.7	84,639	
武蔵野銀行	12.6	13.1	31,282	
千葉興業銀行	22.5	24.8	8,332	
筑波銀行	34.6	38	7,828	
七十七銀行	25.1	27.6	51,115	
青森銀行	6.2	6.9	19,740	
秋田銀行	5	5.7	12,420	
山形銀行	9	10	19,450	
岩手銀行	5.6	6.2	20,615	
東邦銀行	70.4	79.1	24,441	
東北銀行	4.2	4.5	4,927	
みちのく銀行	4.8	5.4	8,677	
ふくおかフィナンシャルグループ	324	71.7	177,314	
静岡銀行	211	222.3	196,957	
十六銀行	10.7	11.9	27,500	
スルガ銀行	81.7	90.6	48,924	
八十二銀行	144.6	159.9	75,792	
山梨中央銀行	50	10.7	15,204	
大垣共立銀行	12.7	13.8	31,381	
福井銀行	6.9	7.7	12,227	
北國銀行	9	9.3	31,945	
清水銀行	2.8	3.8	6,695	
富山銀行	1.6	1.8	5,679	
滋賀銀行	75	17.5	45,465	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
南都銀行	9.4	10.2	22,786
百五銀行	75.9	79.2	30,729
京都銀行	30.5	31.6	147,888
紀陽銀行	29.8	31.1	48,484
三重銀行	3.7	—	—
ほくほくフィナンシャルグループ	53.2	58.8	73,088
広島銀行	117.9	130.4	84,108
山陰合同銀行	46.9	52	42,588
中国銀行	55.2	57	60,135
鳥取銀行	2.6	3.3	4,613
伊予銀行	114	117	72,891
百十四銀行	85	9.4	23,067
四国銀行	12.1	12.6	12,978
阿波銀行	64	14.1	43,216
大分銀行	4.6	5.5	18,425
宮崎銀行	5.3	5.9	15,912
佐賀銀行	4.8	5.4	9,752
十八銀行	50	5.4	14,812
沖縄銀行	7.7	8	27,160
琉球銀行	15.7	20.1	23,376
セブン銀行	299.6	298.4	102,052
みずほフィナンシャルグループ	10,853.1	12,001.4	2,114,646
高知銀行	3.1	3.9	2,843
山口フィナンシャルグループ	75	110.2	116,591
長野銀行	2.6	3	4,662
名古屋銀行	6.5	7.1	24,637
北洋銀行	121.1	132.1	40,422
愛知銀行	2.7	3.2	10,976
第三銀行	4.6	—	—
中京銀行	3.2	3.7	7,988
大光銀行	2.8	3.2	5,340
愛媛銀行	11.2	12.2	13,273
トマト銀行	2.8	3.3	3,504
みなと銀行	7.2	—	—
京葉銀行	71	38.5	27,219
関西アーバン銀行	10.9	—	—
栃木銀行	41.3	45.1	10,778
北日本銀行	2.6	2.8	5,877
東和銀行	14.1	15.7	11,099

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
福島銀行	7.5	8.1	3,167
大東銀行	3.9	4.5	2,817
トモニホールディングス	65.9	68.3	27,524
フィデアホールディングス	78.7	87.5	11,550
池田泉州ホールディングス	84.7	93.7	28,016
<b>証券、商品先物取引業 (0.8%)</b>			
F P G	27.9	27.7	29,251
マーキュリアインベストメント	1.6	3.4	2,329
S B Iホールディングス	90.3	105.2	242,696
ジャフコ	11.5	14.5	57,275
大和証券グループ本社	684	708.7	410,975
野村ホールディングス	1,374.3	1,554	688,111
岡三証券グループ	68	75	36,675
丸三証券	25.9	26.8	21,895
東洋証券	29	33.3	5,427
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	88.4	104.9	52,345
光世証券	2.2	2.7	2,041
水戸証券	25.3	26	6,890
いちよし証券	17	18.6	16,256
松井証券	38.8	43.1	51,504
だいこう証券ビジネス	4.1	3.9	1,684
マネックスグループ	85	82.7	36,057
カブドットコム証券	52.4	66	36,960
極東証券	10.9	11.6	13,850
岩井コスモホールディングス	8.2	8.8	11,140
藍潭證券	15.1	16.3	11,393
マネーパートナーズグループ	10.5	11.4	3,351
<b>保険業 (2.3%)</b>			
かんぽ生命保険	30.2	33.4	82,765
S O M P Oホールディングス	156.7	155.7	657,365
アニコム ホールディングス	5.5	7.2	21,528
MS&ADインシュアランスグループホール	208.9	230.9	776,054
ソニーフィナンシャルホールディングス	65.6	72.6	154,057
第一生命ホールディングス	451.9	499.7	851,988
東京海上ホールディングス	300.9	320.1	1,782,957
アドバンテッジリスクマネジメント	1.1	—	—
T & Dホールディングス	247	273.2	375,513
アドバンスクリエイト	1.9	2.1	3,633



銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
<b>その他金融業 (1.2%)</b>				
全国保証	22.5	24.9	101,094	
ジェイリース	—	2.2	869	
イントラスト	0.6	2.7	1,171	
日本モーゲージサービス	—	1.1	1,442	
C a s a	—	3.1	3,348	
アルヒ	6.8	8	19,440	
プレミアグループ	—	1.8	5,832	
クレディセゾン	60.6	61.9	98,544	
アクリーティブ	4.7	—	—	
芙蓉総合リース	9.1	10.1	56,459	
興銀リース	14.9	16.5	44,599	
東京センチュリー	16.1	17.8	92,382	
日本証券金融	32.9	38.8	24,211	
アイフル	135.5	135.6	41,493	
リコーリース	6.3	6.9	23,736	
イオンフィナンシャルサービス	56.7	56.4	124,136	
アコム	160.6	180	69,840	
ジャックス	9.8	9.9	18,879	
オリエントコーポレーション	177.3	243.3	28,466	
日立キャピタル	22	20.8	52,873	
アプラスフィナンシャル	43.8	46.2	3,973	
オリックス	532.8	589.2	965,698	
三菱UFJ リース	202.7	199.2	114,739	
九州リースサービス	3.4	4.8	3,379	
日本取引所グループ	234.7	238.6	476,961	
イー・ギャランティ	2.2	8.4	8,988	
アサックス	0.9	3.8	2,059	
NECキャピタルソリューション	3.3	3.6	5,936	
<b>不動産業 (2.4%)</b>				
いちご	114.5	112.5	43,087	
日本駐車場開発	97.7	108.3	16,786	
ヒューリック	166.7	184.3	188,907	
三栄建築設計	3.3	3.7	6,097	
スター・マイカ	2.9	4	5,524	
野村不動産ホールディングス	53.1	58.8	122,068	
三重交通グループホールディングス	16.5	18.1	11,059	
サムティ	6.9	12.2	18,690	
ディア・ライフ	8.1	11.5	5,037	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
コーセーアールイー	—	2.7	2,054	
エー・ディー・ワークス	113.6	146.5	4,981	
日本商業開発	4.7	5.8	8,955	
プレサンスコーポレーション	10.9	14	19,334	
ユニゾホールディングス	9.4	13.4	28,555	
THEグローバル社	4	4.5	2,236	
日本管理センター	5.4	6.1	4,733	
サンセイランディック	2.5	2.5	1,885	
エストラスト	1.3	1.6	1,265	
フージャースホールディングス	19.4	19.4	13,250	
オープンハウス	13	14.4	56,232	
東急不動産ホールディングス	193.4	237.6	147,549	
飯田グループホールディングス	66.6	73.7	148,800	
イーランド	1	1.7	1,154	
ムゲンエステート	5.1	6.4	3,948	
ビーロッド	—	1.4	2,067	
ファーストブラザーズ	2.3	2.4	2,700	
ハウスドゥ	1.3	4.9	7,658	
シーアールイー	1.4	3.1	2,876	
プロパティエージェント	—	1	1,127	
ケイアイスター不動産	2.9	2.5	4,382	
アグレ都市デザイン	—	1.3	821	
グッドコムアセット	—	1.6	2,339	
ジェイ・エス・ビー	—	0.3	1,258	
テンポイノベーション	—	0.8	1,440	
グローバル・リンク・マネジメント	—	0.6	442	
パーク24	44.3	51.6	137,462	
バラカ	2.6	2.3	4,374	
三井不動産	398.9	468.6	1,255,848	
三菱地所	594.6	618.8	1,184,383	
平和不動産	14.3	16.8	34,053	
東京建物	87.3	96.5	123,616	
ダイビル	20.7	26.2	28,767	
京阪神ビルディング	13.4	16.1	14,779	
住友不動産	192	198.5	844,022	
大京	12.9	—	—	
テーオーシー	27.7	20.4	16,034	
東京楽天地	1.3	1.3	6,025	
レオパレス21	95.3	108.9	22,324	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スターツコーポレーション	10.9	12.1	29,282
フジ住宅	10.4	11.4	9,963
空港施設	8.8	10.2	5,559
明和地所	4.5	5.2	3,182
ゴールドクレスト	6.4	7	11,263
日本エスリード	3.2	3.5	5,638
日神不動産	10.6	13	6,097
日本エスコン	14.3	16	12,224
タカラレーベン	37.8	42.1	15,029
サンヨーハウジング名古屋	4.6	5.3	4,997
イオンモール	51.5	44.3	83,328
毎日コムネット	—	1.9	1,468
ファースト住建	3.1	3.4	4,199
カチタス	8.2	9.9	36,580
トーセイ	9.8	12.3	12,915
穴吹興産	0.9	1	2,850
エヌ・ティ・ティ都市開発	49.7	—	—
サンフロンティア不動産	8.9	12.2	14,957
エフ・ジェー・ネクスト	6.3	7.7	6,829
インテリックス	2.3	2.7	1,827
ランドビジネス	—	4.7	3,835
グランディハウス	7.5	8	3,528
日本空港ビルデング	23.4	28.2	122,247
<b>サービス業 (4.9%)</b>			
日本工営	5.2	5.7	14,688
L I F U L L	26.8	33.3	20,679
ジェイエイシーリクルートメント	6.2	6.8	16,734
日本M&Aセンター	26.8	63.8	185,339
メンバーズ	1.9	2.9	4,379
中広	0.9	1.3	755
タケエイ	8.2	9	7,335
E・Jホールディングス	—	1	1,078
トラスト・テック	3.4	4.7	17,014
コシダカホールディングス	4.1	22.9	37,098
アルトナー	—	1.7	1,591
バソナグループ	7.3	10.4	15,215
CDS	2.1	2.1	2,673
リンクアンドモチベーション	14.3	15.8	14,931
GCA	8.9	9.1	8,180

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エス・エム・エス	15.3	31.4	61,135
サニーサイドアップ	—	0.9	1,431
パーソルホールディングス	71.4	85.6	166,406
リニカル	5	4.8	8,313
クックパッド	24.3	26.9	7,827
エスクリ	2.8	2.4	1,495
アイ・ケイ・ケイ	4.5	4.5	3,357
学情	3.6	3.5	4,616
スタジオアリス	3.8	4.3	10,173
シミックホールディングス	4.3	4.8	7,752
N J S	2	2	3,020
総合警備保障	30.8	34	164,560
カカコム	59.5	64.4	138,202
アイロムグループ	—	3.3	4,933
セントケア・ホールディング	3.3	4.8	2,726
サイネックス	1.2	1.9	1,309
ルネサンス	3.8	4.8	9,628
ディップ	10.9	13.8	27,682
オプトホールディング	5.5	5.3	9,020
新日本科学	9.7	11.8	8,791
ツクイ	18.3	20.3	15,042
キャリアデザインセンター	1.8	2.2	2,679
ベネフィット・ワン	—	11.8	49,029
エムスリー	81.4	180.1	313,914
ツカダ・グローバルホールディング	6	5.2	3,224
プラス	0.5	0.9	520
アウトソーシング	23.1	45.1	60,794
ウェルネット	7.8	8.2	9,036
ワールドホールディングス	2.6	2.3	4,958
ディー・エヌ・エー	41.7	46.1	77,724
博報堂DYホールディングス	107.5	119	212,534
ぐるなび	12.4	12.4	9,076
エスアールジータカミヤ	9.4	8.9	6,123
ジャパンベストレステキュアシステム	9.8	6.8	8,574
ファンコムコミュニケーションズ	21.7	23.8	12,661
ライク	3.1	3.4	3,393
ビジネス・ブレイクスルー	4	4	1,460
WDBホールディングス	3.6	3.9	10,908
ティア	4.2	4.5	3,006

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
CDG	0.7	0.9	1,129
バリュココマース	7	5.8	12,383
インフォマート	39.3	46.9	58,718
J Pホールディングス	25	24.9	7,071
E P Sホールディングス	11.6	13	23,400
レグス	2.1	2.2	2,021
プレステージ・インターナショナル	16.1	16.1	21,252
アミューズ	5.2	5.2	13,046
ドリームインキュベータ	2.6	2.6	3,913
クイック	4.9	5.4	8,532
T A C	5.7	5.1	1,162
ケネディクス	102.5	75.1	42,131
電通	94.3	104.2	511,101
テイクアンドギヴ・ニーズ	3.7	3.3	5,940
びあ	2.6	2.4	9,684
イオンファンタジー	2.5	2.8	7,907
シーティーエス	8	9.7	6,984
ネクシィーズグループ	3	2.6	4,495
みらかホールディングス	23.1	23.9	72,895
アルプス技研	6.8	7.5	14,865
ダイオーズ	1.5	2	2,756
日本空調サービス	8.2	9.2	6,099
オリエンタルランド	91.4	101.1	1,242,013
ダスキン	20.8	23	62,330
明光ネットワークジャパン	9.8	11	10,373
ファルコホールディングス	4.1	4.5	6,426
秀英予備校	1.9	2.2	1,089
ラウンドワン	24.1	26.6	37,506
リゾートトラスト	32.7	36.2	57,377
ビー・エム・エル	9.9	11	37,015
ワタベウエディング	1.5	1.5	1,026
りらいあコミュニケーションズ	12.3	15.4	15,045
リソー教育	13.3	43.4	21,222
早稲田アカデミー	1.1	1.2	2,040
ユー・エス・エス	94.5	104.5	210,672
東京個別指導学院	2.8	3.1	3,692
サイバーエージェント	50.9	52.7	176,808
楽天	396.8	398.8	319,040
クリーク・アンド・リバー社	4.1	5.1	5,972

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テー・オー・ダブリュー	7.4	7.5	6,000
山田コンサルティンググループ	—	2.6	6,367
セントラルスポーツ	2.9	3.2	11,168
フルキャストホールディングス	6.8	8.5	19,295
エン・ジャパン	—	9.3	36,456
リソルホールディングス	0.8	0.9	3,834
テクノプロ・ホールディングス	13.8	17.2	102,684
アトラ	1.4	1.9	763
インターワークス	1.8	2	1,462
アイ・アールジャパンホールディングス	—	2.6	3,767
Ke e P e r 技研	2.6	3.2	3,644
ファーストロジック	1.2	1.8	1,238
三機サービス	0.9	1.8	2,667
G u n o s y	3.5	5.9	15,534
デザインワン・ジャパン	1.5	1.7	576
イー・ガーディアン	3.9	4.1	8,679
リブセンス	5.6	5.1	1,428
ジャパンマテリアル	7	23.4	33,766
ベクトル	9.3	10.4	15,246
ウチヤマホールディングス	3.9	4	1,764
チャーム・ケア・コーポレーション	—	2.1	3,609
ライクキッズネクスト	0.8	2.1	1,827
キャリアリンク	2.8	3.7	1,450
I B J	6.2	5.9	5,386
アサンテ	2.8	3.5	7,738
N・フィールド	4.4	5.6	5,157
バリュエーHR	1.8	1.9	4,199
M&Aキャピタルパートナーズ	1.6	2.2	12,342
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.3	3.6	4,359
E R Iホールディングス	2.6	2.5	2,072
アピスト	1.1	1.3	4,316
シングマクス	3.1	4.1	3,837
ウィルグループ	3.4	5.6	6,552
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	10.8	12	3,252
日本ビューホテル	2.4	2.7	3,053
リクルートホールディングス	597	613	1,854,325
エラン	2	5.9	8,926
土木管理総合試験所	2.4	3.9	2,098
日本郵政	439.1	701.3	950,962

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ベルシステム24ホールディングス	13	14.3	21,664
鎌倉新書	1.1	6.3	11,226
一蔵	1	1.1	688
L I T A L I C O	1.4	2	4,128
グローバルグループ	0.9	1.1	960
エボラブルアジア	1.6	2.5	6,542
アトラエ	—	1.6	4,928
ストライク	0.8	2.2	4,644
ソラスト	4.7	20.9	23,240
セラク	1.3	2	1,220
インソース	0.9	2.8	6,633
バイカレント・コンサルティング	—	4.5	14,827
Orchestra Holdings	—	1.1	946
アイモバイル	—	2.1	1,843
キャリアインデックス	0.8	2.9	2,743
MS-Japan	0.6	3.5	6,188
船場	1.1	1.5	1,372
グレイステクノロジー	—	2.3	5,526
ジャパンエレベーターサービスホールディング	—	5	10,135
フルテック	—	1	1,109
グリーンズ	—	2.4	3,434
ツナグ・ソリューションズ	—	0.9	550
MS&Consulting	—	1	1,155
日総工産	—	2.1	5,571
キュービーネットホールディングス	—	3.9	8,076
スプリックス	—	2.4	6,549
アドバンテッジリスクマネジメント	—	3.4	3,328
リログループ	42.3	46.8	139,136
東祥	4.8	5.3	18,550
エイチ・アイ・エス	12.1	15.2	65,284
ラックランド	1.5	1.7	3,262
共立メンテナンス	13.8	13.1	70,085
イチネンホールディングス	8.6	8.9	11,934
建設技術研究所	5.2	5.9	8,897
スペース	4.8	5.6	7,532
長大	2.3	3.6	2,890
樫ホールディングス	1.8	1.9	4,808

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
スバル興業	0.6	0.6	3,540	
東京テアトル	3.4	4	5,176	
タナベ経営	1.4	1.6	1,960	
ナガワ	1.5	2.4	13,320	
よみうりランド	1.7	1.9	8,113	
東京都競馬	5.8	5.6	19,992	
常磐興産	3.1	3.5	5,607	
カナモト	11.8	12.8	37,260	
東京ドーム	31.6	31.9	31,389	
西尾レントオール	6.8	8.7	29,536	
トランス・コスモス	8.6	9.5	20,748	
乃村工藝社	18.1	20	65,300	
藤田観光	3.1	3.4	9,091	
KNT-CTホールディングス	4.9	4.7	6,110	
日本管財	8.3	9.1	17,371	
トーカイ	7.4	8.2	23,279	
白洋舎	0.9	1	2,894	
セコム	82.1	90.8	864,325	
セントラル警備保障	3.8	4.1	17,876	
丹青社	16	16.1	20,366	
メイテック	9	10.8	54,000	
アサツー ディ・ケイ	3.1	—	—	
応用地質	8.7	9.1	10,574	
船井総研ホールディングス	16.1	17.6	44,246	
進学会ホールディングス	3.4	3.8	2,078	
オオバ	6.7	6.8	4,229	
いであ	1.5	1.9	1,871	
学究社	2	2.7	3,672	
ベネッセホールディングス	28.3	31.3	96,873	
イオンディライト	9.5	10.5	42,997	
ナック	5.7	5.5	5,764	
ニチイ学館	14.9	12.3	15,498	
ダイセキ	13	14.3	37,923	
ステップ	2.8	3.1	4,439	
合 計	株数・金額	97,775	103,559	206,449,762
	銘柄数<比率>	2,030	2,102	<99.4%>

(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	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 1,001	百万円 —

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

(2019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MUFJ証券)	19,917,600	株 (11,258,200)

(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

(2019年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 206,449,762	% 83.5
コール・ローン等、その他	40,748,860	16.5
投資信託財産総額	247,198,622	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年2月20日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	247,163,212,528
コール・ローン等	40,339,816,598
株式(評価額)	206,449,762,530
未収入金	40,909,240
未収配当金	278,412,545
その他未収収益	53,451,615
差入委託証拠金	860,000
(B) 負債	39,557,055,805
未払金	1,174,785
未払解約金	165,985,110
未払利息	△ 25,545
受入担保金	39,389,921,455
(C) 純資産総額(A-B)	207,606,156,723
元本	154,272,164,277
次期繰越損益金	53,333,992,446
(D) 受益権総口数	154,272,164,277口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,457円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 143,491,492,903円  
 期中追加設定元本額 35,057,134,476円  
 期中一部解約元本額 24,276,463,102円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3457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 トピックスインデックスオープン	11,019,208,453円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	1,152,187,332円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	4,246,122,321円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,903,261,972円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	5,081,358,957円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	9,929,461,236円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	46,957,967,724円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	43,675,372,335円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	205,625,068円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	434,320,018円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,875,589,579円
三菱UFJ D/C年金バランス(株式15)	29,597,012円
三菱UFJ D/C年金バランス(株式40)	88,340,468円
三菱UFJ D/C年金バランス(株式65)	96,769,376円
三菱UFJ D/C年金インデックス(国内株式)	664,292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)	25,576,224,967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)	93,167円
合計	154,272,164,277円

## ○損益の状況 (2018年2月21日~2019年2月20日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	4,587,983,188
受取配当金	4,189,834,614
受取利息	109,129
その他収益金	428,702,912
支払利息	△ 30,663,467
(B) 有価証券売買損益	△16,711,832,397
売買益	9,317,255,915
売買損	△26,029,088,312
(C) 先物取引等取引損益	△ 181,833,140
取引益	462,973,420
取引損	△ 644,806,560
(D) 保管費用等	△ 554,168
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△12,306,236,517
(F) 前期繰越損益金	62,774,501,837
(G) 追加信託差損益金	12,987,908,834
(H) 解約差損益金	△10,122,181,708
(I) 計(E+F+G+H)	53,333,992,446
次期繰越損益金(I)	53,333,992,446

(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 外国株式マザーファンド

### 《第19期》決算日2019年5月20日

[計算期間：2018年5月22日～2019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19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19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（除く日本 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 (除く日本 円換算ベース)		株式 組入比率	株 先物比 率	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
15期(2015年5月20日)	20,323	29.1	655,211.07	28.7	96.7	0.9	2.2	160,903
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

- (注) MSCIコクサイ インデックスとは、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（除く日本 円換算ベース）は、MSCIコクサイ インデックス（除く日本 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の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		MSCIコクサイ インデックス ( 除く日本 円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2018年5月21日	円	%		%	%	%	%
5月末	23,482	—	751,162.81	—	95.2	2.5	2.2
6月末	22,851	△ 2.7	729,922.67	△ 2.8	94.7	2.9	2.2
7月末	23,036	△ 1.9	736,364.53	△ 2.0	94.0	3.4	2.3
8月末	23,946	2.0	765,479.78	1.9	93.2	2.6	2.2
9月末	24,462	4.2	781,574.31	4.0	93.4	2.1	2.2
10月末	25,080	6.8	801,770.24	6.7	95.3	2.5	2.2
11月末	22,872	△ 2.6	730,881.84	△ 2.7	97.6	3.3	2.4
12月末	23,403	△ 0.3	747,183.95	△ 0.5	94.3	2.1	2.4
2019年1月末	20,964	△10.7	668,693.64	△11.0	95.0	7.2	2.5
2月末	22,326	△ 4.9	711,588.45	△ 5.3	93.2	2.2	2.5
3月末	23,663	0.8	755,348.88	0.6	92.7	2.5	2.4
4月末	23,830	1.5	760,367.41	1.2	94.6	2.8	2.5
(期 末) 2019年5月20日	24,896	6.0	794,376.04	5.8	92.6	2.2	2.4
	24,065	2.5	767,061.93	2.1	94.3	3.1	2.5

(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2.5%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(2.1%)を0.4%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。



## ●投資環境について

## ◎外国株式市況

- ・外国株式市況は、米国の堅調な企業決算内容などが好感され、上昇しました。

## ◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて0.8%の円高・米ドル安、5.8%の円高・ユーロ安となりました。

## ●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MSCIコクサイインデックス（除く日本円換算ベース）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2.1%の上昇となったため、乖離は0.4%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<sup>※</sup>

※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

## ○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

(2018年5月22日～2019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	%	(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 )	(0.002)	
(投 資 信 託 証 券)	( 0 )	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	( 0 )	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.006	(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)	( 1 )	(0.005)	
(投 資 信 託 証 券)	( 0 )	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	9	0.040	(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 )	(0.036)	
(そ の 他)	( 1 )	(0.004)	
合 計	11	0.049	
期中の平均基準価額は、23,501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

(2018年5月22日～2019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 8,051 ( 1,069)	千アメリカドル 56,178 ( 1,859)	百株 14,710 ( 809)	千アメリカドル 111,494 ( 7,504)
	カナダ	1,580 ( 127)	千カナダドル 5,325 ( 338)	1,992 ( 224)	千カナダドル 8,258 ( 377)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	572 ( 160)	2,750 (△ 977)	1,333	4,980
	イタリア	2,061 ( 311)	810 ( 77)	3,662 ( 246)	1,303 ( 77)
	フランス	700 ( 9)	2,890 (△ 2)	1,261 ( 0.01)	5,101 (0.07578)
	オランダ	340 (△ 238)	1,227 (△ 476)	801	2,356
	スペイン	1,258 ( 7,898)	835 ( 105)	9,569 ( 451)	1,625 ( 16)
	ベルギー	41	244	84	502
	オーストリア	40 ( -)	131 (△ 8)	43	139
	ルクセンブルク	233	283	73	226
	フィンランド	184 ( 59)	299 ( -)	453	622
	アイルランド	164 ( 67)	457 ( 866)	172	1,184
	ポルトガル	14	22	38	62
	イギリス	- ( 231)	- ( 424)	231	407
	イギリス	7,781 ( 47,666)	千イギリスポンド 4,438 (△ 117)	15,598 (48,030)	千イギリスポンド 9,828 ( 4)
	スイス	434 ( 153)	千スイスフラン 2,800 (△ 99)	703 ( 16)	千スイスフラン 5,088 ( 1)
	スウェーデン	468 ( 268)	千スウェーデンクローネ 7,010 ( -)	979 ( 336)	千スウェーデンクローネ 14,383 ( 252)
	ノルウェー	179 ( 25)	千ノルウェークローネ 2,317 ( -)	310	千ノルウェークローネ 3,577

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク	百株 107 ( 5)	千デンマーククローネ 3,577 ( -)	百株 226	千デンマーククローネ 7,917
	オーストラリア	1,953 ( 481)	千オーストラリアドル 2,838 ( 98)	3,657 ( 114)	千オーストラリアドル 5,455 ( 8)
	ニュージーランド	447	千ニュージーランドドル 353	486	千ニュージーランドドル 303
国	香港	2,738 ( 240)	千香港ドル 8,421 ( -)	7,609	千香港ドル 17,268
	シンガポール	778	千シンガポールドル 645	1,430	千シンガポールドル 966
	イスラエル	86 (△ 5)	千イスラエルシケル 294 ( -)	74 ( -)	千イスラエルシケル 483 ( 205)

(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
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HCP INC	0.9	25	2	61
MACERICH CO/THE	0.495	25	0.839	46
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.211	26	—	—
PROLOGIS INC	3	216	1	139
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.545	25	0.591	27
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.343	35	0.675	80
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.205	50	0.337	89
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.753	69	0.735	70
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.199	26	0.48	63
WELLTOWER INC	0.784	54	1	115
BOSTON PROPERTIES INC	0.446	50	0.719	95
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	—	0.33	35
REALTY INCOME CORP	1	100	1	116
REGENCY CENTERS CORP	0.429	24	0.671	44
SL GREEN REALTY CORP	0.314	24	0.842	80
UDR INC	0.637	24	0.986	43
VENTAS INC	0.872	50	1	89
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5	57	—	—
WEYERHAEUSER CO	0.964	25	3	99
AMERICAN TOWER CORP	0.804	128	1	232
AGNC INVESTMENT CORP	3	63	—	—
WP CAREY INC	3	259	—	—
VEREIT INC	3	25	8	71
DUKE REALTY CORP	0.96	27	1	46
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	—	6	109
IRON MOUNTAIN INC	0.774	25	0.721	26
EQUINIX INC	0.17	61	0.264	115
CROWN CASTLE INTL CORP	0.808	87	1	159
EQUITY RESIDENTIAL	1	95	2	168
COLONY CAPITAL INC	—	—	14	82
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	—	3	67
	( 6)	( 145)		
GGP INC	2	47	—	—
			( 16)	( 333)
HOST HOTELS & RESORTS INC	1	26	3	62
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.599	24	0.929	44
PUBLIC STORAGE	0.275	55	0.557	119
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.565	99	1	223
VORNADO REALTY TRUST	0.404	24	0.389	26
KIMCO REALTY CORP	1	24	3	53

	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
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.291	50	0.625	113
	小 計	42 ( 6)	2,045 ( 145)	70 ( 16)	3,022 ( 333)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3	90	3	92
	小 計	3	90	3	92
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	0.157	23	0.276	40
	UNIBAIL-RODAMCO SE	—	—	—	—
	COVIVIO	0.268	22	—	—
	小 計	0.425	46	0.276 ( 2)	40 ( 479)
	オランダ				
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1 ( 2)	229 ( 479)	0.553	91
	小 計	1 ( 2)	229 ( 479)	0.553	91
	ユ ー ロ 計	1 ( 2)	275 ( 479)	0.829 ( 2)	132 ( 479)
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	HAMMERSON PLC	5	19	9	41
	SEGRO PLC	3	21	4	27
	小 計	9	40	14	69
	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	13	37	18	49
	SCENTRE GROUP	9	37	21	87
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIEL/CDI	— ( 17)	— ( 256)	17	258
	ONEMARKET LTD	— ( 2)	— ( 3)	2	3
	GPT GROUP	—	—	8	51
	MIRVAC GROUP	15	37	21	49
	STOCKLAND	9	36	26	97
	WESTFIELD CORP	—	—	—	—
	DEXUS	6	72	11	135
	GOODMAN GROUP	8	95	16	185
	小 計	63 ( 20)	316 ( 259)	145 ( 48)	917 ( 429)
香港		千香港ドル		千香港ドル	
LINK REIT	3	243	8	665	
小 計	3	243	8	665	

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
	SUNTEC REIT	20 ( - )	37 (△0.70156)	34	61
	CAPITALAND MALL TRUST	15	34	16	35
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	13 ( - )	34 (△0.92927)	16	48
小計		48 ( - )	106 (△ 1)	66	146

(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 32,546	百万円 32,276	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

(2018年5月22日～2019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	28,059,199千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	96,076,291千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.29

(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

(2018年5月22日～2019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		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
		百万円	B/A		百万円	D/C
為替直物取引	百万円 17,306	百万円 2,813	% 16.3	百万円 29,232	百万円 5,149	% 17.6

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信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2019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	187	169	2,012	221,719	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	437	408	3,102	341,789	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	81	72	500	55,093	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13	10	93	10,315	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	111	102	1,649	181,765	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	12	—	—	—	小売
AES CORP	174	157	257	28,379	公益事業
AFLAC INC	196	175	917	101,050	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	226	204	1,073	118,219	保険
APACHE CORP	95	85	261	28,788	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	201	219	602	66,416	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	12	12	177	19,576	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	154	148	2,650	291,968	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	55	51	1,077	118,687	素材
ANTHEM INC	64	60	1,598	176,092	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	136	115	840	92,601	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	345	321	1,199	132,169	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	121	116	885	97,569	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	142	125	4,454	490,784	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	66	62	1,421	156,586	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	66	57	395	43,536	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	411	379	1,778	195,960	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	30	27	1,212	133,632	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,026	961	5,585	615,299	電気通信サービス
BALL CORP	82	74	465	51,279	素材
ALLSTATE CORP	89	80	765	84,345	保険
AVERY DENNISON CORP	21	21	216	23,822	素材
CHUBB LTD	117	107	1,554	171,284	保険
ANALOG DEVICES INC	93	85	863	95,154	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	7	6	595	65,592	小売
CVS HEALTH CORP	255	300	1,591	175,315	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	218	185	554	61,096	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	873	773	8,571	944,297	銀行
CIGNA CORP	62	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	149	137	1,685	185,663	資本財
COCA-COLA CO/THE	1,018	940	4,629	509,996	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	122	110	996	109,772	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	43	43	168	18,550	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	214	187	1,468	161,820	運輸
CHEVRON CORP	478	444	5,354	589,861	エネルギー
TAPESTRY INC	74	61	188	20,783	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC	41	—	—	—	資本財
CONOCOPHILLIPS	302	268	1,665	183,517	エネルギー
CME GROUP INC	85	83	1,530	168,600	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	80	70	315	34,776	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	210	191	1,378	151,831	家庭用品・パーソナル用品



銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
DOMINION ENERGY INC	162	176	1,332	146,754	公益事業
DEVON ENERGY CORP	124	112	345	38,059	エネルギー
DEERE & CO	68	71	958	105,590	資本財
DANAHER CORP	157	146	1,923	211,955	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	379	418	5,646	622,022	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	29	28	342	37,726	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	176	166	1,452	160,001	公益事業
DR HORTON INC	88	80	358	39,525	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	129	114	813	89,603	小売
DAVITA INC	36	32	161	17,838	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	38	35	337	37,147	資本財
DTE ENERGY COMPANY	46	43	558	61,486	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,066	985	7,477	823,847	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53	47	829	91,396	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	146	134	1,255	138,307	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	161	145	946	104,254	資本財
EXELON CORP	239	226	1,108	122,114	公益事業
ECOLAB INC	65	60	1,100	121,194	素材
EQUIFAX INC	29	27	327	36,094	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	56	51	855	94,254	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	110	100	789	86,975	資本財
EDISON INTERNATIONAL	80	77	462	50,937	公益事業
ENTERGY CORP	45	41	407	44,885	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	10	8	217	23,986	保険
NEXTERA ENERGY INC	118	111	2,218	244,382	公益事業
MACY'S INC	72	69	151	16,726	小売
FEDEX CORP	64	58	989	109,044	運輸
FORD MOTOR CO	935	860	885	97,585	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	83	70	234	25,878	各種金融
FIRSTENERGY CORP	111	121	515	56,774	公益事業
FLUOR CORP	37	32	96	10,608	資本財
FREEMPORT-MCMORAN INC	349	320	332	36,626	素材
GENERAL MILLS INC	142	142	745	82,079	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	63	58	973	107,242	資本財
WW GRAINGER INC	13	10	288	31,809	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,182	2,021	2,021	222,751	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	40	36	550	60,604	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	36	32	322	35,553	小売
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	58	58	91	10,077	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	56	56	124	13,765	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	90	77	1,537	169,352	各種金融
HALLIBURTON CO	220	199	501	55,265	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	182	172	2,932	323,034	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	40	40	140	15,481	自動車・自動車部品
HP INC	419	364	692	76,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	88	82	439	48,403	保険
HERSHEY CO/THE	36	32	422	46,493	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	294	262	5,061	557,613	小売
HASBRO INC	26	29	287	31,627	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	61	58	710	78,320	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	221	211	2,841	313,067	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	99	92	415	45,765	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ILLINOIS TOOL WORKS	78	69	1,046	115,295	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	91	92	208	22,989	メディア・娯楽
IDEX CORP	19	17	260	28,688	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19	21	287	31,709	素材
JOHNSON & JOHNSON	676	624	8,649	952,904	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	25	23	281	31,062	運輸
KELLOGG CO	66	58	333	36,749	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	89	80	1,037	114,272	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	376	338	1,767	194,686	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	220	189	459	50,623	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	42	37	239	26,429	小売
ELI LILLY & CO	249	208	2,413	265,930	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	25	24	394	43,507	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	36	29	153	16,874	運輸
LENNAR CORP-A	70	67	359	39,597	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	209	187	2,044	225,213	小売
LEGGETT & PLATT INC	35	27	101	11,209	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	59	59	133	14,672	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	97	89	537	59,181	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	65	59	2,013	221,816	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	55	50	324	35,712	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	10	8	225	24,860	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	19	17	421	46,457	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	78	67	880	96,990	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	200	179	3,574	393,770	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	64	58	1,243	137,004	各種金融
MEDTRONIC PLC	340	312	2,741	301,989	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	685	605	4,765	524,960	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	290	263	950	104,752	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	93	79	86	9,533	耐久消費財・アパレル
3M CO	149	135	2,291	252,418	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	40	38	572	63,058	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	114	113	294	32,442	消費者サービス
MASCO CORP	78	68	256	28,238	資本財
MONSANTO CO	110	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	33	31	518	57,090	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	127	117	1,124	123,915	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	15	15	218	24,049	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	343	299	1,316	144,993	各種金融
MCKESSON CORP	52	46	580	63,898	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	224	194	921	101,471	保険
MANPOWERGROUP INC	16	16	147	16,227	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	43	40	745	82,079	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	72	63	1,295	142,714	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,494	2,168	6,159	678,639	銀行
NISOURCE INC	86	83	236	26,061	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	41	38	1,175	129,475	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	133	—	—	—	銀行
NEWMONT GOLDCORP CORP	135	191	593	65,400	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	268	—	—	—	メディア・娯楽
MCCORMICK & CO-NON VTC SHRS	30	27	424	46,807	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	3	3	334	36,820	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NUCOR CORP	79	72	387	42,734	素材
NEWELL BRANDS INC	122	115	178	19,706	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	107	—	—	—	メディア・娯楽
NOBLE ENERGY INC	114	109	260	28,679	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	193	175	927	102,144	エネルギー
OMNICOM GROUP	58	52	419	46,206	メディア・娯楽
PEPSICO INC	358	328	4,286	472,269	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	22	23	223	24,613	素材
ALTRIA GROUP INC	480	436	2,286	251,954	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	30	27	265	29,304	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	638	579	6,227	686,034	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	119	107	1,399	154,165	銀行
PFIZER INC	1,500	1,345	5,579	614,652	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	107	95	948	104,482	保険
PULTEGROUP INC	67	56	183	20,196	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	33	31	520	57,388	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	43	39	611	67,337	エネルギー
CITIGROUP INC	665	568	3,698	407,415	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	71	67	369	40,750	保険
PPG INDUSTRIES INC	62	55	618	68,180	素材
PENTAIR PLC	42	42	151	16,725	資本財
PRAXAIR INC	72	—	—	—	素材
P G & E CORP	126	—	—	—	公益事業
PPL CORP	177	162	484	53,377	公益事業
PROGRESSIVE CORP	144	135	1,050	115,755	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	130	115	699	77,094	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	43	39	492	54,234	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	72	66	1,171	129,024	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	59	54	463	51,111	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	288	237	341	37,609	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	11	10	176	19,460	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	25	23	854	94,105	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	101	115	343	37,825	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	29	29	167	18,502	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	32	28	452	49,825	資本財
SCHLUMBERGER LTD	347	322	1,257	138,547	エネルギー
STRYKER CORP	84	78	1,440	158,743	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	303	281	1,218	134,211	各種金融
SEMPRA ENERGY	61	63	827	91,188	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21	19	853	94,029	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	38	35	476	52,443	資本財
SUNTRUST BANKS INC	118	103	638	70,291	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	68	60	897	98,907	保険
SOUTHERN CO/THE	254	239	1,291	142,268	公益事業
AT&T INC	1,544	1,692	5,383	593,098	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	74	64	288	31,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	93	86	522	57,529	各種金融
SYSCO CORP	125	113	853	94,066	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	45	37	157	17,371	素材
SCANA CORP	36	—	—	—	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	248	223	2,388	263,196	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	30	26	257	28,339	小売

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	
TORCHMARK CORP	26	26	231	25,542	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	234	213	830	91,503	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	100	93	2,451	270,095	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	66	54	269	29,729	資本財
UNION PACIFIC CORP	198	171	2,997	330,276	運輸
UNUM GROUP	55	46	160	17,669	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	190	190	2,551	281,133	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	243	223	5,404	595,386	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	417	358	1,847	203,493	銀行
MARATHON OIL CORP	207	199	308	34,001	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	173	161	1,609	177,371	運輸
VALERO ENERGY CORP	108	97	819	90,268	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	19	259	28,585	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	88	79	383	42,235	メディア・娯楽
VF CORP	86	77	707	77,956	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	33	31	407	44,853	素材
WILLIAMS COS INC	212	281	775	85,391	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	211	187	980	108,019	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	81	75	614	67,719	公益事業
WALMART INC	376	338	3,409	375,577	食品・生活必需品小売り
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	11	304	33,501	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	1,177	1,040	4,756	524,008	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	110	99	1,075	118,507	商業・専門サービス
WATERS CORP	19	18	375	41,356	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	18	15	200	22,107	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	50	45	148	16,308	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	126	123	715	78,879	公益事業
KEYCORP	275	246	412	45,417	銀行
CARMAX INC	46	39	300	33,082	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	51	48	567	62,526	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	36	—	—	—	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	80	74	750	82,652	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	157	288	1,528	168,366	小売
CA INC	74	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	32	30	444	48,941	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	34	31	322	35,541	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	73	67	460	50,688	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	88	98	531	58,541	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	84	76	907	100,013	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	106	108	315	34,738	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	79	70	616	67,918	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	181	178	486	53,641	銀行
STERICYCLE INC	23	—	—	—	商業・専門サービス
INTEL CORP	1,178	1,061	4,766	525,165	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,244	1,047	5,902	650,296	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	21	21	475	52,354	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	28	26	556	61,257	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	110	102	2,533	279,106	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	268	227	970	106,871	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	77	70	681	75,123	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	74	69	576	63,479	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	155	155	308	33,945	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ROSS STORES INC	95	85	833	91,868	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	57	54	457	50,376	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	330	296	2,507	276,223	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	169	148	2,520	277,714	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	42	38	281	31,025	銀行
NORTHERN TRUST CORP	55	50	468	51,614	各種金融
MICROSOFT CORP	1,844	1,696	21,725	2,393,544	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	20	19	361	39,853	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	51	98	553	61,004	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	360	288	2,278	250,999	消費者サービス
ORACLE CORP	788	617	3,365	370,727	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	108	101	3,593	395,886	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21	18	652	71,911	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	180	167	776	85,564	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	46	42	301	33,208	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	39	33	226	24,947	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	31	27	276	30,458	小売
LAM RESEARCH CORP	41	36	711	78,439	半導体・半導体製造装置
COPART INC	—	51	334	36,887	商業・専門サービス
WYNN RESORTS LTD	24	22	277	30,539	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,173	1,055	4,597	506,489	メディア・娯楽
XILINX INC	62	58	610	67,228	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	89	82	568	62,612	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	56	49	270	29,808	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	19	17	579	63,833	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	328	300	1,996	219,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	37	30	296	32,707	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	28	26	1,298	143,096	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	61	57	1,410	155,378	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	13	12	277	30,604	銀行
PAYCHEX INC	81	77	664	73,240	ソフトウェア・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	104	195	21,506	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	14	14	169	18,623	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	33	30	363	40,029	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15	13	194	21,460	運輸
AUTODESK INC	50	50	886	97,623	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	47	47	121	13,336	メディア・娯楽
SALESFORCE.COM INC	172	177	2,750	303,064	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	33	28	106	11,760	小売
ALPHABET INC-CL A	75	69	8,139	896,715	メディア・娯楽
EAST WEST BANCORP INC	34	34	162	17,920	銀行
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	9	87	9,627	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	31	28	221	24,362	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	59	60	242	26,687	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	371	281	2,297	253,122	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	67	67	302	33,367	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSIS INC	36	34	414	45,617	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	69	64	346	38,128	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	103	96	18,067	1,990,510	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	61	54	572	63,121	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	33	29	290	31,996	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	39	37	405	44,627	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STEEL DYNAMICS INC	57	57	173	19,069	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	66	58	282	31,100	各種金融
CERNER CORP	76	70	479	52,848	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	40	40	100	11,071	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	22	25	504	55,533	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	66	61	577	63,598	商業・専門サービス
EBAY INC	249	212	785	86,533	小売
IAC/INTERACTIVECORP	18	17	420	46,335	メディア・娯楽
NVIDIA CORP	152	134	2,108	232,340	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	60	56	569	62,732	小売
BOOKING HOLDINGS INC	12	10	1,924	212,067	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	319	301	6,123	674,626	各種金融
BB&T CORP	197	178	854	94,099	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	258	230	1,060	116,782	各種金融
BORGWARNER INC	50	50	184	20,325	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	56	43	116	12,824	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	28	25	323	35,622	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	195	—	—	—	メディア・娯楽
AMERISOURCEBERGEN CORP	40	35	275	30,366	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	12	12	118	13,036	保険
AETNA INC	82	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	61	56	419	46,199	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	124	114	982	108,191	公益事業
AON PLC	62	56	1,013	111,603	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	138	130	530	58,405	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	20	—	—	—	保険
HESS CORP	69	64	422	46,592	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	91	74	187	20,647	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	71	66	353	38,901	各種金融
RED HAT INC	44	40	757	83,426	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	14	14	209	23,033	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	55	55	195	21,504	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	41	36	286	31,603	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	67	59	413	45,563	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	46	40	312	34,428	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	96	138	314	34,631	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	53	46	1,072	118,190	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	36	34	1,050	115,739	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	124	113	3,179	350,241	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	64	59	1,002	110,437	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	227	223	259	28,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELGENE CORP	197	162	1,552	170,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	148	134	799	88,090	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	143	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	43	39	291	32,117	運輸
FASTENAL CO	71	66	428	47,246	資本財
FISERV INC	103	91	799	88,128	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	126	126	129	14,317	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEKTAR THERAPEUTICS	—	41	132	14,600	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	391	221	24,404	メディア・娯楽
APPLE INC	1,292	1,103	20,861	2,298,346	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	37	37	368	40,634	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	270	241	319	35,213	銀行
ZIONS BANCORP NA	52	42	191	21,072	銀行
COSTAR GROUP INC	9	8	449	49,497	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	55	50	664	73,202	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	34	281	30,978	運輸
CENTURYLINK INC	241	213	225	24,863	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	37	31	157	17,350	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	114	115	226	24,954	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	96	94	642	70,807	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	71	64	291	32,123	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	36	29	153	16,900	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	19	16	262	28,942	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	92	93	224	24,776	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	43	38	787	86,772	食品・飲料・タバコ
NVR INC	0.86	0.75	249	27,432	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	45	—	—	—	エネルギー
COOPER COS INC/THE	11	11	332	36,603	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	65	—	—	—	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	77	68	631	69,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	26	34	211	23,284	保険
AGCO CORP	17	—	—	—	資本財
DISCOVERY INC - A	41	31	87	9,638	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	97	99	631	69,624	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	31	28	328	36,158	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	56	56	239	26,403	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	146	119	294	32,465	メディア・娯楽
AMERIPRISE FINANCIAL INC	37	32	465	51,262	各種金融
ANDEAVOR	38	—	—	—	エネルギー
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	69	61	240	26,452	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	145	132	1,076	118,605	各種金融
NASDAQ INC	27	27	250	27,636	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	50	41	97	10,791	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	36	36	231	25,488	メディア・娯楽
VIACOM INC-CLASS B	92	76	219	24,128	メディア・娯楽
AUTOLIV INC	21	21	145	15,986	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	73	74	351	38,749	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	5	422	46,534	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	62	62	324	35,739	食品・飲料・タバコ
QURATE RETAIL INC	114	94	127	14,092	小売
ARROW ELECTRONICS INC	23	17	119	13,126	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	39	34	557	61,384	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	32	27	213	23,526	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	75	57	107	11,789	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	15	13	303	33,383	素材
RANGE RESOURCES CORP	67	—	—	—	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	22	22	155	17,143	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	15	11	132	14,589	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	61	52	254	28,016	公益事業
WYNDHAM DESTINATIONS INC	25	—	—	—	消費者サービス
HANESBRANDS INC	88	88	148	16,373	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	236	213	5,401	595,031	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	112	112	218	24,043	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
LEIDOS HOLDINGS INC	34	34	262	28,966	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	32	25	128	14,116	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	29	25	214	23,597	資本財
AVNET INC	28	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPG PHOTONICS CORP	9	9	128	14,133	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	86	80	184	20,306	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	60	60	122	13,544	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	13	10	500	55,170	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	30	28	347	38,273	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	30	31	547	60,302	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	91	91	147	16,279	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	87	81	731	80,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	92	77	598	65,966	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	27	22	389	42,940	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	13	10	141	15,576	資本財
MERCADOLIBRE INC	10	9	571	62,983	小売
VMWARE INC-CLASS A	18	18	373	41,145	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	71	61	320	35,322	保険
SEATTLE GENETICS INC	28	28	188	20,730	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	14	13	462	50,970	小売
LKQ CORP	74	69	187	20,621	小売
HORMEL FOODS CORP	69	69	275	30,405	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	21	—	—	—	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	36	31	224	24,684	素材
HARRIS CORP	30	27	512	56,469	資本財
HUMANA INC	36	31	787	86,739	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	—	68	244	26,956	公益事業
INVESCO LTD	100	100	205	22,667	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	43	40	363	40,050	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	32	167	18,461	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	40	37	375	41,359	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	36	47	537	59,180	エネルギー
MSCI INC	21	20	458	50,550	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	25	21	87	9,683	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	47	42	246	27,207	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	391	361	3,137	345,695	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	456	409	6,722	740,611	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	46	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CABOT OIL & GAS CORP	115	97	254	28,058	エネルギー
FLOWERVE CORP	29	26	133	14,701	資本財
HELMERICH & PAYNE	29	22	124	13,715	エネルギー
T-MOBILE US INC	72	80	607	66,926	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C	67	71	186	20,558	メディア・娯楽
RESMED INC	34	34	385	42,418	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	21	20	318	35,112	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	56	55	472	52,068	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	33	90	304	33,505	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	61	55	411	45,336	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	21	203	22,447	運輸
PERRIGO CO PLC	31	31	153	16,963	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP	32	32	245	27,085	素材
WABTEC CORP	22	31	209	23,101	資本財



銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
EVERSOURCE ENERGY	81	74	544	60,026	公益事業
INGREDION INC	17	17	145	15,998	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	83	78	1,098	121,049	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC	31	32	197	21,737	素材
EATON VANCE CORP	30	30	116	12,785	各種金融
DELTA AIR LINES INC	44	36	198	21,830	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	45	41	465	51,336	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	38	36	515	56,807	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	69	60	731	80,586	小売
FORTINET INC	39	35	292	32,231	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	18	14	114	12,624	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	5	435	47,937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	34	21	110	12,163	銀行
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	—	6	41	4,567	運輸
GENERAL MOTORS CO	320	296	1,095	120,674	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	86	79	757	83,424	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	85	76	609	67,188	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11	10	214	23,648	資本財
HCA HEALTHCARE INC	71	63	782	86,173	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	39	36	157	17,347	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	124	161	837	92,260	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	25	28	293	32,324	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	36	29	156	17,273	資本財
DEXCOM INC	—	21	257	28,323	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	15	13	179	19,746	資本財
XYLEM INC	43	41	312	34,374	資本財
ABIOMED INC	—	9	245	27,061	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC	25	25	115	12,683	メディア・娯楽
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	15	12	176	19,470	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	40	37	377	41,572	銀行
ALLEGHANY CORP	3	3	250	27,566	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	20	18	556	61,277	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	110	102	868	95,724	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	600	558	10,354	1,140,741	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	70	66	377	41,631	公益事業
ALBEMARLE CORP	27	24	166	18,394	素材
PVH CORP	18	18	204	22,503	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	501	475	961	105,873	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	89	75	177	19,585	商業・専門サービス
APTIV PLC	68	59	436	48,043	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	44	36	166	18,303	資本財
SPLUNK INC	35	34	471	51,923	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	51	51	218	24,075	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	13	13	119	13,116	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	401	349	2,779	306,262	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	34	29	628	69,212	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	48	52	355	39,140	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	31	29	246	27,105	各種金融
ZOETIS INC	121	111	1,140	125,641	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	102	102	116	12,854	メディア・娯楽
SPRINT CORP	218	155	96	10,616	電気通信サービス
SNAP-ON INC	13	13	223	24,569	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CAPRI HOLDINGS LTD	38	35	141	15,548	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	162	159	597	65,783	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	20	17	232	25,603	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	73	69	836	92,178	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	34	34	728	80,217	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	44	41	1,137	125,263	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	21	18	227	25,069	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	22	20	560	61,701	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	22	20	205	22,679	資本財
ALPHABET INC-CL C	79	73	8,495	935,921	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	20	18	227	25,079	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	29	29	94	10,427	運輸
VOYA FINANCIAL INC	44	39	206	22,796	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	9	58	6,391	素材
ANTERO RESOURCES CORP	60	—	—	—	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	35	36	483	53,265	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	112	94	278	30,699	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	71	63	591	65,216	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	30	30	157	17,354	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	21	35	392	43,285	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	—	42	349	38,554	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	26	26	265	29,209	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	29	24	263	29,071	メディア・娯楽
OWENS CORNING	28	28	136	15,002	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	48	51	295	32,533	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	22	21	484	53,342	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	199	153	535	59,025	各種金融
QORVO INC	32	29	188	20,728	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	47	44	371	40,973	保険
ACUITY BRANDS INC	9	9	133	14,701	資本財
JONES LANG LASALLE INC	12	9	128	14,195	不動産
ARAMARK	59	59	186	20,576	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	121	111	387	42,683	銀行
LEAR CORP	16	14	193	21,312	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	22	22	152	16,756	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	58	43	111	12,316	素材
TARGA RESOURCES CORP	52	58	245	27,048	エネルギー
GRUBHUB INC	—	22	137	15,160	小売
CHEMOURS CO/THE	46	42	97	10,795	素材
WESTROCK CO	62	62	230	25,380	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	155	144	468	51,628	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	287	260	2,937	323,616	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	17	211	23,291	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	28	28	114	12,593	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	400	332	485	53,540	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	1	1	72	7,987	運輸
CDW CORP/DE	38	36	376	41,474	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SABRE CORP	57	68	135	14,899	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	113	123	320	35,287	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	12	11	295	32,515	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	43	40	176	19,442	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	39	41	266	29,377	商業・専門サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GODADDY INC - CLASS A	—	40	303	33,438	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	18	—	—	—	素材
WAYFAIR INC- CLASS A	—	14	210	23,197	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	48	48	99	10,989	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	41	41	157	17,390	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	24	15	59	6,584	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	50	50	193	21,318	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC	9	8	192	21,153	消費者サービス
DOMINO'S PIZZA INC	11	8	247	27,298	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	46	37	1,437	158,363	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	21	20	511	56,362	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	34	34	151	16,729	資本財
UGI CORP	46	40	220	24,278	公益事業
WESTAR ENERGY INC	36	—	—	—	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	55	49	279	30,807	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	79	70	564	62,211	資本財
IHS MARKIT LTD	102	92	530	58,494	商業・専門サービス
XL GROUP LTD	63	—	—	—	保険
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	45	54	321	35,377	ソフトウェア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	51	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COTY INC-CL A	127	126	171	18,848	家庭用品・パーソナル用品
ARCONIC INC	108	108	239	26,363	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	36	243	26,867	食品・飲料・タバコ
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	58	58	119	13,192	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	16	13	207	22,836	保険
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	7	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
TELEFLEX INC	11	10	305	33,686	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	50	50	164	18,077	電気通信サービス
BEIGENE LTD-ADR	—	8	105	11,589	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENVISION HEALTHCARE CORP	31	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC	115	91	206	22,757	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	29	29	417	45,947	ヘルスケア機器・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	24	26	278	30,698	各種金融
DXC TECHNOLOGY CO	72	66	375	41,331	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	39	39	166	18,354	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	19	18	181	19,959	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC	51	44	84	9,307	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC	47	38	165	18,250	資本財
ROLLINS INC	26	33	124	13,741	商業・専門サービス
TESARO INC	10	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XPO LOGISTICS INC	—	29	169	18,700	運輸
BAKER HUGHES A GE CO	98	125	286	31,582	エネルギー
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	22	20	77	8,527	保険
DOWDUPONT INC	589	532	1,650	181,847	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	35	25	79	8,706	運輸
SQUARE INC - A	70	70	461	50,819	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	65	71	178	19,636	公益事業
PTC INC	—	24	212	23,449	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	102	96	2,788	307,203	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	—	62	368	40,554	公益事業
ALTICE USA INC- A	—	79	194	21,475	メディア・娯楽
LINDE PLC	—	128	2,423	267,002	素材

銘柄	株数	当期		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		
WIX.COM LTD	—	11	153	16,874		ソフトウェア・サービス
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	—	57	123	13,659		各種金融
BURLINGTON STORES INC	—	16	274	30,294		小売
KKR & CO INC -A	—	104	256	28,268		各種金融
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	67	221	24,424		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIGNA CORP	—	88	1,372	151,159		ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	—	34	242	26,718		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOX CORP - CLASS A	—	76	283	31,276		メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	—	35	132	14,562		メディア・娯楽
DOW INC	—	177	903	99,502		素材
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	280	280	190	20,976		不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	60	53	189	20,886		資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	55	51	316	34,835		資本財
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	—	80	61	6,777		食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	76,889	70,489	568,837	62,668,835	
	銘柄数<比率>	600	598	—	<64.3%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	366	336	3,532	289,555		銀行
IMPERIAL OIL LTD	69	69	259	21,274		エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	70	44	385	31,605		商業・専門サービス
TC ENERGY CORP	220	215	1,408	115,448		エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	91	82	563	46,216		電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	156	135	721	59,110		保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	138	114	313	25,663		素材
BARRICK GOLD CORP	294	408	671	55,021		素材
BCE INC	40	33	199	16,391		電気通信サービス
BOMBARDIER INC-B	530	530	111	9,167		資本財
BANK OF MONTREAL	163	150	1,551	127,175		銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	214	195	1,247	102,236		各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	301	286	2,043	167,523		銀行
BAUSCH HEALTH COS INC	76	76	256	21,021		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	72	60	220	18,037		資本財
CAMECO CORP	106	106	144	11,809		エネルギー
CI FINANCIAL CORP	72	44	89	7,304		各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	108	102	1,128	92,516		銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	306	278	1,019	83,572		エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	188	170	2,147	176,088		運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	16	13	182	14,988		小売
ENBRIDGE INC	417	472	2,383	195,407		エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	7	6	397	32,569		保険
CGI INC	63	59	575	47,178		ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	91	91	123	10,147		エネルギー
IGM FINANCIAL INC	23	23	84	6,914		各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	53	41	286	23,518		食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	492	459	1,067	87,487		保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	86	73	437	35,829		自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	85	78	492	40,336		銀行
ONEX CORPORATION	19	17	132	10,862		各種金融
POWER CORP OF CANADA	93	70	196	16,085		保険
POWER FINANCIAL CORP	58	58	173	14,202		保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	112	112	302	24,772		メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY INC	416	371	1,607	131,786		エネルギー

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
WESTON (GEORGE) LTD	14	16	174	14,266	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	37	34	1,047	85,846	運輸
ENCANA CORP	236	330	295	24,239	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	57	57	315	25,854	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	46	46	106	8,767	資本財
GOLDCORP INC	226	—	—	—	素材
KINROSS GOLD CORP	353	232	98	8,083	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	46	45	120	9,864	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC	70	70	217	17,829	保険
METHANEX CORP	19	13	82	6,773	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	281	281	48	3,962	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	53	44	222	18,262	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	50	49	224	18,442	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	131	131	148	12,210	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	57	57	281	23,060	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	178	163	193	15,834	素材
FORTIS INC	108	98	491	40,274	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	108	102	859	70,499	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	162	162	101	8,353	素材
TORONTO-DOMINION BANK	465	427	3,175	260,335	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	45	45	459	37,709	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	104	97	262	21,502	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	49	37	115	9,485	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	29	—	—	—	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	34	34	125	10,324	公益事業
METRO INC/CN	60	60	295	24,259	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	64	65	356	29,238	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	35	31	360	29,535	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	118	—	—	—	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	252	254	295	24,217	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	96	96	78	6,437	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	62	62	119	9,824	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	126	117	575	47,145	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	31	26	80	6,609	エネルギー
DOLLARAMA INC	27	70	290	23,843	小売
KEYERA CORP	51	51	173	14,211	エネルギー
ALTAGAS LTD	47	63	121	9,942	公益事業
ATCO LTD -CLASS I	21	21	95	7,846	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	41	41	86	7,075	不動産
INTER PIPELINE LTD	98	98	205	16,887	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	58	58	109	8,990	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	68	68	58	4,833	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	5	5	600	49,188	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	55	56	514	42,141	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	18	9	50	4,176	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	37	37	222	18,208	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	110	—	—	—	各種金融
LINAMAR CORP	12	—	—	—	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD	69	65	145	11,962	公益事業
EMERA INC	17	17	87	7,182	公益事業
SHOPIFY INC - CLASS A	21	21	772	63,362	ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	163	141	937	76,895	素材

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		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	
WSP GLOBAL INC	—	24	177	14,518	資本財
AURORA CANNABIS INC	—	163	190	15,647	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANOPY GROWTH CORP	—	49	294	24,118	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	103	8,499	消費者サービス
IA FINANCIAL CORP INC	—	20	99	8,175	保険
CRONOS GROUP INC	—	44	88	7,239	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>	10,334 87	9,825 88	43,215 —	3,542,830 <3.6%>
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
COMMERZBANK AG	264	217	166	20,515	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	514	456	312	38,454	各種金融
SIEMENS AG-REG	192	177	1,911	235,075	資本財
RWE AG	128	114	269	33,109	公益事業
BASF SE	231	213	1,355	166,699	素材
VOLKSWAGEN AG	8	6	96	11,844	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	242	211	1,129	138,871	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	45	41	354	43,583	家庭用品・パーソナル用品
E. ON SE	564	496	461	56,775	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	82	75	499	61,400	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	208	216	1,233	151,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANZ SE-REG	112	98	2,020	248,499	保険
MAN SE	9	—	—	—	資本財
CONTINENTAL AG	28	25	331	40,796	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	290	258	465	57,228	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	36	37	221	27,256	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	63	58	107	13,228	運輸
HUGO BOSS AG -ORD	17	16	95	11,720	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	244	227	637	78,431	運輸
SAP SE	247	228	2,620	322,292	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	60	62	95	11,803	メディア・娯楽
DEUTSCHE BOERSE AG	48	44	548	67,403	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	54 9	50 9	353 66	43,415 8,231	ヘルスケア機器・サービス 運輸
ADIDAS AG	47	42	1,073	131,959	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	837	776	1,181	145,283	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	38	34	760	93,475	保険
THYSSENKRUPP AG	109	109	137	16,852	素材
BEIERSDORF AG	24	23	244	30,065	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	36	33	233	28,689	素材
MERCK KGAA	31	28	261	32,165	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	46	43	642	79,051	自動車・自動車部品
PUMA SE	1	2	114	14,071	耐久消費財・アパレル
LANXESS AG	21	21	106	13,136	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	103	94	459	56,456	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG	5	5	61	7,509	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	88	80	341	42,040	不動産
GEA GROUP AG	44	36	91	11,274	資本財
SYMRISE AG	29	29	259	31,950	素材
K+S AG-REG	51	—	—	—	素材
HENKEL AG & CO KGAA	24	22	183	22,530	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	29	29	93	11,546	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	15	13	79	9,785	自動車・自動車部品

銘柄	株数	当期末			業種等	
		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		
HANNOVER RUECK SE	14	14	195	24,001	保険	
BRENNTAG AG	36	36	166	20,443	資本財	
AXEL SPRINGER SE	13	13	65	8,023	メディア・娯楽	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	19	14	53	6,553	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	199	199	56	6,982	電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	26	20	61	7,521	資本財	
VONOVIA SE	119	117	554	68,146	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	44	41	109	13,414	素材	
ZALANDO SE	29	24	93	11,509	小売	
COVESTRO AG	40	41	181	22,377	素材	
SCHAEFFLER AG - PREF	46	—	—	—	自動車・自動車部品	
UNIPER SE	50	50	132	16,262	公益事業	
INNOGY SE	33	32	132	16,272	公益事業	
METRO AG	48	48	69	8,588	食品・生活必需品小売り	
KION GROUP AG	18	18	102	12,550	資本財	
LINDE AG - TENDER	47	—	—	—	素材	
I&I DRILLISCH AG	12	12	36	4,456	電気通信サービス	
MTU AERO ENGINES AG	12	11	236	29,120	資本財	
WIRECARD AG	29	26	376	46,259	ソフトウェア・サービス	
DELIVERY HERO SE	—	22	94	11,667	小売	
SARTORIUS AG-VORZUG	—	8	147	18,103	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	37	37	138	17,061	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額	6,173	5,573	24,684	3,035,442	
	銘柄数<比率>	63	61	—	<3.1%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	316	271	462	56,840	保険	
INTESA SANPAOLO	3,412	3,467	752	92,546	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	3,021	2,968	137	16,906	電気通信サービス	
ENI SPA	633	597	886	109,047	エネルギー	
UNICREDIT SPA	503	457	484	59,636	銀行	
ENEL SPA	2,071	1,909	1,074	132,162	公益事業	
RECORDATI SPA	23	22	83	10,235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATLANTIA SPA	112	117	268	32,981	運輸	
INTESA SANPAOLO-RSP	246	—	—	—	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	44	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	154	154	136	16,798	銀行	
SNAM SPA	551	553	254	31,281	エネルギー	
TELECOM ITALIA-RSP	1,610	871	37	4,639	電気通信サービス	
LEONARDO SPA	89	89	89	11,055	資本財	
TERNA SPA	370	312	175	21,625	公益事業	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	268	—	—	—	保険	
PRYSMIAN SPA	54	45	78	9,701	資本財	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	148	148	136	16,773	食品・飲料・タバコ	
POSTE ITALIANE SPA	143	113	102	12,641	保険	
MONCLER SPA	—	44	157	19,316	耐久消費財・アパレル	
PIRELLI & C SPA	—	94	54	6,695	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額	13,775	12,238	5,374	660,883	
	銘柄数<比率>	19	18	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	43	39	436	53,728	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	70	64	2,201	270,682	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	148	138	296	36,459	自動車・自動車部品	

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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AXA SA	488	451	1,020	125,477	保険
DANONE	152	143	1,020	125,518	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	150	127	221	27,211	食品・生活必需品小売り
VIVENDI	263	238	592	72,920	メディア・娯楽
INGENICO GROUP	16	15	115	14,230	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	193	182	469	57,772	銀行
AIR LIQUIDE SA	107	99	1,180	145,169	素材
TOTAL SA	605	562	2,764	340,003	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	127	115	395	48,579	資本財
VINCI SA	127	118	1,059	130,312	資本財
SANOFI	285	262	1,974	242,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	117	122	246	30,253	公益事業
L'OREAL	63	58	1,425	175,299	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	44	44	156	19,281	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	142	127	929	114,310	資本財
BNP PARIBAS	282	261	1,186	145,944	銀行
ESSILORLUXOTTICA	53	65	721	88,667	耐久消費財・アパレル
CAPGEMINI SE	40	37	393	48,394	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	14	14	45	5,586	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	60	54	148	18,289	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	7	7	465	57,181	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA	22	19	196	24,133	消費者サービス
KERING	18	17	916	112,718	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	31	30	436	53,690	ソフトウェア・サービス
ATOS SE	23	23	167	20,599	ソフトウェア・サービス
ORANGE	497	457	632	77,811	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	48	36	75	9,234	保険
IMERYS SA	9	9	41	5,051	素材
SAFRAN SA	84	77	975	119,996	資本財
RENAULT SA	48	42	221	27,255	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	50	46	236	29,131	メディア・娯楽
LAGARDERE SCA	32	—	—	—	メディア・娯楽
JCDECAUX SA	20	20	55	6,771	メディア・娯楽
SOCIETE BIC SA	7	7	56	6,942	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	52	52	172	21,158	資本財
THALES SA	25	23	244	30,035	資本財
PERNOD RICARD SA	52	48	778	95,673	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	290	258	289	35,541	銀行
ENGIE	457	415	564	69,362	公益事業
ALSTOM	41	39	156	19,273	資本財
ARKEMA	15	14	116	14,370	素材
LEGRAND SA	66	61	380	46,813	資本財
SCOR SE	40	40	149	18,442	保険
ADP	7	6	104	12,888	運輸
EDF	152	151	192	23,689	公益事業
NATIXIS	225	225	114	14,138	各種金融
WENDEL	6	6	77	9,496	各種金融
BUREAU VERITAS SA	61	54	117	14,492	商業・専門サービス
EURAZEO SE	12	13	86	10,612	各種金融
SUEZ	88	88	109	13,490	公益事業
EIFFAGE	17	19	182	22,490	資本財
ILIAD SA	7	7	74	9,101	電気通信サービス



銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	48	30	47	5,879	メディア・娯楽	
BIOMERIEUX	10	10	75	9,244	ヘルスケア機器・サービス	
GETLINK SE	107	95	135	16,628	運輸	
EDENRED	59	51	213	26,203	商業・専門サービス	
REMY COINTREAU	5	5	70	8,721	食品・飲料・タバコ	
REXEL SA	82	66	71	8,838	資本財	
BOLLORE	242	169	69	8,584	運輸	
DASSAULT AVIATION SA	0.63	0.63	79	9,730	資本財	
SEB SA	5	5	94	11,587	耐久消費財・アパレル	
IPSEN	10	8	93	11,470	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	11,209	各種金融	
FAURECIA	18	18	70	8,724	自動車・自動車部品	
TELEPERFORMANCE	14	12	213	26,314	商業・専門サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	15	20	148	18,249	メディア・娯楽	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	—	7	88	10,932	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WORDLINE SA	—	19	98	12,121	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,761	6,210	29,055	3,572,926	
	銘柄 数 < 比 率 >	69	70	—	< 3.7% >	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N. V.	51	49	166	20,506	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CNH INDUSTRIAL NV	248	248	203	25,007	資本財	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	268	247	331	40,764	自動車・自動車部品	
FERRARI NV	30	28	361	44,514	自動車・自動車部品	
EXOR NV	25	25	150	18,448	各種金融	
AIRBUS SE	146	135	1,638	201,466	資本財	
STMICROELECTRONICS NV	154	161	251	30,899	半導体・半導体製造装置	
WOLTERS KLUWER	69	67	413	50,899	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE KPN NV	834	834	223	27,434	電気通信サービス	
AKZO NOBEL N. V.	64	52	399	49,087	素材	
HEINEKEN NV	65	58	574	70,639	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	238	214	782	96,163	ヘルスケア機器・サービス	
RELX NV	248	—	—	—	商業・専門サービス	
AEGON NV	436	436	186	22,990	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	326	269	564	69,471	食品・生活必需品小売り	
RANDSTAD NV	27	27	133	16,405	商業・専門サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	27	27	253	31,193	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	45	41	432	53,201	素材	
ING GROEP NV	978	904	914	112,462	銀行	
ASML HOLDING NV	97	95	1,739	213,955	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV-CVA	409	358	1,949	239,695	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	20	14	56	6,930	エネルギー	
BOSKALIS WESTMINSTER	25	—	—	—	資本財	
NN GROUP NV	75	75	278	34,268	保険	
ALTICE EUROPE NV	142	—	—	—	メディア・娯楽	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	109	91	176	21,721	銀行	
ADYEN NV	—	2	175	21,582	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,169	4,470	12,358	1,519,711	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	24	—	< 1.6% >	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	64	64	93	11,533	資本財	
ENDESA SA	83	72	166	20,416	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	57	55	210	25,892	資本財	

銘柄	株数	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…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	1,458	1,451	1,187	146,045	公益事業	
TELEFONICA SA	1,171	1,081	776	95,450	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	4,059	3,784	1,574	193,560	銀行	
BANKINTER SA	176	176	119	14,654	銀行	
REPSOL SA	310	323	479	58,924	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,676	1,542	794	97,727	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	92	76	204	25,166	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	271	250	636	78,286	小売	
MAPPRE SA	298	297	79	9,809	保険	
FERROVIAL SA	115	108	230	28,379	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	115	108	3	412	資本財	
ENAGAS SA	60	60	154	19,017	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	116	94	184	22,730	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,276	1,253	133	16,446	銀行	
CAIXABANK SA	896	792	221	27,179	銀行	
GRIFOLS SA	72	72	173	21,358	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	111	101	716	88,132	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	147	—	—	—	運輸	
BANKIA SA	331	331	76	9,462	銀行	
AENA SME SA	16	16	274	33,772	運輸	
小 計	株数・金額	12,981	12,117	8,492	1,044,359	
	銘柄数<比率>	23	22	—	<1.1%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	49	39	178	21,949	保険	
UCB SA	29	29	206	25,341	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	161	19,809	各種金融	
UMICORE	52	52	151	18,664	素材	
COLRUYT SA	16	16	107	13,245	食品・生活必需品小売り	
KBC GROUP NV	63	57	352	43,404	銀行	
SOLVAY SA	17	17	158	19,445	素材	
PROXIMUS	40	28	73	8,998	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	14	14	70	8,637	メディア・娯楽	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	191	176	1,312	161,362	食品・飲料・タバコ	
小 計	株数・金額	495	452	2,771	340,858	
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	74	66	223	27,481	銀行	
VERBUND AG	—	17	82	10,189	公益事業	
OMV AG	35	35	158	19,522	エネルギー	
VOESTALPINE AG	30	18	47	5,838	素材	
ANDRITZ AG	19	19	66	8,207	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	40	40	87	10,729	銀行	
小 計	株数・金額	200	197	666	81,968	
	銘柄数<比率>	5	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	10	10	46	5,772	メディア・娯楽	
AROUNDTOWN SA	—	192	144	17,794	不動産	
TENARIS SA	125	110	138	17,020	エネルギー	
SES	95	94	142	17,582	メディア・娯楽	
EUROFINS SCIENTIFIC	3	2	107	13,249	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	株数	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…ルクセンブルク)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ARCELORMITTAL	169	153	225	27,679	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	403	564	805	99,099	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	6	—	< 0.1% >	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ	1,488	1,278	568	69,866	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STORA ENSO OYJ-R SHS	132	132	138	16,974	素材	
NOKIAN RENKAAT OYJ	31	29	77	9,498	自動車・自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	132	120	286	35,209	素材	
FORTUM OYJ	116	97	187	23,008	公益事業	
KONE OYJ-B	84	78	401	49,395	資本財	
METSO OYJ	29	29	91	11,208	資本財	
SAMPO OYJ-A SHS	114	105	415	51,097	保険	
WARTSILA OYJ ABP	104	104	144	17,748	資本財	
ELISA OYJ	37	31	125	15,440	電気通信サービス	
NESTE OYJ	33	89	286	35,191	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	27	27	79	9,767	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	2,333	2,124	2,800	344,405	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	12	—	< 0.4% >	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	40	37	398	49,025	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC	—	37	169	20,798	資本財	
PADDY POWER BETFAIR PLC	20	20	133	16,473	消費者サービス	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	230	233	126	15,521	銀行	
AIB GROUP PLC	200	200	79	9,822	銀行	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	—	47	118	14,562	素材	
CRH PLC	215	189	543	66,787	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	706	766	1,569	192,991	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	7	—	< 0.2% >	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	634	634	206	25,424	公益事業	
JERONIMO MARTINS	54	54	70	8,705	食品・生活必需品小売り	
GALP ENERGIA SGPS SA	133	109	155	19,148	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	823	799	433	53,277	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.1% >	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	49,825	45,514	89,012	10,945,924	
	銘柄 数 < 比 率 >	240	239	—	< 11.2% >	
(イギリス)						
BARCLAYS PLC	4,288	3,989	633	88,883	銀行	
BP PLC	4,982	4,671	2,597	364,580	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	18,120	16,655	1,004	141,060	銀行	
ASTRAZENECA PLC	318	295	1,733	243,352	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	103	87	130	18,334	資本財	
NEXT PLC	35	31	180	25,279	小売	
DIAGEO PLC	627	565	1,894	265,935	食品・飲料・タバコ	
SKY PLC	252	—	—	—	メディア・娯楽	
BAE SYSTEMS PLC	814	759	353	49,666	資本財	
UNILEVER PLC	309	258	1,242	174,361	家庭用品・パーソナル用品	
TESCO PLC	2,448	2,252	539	75,680	食品・生活必需品小売り	
RELX PLC	272	459	831	116,667	商業・専門サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	375	375	100	14,117	小売	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	167	156	977	137,215	家庭用品・パーソナル用品	
PRUDENTIAL PLC	650	603	1,004	141,011	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,513	1,425	395	55,528	保険
SAGE GROUP PLC/THE	260	261	195	27,428	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	5,032	4,669	3,056	429,051	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	576	533	1,576	221,343	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	159	146	114	16,049	公益事業
SCHRODERS PLC	28	28	87	12,294	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	869	1,095	249	34,994	銀行
BHP GROUP PLC	525	493	885	124,296	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	238	218	472	66,354	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	321	286	276	38,763	メディア・娯楽
CENTRICA PLC	1,357	1,333	124	17,493	公益事業
BT GROUP PLC	2,098	1,966	398	55,956	電気通信サービス
SSE PLC	256	233	242	34,065	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	820	656	444	62,420	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	420	387	363	50,956	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT	29,883	29,619	2	415	資本財
COMPASS GROUP PLC	405	375	676	94,955	消費者サービス
KINGFISHER PLC	522	522	119	16,726	小売
PEARSON PLC	195	195	156	22,015	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC	63	49	96	13,491	公益事業
RIO TINTO PLC	306	269	1,258	176,700	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,237	1,156	1,798	252,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC	233	234	252	35,410	各種金融
VODAFONE GROUP PLC	6,700	6,210	771	108,341	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	518	462	97	13,701	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	370	433	87	12,239	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	997	927	389	54,686	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	46	46	147	20,761	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	244	244	138	19,402	保険
WHITBREAD PLC	48	40	185	25,991	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	847	780	638	89,660	公益事業
FERGUSON PLC	63	—	—	—	資本財
BUNZL PLC	89	74	157	22,044	資本財
COBHAM PLC	657	—	—	—	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	340	240	473	66,413	素材
INTERTEK GROUP PLC	38	36	184	25,920	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	103	90	167	23,466	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	47	38	196	27,572	消費者サービス
CARNIVAL PLC	46	41	168	23,714	消費者サービス
PERSIMMON PLC	73	70	148	20,868	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	210	201	106	14,883	資本財
ITV PLC	951	728	83	11,662	メディア・娯楽
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	78	74	394	55,362	各種金融
G4S PLC	424	405	87	12,241	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	30	30	114	16,102	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	263	232	142	19,999	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	73	—	—	—	資本財
SMITH & NEPHEW PLC	218	199	325	45,668	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	853	667	118	16,629	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,143	1,052	2,667	374,466	エネルギー
TRAVIS PERKINS PLC	67	—	—	—	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	943	868	2,206	309,708	エネルギー

銘柄	株数	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		
OLD MUTUAL PLC	1,209	—	—	—	—	保険
INVESTECH PLC	179	182	89	12,623	12,623	各種金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	675	610	160	22,565	22,565	各種金融
EXPERIAN PLC	237	213	491	68,994	68,994	商業・専門サービス
MONDI PLC	97	79	135	18,988	18,988	素材
WEIR GROUP PLC/THE	59	59	93	13,109	13,109	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	88	88	226	31,839	31,839	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	101	101	84	11,889	11,889	素材
SHIRE PLC	230	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADMIRAL GROUP PLC	55	42	89	12,568	12,568	保険
FRESNILLO PLC	59	59	43	6,118	6,118	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	24	—	—	—	—	素材
BABCOCK INTL GROUP PLC	69	69	35	5,023	5,023	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC	124	110	124	17,445	17,445	各種金融
GLENCORE PLC	3,075	2,625	726	101,974	101,974	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	67	67	163	22,918	22,918	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	35	32	169	23,748	23,748	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,218	1,101	195	27,451	27,451	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	49	49	140	19,765	19,765	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC	44	44	45	6,350	6,350	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	369	273	88	12,397	12,397	保険
ROYAL MAIL PLC	241	200	47	6,719	6,719	運輸
ASHTED GROUP PLC	121	108	223	31,365	31,365	資本財
MERLIN ENTERTAINMENT	150	154	57	8,117	8,117	消費者サービス
TUI AG-DI	104	104	86	12,166	12,166	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	108	81	155	21,787	21,787	ソフトウェア・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	104	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NMC HEALTH PLC	—	25	62	8,747	8,747	ヘルスケア機器・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	211	186	109	15,338	15,338	メディア・娯楽
DCC PLC	21	24	170	23,873	23,873	資本財
GVC HOLDINGS PLC	136	136	85	12,022	12,022	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC	322	322	45	6,402	6,402	ヘルスケア機器・サービス
JOHN WOOD GROUP PLC	175	176	79	11,178	11,178	エネルギー
INFORMA PLC	—	278	215	30,239	30,239	メディア・娯楽
FERGUSON PLC	—	53	288	40,502	40,502	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	107,363	99,182	41,401	5,811,079	
	銘柄 数 < 比 率 >	99	93	—	< 6.0% >	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	782	712	7,126	776,311	776,311	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	131	120	878	95,737	95,737	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	604	588	708	77,237	77,237	各種金融
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	115	116	621	67,683	67,683	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	176	163	4,350	473,971	473,971	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG	2	2	564	61,523	61,523	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	13	13	283	30,856	30,856	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	38	35	1,147	125,013	125,013	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2	2	208	22,730	22,730	ヘルスケア機器・サービス
LONZA GROUP AG-REG	18	17	563	61,371	61,371	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	14	9	52	5,693	5,693	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	8	189	20,681	20,681	資本財
GEBERIT AG-REG	9	8	383	41,755	41,755	資本財
SWISS RE AG	79	73	683	74,411	74,411	保険

銘柄	株数	当期		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		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	7	206	22,520		耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR	10	5	42	4,618		各種金融
NOVARTIS AG-REG	559	504	4,241	462,041		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	222	24,188		商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	6	6	308	33,573		電気通信サービス
ABB LTD-REG	457	422	818	89,149		資本財
CLARIANT AG-REG	58	50	96	10,496		素材
SGS SA-REG	1	1	308	33,639		商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4	6	126	13,758		資本財
TEMENOS AG - REG	—	12	220	24,075		ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	12	12	171	18,656		運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	11	11	201	21,944		保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	8	389	42,441		保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.02	153	16,711		食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	54	54	241	26,359		各種金融
SIKA AG-REG	0.54	29	460	50,117		素材
SWISS PRIME SITE-REG	19	14	123	13,433		不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.26	0.26	176	19,203		食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4	3	279	30,420		各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.61	0.59	114	12,494		食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1	1	112	12,233		素材
UBS GROUP AG-REG	922	892	1,083	118,072		各種金融
DUFREY AG-REG	9	8	75	8,209		小売
VIFOR PHARMA AG	13	9	129	14,100		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALCON INC	—	98	611	66,583		ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	4,206	4,075	28,676	3,124,023	
銘柄数<比率>		37	39	—	<3.2%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ			
ELECTROLUX AB-SER B	62	62	1,402	16,030		耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	777	709	6,431	73,507		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	95	83	2,115	24,180		資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	382	371	3,317	37,920		銀行
INVESTOR AB-B SHS	115	105	4,632	52,953		各種金融
NORDEA BANK AB	755	—	—	—		銀行
GETINGE AB-B SHS	53	—	—	—		ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	388	350	3,544	40,518		銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	170	159	4,439	50,743		資本財
SKF AB-B SHARES	90	90	1,438	16,446		資本財
ASSA ABLOY AB-B	252	239	4,706	53,799		資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	244	195	3,129	35,769		小売
SANDVIK AB	283	261	4,258	48,676		資本財
SWEDBANK AB - A SHARES	230	204	2,951	33,738		銀行
SECURITAS AB-B SHS	69	58	937	10,713		商業・専門サービス
SKANSKA AB-B SHS	80	80	1,292	14,776		資本財
SWEDISH MATCH AB	47	42	1,984	22,679		食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	98	122	1,564	17,884		電気通信サービス
TELIA CO AB	698	618	2,521	28,823		電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS	397	367	5,198	59,421		資本財
ALFA LAVAL AB	68	60	1,266	14,479		資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	51	44	1,325	15,147		エネルギー
BOLIDEN AB	70	63	1,475	16,864		素材
HUSQVARNA AB-B SHS	107	107	916	10,473		耐久消費財・アパレル

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		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	千円			
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	14	11	633	電気通信サービス		
HEXAGON AB-B SHS	63	63	3,081	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
KINNEVIK AB - B	60	60	1,583	各種金融		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	41	41	841	各種金融		
ICA GRUPPEN AB	20	20	768	食品・生活必需品小売り		
LUNDBERGS AB-B SHS	20	20	634	各種金融		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	152	143	4,117	家庭用品・パーソナル用品		
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	95	—	—	資本財		
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	170	—	—	資本財		
BOLIDEN AB-REDEMPTION	70	—	—	素材		
EPIROC AB-B	—	95	870	資本財		
EPIROC AB-A	—	137	1,308	資本財		
NORDEA BANK ABP	—	730	5,267	銀行		
小 計	株数・金額	6,301	5,722	79,959	913,939	
	銘柄数<比率>	34	32	—	<0.9%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	246	224	3,501	43,907	銀行	
NORSK HYDRO ASA	313	311	1,045	13,105	素材	
ORKLA ASA	213	165	1,242	15,580	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	293	264	4,870	61,075	エネルギー	
TELENOR ASA	185	172	3,034	38,049	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	42	42	1,564	19,622	素材	
MOWI ASA	104	104	2,103	26,379	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	56	37	661	8,289	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	25	25	500	6,281	メディア・娯楽	
AKER BP ASA	—	26	700	8,790	エネルギー	
小 計	株数・金額	1,481	1,374	19,224	241,080	
	銘柄数<比率>	9	10	—	<0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	468	423	13,260	218,404	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	55	48	1,579	26,013	素材	
DANSKE BANK A/S	189	167	1,821	30,001	銀行	
DEMANT A/S	31	26	590	9,720	ヘルスケア機器・サービス	
H LUNDBECK A/S	18	18	505	8,330	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	54	45	2,542	41,872	資本財	
CARLSBERG AS-B	26	26	2,300	37,888	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	31	28	2,021	33,297	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	46	43	2,570	42,329	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1	1	1,125	18,536	運輸	
TRYG A/S	30	30	649	10,703	保険	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.92	0.92	696	11,477	運輸	
PANDORA A/S	26	26	671	11,062	耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	43	32	700	11,536	商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	23	23	1,712	28,211	素材	
GENMAB A/S	14	13	1,571	25,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ORSTED A/S	46	41	2,166	35,680	公益事業	
小 計	株数・金額	1,112	998	36,487	600,950	
	銘柄数<比率>	17	17	—	<0.6%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP GROUP LTD	809	686	2,641	201,086	素材	
CSL LTD	113	105	2,177	165,790	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALUMINA LTD	655	460	110	8,381	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	237	223	829	63,193	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	741	668	1,728	131,638	銀行
RIO TINTO LTD	102	84	855	65,121	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	335	297	379	28,864	保険
LENLELEASE GROUP	146	146	207	15,813	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	442	412	3,005	228,842	銀行
WESTPAC BANKING CORP	856	800	2,034	154,939	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	680	639	1,528	116,410	銀行
BRAMBLES LTD	388	389	489	37,269	商業・専門サービス
BORAL LTD	277	277	130	9,918	素材
WOOLWORTHS GROUP LTD	329	301	1,031	78,565	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	1,014	1,017	362	27,584	電気通信サービス
AMP LTD	715	715	157	11,988	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	458	458	211	16,141	消費者サービス
AMCOR LIMITED	287	287	477	36,393	素材
COMPUTERSHARE LTD	108	94	167	12,791	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	144	127	345	26,269	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	82	74	897	68,367	各種金融
CIMIC GROUP LTD	27	27	128	9,774	資本財
ASX LTD	51	43	331	25,260	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	119	119	111	8,486	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	14	14	285	21,745	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	119	91	168	12,834	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	150	159	60	4,644	小売
NEWCREST MINING LTD	188	187	503	38,348	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	586	508	408	31,097	保険
ORIGIN ENERGY LTD	426	430	339	25,871	エネルギー
ORICA LTD	87	73	151	11,502	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	105	106	282	21,528	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	444	377	275	20,963	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	321	321	444	33,816	保険
TRANSURBAN GROUP	564	612	854	65,099	運輸
WESFARMERS LTD	282	260	947	72,159	小売
BLUESCOPE STEEL LTD	130	130	169	12,884	素材
CHALLENGER LTD	134	134	105	8,048	各種金融
SYDNEY AIRPORT	263	261	204	15,565	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	62	62	168	12,802	エネルギー
OIL SEARCH LTD	329	332	257	19,617	エネルギー
WORLEYPARSONS LTD	—	77	110	8,443	エネルギー
AGL ENERGY LTD	164	164	369	28,116	公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD	424	367	328	25,027	素材
AUSNET SERVICES	572	572	106	8,106	公益事業
CROWN RESORTS LTD	109	83	108	8,223	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	467	376	125	9,547	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	127	127	135	10,287	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	547	527	270	20,565	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	193	167	261	19,901	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD	37	32	209	15,914	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	14	59	4,522	消費者サービス
SEEK LTD	91	66	134	10,241	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	110	110	96	7,380	銀行
REA GROUP LTD	15	9	83	6,378	メディア・娯楽



銘柄	株数	当 期		業 種 等		
		株 数	株 数		評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
TPG TELECOM LTD	104	104	64	4,941	電気通信サービス	
HEALTHSCOPE LTD	471	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	762	687	197	15,070	保険	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	17	17	70	5,378	消費者サービス	
SOUTH32 LTD	1,307	1,200	422	32,186	素材	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	—	27	62	4,764	エネルギー	
COLES GROUP LTD	—	280	362	27,591	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	18,880	17,542	29,551	2,250,014	
	銘柄 数 < 比 率 >	59	61	—	< 2.3% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	380	482	181	13,050	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	258	170	146	10,535	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	138	138	224	16,153	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	176	177	90	6,518	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	110	70	81	5,844	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	356	356	154	11,089	公益事業	
MERCURY NZ LTD	196	—	—	—	公益事業	
A2 MILK CO LTD	—	182	296	21,323	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,617	1,578	1,173	84,516	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 0.1% >	
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	320	320	726	10,198	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	130	100	945	13,274	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	681	611	4,788	67,227	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	370	375	5,025	70,551	不動産	
MTR CORP	395	380	1,824	25,608	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	2,092	2,111	4,003	56,206	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,550	1,340	1,650	23,178	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	345	345	1,928	27,076	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	299	270	6,604	92,722	各種金融	
HANG LUNG GROUP LTD	240	240	510	7,160	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	450	450	792	11,119	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	415	375	3,277	46,016	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	310	281	1,358	19,070	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	329	329	796	11,178	銀行	
HANG SENG BANK LTD	192	181	3,627	50,926	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	170	170	716	10,060	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	360	360	382	5,367	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	71	71	555	7,800	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	842	842	1,099	15,439	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	210	210	447	6,280	耐久消費財・アパレル	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	180	150	954	13,404	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	930	835	2,709	38,042	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	330	335	1,680	23,587	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	1,230	1,240	569	7,991	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	1,684	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	185	185	596	8,376	不動産	
MINTH GROUP LTD	180	180	414	5,812	自動車・自動車部品	
NWS HOLDINGS LTD	440	310	492	6,920	資本財	
SANDS CHINA LTD	588	528	2,051	28,799	消費者サービス	
WHEELLOCK & CO LTD	220	210	1,143	16,054	不動産	
WYNN MACAU LTD	424	308	540	7,584	消費者サービス	

銘柄	株数	当 期 末			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		
SJM HOLDINGS LTD	580	580	516	7,255	消費者サービス	
FIRST PACIFIC CO	620	—	—	—	各種金融	
AIA GROUP LTD	3,028	2,796	21,543	302,466	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	314	250	795	11,161	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	580	560	2,791	39,194	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	264	264	342	4,811	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,030	960	1,144	16,066	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	2,120	2,120	1,596	22,412	食品・飲料・タバコ	
CK ASSET HOLDINGS LTD	641	616	3,732	52,402	不動産	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	1,020	—	—	—	各種金融	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	320	260	1,492	20,953	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	26,681	22,051	86,165	1,209,761	
	銘柄 数 < 比 率 >	42	39	—	< 1.2% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	800	752	838	67,137	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	436	306	72	5,840	メディア・娯楽	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	293	293	74	5,935	資本財	
CAPITALAND LTD	607	612	203	16,317	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	113	61	52	4,205	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	27	89	7,173	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	444	411	1,064	85,200	銀行	
KEPPEL CORP LTD	348	348	220	17,666	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	334	302	754	60,404	銀行	
VENTURE CORP LTD	—	70	109	8,743	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	431	294	114	9,180	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,036	1,916	601	48,194	電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	155	141	131	10,529	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	212	212	157	12,578	各種金融	
UOL GROUP LTD	138	138	97	7,790	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	562	562	139	11,159	運輸	
STARHUB LTD	159	—	—	—	電気通信サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,857	1,857	51	4,090	食品・飲料・タバコ	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	444	444	158	12,656	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE LTD	1,397	1,397	124	9,955	消費者サービス	
SATS LTD	190	188	95	7,647	運輸	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	635	635	93	7,474	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,620	10,968	5,243	419,880	
	銘柄 数 < 比 率 >	21	21	—	< 0.4% >	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ISRAEL CHEMICALS LTD	144	189	368	11,374	素材	
BANK HAOALIM BM	251	251	658	20,306	銀行	
NICE LTD	16	15	803	24,769	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	344	316	785	24,224	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	5	5	285	8,800	資本財	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	593	593	157	4,846	電気通信サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	38	38	296	9,145	銀行	
AZRIELI GROUP LTD	11	11	233	7,215	不動産	
FRUTAROM	10	—	—	—	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,415	1,421	3,588	110,684	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 0.1% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	317,729	290,745	—	91,923,521	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,261	1,252	—	< 94.3% >	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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	%
HCP INC	11	10	327	36,057	0.0
MACERICH CO/THE	3	2	117	12,986	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	2	381	42,083	0.0
PROLOGIS INC	13	14	1,119	123,335	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2	232	25,641	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3	3	209	23,100	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	5	4	581	64,105	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	435	47,927	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	3	321	35,392	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	212	23,457	0.0
WELLTOWER INC	9	8	678	74,776	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	3	3	477	52,624	0.1
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	2	284	31,396	0.0
REALTY INCOME CORP	7	7	488	53,847	0.1
REGENCY CENTERS CORP	3	3	226	24,971	0.0
SL GREEN REALTY CORP	2	1	161	17,841	0.0
UDR INC	6	6	270	29,837	0.0
VENTAS INC	9	8	552	60,826	0.1
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	27	33	315	34,740	0.0
WEYERHAEUSER CO	19	16	404	44,606	0.0
AMERICAN TOWER CORP	10	10	2,074	228,570	0.2
AGNC INVESTMENT CORP	9	12	216	23,863	0.0
WP CAREY INC	—	3	319	35,220	0.0
VEREIT INC	25	20	174	19,203	0.0
DUKE REALTY CORP	9	8	269	29,745	0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6	—	—	—	—
IRON MOUNTAIN INC	6	6	214	23,665	0.0
EQUINIX INC	1	1	904	99,656	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP	10	9	1,227	135,186	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	9	8	643	70,864	0.1
COLONY CAPITAL INC	14	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	7	7	201	22,230	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	2	51	5,632	0.0
GGP INC	14	—	—	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	18	16	316	34,895	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	3	3	146	16,173	0.0
PUBLIC STORAGE	3	3	830	91,547	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	7	1,256	138,462	0.1
VORNADO REALTY TRUST	4	4	280	30,923	0.0
KIMCO REALTY CORP	11	9	175	19,369	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	3	652	71,906	0.1
小 計	口 数	口 数	金 額	金 額	
	318	279	17,760	1,956,675	
銘 柄 数 < 比 率 >	39	38	—	< 2.0% >	

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	%
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1	1	60	4,958	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3	3	85	7,049	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		4	4	110	9,055	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	9	9	256	21,062	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	1	150	18,532	0.0
KLEPIERRE		5	5	160	19,762	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		2	—	—	—	—
COVIVIO		0.885	1	107	13,256	0.0
ICADE		0.932	0.932	71	8,853	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	10	8	491	60,405	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	3	453	55,794	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	—	3	453	55,794	
	銘柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	10	11	944	116,199	
	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	22	126	17,744	0.0
HAMMERSON PLC		21	17	50	7,151	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		17	17	158	22,260	0.0
SEGRO PLC		26	25	182	25,554	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	88	83	518	72,711	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		89	83	216	16,482	0.0
SCENTRE GROUP		133	121	465	35,422	0.0
GPT GROUP		47	39	231	17,610	0.0
MIRVAC GROUP		100	94	278	21,215	0.0
STOCKLAND		64	47	187	14,293	0.0
WESTFIELD CORP		48	—	—	—	—
DEXUS		26	21	285	21,715	0.0
GOODMAN GROUP		47	39	537	40,934	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	557	447	2,202	167,674	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	7	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		55	50	4,789	67,250	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	55	50	4,789	67,250	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		67	53	96	7,724	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		58	58	111	8,963	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		65	64	157	12,620	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	
(シンガポール) ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	千口 54	千口 51	千シンガポールドル 151	千円 12,129	% 0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 245	227	517	41,437	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額 1,286	1,110	—	2,443,013	
	銘 柄 数 < 比 率 >	64	—	< 2.5% >	

(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 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
株式先物取引		
SP EMINI	2,096	—
SP/TSE60	112	—
SWISS IX	94	—
EURO ST	422	—
SPI 200	145	—
FTSE100	185	—

(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

(2019年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 91,923,521	% 94.2
投資証券	2,443,013	2.5
コール・ローン等、その他	3,182,354	3.3
投資信託財産総額	97,548,888	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(97,407,310千円)の投資信託財産総額(97,548,888千円)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=110.17円	1 カナダドル=81.98円	1 ユーロ=122.97円	1 イギリスポンド=140.36円
1 スイスフラン=108.94円	1 スウェーデンクローネ=11.43円	1 ノルウェークローネ=12.54円	1 デンマーククローネ=16.47円
1 オーストラリアドル=76.14円	1 ニュージーランドドル=72.01円	1 香港ドル=14.04円	1 シンガポールドル=80.07円
1 イスラエルシェケル=30.84円			

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	97,578,534,454
コール・ローン等	2,458,948,784
株式(評価額)	91,923,521,481
投資証券(評価額)	2,443,013,252
未収入金	58,350,085
未収配当金	185,245,481
差入委託証拠金	509,455,371
(B) 負債	114,083,555
未払金	64,296,624
未払解約金	49,786,739
未払利息	192
(C) 純資産総額(A-B)	97,464,450,899
元本	40,500,882,275
次期繰越損益金	56,963,568,624
(D) 受益権総口数	40,500,882,275口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,065円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 45,235,834,310円  
 期中追加設定元本額 8,442,236,783円  
 期中一部解約元本額 13,177,188,818円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2,4065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 ライフセレクトファンド(安定型)	292,934,069円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	1,193,497,792円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,080,294,982円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,551,486,133円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	13,319,800,238円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	12,102,797,498円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	109,546,512円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	241,904,647円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,338,929,077円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	3,927,158円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	29,212,004円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	39,000,540円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国株式)	399,808円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	8,197,125,847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)	25,970円
合計	40,500,882,275円

## ○損益の状況 (2018年5月22日～2019年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,277,679,490
受取配当金	2,240,390,493
受取利息	19,258,694
その他収益金	20,974,591
支払利息	△ 2,944,288
(B) 有価証券売買損益	776,883,149
売買益	10,265,744,042
売買損	△ 9,488,860,893
(C) 先物取引等取引損益	209,122,970
取引益	561,494,658
取引損	△ 352,371,688
(D) 保管費用等	△ 40,976,336
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,222,709,273
(F) 前期繰越損益金	60,987,041,265
(G) 追加信託差損益金	10,831,510,934
(H) 解約差損益金	△18,077,692,848
(I) 計(E+F+G+H)	56,963,568,624
次期繰越損益金(I)	56,963,568,624

(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 国内債券マザーファンド

### 《第19期》決算日2019年5月20日

[計算期間：2018年5月22日～2019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19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19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
15期(2015年5月20日)	13,192	2.5	362,715	2.4	99.3	—	256,631
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

(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		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(期 首) 2018年5月21日	円 13,877	% —	381.504	% —	% 99.2	% 0.4
5月末	13,912	0.3	382.498	0.3	98.3	0.5
6月末	13,919	0.3	382.669	0.3	99.1	0.5
7月末	13,894	0.1	381.979	0.1	100.6	0.5
8月末	13,819	△0.4	379.893	△0.4	99.3	0.6
9月末	13,786	△0.7	378.986	△0.7	100.3	0.6
10月末	13,810	△0.5	379.645	△0.5	95.7	0.2
11月末	13,868	△0.1	381.238	△0.1	99.5	0.5
12月末	13,969	0.7	384.131	0.7	95.9	0.1
2019年1月末	14,027	1.1	385.580	1.1	100.8	0.1
2月末	14,057	1.3	386.427	1.3	100.8	0.1
3月末	14,156	2.0	389.143	2.0	99.1	0.1
4月末	14,110	1.7	387.945	1.7	100.8	0.2
(期 末) 2019年5月20日	14,116	1.7	388.062	1.7	99.3	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1.7%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(1.7%)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。



**●投資環境について**

- ・国内債券市況は、日本銀行による金融緩和策の柔軟化を受けて下落する局面もありましたが、期の後半にかけ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、期を通じて見ると上昇しました。

**●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1.7%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

主なマイナス要因：評価時価差異要因\*

※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

(2018年5月22日～2019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、13,935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

(2018年5月22日～2019年5月20日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	59,274,866	49,281,444 ( 100,000)
	地方債証券	1,989,954	2,191,693
	特殊債券	3,516,076	3,307,956 ( 289,665)
	社債券	5,117,149	2,248,239 ( 200,000)

(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 6,500	百万円 6,959	百万円 -	百万円 -

## ○利害関係人との取引状況等

(2018年5月22日～2019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	$\frac{D}{C}$

(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 500	百万円 501	百万円 820

## 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、日立キャピタルです。

## ○組入資産の明細

(2019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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	179,619,000	197,477,080	82.6	—	54.6	18.1	9.9
地方債証券	11,538,920	12,347,360	5.2	—	3.3	1.3	0.6
	( 11,538,920)	( 12,347,360)	( 5.2)	(—)	( 3.3)	( 1.3)	( 0.6)
特殊債券 (除く金融債)	12,645,147	13,650,507	5.7	—	3.8	1.5	0.4
	( 12,645,147)	( 13,650,507)	( 5.7)	(—)	( 3.8)	( 1.5)	( 0.4)
金融債券	1,200,000	1,201,303	0.5	—	—	0.4	0.1
	( 1,200,000)	( 1,201,303)	( 0.5)	(—)	( —)	( 0.4)	( 0.1)
普通社債券	12,511,000	12,783,827	5.3	—	2.0	2.8	0.5
	( 12,511,000)	( 12,783,827)	( 5.3)	(—)	( 2.0)	( 2.8)	( 0.5)
合 計	217,514,067	237,460,079	99.3	—	63.7	24.1	11.5
	( 37,895,067)	( 39,982,998)	(16.7)	(—)	( 9.1)	( 6.0)	( 1.6)

(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389回利付国債 (2年)	0.1	550,000	551,501	2020/6/1
第390回利付国債 (2年)	0.1	850,000	852,507	2020/7/1
第391回利付国債 (2年)	0.1	600,000	601,902	2020/8/1
第392回利付国債 (2年)	0.1	1,150,000	1,153,910	2020/9/1
第393回利付国債 (2年)	0.1	450,000	451,629	2020/10/1
第394回利付国債 (2年)	0.1	400,000	401,508	2020/11/1
第395回利付国債 (2年)	0.1	670,000	672,673	2020/12/1
第396回利付国債 (2年)	0.1	1,650,000	1,656,946	2021/1/1
第397回利付国債 (2年)	0.1	500,000	502,215	2021/2/1
第399回利付国債 (2年)	0.1	1,100,000	1,105,335	2021/4/1
第124回利付国債 (5年)	0.1	1,880,000	1,885,395	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)	0.1	2,110,000	2,117,469	2020/9/20
第126回利付国債 (5年)	0.1	1,020,000	1,024,284	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	1,500,000	1,507,290	2021/3/20
第128回利付国債 (5年)	0.1	2,310,000	2,322,774	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)	0.1	2,350,000	2,364,570	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)	0.1	1,030,000	1,037,076	2021/12/20
第131回利付国債 (5年)	0.1	1,210,000	1,219,111	2022/3/20
第132回利付国債 (5年)	0.1	2,070,000	2,086,974	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)	0.1	1,080,000	1,089,774	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)	0.1	1,470,000	1,484,303	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	1,210,000	1,222,584	2023/3/20
第136回利付国債 (5年)	0.1	190,000	192,107	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	2,120,000	2,144,507	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	4,730,000	4,787,847	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	400,000	405,160	2024/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	220,000	330,319	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	415,000	604,410	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	285,000	418,331	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	520,000	769,080	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	430,000	615,364	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	440,000	620,936	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	400,000	543,192	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	520,000	659,198	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	600,000	564,654	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	940,000	1,039,762	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	770,000	824,993	2058/3/20
第308回利付国債 (10年)	1.3	690,000	700,957	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)	1.1	1,580,000	1,601,661	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)	1.0	1,500,000	1,523,355	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)	0.8	590,000	597,611	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)	1.2	2,180,000	2,227,240	2020/12/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	840,000	862,503	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	580,000	593,409	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	780,000	802,159	2021/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第316回利付国債 (10年)	1.1	400,000	410,528	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	250,000	257,380	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	550,000	564,943	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)	1.1	790,000	815,927	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	640,000	659,340	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)	1.0	870,000	898,814	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)	0.9	420,000	432,717	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	470,000	485,505	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	1,009,292	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,390,000	1,434,966	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	100,000	103,118	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	880,000	910,606	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,770,000	1,822,179	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	1,530,000	1,590,679	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,450,000	1,511,074	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	640,000	661,369	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,680,000	1,739,354	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	700,000	726,068	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,160,000	1,205,472	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	1,820,000	1,885,119	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	420,000	435,615	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	980,000	1,005,391	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,440,000	1,487,448	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	2,160,000	2,234,282	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	1,870,000	1,936,385	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,100,000	1,133,286	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	230,000	233,967	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	1,730,000	1,760,949	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	1,940,000	1,975,230	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	1,790,000	1,822,918	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	1,550,000	1,578,194	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	1,690,000	1,721,045	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	1,690,000	1,720,572	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	1,410,000	1,435,027	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	2,100,000	2,135,511	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	1,930,000	1,962,674	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	2,130,000	2,165,038	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	2,900,000	2,946,139	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	900,000	913,329	2029/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	120,000	154,722	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	170,000	214,103	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	190,000	238,056	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	125,000	166,308	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	180,000	226,422	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	170,000	219,359	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	225,000	289,251	2032/5/20

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8回利付国債 (30年)		1.8	160,000	196,248	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)		1.4	90,000	105,608	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)		1.1	263,000	298,265	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)		1.7	100,000	121,795	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	205,000	261,645	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	390,000	493,318	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	380,000	504,035	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	440,000	591,624	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	345,000	465,477	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	350,000	468,132	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	360,000	477,100	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	290,000	385,186	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	260,000	354,588	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	250,000	333,465	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	285,000	390,455	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)		2.5	140,000	192,234	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)		2.5	230,000	316,503	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	205,000	275,782	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	430,000	587,302	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	400,000	555,824	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	415,000	579,273	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	480,000	663,595	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	625,000	855,750	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	725,000	983,339	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	570,000	787,318	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)		2.0	623,000	826,247	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	815,000	1,118,506	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	790,000	1,055,645	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	790,000	1,059,966	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	820,000	1,085,983	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	435,000	568,110	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	840,000	1,117,998	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	450,000	589,707	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)		1.7	250,000	322,382	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	570,000	735,704	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)		1.7	520,000	671,793	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	520,000	673,176	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)		1.5	550,000	686,427	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	660,000	824,175	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)		1.6	810,000	1,032,247	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	660,000	809,523	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	770,000	944,797	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	530,000	570,990	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	350,000	332,507	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	540,000	540,000	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)		0.6	610,000	624,786	2046/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
国債証券	%	千円	千円	
第54回利付国債 (30年)	0.8	430,000	462,078	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	660,000	709,625	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	620,000	666,159	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	770,000	826,733	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	630,000	676,771	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	370,000	387,312	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	650,000	714,681	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	710,000	741,815	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	270,000	267,224	2049/3/20
第47回利付国債 (20年)	2.2	100,000	103,168	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	250,000	260,595	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	170,000	177,072	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)	1.9	515,000	534,528	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	140,000	146,340	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	260,000	273,813	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)	2.1	80,000	84,700	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)	2.2	530,000	562,520	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	240,000	254,786	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	370,000	394,815	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)	1.9	160,000	170,235	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	350,000	374,230	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	590,000	629,665	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)	1.4	230,000	242,974	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	260,000	271,674	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	560,000	582,209	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	275,000	297,145	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	480,000	523,152	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	430,000	470,897	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	170,000	185,385	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	80,000	88,021	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	395,000	440,373	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	120,000	133,201	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	510,000	576,896	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	224,184	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	645,000	723,425	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	200,000	224,274	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	380,000	428,260	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	230,000	260,511	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	210,000	235,389	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	260,000	292,962	2025/3/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	100,000	113,231	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	370,000	421,226	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	620,000	709,205	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	182,000	209,227	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	410,000	468,609	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	230,000	265,528	2026/3/20



銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第86回利付国債 (20年)	2.3	532,000	621,514	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	170,000	197,431	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	460,000	540,283	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	130,000	151,759	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	470,000	551,291	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	80,000	94,429	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	650,000	761,013	2026/12/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	260,000	305,622	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	490,000	586,534	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	120,000	141,684	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	330,000	393,954	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	340,000	403,032	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	635,000	755,618	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	370,000	445,217	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	350,000	427,378	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	190,000	233,107	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	320,000	389,673	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	310,000	371,826	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	350,000	421,358	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	210,000	254,788	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	240,000	289,968	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	500,000	594,460	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	60,000	71,522	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	280,000	339,301	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	450,000	551,758	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	610,000	741,766	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	460,000	561,278	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	580,000	710,030	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	290,000	358,089	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	215,000	266,369	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	510,000	626,325	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	444,000	542,106	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	240,000	287,714	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	200,000	235,332	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	490,000	594,507	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	310,000	372,610	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	500,000	619,830	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	340,000	417,557	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	660,000	828,339	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	330,000	406,395	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	80,000	97,577	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	600,000	733,746	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	580,000	703,992	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	420,000	504,642	2031/9/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	730,000	888,081	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	1,010,000	1,231,402	2032/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
第135回利付国債 (20年)		1.7	220,000	265,430	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	60,000	71,627	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)		1.7	310,000	374,774	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	880,000	1,065,970	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)		1.7	820,000	995,160	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	480,000	588,960	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	540,000	649,166	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	470,000	558,613	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	1,080,000	1,315,386	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	1,020,000	1,244,471	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	790,000	954,154	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	1,040,000	1,242,779	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	640,000	765,728	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	1,120,000	1,324,881	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	750,000	865,305	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	840,000	969,628	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	1,260,000	1,474,792	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	950,000	1,097,658	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	1,170,000	1,313,910	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	940,000	962,766	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	770,000	761,814	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	930,000	965,414	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	1,030,000	1,085,228	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	1,070,000	1,145,338	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	820,000	862,927	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	890,000	935,585	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	730,000	766,521	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	950,000	979,497	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	930,000	957,518	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	530,000	564,614	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	1,100,000	1,129,205	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	380,000	382,458	2039/3/20
小	計		179,619,000	197,477,080	
<b>地方債証券</b>					
第5回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	112,108	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	113,470	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	70,000	95,581	2038/9/17
第10回東京都公募公債 (20年)		2.33	100,000	116,746	2026/9/18
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	133,792	2039/9/20
第25回東京都公募公債 (20年)		1.8	100,000	119,562	2031/12/19
第27回東京都公募公債 (20年)		1.68	100,000	118,863	2032/12/20
第700回東京都公募公債		1.02	100,000	102,339	2021/9/17
第710回東京都公募公債		0.81	100,000	102,450	2022/6/20
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	206,474	2023/3/20
第730回東京都公募公債		0.664	100,000	103,132	2024/3/19
第749回東京都公募公債		0.436	100,000	102,567	2025/9/19

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	101,127	2027/6/18
第771回東京都公募公債	0.155	200,000	201,808	2027/9/17
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	110,837	2024/3/19
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	80,000	81,067	2020/10/29
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	51,300	2022/10/31
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	100,000	102,354	2024/12/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	100,311	2026/4/28
平成29年度第1回北海道公募公債	0.2	272,000	275,008	2027/4/28
平成29年度第13回北海道公募公債	0.21	108,000	109,149	2027/12/28
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	100,000	140,232	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	137,967	2038/3/19
第227回神奈川県公募公債	0.18	100,000	101,087	2027/6/18
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	121,405	2030/5/28
第342回大阪府公募公債	1.2	25,000	25,396	2020/9/29
第344回大阪府公募公債	1.06	21,000	21,327	2020/11/27
第348回大阪府公募公債	1.32	50,000	51,194	2021/3/30
第358回大阪府公募公債	0.97	70,000	71,816	2022/2/28
第404回大阪府公募公債	0.4	400,000	409,612	2026/1/28
第408回大阪府公募公債	0.072	118,000	118,264	2026/5/29
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	2.19	100,000	121,071	2029/9/20
平成22年度第2回京都府公募公債	1.16	40,000	40,617	2020/9/24
平成22年度第7回京都府公募公債	1.31	45,900	46,991	2021/3/22
平成23年度第2回京都府公募公債	1.2	66,000	67,634	2021/6/22
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	50,000	67,474	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債(12年)	0.73	100,000	104,927	2026/8/6
第5回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	110,803	2028/5/26
平成23年度第11回兵庫県公募公債	0.95	50,000	51,229	2022/1/27
平成28年度第29回兵庫県公募公債	0.238	100,000	101,413	2027/2/19
第3回静岡県公募公債(15年)	1.368	100,000	110,987	2027/10/29
第14回静岡県公募公債(20年)	1.736	100,000	119,047	2032/6/18
平成25年度第7回静岡県公募公債	0.801	100,000	103,404	2023/9/20
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	29,800	30,702	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	2.04	200,000	236,632	2028/12/20
平成22年度第5回愛知県公募公債	1.258	27,200	27,576	2020/6/30
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	71,733	2021/10/28
平成23年度第13回愛知県公募公債	1.529	200,000	222,230	2026/11/13
平成23年度第20回愛知県公募公債	1.082	100,000	103,047	2022/3/29
平成28年度第16回愛知県公募公債	0.259	200,000	203,378	2027/2/12
平成22年度第3回広島県公募公債	1.08	45,000	45,645	2020/9/24
平成26年度第7回広島県公募公債	0.46	260,000	266,526	2025/3/25
平成27年度第5回広島県公募公債	0.41	200,000	204,936	2026/1/26
平成30年度第1回広島県公募公債	0.2	100,000	101,016	2028/5/25
第8回埼玉県公募公債(20年)	2.19	100,000	121,071	2029/9/20
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	119,931	2030/11/12
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	40,000	40,895	2021/2/25
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	102,623	2021/4/27

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
地方債証券	%	千円	千円
平成22年度第10回福岡県公募公債	1.36	50,000	51,189
平成24年度第6回福岡県公募公債	0.8	100,000	102,693
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	80,000	81,790
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	80,000	81,941
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	82,104
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	80,000	82,242
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	80,000	82,425
平成27年度第3回千葉県公募公債	0.524	200,000	206,016
平成27年度第2回新潟県公募公債	0.215	140,000	141,654
平成29年度第3回新潟県公募公債	0.23	100,000	101,317
平成22年度第1回岐阜県公募公債	1.21	42,000	42,684
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	101,492
第96回共同発行市場公募地方債	1.29	20,000	20,470
第104回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	102,555
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	70,000	71,981
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	308,280
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	103,430
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	103,488
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	103,124
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	200,000	206,642
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	205,250
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	203,574
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	205,136
第186回共同発行市場公募地方債	0.25	200,000	202,778
平成22年度第8回大阪市公募公債	1.28	50,000	51,065
平成22年度第10回大阪市公募公債	1.31	20,000	20,472
平成26年度第7回大阪市公募公債	0.535	100,000	102,793
第1回名古屋市公募公債(20年)	1.99	100,000	109,053
第9回名古屋市公募公債(20年)	2.07	100,000	118,826
第9回名古屋市公募公債(30年)	2.095	90,000	119,005
第3回京都市公募公債(20年)	2.09	100,000	113,465
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	110,000	129,427
平成23年度第5回神戸市公募公債	1.025	100,000	102,440
第5回横浜市公募公債(20年)	2.17	100,000	113,001
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	250,000	283,170
第11回横浜市公募公債(20年)	2.2	200,000	232,660
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	40,000	47,137
平成22年度第7回札幌市公募公債	1.05	50,000	50,688
平成30年度第5回札幌市公募公債	0.264	100,000	101,564
第7回川崎市公募公債(20年)	2.08	100,000	119,669
平成22年度第9回福岡市公募公債	1.32	127,300	130,365
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	50,000	51,202
平成24年度第4回福岡市公募公債	0.8	70,000	71,894
平成22年度第6回広島市公募公債	1.21	50,000	51,212
平成22年度第1回相模原市公募公債	1.29	60,000	61,209
平成22年度第1回三重県公募公債	1.056	149,170	151,547

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	162,550	166,686	2021/11/30
平成30年度第1回山梨県公募公債		0.289	100,000	101,864	2028/10/30
平成22年度第1回岡山県公募公債		1.05	50,000	50,792	2020/11/30
小	計		11,538,920	12,347,360	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
第6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	103,431	2021/2/26
第9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	103,579	2021/3/26
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	200,000	241,736	2029/10/31
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	121,525	2030/4/30
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	133,617	2040/5/31
第114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	119,604	2030/7/31
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	125,850	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	119,819	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	14,365	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	204,984	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	131,193	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	102,896	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	300,000	308,556	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	30,964	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	348,782	2023/5/31
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	103,308	2024/3/29
第218回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.66	201,000	208,039	2024/5/31
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	103,474	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	102,914	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	102,785	2024/12/27
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.44	400,000	411,824	2025/8/29
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.195	120,000	122,013	2028/2/29
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	101,886	2020/7/15
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	109,082	2028/4/28
第12回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	104,501	2021/6/28
第1回政府保証公営企業債券(15年)		1.6	200,000	203,566	2020/6/22
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	11,000	11,236	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	20,483	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	127,612	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	205,838	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	35,922	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	102,843	2022/9/16
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	39,212	2023/2/17
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	103,689	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	100,000	103,340	2023/12/18
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	100,000	100,341	2026/3/13
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.115	200,000	202,228	2027/1/19
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	125,000	126,887	2027/7/16
第2回政府保証公営企業債券(15年)		2.1	100,000	104,073	2021/4/16
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	92,922	2023/10/20
第211回政府保証預金保険機構債券		0.1	100,000	100,326	2021/10/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第5回	政府保証新関西国際空港債券	0.145	100,000	101,379	2027/3/30
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	200,214	2022/5/20
第13回	政府保証中部国際空港債券	1.3	72,000	73,748	2021/3/15
第36回	日本政策投資銀行債券(財投機関債)	2.23	30,000	35,142	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	155,482	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	162,435	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	151,518	2047/3/20
第22回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	110,000	164,367	2047/3/20
第28回	道路債券(財投機関債)	2.83	100,000	135,455	2033/12/20
第30回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.25	100,000	118,310	2027/12/20
第47回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.41	100,000	122,151	2029/4/20
第67回	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.3	100,000	102,331	2021/3/19
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	119,486	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	103,734	2023/6/20
第3回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	100,000	103,854	2023/3/22
第4回	回営企業債券(30年)(財投機関債)	2.95	100,000	137,664	2034/3/24
第5回	回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.22	100,000	121,591	2030/1/28
第7回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.2	100,000	110,511	2024/3/22
第8回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.25	100,000	110,753	2024/3/22
第13回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.278	100,000	101,374	2020/6/26
第13回	回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	2.132	100,000	122,072	2031/1/28
第19回	回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.84	100,000	119,568	2031/12/26
第23回	回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	1.68	100,000	118,029	2032/7/28
第24回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.29	100,000	119,364	2028/4/25
第44回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.791	200,000	205,648	2023/1/27
第47回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.576	200,000	204,338	2023/4/28
第104回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.255	200,000	202,634	2028/1/28
F131回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.546	70,000	80,973	2031/7/30
F151回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.348	100,000	110,565	2027/11/5
F197回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.052	100,000	108,059	2027/10/29
F203回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	1.063	100,000	108,489	2028/2/28
F438回	回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	0.123	200,000	200,584	2026/3/27
第1回	回営企業債券(20年)(財投機関債)	2.1	100,000	106,395	2022/6/20
第29回	福祉医療機構債券(財投機関債)	1.145	100,000	102,895	2021/12/20
第4回	回中部国際空港(財投機関債)	0.305	200,000	203,392	2027/2/22
第1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	29,628	30,937	2042/5/10
第2回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	32,174	33,855	2042/6/10
第3回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	25,752	26,512	2036/5/10
第5回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	40,272	41,480	2036/11/10
第6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	13,795	14,411	2037/5/10
第7回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	41,481	43,310	2037/5/10
第8回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	16,474	17,299	2042/12/10
第9回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	30,306	30,429	2037/12/10
第10回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	10,828	10,918	2038/2/10
第11回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	11,838	11,944	2038/6/10
第13回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	17,481	18,455	2043/5/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	36,960	37,984	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	37,218	38,313	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	18,793	19,289	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	12,964	13,363	2039/6/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.95	30,921	33,369	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	14,840	15,384	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	31,451	33,835	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	15,892	16,531	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	66,614	71,025	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	66,206	70,407	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	29,828	31,043	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	37,597	39,575	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	29,462	31,021	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	29,526	31,152	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	128,751	138,345	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	72,676	77,759	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	67,566	72,360	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	33,471	35,693	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	33,912	36,062	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	36,757	39,148	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	33,042	35,066	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	39,787	42,208	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	41,395	43,905	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	45,757	48,568	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	46,867	49,783	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	48,803	51,661	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	94,434	99,583	2047/6/10
第63回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.358	100,000	102,106	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	157,323	164,905	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	55,458	57,930	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	111,082	115,834	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	119,620	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	124,086	128,576	2049/11/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	76,075	78,371	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	240,754	2032/4/16
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	92,516	93,628	2052/7/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	94,425	95,314	2052/12/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	95,061	96,395	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	95,185	96,279	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	95,667	96,603	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	95,817	96,754	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	96,292	97,377	2053/6/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	97,784	99,226	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	98,357	100,033	2053/11/10
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	99,926	2026/10/20
第17回国際協力機構債券(財投機関債)		0.72	30,000	30,750	2022/12/26

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
第17回東京都住宅供給公社債券	1.17	100,000	102,165	2021/9/17
第18回韓国輸出入銀行	0.27	100,000	100,196	2021/6/28
小 計		12,645,147	13,650,507	
<b>金融債券</b>				
第310回信金中金債	0.225	200,000	200,484	2020/9/25
第318回信金中金債	0.04	300,000	299,937	2021/5/27
第321回信金中金債	0.03	200,000	199,908	2021/8/27
第333回信金中金債	0.09	100,000	100,121	2022/8/26
第337回信金中金債	0.11	100,000	100,206	2022/12/27
第338回信金中金債	0.11	200,000	200,422	2023/1/27
第341回信金中金債	0.11	100,000	100,225	2023/4/27
小 計		1,200,000	1,201,303	
<b>普通社債券</b>				
第548回東京電力	2.347	100,000	112,787	2028/9/29
第499回中部電力	1.194	50,000	51,996	2023/6/23
第518回中部電力	0.19	200,000	200,108	2023/1/25
第528回中部電力	0.13	100,000	99,574	2023/11/24
第510回関西電力	0.49	100,000	100,668	2027/7/23
第518回関西電力	0.44	100,000	100,129	2028/6/20
第383回中国電力	0.764	100,000	102,634	2024/10/25
第393回中国電力	0.26	100,000	99,339	2026/11/25
第297回北陸電力	0.976	200,000	20,261	2020/10/23
第494回東北電力	0.425	200,000	201,020	2027/6/25
第427回九州電力	1.024	100,000	103,625	2024/5/24
第468回九州電力	0.435	100,000	100,176	2028/8/25
第308回北海道電力	1.155	100,000	101,436	2020/9/25
第316回北海道電力	1.164	100,000	101,190	2020/6/25
第6回新関西国際空港	1.445	100,000	112,014	2028/9/15
第26回関西国際空港	1.156	100,000	101,478	2020/9/18
第15回成田国際空港	0.739	100,000	103,294	2024/2/20
第7回大和ハウス工業	0.06	100,000	99,900	2021/6/18
第5回日揮	0.2	300,000	300,462	2022/10/13
第7回明治ホールディングス	0.22	100,000	100,178	2024/9/13
第11回アサヒグループホールディングス	0.23	100,000	100,221	2024/6/13
第3回 キュービー	0.23	100,000	99,982	2026/2/13
第6回ヒューリック	0.494	200,000	200,124	2028/10/20
第4回トヨタ紡織	0.21	200,000	201,374	2024/12/20
第22回森ビル	0.18	100,000	99,680	2023/3/8
第11回セブン&アイ・ホールディングス	0.514	200,000	202,520	2022/6/20
第31回東レ	0.25	100,000	100,127	2024/7/19
第1回電通	0.11	200,000	200,040	2023/10/25
第2回電通	0.24	100,000	100,366	2025/10/24
第2回大塚ホールディングス	0.26	100,000	100,115	2026/3/6
第3回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	102,703	2022/12/2
第13回ブリヂストン	0.23	200,000	199,758	2026/4/17
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	100,921	2027/5/20



銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
普通社債券	%	千円	千円
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	102,380
第48回日本精工	0.16	100,000	100,110
第13回パナソニック	0.568	100,000	101,194
第15回パナソニック	0.19	100,000	100,201
第17回パナソニック	0.47	100,000	101,127
第1回村田製作所	0.08	200,000	200,032
第34回三菱重工業	0.104	200,000	199,796
第1回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,056
第7回J A三井リース	0.2	100,000	100,084
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,154
第16回アイシン精機	0.16	100,000	99,907
第1回明治安田生命2018基金	0.315	100,000	99,977
第15回パン・パシフィック・インターナショナル	0.11	200,000	199,754
第78回三菱商事	1.155	100,000	102,966
第79回三菱商事	1.022	100,000	102,776
第33回丸井	0.04	100,000	99,870
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	100,000	99,765
第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	103,494
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	116,413
第9回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.68	100,000	102,993
第12回住友信託銀行(劣後特約付)	1.373	100,000	101,878
第15回住友信託銀行(劣後特約付)	1.62	100,000	104,069
第22回三井住友銀行(劣後特約付)	1.43	100,000	101,789
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	100,000	102,368
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	2.14	100,000	112,263
第20回東京センチュリーリース	0.19	100,000	100,086
第26回東京センチュリーリース	0.04	100,000	99,847
第38回ホンダファイナンス	0.01	100,000	99,894
第53回ホンダファイナンス	0.05	200,000	199,774
第77回トヨタファイナンス	0.145	100,000	100,102
第87回トヨタファイナンス	0.04	200,000	199,968
第29回リコーリース	0.08	100,000	100,004
第30回リコーリース	0.16	100,000	100,069
第52回日立キャピタル	0.508	100,000	100,871
第70回日立キャピタル	0.2	100,000	100,054
第194回オリックス	0.19	200,000	199,862
第21回三井住友ファイナンス&リース	0.18	100,000	100,065
第65回三菱UFJリース	0.1	100,000	99,961
第66回三菱UFJリース	0.21	200,000	200,040
第23回野村ホールディングス	1.808	100,000	101,874
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	111,867
第58回三井不動産	0.1	100,000	99,907
第64回三井不動産	0.08	100,000	100,017
第72回三菱地所	2.28	100,000	111,272
第125回三菱地所	0.19	100,000	100,019
第11回エス・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	102,385
			償還年月日

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36回	京王電鉄	0.325	100,000	101,004	2027/9/17
第15回	東日本旅客鉄道	2.65	20,000	20,665	2020/8/25
第19回	東日本旅客鉄道	2.36	100,000	106,463	2022/2/25
第32回	東日本旅客鉄道	2.26	100,000	110,490	2024/3/19
第34回	東日本旅客鉄道	2.53	100,000	112,380	2024/6/20
第100回	東日本旅客鉄道	1.981	100,000	129,701	2044/1/29
第9回	西日本旅客鉄道	2.28	100,000	106,415	2022/3/25
第6回	東海旅客鉄道	2.39	21,000	22,361	2022/2/15
第42回	東海旅客鉄道	2.312	100,000	120,272	2029/4/24
第53回	東海旅客鉄道	1.797	100,000	116,800	2030/10/25
第50回	阪急阪神ホールディングス	0.345	100,000	100,938	2028/9/13
第16回	三菱倉庫	0.21	100,000	100,184	2024/12/6
第63回	日本電信電話	0.69	200,000	204,700	2023/3/20
第21回	KDDI	0.669	100,000	102,551	2024/9/20
第20回	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	102,741	2023/9/20
第8回	電源開発	2.11	100,000	109,967	2024/12/20
第38回	電源開発	0.978	100,000	103,252	2023/12/20
第50回	電源開発	0.415	100,000	100,138	2027/7/20
第4回	東京電力パワーグリッド	0.69	200,000	200,828	2024/6/20
第12回	東京電力パワーグリッド	0.44	100,000	100,019	2023/4/19
第15回	東京電力パワーグリッド	0.89	100,000	99,065	2030/7/24
第23回	東京ガス	1.01	100,000	103,885	2023/6/9
第13回	広島ガス	0.405	100,000	100,568	2028/9/13
第6回	SCSK	0.14	100,000	99,860	2022/7/21
第4回	ファーストリテイリング	0.749	100,000	103,048	2025/12/18
第14回	フランス相互信用連合銀行	0.563	100,000	100,838	2021/10/15
第26回	フランス相互信用連合銀行	0.443	100,000	100,660	2023/10/12
第1回	韓国石油公社債	0.24	100,000	100,072	2022/1/21
第11回	ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,071	2020/1/16
第12回	ウエストパック・バンキング・コーポレーション	0.32	200,000	200,336	2023/7/6
小	計		12,511,000	12,783,827	
合	計		217,514,067	237,460,079	

## 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 457	百万円 -

## ○投資信託財産の構成

(2019年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 237,460,079	% 99.2
コール・ローン等、その他	1,972,148	0.8
投資信託財産総額	239,432,227	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	239,432,197,829
コール・ローン等	944,954,888
公社債(評価額)	237,460,079,518
未収入金	474,815,700
未収利息	538,454,615
前払費用	12,753,108
差入委託証拠金	1,140,000
(B) 負債	328,929,438
未払金	201,001,240
未払解約金	127,926,500
未払利息	1,698
(C) 純資産総額(A-B)	239,103,268,391
元本	169,381,679,941
次期繰越損益金	69,721,588,450
(D) 受益権総口数	169,381,679,941口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,116円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 162,212,782,817円  
 期中追加設定元本額 39,752,908,811円  
 期中一部解約元本額 32,584,011,687円  
 また、1口当たり純資産額は、期末14,116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 ライフセレクトファンド(安定型)	4,327,405,345円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	5,201,046,125円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,295,754,195円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	37,691,929,467円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	58,045,021,507円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	14,516,560,405円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	192,344,411円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	141,597,476円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	1,948,629,213円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	4,959,627,533円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	22,679,350,335円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	154,676,847円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	144,273,641円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	43,315,099円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	18,040,034,771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)	113,175円
合計	169,381,679,941円

## ○損益の状況 (2018年5月22日~2019年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,111,788,105
受取利息	2,112,806,648
支払利息	△ 1,018,543
(B) 有価証券売買損益	1,820,185,816
売買益	2,660,244,678
売買損	△ 840,058,862
(C) 先物取引等取引損益	11,933,880
取引益	14,810,880
取引損	△ 2,877,000
(D) 保管費用等	△ 18,245
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,943,889,556
(F) 前期繰越損益金	62,885,721,074
(G) 追加信託差損益金	15,652,808,547
(H) 解約差損益金	△12,760,830,727
(I) 計(E+F+G+H)	69,721,588,450
次期繰越損益金(I)	69,721,588,450

(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19期》決算日2019年5月20日

[計算期間：2018年5月22日～2019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19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19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 (除く日本、円ベース)		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
15期(2015年5月20日)	27,492	13.1	466.3665	13.1	98.8	—	128,186
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

(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		FTSE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	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2018年5月21日	円	%		%	%	%
	26,312	—	446.7912	—	98.7	—
5月末	25,783	△2.0	439.0315	△1.7	99.4	—
6月末	26,166	△0.6	444.9739	△0.4	98.3	—
7月末	26,362	0.2	448.9124	0.5	98.9	—
8月末	26,345	0.1	449.7333	0.7	98.6	—
9月末	26,786	1.8	455.6286	2.0	98.6	—
10月末	26,301	△0.0	446.4447	△0.1	96.9	—
11月末	26,538	0.9	451.1517	1.0	98.6	—
12月末	26,371	0.2	447.2109	0.1	96.8	—
2019年1月末	26,207	△0.4	447.5574	0.2	99.8	—
2月末	26,575	1.0	452.7745	1.3	98.9	—
3月末	26,930	2.3	456.9806	2.3	98.1	—
4月末	26,854	2.1	456.1044	2.1	98.8	—
(期 末) 2019年5月20日	26,691	1.4	453.5333	1.5	98.6	—

(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

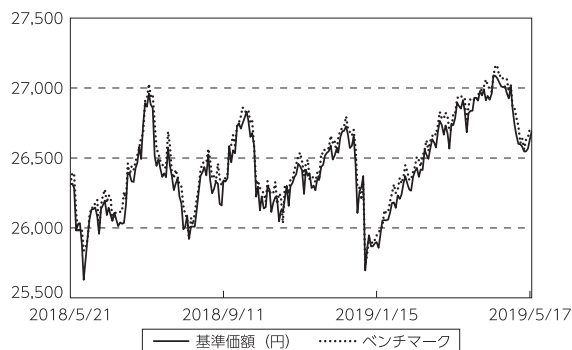
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.4%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(1.5%)を0.1%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。

## ●投資環境について

## ◎外国債券市況

- ・先進国の債券市況は、期の後半にかけての米国の利上げ休止観測などが上昇要因となり、期首との比較では上昇しました。

## ◎為替市況

- ・期の後半にかけて世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首との比較では、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1.5%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.1\%$ 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<sup>※</sup>

<sup>※</sup>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

(2018年5月22日～2019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	%	(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、26,420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

(2018年5月22日～2019年5月20日)

## 公社債

		買付額	売付額
外                      国	アメリカ	千アメリカドル 86,946	千アメリカドル 64,213
	カナダ	千カナダドル 3,779	千カナダドル 4,293
	メキシコ	千メキシコペソ 14,070	千メキシコペソ 8,285
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	千ユーロ 8,319	千ユーロ 8,262
	イタリア	千ユーロ 10,325	千ユーロ 9,441
	フランス	千ユーロ 10,686	千ユーロ 8,709
	オランダ	千ユーロ 1,628	千ユーロ 1,512
	スペイン	千ユーロ 6,611	千ユーロ 5,715
	ベルギー	千ユーロ 2,225	千ユーロ 1,289
	オーストリア	千ユーロ 801	千ユーロ 1,046
	フィンランド	千ユーロ 557	千ユーロ 605
	アイルランド	千ユーロ 744	千ユーロ 706
	イギリス	千イギリスポンド 5,872	千イギリスポンド 5,529
	スイス	千スイスフラン —	千スイスフラン 726
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 2,290	千スウェーデンクローネ 2,011
	ノルウェー	千ノルウェークローネ 2,102	千ノルウェークローネ 3,286
	デンマーク	千デンマーククローネ 1,661	千デンマーククローネ 3,332
	ポーランド	千ポーランドズロチ 2,866	千ポーランドズロチ 2,519
	オーストラリア	千オーストラリアドル 2,594	千オーストラリアドル 2,623
	シンガポール	千シンガポールドル 523	千シンガポールドル 455
	マレーシア	千マレーシアリンギット 1,918	千マレーシアリンギット 1,867
	南アフリカ	千南アフリカランド 3,967	千南アフリカランド 1,338

(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

(2018年5月22日～2019年5月20日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		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 4,431	% 36.4		百万円 1,092	% 10.6	

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

(2019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	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカドル 213,630	千アメリカドル 216,795	千円 23,884,386	% 46.8	% —	% 19.6	% 17.9	% 9.2
カナダ	千カナダドル 10,840	千カナダドル 11,748	963,167	1.9	—	1.0	0.5	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 72,350	千メキシコペソ 71,434	411,462	0.8	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	22,110	26,769	3,291,883	6.4	—	3.6	2.1	0.7
イタリア	33,110	35,585	4,375,897	8.6	—	4.9	2.8	0.8
フランス	34,110	40,702	5,005,212	9.8	—	6.6	2.3	0.9
オランダ	6,980	8,356	1,027,552	2.0	—	1.2	0.7	0.1
スペイン	19,980	23,738	2,919,063	5.7	—	3.7	1.4	0.6
ベルギー	8,610	10,419	1,281,260	2.5	—	2.0	0.4	0.1
オーストリア	4,690	5,714	702,680	1.4	—	1.0	0.4	—
フィンランド	2,140	2,373	291,808	0.6	—	0.3	0.1	0.1
アイルランド	2,740	3,104	381,778	0.7	—	0.5	0.3	0.0
イギリス	千イギリスポンド 18,350	千イギリスポンド 23,316	3,272,751	6.4	—	4.9	1.0	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 13,250	千スウェーデンクローネ 15,073	172,292	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 9,100	千ノルウェークローネ 9,388	117,734	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 11,700	千デンマーククローネ 15,257	251,283	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 10,000	千ポーランドズロチ 10,429	298,084	0.6	—	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 11,560	千オーストラリアドル 13,079	995,845	2.0	—	1.3	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,400	千シンガポールドル 2,489	199,370	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 8,180	千マレーシアリンギット 8,303	219,056	0.4	—	0.3	0.1	—
南アフリカ	千南アフリカランド 40,150	千南アフリカランド 36,251	277,688	0.5	—	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	50,340,263	98.6	—	53.1	31.6	13.9

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

(注) 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	銘柄	利率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.125 T-NOTE 200430	1.125	50	49	5,446	2020/4/30
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	700	686	75,636	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	1,300	1,272	140,155	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	1,700	1,661	183,060	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,100	1,074	118,337	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	900	884	97,417	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	800	782	86,208	2021/10/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	2,700	2,599	286,397	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 200430	1.375	1,050	1,040	114,648	2020/4/30
	1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,150	2,129	234,570	2020/5/31
	1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,200	2,176	239,779	2020/8/31
	1.375 T-NOTE 201031	1.375	1,900	1,875	206,657	2020/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,250	1,231	135,711	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	300	290	31,974	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	950	918	101,170	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 200515	1.5	1,000	991	109,287	2020/5/15
	1.5 T-NOTE 200531	1.5	550	545	60,084	2020/5/31
	1.5 T-NOTE 200715	1.5	2,700	2,675	294,728	2020/7/15
	1.5 T-NOTE 200815	1.5	600	593	65,433	2020/8/15
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	200	196	21,663	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	2,400	2,340	257,880	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	1,600	1,514	166,893	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	1,750	1,735	191,246	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201015	1.625	2,900	2,875	316,784	2020/10/15
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,100	1,089	120,003	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	350	344	37,926	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 220831	1.625	1,500	1,475	162,517	2022/8/31
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,050	2,007	221,208	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	600	587	64,717	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,050	1,025	112,985	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	1,950	1,870	206,087	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	1,750	1,675	184,573	2026/5/15
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	1,000	992	109,335	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 201115	1.75	5,100	5,061	557,587	2020/11/15
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	750	743	81,962	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,550	1,534	169,015	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	100	98	10,897	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	950	939	103,541	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	400	395	43,572	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,600	2,570	283,152	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,600	1,581	174,206	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,550	1,530	168,575	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	850	837	92,298	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,200	1,180	130,076	2023/5/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	750	744	82,075	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,700	1,687	185,957	2022/3/31
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	100	99	10,929	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220731	1.875	1,200	1,189	131,078	2022/7/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	750	743	81,917	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 220930	1.875	950	941	103,762	2022/9/30
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	1,800	1,783	196,508	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	250	249	27,439	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	2,350	2,340	257,867	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	450	448	49,386	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	700	696	76,787	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	450	448	49,375	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,100	1,095	120,704	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,095	120,713	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,494	164,628	2021/11/15
	2 T-NOTE 211231	2.0	450	448	49,398	2021/12/31
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,200	1,195	131,682	2022/2/15
	2 T-NOTE 230215	2.0	2,800	2,783	306,692	2023/2/15
	2 T-NOTE 240531	2.0	1,650	1,635	180,175	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	2,500	2,470	272,132	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	2,900	2,856	314,725	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	1,250	1,223	134,818	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	100	99	10,995	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,150	1,148	126,556	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	1,100	1,098	121,016	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,100	1,098	121,063	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	1,550	1,549	170,656	2021/12/31
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,050	1,048	115,561	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	2,600	2,593	285,770	2023/11/30
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	500	498	54,938	2024/2/29
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	550	548	60,423	2024/3/31
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	1,400	1,395	153,695	2024/7/31
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	2,000	1,991	219,410	2024/9/30
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	1,250	1,241	136,787	2025/5/15
	2.25 T-BOND 460815	2.25	1,050	936	103,134	2046/8/15
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	200	200	22,045	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	900	900	99,249	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,300	1,302	143,455	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	3,850	3,860	425,347	2023/12/31
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	750	752	82,866	2024/1/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	2,950	2,955	325,585	2024/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	900	895	98,672	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	600	595	65,647	2027/8/15
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	1,800	1,785	196,725	2027/11/15
	2.375 T-NOTE 200430	2.375	1,500	1,500	165,313	2020/4/30

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.375	T-NOTE 201231	2.375	200	200	22,073	2020/12/31
		2.375	T-NOTE 210415	2.375	2,300	2,306	254,133	2021/4/15
		2.375	T-NOTE 220315	2.375	2,600	2,616	288,310	2022/3/15
		2.375	T-NOTE 230131	2.375	1,550	1,561	172,044	2023/1/31
		2.375	T-NOTE 240815	2.375	1,450	1,462	161,081	2024/8/15
		2.375	T-NOTE 270515	2.375	1,900	1,907	210,107	2027/5/15
		2.5	T-BOND 450215	2.5	2,400	2,262	249,266	2045/2/15
		2.5	T-BOND 460215	2.5	950	893	98,439	2046/2/15
		2.5	T-BOND 460515	2.5	550	516	56,948	2046/5/15
		2.5	T-NOTE 201231	2.5	1,000	1,003	110,578	2020/12/31
		2.5	T-NOTE 220115	2.5	2,400	2,420	266,649	2022/1/15
		2.5	T-NOTE 220215	2.5	3,100	3,128	344,662	2022/2/15
		2.5	T-NOTE 230815	2.5	3,750	3,799	418,592	2023/8/15
		2.5	T-NOTE 240515	2.5	1,500	1,521	167,630	2024/5/15
		2.5	T-NOTE 260228	2.5	900	912	100,516	2026/2/28
		2.625	T-NOTE 200815	2.625	1,200	1,204	132,715	2020/8/15
		2.625	T-NOTE 201115	2.625	1,350	1,357	149,513	2020/11/15
		2.625	T-NOTE 210715	2.625	1,600	1,614	177,890	2021/7/15
		2.625	T-NOTE 230630	2.625	2,000	2,035	224,247	2023/6/30
		2.625	T-NOTE 250331	2.625	1,600	1,634	180,031	2025/3/31
		2.625	T-NOTE 251231	2.625	1,450	1,481	163,191	2025/12/31
		2.75	T-BOND 420815	2.75	450	448	49,365	2042/8/15
		2.75	T-BOND 421115	2.75	700	696	76,703	2042/11/15
		2.75	T-BOND 470815	2.75	1,200	1,182	130,293	2047/8/15
		2.75	T-BOND 471115	2.75	450	443	48,848	2047/11/15
		2.75	T-NOTE 210815	2.75	1,000	1,012	111,525	2021/8/15
		2.75	T-NOTE 231115	2.75	1,900	1,946	214,408	2023/11/15
		2.75	T-NOTE 240215	2.75	1,100	1,127	124,254	2024/2/15
		2.75	T-NOTE 250630	2.75	2,300	2,365	260,656	2025/6/30
		2.75	T-NOTE 250831	2.75	850	874	96,336	2025/8/31
		2.75	T-NOTE 280215	2.75	2,900	2,988	329,252	2028/2/15
		2.875	T-BOND 430515	2.875	1,050	1,065	117,413	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	1,400	1,417	156,141	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	950	961	105,928	2046/11/15
		2.875	T-NOTE 250430	2.875	1,130	1,169	128,888	2025/4/30
		2.875	T-NOTE 280515	2.875	1,750	1,821	200,644	2028/5/15
		2.875	T-NOTE 280815	2.875	3,500	3,643	401,350	2028/8/15
		3.0	T-BOND 420515	3.0	400	415	45,820	2042/5/15
		3.0	T-BOND 441115	3.0	2,520	2,610	287,583	2044/11/15
		3.0	T-BOND 450515	3.0	1,700	1,761	194,078	2045/5/15
		3.0	T-BOND 451115	3.0	1,200	1,244	137,058	2045/11/15
		3.0	T-BOND 470215	3.0	900	933	102,809	2047/2/15
		3.0	T-BOND 470515	3.0	750	777	85,603	2047/5/15
		3.0	T-BOND 480215	3.0	950	982	108,283	2048/2/15
		3.0	T-BOND 480815	3.0	2,240	2,317	255,321	2048/8/15

銘柄	当 期 末					償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	3 T-NOTE 250930	3.0	2,100	2,191	241,442	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	1,300	1,356	149,498	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	350	372	41,002	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	370	393	43,301	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	1,300	1,376	151,646	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	1,250	1,323	145,792	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	600	635	70,031	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	750	763	84,096	2021/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	1,500	1,593	175,531	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	850	938	103,367	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	1,030	1,144	126,134	2048/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	250	282	31,168	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	800	808	89,117	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	950	1,090	120,164	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	850	976	107,566	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	300	307	33,850	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	400	467	51,518	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	750	878	96,758	2043/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	450	535	59,011	2040/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	250	312	34,402	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	500	625	68,946	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	150	189	20,884	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	230	292	32,178	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	450	571	63,016	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	250	318	35,093	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	410	518	57,118	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	350	449	49,518	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	200	257	28,418	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	550	721	79,448	2040/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	350	467	51,507	2041/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	150	202	22,304	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	400	496	54,747	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	250	311	34,352	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	400	519	57,222	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	150	188	20,784	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	850	1,046	115,277	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	1,000	1,288	141,964	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	1,100	1,280	141,092	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	150	205	22,605	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	200	257	28,344	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	500	569	62,773	2021/11/15
	8.75 T-BOND 200815	8.75	800	863	95,093	2020/8/15
小 計					23,884,386	
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	291	23,866	2022/3/1

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
カナダ	国債証券	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	650	642	52,642	2020/9/1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	550	541	44,409	2021/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	600	588	48,262	2021/9/1
		1 CAN GOVT 220901	1.0	950	932	76,407	2022/9/1
		1 CAN GOVT 270601	1.0	300	285	23,365	2027/6/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	850	846	69,408	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	400	396	32,485	2026/6/1
		2 CAN GOVT 201101	2.0	550	552	45,303	2020/11/1
		2 CAN GOVT 280601	2.0	350	359	29,473	2028/6/1
		2 CAN GOVT 511201	2.0	80	81	6,691	2051/12/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	900	932	76,414	2025/6/1
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	350	367	30,149	2029/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	400	417	34,224	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	250	258	21,193	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	390	462	37,938	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	150	189	15,562	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	350	361	29,632	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	600	610	50,074	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	390	516	42,358	2045/12/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	380	520	42,693	2041/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	320	471	38,651	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	300	410	33,667	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	330	490	40,197	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	150	220	18,094	2027/6/1
小	計					963,167	
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	7,650	8,368	48,199	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	2,050	2,352	13,552	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	2,700	2,385	13,740	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	9,000	8,759	50,453	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	5,600	5,386	31,027	2022/6/9
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	3,450	3,395	19,558	2021/12/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	10,200	9,868	56,843	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	3,350	3,231	18,614	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	3,700	3,516	20,256	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	6,350	5,873	33,828	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	6,500	6,501	37,450	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	4,700	4,718	27,178	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	1,800	1,699	9,791	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	2,700	2,767	15,941	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	2,600	2,608	15,025	2038/11/18
小	計					411,462	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	450	461	56,750	2026/8/15
		0 OBL 210409	—	550	556	68,481	2021/4/9



銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0 OBL 211008	—	400	406	49,971	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	600	611	75,189	2022/4/8
		0 OBL 230414	—	300	307	37,778	2023/4/14
		0.25 BUND 270215	0.25	600	626	77,011	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	430	446	54,888	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	200	206	25,453	2029/2/15
		0.25 OBL 201016	0.25	600	607	74,694	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	750	792	97,468	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	650	689	84,814	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	720	765	94,186	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	250	265	32,682	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	400	432	53,134	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	500	545	67,074	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	410	489	60,147	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	1,390	1,489	183,153	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	350	378	46,493	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	500	542	66,705	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	750	826	101,684	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	750	806	99,229	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,050	1,166	143,404	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	500	535	65,833	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	450	500	61,490	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	550	570	70,152	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	450	480	59,062	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	400	421	51,772	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	640	948	116,632	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	640	965	118,767	2046/8/15
3 BUND 200704	3.0	600	624	76,788	2020/7/4		
3.25 BUND 210704	3.25	550	595	73,276	2021/7/4		
3.25 BUND 420704	3.25	420	684	84,146	2042/7/4		
4 BUND 370104	4.0	630	1,037	127,621	2037/1/4		
4.25 BUND 390704	4.25	390	687	84,587	2039/7/4		
4.75 BUND 280704	4.75	540	787	96,801	2028/7/4		
4.75 BUND 340704	4.75	500	845	103,988	2034/7/4		
4.75 BUND 400704	4.75	430	816	100,382	2040/7/4		
5.5 BUND 310104	5.5	450	742	91,266	2031/1/4		
5.625 BUND 280104	5.625	570	863	106,137	2028/1/4		
6.25 BUND 240104	6.25	150	197	24,325	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	250	420	51,743	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	400	623	76,707	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.2 ITALY GOVT 201015	0.2	1,200	1,198	147,349	2020/10/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	100	98	12,153	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	500	497	61,228	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	400	401	49,399	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	1,870	1,800	221,384	2023/10/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	400	402	49,462	2020/5/1
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	150	148	18,248	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	350	343	42,264	2023/3/15
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	450	451	55,473	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	400	376	46,272	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	450	452	55,648	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	600	603	74,192	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	300	291	35,832	2025/5/15
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	350	340	41,876	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	500	483	59,479	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	680	600	73,848	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	400	401	49,392	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,300	1,296	159,381	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	130	126	15,573	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	270	264	32,560	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	150	154	18,994	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	800	795	97,821	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	250	225	27,714	2036/9/1
		2.3 ITALY GOVT 211015	2.3	500	516	63,502	2021/10/15
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	290	275	33,849	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	550	567	69,768	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	420	430	52,915	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	600	534	65,729	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	490	501	61,714	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	170	145	17,844	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	250	240	29,612	2038/9/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	270	278	34,244	2029/8/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	400	392	48,307	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	330	342	42,078	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	390	391	48,143	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	650	697	85,774	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	550	581	71,450	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	250	264	32,570	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	1,000	1,064	130,848	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	500	546	67,217	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	200	210	25,876	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	600	628	77,260	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	800	892	109,797	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	250	278	34,265	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	1,100	1,237	152,225	2024/3/1
4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	400	459	56,489	2026/3/1		
4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	650	706	86,914	2021/9/1		
4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	170	192	23,616	2023/8/1		
4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	650	776	95,432	2028/9/1		
4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	450	545	67,053	2044/9/1		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	5 ITALY GOVT 220301	5.0	650	719	88,457	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	700	814	100,193	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	710	878	107,983	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	700	871	107,187	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	400	495	60,897	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	700	862	106,118	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	750	850	104,619	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	770	876	107,810	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	550	720	88,603	2033/2/1
6 ITALY GOVT 310501	6.0	800	1,055	129,845	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	650	852	104,863	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	550	737	90,726	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	300	394	48,532	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 200525	—	850	854	105,118	2020/5/25
		0 O. A. T 210525	—	1,900	1,921	236,331	2021/5/25
		0 O. A. T 220525	—	950	964	118,579	2022/5/25
		0 O. A. T 240325	—	250	253	31,202	2024/3/25
		0.25 O. A. T 201125	0.25	500	506	62,257	2020/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	400	408	50,186	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,430	1,490	183,304	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	400	416	51,181	2026/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	1,200	1,263	155,338	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	1,250	1,311	161,310	2028/11/25
		1 O. A. T 251125	1.0	800	860	105,766	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	1,200	1,291	158,874	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	60	64	7,966	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	860	918	112,913	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,050	1,177	144,812	2031/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,050	1,142	140,449	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,000	1,111	136,741	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	250	286	35,230	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	310	334	41,173	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	880	1,038	127,716	2048/5/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	1,100	1,203	148,002	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	850	960	118,108	2024/5/25
		2.5 O. A. T 201025	2.5	1,000	1,044	128,384	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,300	1,599	196,741	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	1,000	1,227	150,894	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	950	1,048	128,949	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	700	765	94,115	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	660	971	119,437	2045/5/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	1,250	1,566	192,604	2026/4/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	1,150	1,246	153,285	2021/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	890	1,388	170,740	2038/10/25
4 O. A. T 550425	4.0	390	680	83,663	2055/4/25		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	4 O. A. T 600425	4.0	410	737	90,641	2060/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	1,590	1,921	236,234	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	850	1,440	177,100	2041/4/25
		4.75 O. A. T 350425	4.75	680	1,098	135,029	2035/4/25
		5.5 O. A. T 290425	5.5	850	1,291	158,805	2029/4/25
		5.75 O. A. T 321025	5.75	900	1,512	185,954	2032/10/25
		6 O. A. T 251025	6.0	650	908	111,758	2025/10/25
		8.5 O. A. T 230425	8.5	350	474	58,304	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	450	457	56,221	2022/1/15
		0 NETH GOVT 240115	—	880	897	110,357	2024/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	300	310	38,169	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	650	683	84,059	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	250	267	32,893	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	100	107	13,161	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	350	382	47,087	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	550	618	76,073	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	400	436	53,633	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	410	533	65,617	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	370	575	70,741	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	350	379	46,667	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	500	523	64,405	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	200	231	28,527	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	400	679	83,607	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	390	631	77,640	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5	430	639	78,687	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	450	458	56,371	2023/7/30
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	600	611	75,226	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	450	460	56,626	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	700	716	88,101	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	550	560	68,875	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	450	477	58,684	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	910	965	118,759	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	410	433	53,274	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	500	533	65,608	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	650	685	84,323	2029/4/30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	500	535	65,908	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	550	596	73,297	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	550	608	74,853	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	440	484	59,534	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	740	827	101,782	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	490	554	68,240	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	320	365	44,986	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	600	686	84,409	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	440	524	64,544	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	260	337	41,562	2066/7/30

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	600	712	87,612	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	800	833	102,463	2020/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	620	880	108,247	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	500	599	73,706	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	500	635	78,198	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	580	892	109,791	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	500	613	75,422	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	550	591	72,754	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	410	642	78,979	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	400	559	68,810	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	320	529	65,154	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	550	664	81,653	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	500	556	68,450	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	550	859	105,700	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	700	816	100,345	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	680	943	116,007	2026/7/30
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	660	982	120,789	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,300	1,371	168,682	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	500	526	64,718	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	300	314	38,668	2028/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	370	388	47,770	2031/6/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	270	289	35,591	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	360	381	46,913	2047/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	190	219	26,966	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	450	499	61,393	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	120	142	17,497	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	500	572	70,443	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	100	131	16,164	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	550	582	71,601	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	230	357	43,937	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	400	451	55,566	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	350	496	61,108	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	350	389	47,937	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	300	347	42,790	2022/9/28
4.25 BEL GOVT 410328	4.25	360	575	70,780	2041/3/28		
4.5 BEL GOVT 260328	4.5	450	590	72,573	2026/3/28		
5 BEL GOVT 350328	5.0	610	985	121,207	2035/3/28		
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	550	804	98,945	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	150	156	19,193	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	250	257	31,628	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	350	371	45,657	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	150	158	19,509	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	250	272	33,531	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	150	169	20,816	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	60	65	8,006	2086/11/2

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	300	331	40,820	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	480	526	64,721	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	120	164	20,178	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	140	176	21,728	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	190	287	35,357	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	400	455	55,955	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	400	438	53,877	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	250	280	34,510	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	100	191	23,496	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	350	555	68,307	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	300	403	49,593	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	300	453	55,788	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	50	50	6,254	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	150	151	18,674	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	200	208	25,676	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	120	124	15,270	2028/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	160	167	20,623	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	200	213	26,283	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	100	108	13,389	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	110	125	15,427	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	120	129	15,887	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	250	267	32,923	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	150	167	20,602	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	120	169	20,897	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	150	186	22,929	2028/7/4
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	150	161	19,882	2021/4/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	110	138	17,083	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 221018	—	100	101	12,437	2022/10/18
		0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	470	485	59,746	2022/3/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	250	262	32,273	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	200	212	26,158	2026/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	200	211	26,002	2033/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	150	164	20,264	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	220	252	31,107	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	250	298	36,683	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	250	293	36,113	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	174	21,439	2023/3/20
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	50	53	6,628	2020/10/18
5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	450	593	72,924	2025/3/13		
小 計						19,277,139	
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	794	111,582	2022/7/22
		0.75 GILT 230722	0.75	900	900	126,335	2023/7/22
		1.25 GILT 270722	1.25	520	532	74,748	2027/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	400	405	56,906	2021/1/22

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券					
		1.5	550	574	80,591	2026/7/22
		1.625	650	684	96,023	2028/10/22
		1.625	430	455	63,884	2071/10/22
		1.75	650	672	94,325	2022/9/7
		1.75	630	654	91,905	2037/9/7
		2.0	750	761	106,854	2020/7/22
		2.0	570	611	85,852	2025/9/7
		2.25	250	265	37,319	2023/9/7
		2.5	350	468	65,817	2065/7/22
		2.75	350	385	54,133	2024/9/7
		3.25	710	948	133,184	2044/1/22
		3.5	500	699	98,228	2045/1/22
		3.5	820	1,394	195,720	2068/7/22
		3.75	550	571	80,208	2020/9/7
		3.75	550	588	82,608	2021/9/7
		3.75	530	834	117,068	2052/7/22
		4.0	250	273	38,319	2022/3/7
		4.0	210	370	51,992	2060/1/22
		4.25	350	445	62,536	2027/12/7
		4.25	400	543	76,350	2032/6/7
		4.25	850	1,207	169,548	2036/3/7
		4.25	330	487	68,416	2039/9/7
		4.25	460	688	96,628	2040/12/7
		4.25	1,070	1,702	238,965	2046/12/7
		4.25	530	873	122,661	2049/12/7
		4.25	310	547	76,864	2055/12/7
		4.5	260	372	52,258	2034/9/7
		4.5	400	631	88,626	2042/12/7
		4.75	400	556	78,072	2030/12/7
		4.75	190	295	41,442	2038/12/7
		5.0	400	494	69,475	2025/3/7
		6.0	230	334	46,942	2028/12/7
		8.0	250	287	40,346	2021/6/7
小	計				3,272,751	
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	950	1,011	11,561	2028/5/12
		0.75	1,300	1,377	15,745	2029/11/12
		1.0	1,600	1,732	19,796	2026/11/12
		1.5	2,200	2,394	27,366	2023/11/13
		2.5	1,350	1,574	18,001	2025/5/12
		3.5	2,600	2,919	33,367	2022/6/1
		3.5	1,200	1,836	20,990	2039/3/30
		5.0	2,050	2,227	25,461	2020/12/1
小	計				172,292	

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		
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円	
国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	700	701	8,791	2026/2/19
	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	950	966	12,124	2025/3/13
	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,000	1,015	12,736	2027/2/17
	1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	600	605	7,597	2029/9/6
	2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,792	22,480	2023/5/24
	2 NORWE GOVT 280426	2.0	1,050	1,084	13,602	2028/4/26
	3 NORWE GOVT 240314	3.0	950	1,020	12,795	2024/3/14
	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	2,100	2,201	27,606	2021/5/25
小計					117,734	
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ		
国債証券	0.25 DMK GOVT 201115	0.25	550	557	9,182	2020/11/15
	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	1,900	2,013	33,164	2027/11/15
	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	1,600	1,746	28,765	2023/11/15
	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	2,500	2,848	46,920	2025/11/15
	3 DMK GOVT 211115	3.0	1,800	1,964	32,361	2021/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	3,350	6,125	100,888	2039/11/15
小計					251,283	
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	601	17,195	2021/7/25
	2 POLAND 210425	2.0	950	957	27,354	2021/4/25
	2.25 POLAND 220425	2.25	700	708	20,250	2022/4/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	1,350	1,339	38,278	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	950	933	26,678	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	400	398	11,377	2028/4/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,150	1,200	34,311	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,050	1,132	32,354	2023/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	750	788	22,548	2020/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	500	548	15,673	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	800	897	25,657	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	500	629	17,979	2029/4/25
	POLAND 200725	—	300	294	8,423	2020/7/25
小計					298,084	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	400	402	30,683	2020/11/21
	2 AUST GOVT 211221	2.0	350	357	27,205	2021/12/21
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	150	155	11,833	2022/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	700	737	56,154	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	250	270	20,594	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	650	695	52,983	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	800	874	66,606	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	800	878	66,884	2028/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	320	353	26,914	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	222	16,970	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	250	274	20,902	2041/5/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	240	275	20,961	2047/3/21



銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
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	千円		
国債証券	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	750	830	63,222	2025/4/21	
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	750	860	65,491	2029/4/21	
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	210	250	19,035	2039/6/21	
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	280	353	26,909	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	850	1,006	76,634	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	660	878	66,904	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	600	744	56,652	2027/4/21	
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	650	756	57,614	2023/4/21	
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	750	816	62,171	2021/5/15	
5.75 AUST GOVT 220715	5.75	950	1,083	82,514	2022/7/15		
小 計					995,845		
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 SINGAPORGOVT 200701	2.0	50	50	4,006	2020/7/1	
	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	70	70	5,632	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	220	221	17,731	2021/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	100	96	7,750	2036/8/1	
	2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	80	83	6,649	2028/5/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	350	361	28,907	2023/7/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	170	174	13,993	2042/4/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	150	152	12,216	2046/3/1	
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	50	53	4,251	2029/7/1	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	120	127	10,204	2030/9/1	
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	250	262	21,014	2024/9/1	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	230	238	19,117	2022/9/1	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	240	243	19,536	2020/9/1	
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	120	133	10,710	2033/9/1	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	200	220	17,647	2027/3/1	
	小 計					199,370	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
国債証券	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	350	349	9,207	2022/8/15	
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	250	248	6,562	2023/3/15	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	292	7,709	2027/5/31	
	3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	350	351	9,278	2021/11/30	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	100	98	2,610	2028/6/15	
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	250	252	6,655	2022/9/30	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	300	301	7,964	2023/8/17	
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	291	7,700	2033/4/15	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	450	450	11,881	2027/3/15	
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	150	150	3,965	2027/11/16	
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	600	605	15,961	2026/7/15	
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	500	504	13,310	2025/9/15	
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	480	486	12,845	2021/9/30	
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	200	200	5,283	2032/4/15	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	400	406	10,718	2021/7/15	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	400	409	10,791	2024/7/15	

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
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	4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	400	405	10,693	2031/6/30
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	200	5,280	2035/5/31
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	300	310	8,178	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	500	522	13,773	2030/4/15
	4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	200	211	5,567	2033/11/7
	4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	300	306	8,090	2046/3/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	550	579	15,279	2037/4/7
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	369	9,744	2043/9/30
小 計					219,056	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	5,600	6,206	47,541	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,000	2,895	22,176	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	3,500	2,469	18,914	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	1,500	1,502	11,507	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	3,550	2,975	22,791	2031/2/28
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	1,950	1,957	14,996	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	2,700	2,493	19,097	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	2,350	2,152	16,486	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	2,700	2,423	18,566	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	4,350	3,911	29,958	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	4,850	4,369	33,469	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	1,150	1,079	8,268	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	1,950	1,816	13,913	2040/1/31
小 計					277,688	
合 計					50,340,263	

(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

(2019年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 50,340,263	% 97.1
コール・ローン等、その他	1,514,131	2.9
投資信託財産総額	51,854,394	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(50,987,225千円)の投資信託財産総額(51,854,394千円)に対する比率は98.3%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=110.17円	1 カナダドル=81.98円	1 メキシコペソ=5.76円	1 ユーロ=122.97円
1 イギリスポンド=140.36円	1 スウェーデンクローネ=11.43円	1 ノルウェークローネ=12.54円	1 デンマーククローネ=16.47円
1 ボーランドズロチ=28.58円	1 オーストラリアドル=76.14円	1 シンガポールドル=80.07円	1 マレーシアリンギット=26.38円
1 南アフリカランド=7.66円			

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	51,929,635,687
コール・ローン等	1,157,841,240
公社債(評価額)	50,340,263,696
未収入金	75,363,083
未収利息	329,021,711
前払費用	27,145,957
(B) 負債	874,090,419
未払金	833,189,073
未払解約金	40,901,150
未払利息	196
(C) 純資産総額(A-B)	51,055,545,268
元本	19,128,732,358
次期繰越損益金	31,926,812,910
(D) 受益権総口数	19,128,732,358口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,691円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 18,401,465,597円  
 期中追加設定元本額 4,706,119,840円  
 期中一部解約元本額 3,978,853,079円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2,6691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 ライフセレクトファンド(安定型)	169,925,663円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	325,798,151円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	200,530,467円
三菱UFJ 外国債券オープン	1,083,502,633円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,480,063,598円
三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	3,635,995,431円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	2,246,580,193円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	507,367,195円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	72,837,943円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	310,674,882円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	18,222,047円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	27,112,304円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	20,110,148円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,093,862,518円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	404,001,088円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,301,939,726円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	2,873,673,984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)	7,089円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	21,341,358円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	2,335,185,940円
合計	19,128,732,358円

## ○損益の状況 (2018年5月22日~2019年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,180,346,760
受取利息	1,180,656,823
支払利息	△ 310,063
(B) 有価証券売買損益	△ 438,352,781
売買益	1,611,437,632
売買損	△ 2,049,790,413
(C) 保管費用等	△ 12,383,121
(D) 当期損益金(A+B+C)	729,610,858
(E) 前期繰越損益金	30,016,940,706
(F) 追加信託差損益金	7,738,195,065
(G) 解約差損益金	△ 6,557,933,719
(H) 計(D+E+F+G)	31,926,812,910
次期繰越損益金(H)	31,926,812,910

- (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15期》決算日2019年3月11日

[計算期間：2018年3月13日～2019年3月11日]

「MUAM J-REITマザーファンド」は、3月11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	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REIT指数 (配当込み)		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(2015年3月10日)	26,403	27.0	3,166.15	26.3	95.9	7,117
12期(2016年3月10日)	28,097	6.4	3,332.09	5.2	97.4	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

(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		東 証 R E I T 指 数 ( 配 当 込 み )	騰 落 率	投 資 信 託 組 入 比	託 券 率
	円	%				
(期首) 2018年3月12日	26,458	—	3,203.75	—	—	96.7
3月末	27,034	2.2	3,274.92	2.2	—	97.0
4月末	27,728	4.8	3,358.59	4.8	—	96.8
5月末	27,877	5.4	3,379.45	5.5	—	97.1
6月末	28,501	7.7	3,450.92	7.7	—	97.1
7月末	28,688	8.4	3,468.88	8.3	—	95.9
8月末	28,659	8.3	3,457.71	7.9	—	97.8
9月末	29,137	10.1	3,513.39	9.7	—	97.6
10月末	28,703	8.5	3,459.73	8.0	—	97.6
11月末	30,031	13.5	3,610.49	12.7	—	97.4
12月末	29,503	11.5	3,543.83	10.6	—	97.7
2019年1月末	30,786	16.4	3,709.11	15.8	—	97.1
2月末	30,993	17.1	3,728.00	16.4	—	97.0
(期末) 2019年3月11日	31,019	17.2	3,730.52	16.4	—	97.7

(注) 騰落率は期首比。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

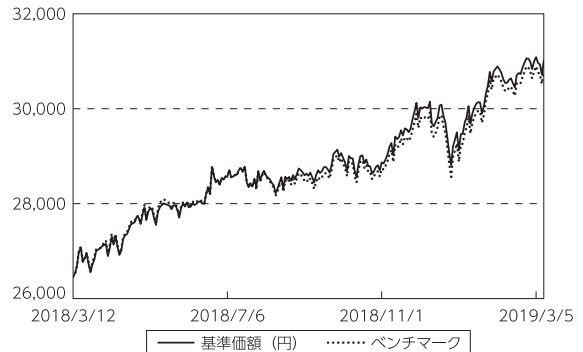
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ17.2%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(16.4%)を0.8%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。

## ●投資環境について

### ◎J-REIT市況

・期首から2018年6月下旬にかけては、相対的に高い配当利回りなど各種バリュエーションの割安感や、東京都心をはじめとしたオフィス・ビルの空室率低下と賃料上昇の傾向が強まったことなどを受けて、上昇基調で推移しました。7月以降は、米中間を中心とした貿易摩擦問題や、リート各社による公募増資が相次いで発表されたことによる投資口需給への懸念などから上値が重い局面もありましたが、11月は日銀の金融緩和策による低金利環境の継続と、安定した改善基調を辿る不動産市況などを背景に反発に転じました。12月は米国を起点とする世界的な株式市況の下落などを受けて調整したものの、2019年1月以降は米国の利上げ観測の後退や貿易摩擦の緩和期待などを背景に反発し、期を通してみると上昇基調での推移となりました。

### ●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等の分析を中心にを行い、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)等の分析を行いました。  
 ・組入銘柄数は46~52銘柄程度で推移させました。  
 ・主な売買動向については、オフィス賃料の引き上げを通じた内部成長等を期待してグローバル・ワン不動産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インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人のウェイトを引き下げたこと等が挙げられます。

### ●当該投資信託のベンチマークとの差異について 銘柄選択がプラスに寄与しました。

#### (プラス要因となった主な銘柄)

・グローバル・ワン不動産投資法人：オフィス賃料の引き上げを通じた内部成長などを評価して

期首よりオーバーウェイト。投資口価格が好調に推移したことからプラスに寄与。

・大和証券オフィス投資法人：投資口が割安であることに加え、賃料の引き上げや物件取得により中期的に業績成長が見込めると判断し、期首よりオーバーウェイト。投資口価格が好調に推移したことからプラスに寄与。

#### (マイナス要因となった主な銘柄)

・アクティビア・プロパティーズ投資法人：相対的に高い業績成長の実績を評価して期首より保有。投資口価格が低調に推移したことからマイナスに影響。

## ○今後の運用方針

### ◎運用環境の見通し

・今後のJ-REIT市況については、堅調に推移するとみています。  
 ・日銀の金融緩和策を背景とした国内の低金利環境が当面続くことに加えて、オフィス・ビル賃料の緩やかな上昇傾向などを背景にREIT各社の業績は総じて堅調に推移しているため、中期的には徐々に下値を切り上げていくと考えます。

### ◎今後の運用方針

・REITの組入比率については、運用の基本方針にしたがい、引き続き高水準(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。  
 ・前述の不動産市況を踏まえ、保有物件の賃料動向等、REIT各社の業績の先行きについて特に注意深く見守るほか、スポンサーのサポート体制等にも着目していく方針です。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2018年3月13日～2019年3月11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 23 (23)	% 0.079 (0.079)	(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	23	0.079	
期中の平均基準価額は、28,813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

(2018年3月13日～2019年3月11日)

## 投資信託証券

銘柄		買付		売付		
		口数	金額	口数	金額	
		千口	千円	千口	千円	
国	サンケイリアルエステート投資法人	0.618	61,800	—	—	
	日本アコモデーションファンド投資法人	0.2	108,343	0.3	147,815	
	MCUBS MidCity投資法人	1	103,688	0.7	62,556	
	森ヒルズリート投資法人	—	—	0.9	126,648	
	産業ファンド投資法人	—	—	0.6	71,508	
	アドバンス・レジデンス投資法人	0.6	178,167	0.3	92,900	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	—	—	1	240,144	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.1	48,099	0.15	72,116	
	GLP投資法人	0.9	102,768	1	116,139	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.2	55,907	0.4	107,035	
	日本プロロジスリート投資法人	0.55	127,347	0.85	196,095	
	星野リゾート・リート投資法人	0.5	271,139	0.3	164,486	
	Oneリート投資法人	—	—	0.4	99,227	
	イオンリート投資法人	2	336,010	0.7	91,927	
	ヒューリックリート投資法人	0.1	17,002	0.5	81,738	
	日本リート投資法人	0.1	36,757	0.35	124,932	
	インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	—	—	10	154,127	
	積水ハウス・リート投資法人	4 ( 2)	340,866 ( 93,600)	3	223,325	
	内	ケネディクス商業リート投資法人	—	—	0.05	12,424
		ヘルスケア&メディカル投資法人	1	124,122	1	185,925
野村不動産マスターファンド投資法人		2 ( 0.088)	327,953 ( 13,219)	0.9	134,779	
いちごホテルリート投資法人		0.2	27,658	0.4	51,983	
ラサールロジポート投資法人		1	106,502	0.5	53,690	
スターアジア不動産投資法人		0.7	76,339	0.7	73,883	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		0.259 ( 0.111)	86,078 ( 34,852)	0.37	126,281	
さくら総合リート投資法人		—	—	0.4	37,430	
投資法人みらい		—	—	0.8	151,867	
森トラスト・ホテルリート投資法人		0.1	15,007	0.8	116,179	
三菱地所物流リート投資法人		0.5	130,024	0.2	50,035	
CREロジスティクスファンド投資法人		0.05	5,561	0.35	39,263	
ザイマックス・リート投資法人		0.85	96,440	0.35	40,077	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		0.6	54,510	0.4	37,487	
日本ビルファンド投資法人		0.32	224,332	0.42	289,434	
ジャパンリアルエステイト投資法人		0.5	299,684	0.4	250,108	
日本リテールファンド投資法人		1	212,178	1	274,538	
オリックス不動産投資法人		0.7	126,406	1	198,988	



銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国	日本プライムリアルティ投資法人	0.7	275,563	0.1	43,284
	プレミア投資法人	0.6	67,577	0.4	49,201
	東急リアル・エステート投資法人	1	171,219	0.3	50,283
	グローバル・ワン不動産投資法人	2	343,843	0.9	106,265
		( 1)	( -)		
	ユナイテッド・アーバン投資法人	0.8	137,670	1	259,817
	森トラスト総合リート投資法人	-	-	0.6	96,676
	インヴィンシブル投資法人	1	48,128	3	140,278
	フロンティア不動産投資法人	0.85	378,965	0.25	111,840
	平和不動産リート投資法人	0.3	30,887	0.6	72,386
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1	286,852	0.7	160,984
	福岡リート投資法人	-	-	0.75	126,493
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.03	22,291	0.38	260,816
	積水ハウス・レジデンシャル投資法人	-	-	-	-
		(△ 0.8)	(△ 93,600)		
	いちごオフィスリート投資法人	0.2	18,761	0.4	36,417
	大和証券オフィス投資法人	0.1	69,750	0.4	263,577
	阪急阪神リート投資法人	1	195,474	0.7	97,657
		( 0.13)	( 17,859)		
	内	大和ハウスリート投資法人	1	315,399	0.45
		( 0.042)	( 10,322)		
ジャパン・ホテル・リート投資法人		2	223,535	2	211,788
日本賃貸住宅投資法人		-	-	1	106,313
ジャパンエクセレント投資法人		1	164,657	0.3	44,938
野村不動産マスターファンド投資法人(新)		0.088	13,219	-	-
		(△0.088)	(△ 13,219)		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人(新)		0.111	34,852	-	-
		(△0.111)	(△ 34,852)		
阪急阪神リート投資法人(新)		0.13	17,859	-	-
	(△0.13)	(△ 17,859)			
大和ハウスリート投資法人(新)	0.042	10,322	-	-	
	(△0.042)	(△ 10,322)			
合 計	39	6,527,532	48	6,649,604	
	( 2)	( -)			

(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

(2018年3月13日～2019年3月11日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
投資信託証券	百万円 6,527	百万円 891	13.7	百万円 6,649	百万円 939	14.1

## 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 259

## 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)	9,758千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,374千円
(B) / (A)	14.1%

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

(2019年3月11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	%
サンケイリアルエステート投資法人	—	0.618	61,800	0.5
日本アコモデーションファンド投資法人	0.6	0.5	286,000	2.2
MCUBS MidCity投資法人	2	2	245,000	1.9
森ヒルズリート投資法人	1	0.5	70,800	0.5
産業ファンド投資法人	1	0.8	95,840	0.7
アドバンス・レジデンス投資法人	1	1	438,200	3.4
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2	1	178,900	1.4
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.8	0.75	346,875	2.7
GLP投資法人	2	2	291,000	2.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.9	0.7	203,560	1.6
日本プロロジスリート投資法人	2	1	421,200	3.3
星野リゾート・リート投資法人	0.1	0.3	161,400	1.2
Oneリート投資法人	0.4	—	—	—
イオンリート投資法人	0.5	2	319,000	2.5
ヒューリックリート投資法人	0.9	0.5	88,900	0.7
日本リート投資法人	0.8	0.55	225,775	1.7
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	12	2	32,320	0.3
積水ハウス・リート投資法人	0.7	4	364,050	2.8
ケネディクス商業リート投資法人	0.1	0.05	13,385	0.1
ヘルスケア&メディカル投資法人	1	0.6	66,540	0.5
野村不動産マスターファンド投資法人	2	4	608,400	4.7
いちごホテルリート投資法人	0.2	—	—	—
ラサールロジポート投資法人	1	1	158,700	1.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.4	0.4	136,600	1.1
さくら総合リート投資法人	0.4	—	—	—
投資法人みらい	0.8	—	—	—
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.7	—	—	—
三菱地所物流リート投資法人	—	0.3	73,950	0.6
CREロジスティクスファンド投資法人	0.3	—	—	—
ザイマックス・リート投資法人	0.3	0.8	92,080	0.7
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	—	0.2	17,880	0.1
日本ビルファンド投資法人	1	1	1,005,200	7.8
ジャパンリアルエステイト投資法人	1	1	893,200	6.9
日本リートファンド投資法人	2	2	576,940	4.5
オリックス不動産投資法人	3	2	518,560	4.0
日本プライムリアルティ投資法人	0.2	0.8	349,200	2.7
プレミア投資法人	1	1	160,080	1.2
東急リアル・エステート投資法人	—	0.8	133,280	1.0
グローバル・ワン不動産投資法人	0.4	3	454,320	3.5
ユナイテッド・アーバン投資法人	3	2	444,860	3.4
森トラスト総合リート投資法人	0.6	—	—	—
インヴィンシブル投資法人	5	3	152,400	1.2
フロンティア不動産投資法人	0.4	1	463,000	3.6

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	0.7	0.4	49,680	0.4	
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.1	0.7	157,080	1.2	
福岡リート投資法人	0.8	0.05	8,310	0.1	
ケネディクス・オフィス投資法人	0.85	0.5	376,000	2.9	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	0.8	—	—	—	
いちごオフィスリート投資法人	2	1	183,780	1.4	
大和証券オフィス投資法人	0.8	0.5	375,500	2.9	
阪急阪神リート投資法人	0.3	1	158,070	1.2	
大和ハウスリート投資法人	0.7	1	364,050	2.8	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4	5	427,000	3.3	
日本賃貸住宅投資法人	2	1	115,440	0.9	
ジャパンエクセレント投資法人	0.8	1	250,560	1.9	
合 計	口 数 ・ 金 額	73	66	12,614,665	
	銘 柄 数 < 比 率 >	51	47	< 97.7% >	

(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) 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、アクティブア・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、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、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、三菱地所物流リート投資法人、ザイマックス・リート投資法人、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、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MUFJ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2018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

(2019年3月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	12,614,665	97.3
コール・ローン等、その他	355,448	2.7
投資信託財産総額	12,970,113	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年3月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,970,113,654
コール・ローン等	156,467,162
投資証券(評価額)	12,614,665,000
未収入金	44,977,405
未収配当金	154,004,087
(B) 負債	52,597,541
未払金	23,061,501
未払解約金	29,535,939
未払利息	101
(C) 純資産総額(A-B)	12,917,516,113
元本	4,164,352,947
次期繰越損益金	8,753,163,166
(D) 受益権総口数	4,164,352,947口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,019円

## ＜注記事項＞

- ①期首元本額 4,391,072,732円  
 期中追加設定元本額 1,561,410,796円  
 期中一部解約元本額 1,788,130,581円  
 また、1口当たり純資産額は、期末3,1019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 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	87,873,710円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	62,779,710円
ファンド・マネジャー(国内リート)	11,337,324円
三菱UFJ <DC> J-REITファンド	3,419,651,842円
MUAM J-REITファンド(適格機関投資家転売制限付)	582,710,361円
合計	4,164,352,947円

## 【お知らせ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(特化型に分類)とともに、約款記載の整備を行うため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載変更ならびに約款記載の整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。(2018年4月5日)

## ○損益の状況 (2018年3月13日～2019年3月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	471,970,217
受取配当金	469,965,349
受取利息	684
その他収益金	2,211,233
支払利息	△ 207,049
(B) 有価証券売買損益	1,504,687,214
売買益	1,553,396,554
売買損	△ 48,709,340
(C) 保管費用等	△ 2,584
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,976,654,847
(E) 前期繰越損益金	7,226,827,478
(F) 追加信託差損益金	3,017,297,606
(G) 解約差損益金	△3,467,616,765
(H) 計(D+E+F+G)	8,753,163,166
次期繰越損益金(H)	8,753,163,166

- (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14期》決算日2020年1月6日

[計算期間：2019年1月8日～2020年1月6日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月6日に第14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14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 REIT 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
10期(2016年1月5日)	15,105	△ 1.8	39,610.16	△ 2.5	98.7	16,191
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

(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 L.L.C 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 (「SPDJI」) 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<sup>®</sup> および S & P<sup>®</sup> は Standard & Poor's Financial Services LLC (「S & P」) の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup> 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 SPDJI 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、SPDJI、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 ス ン デ ッ ク ス 騰 落 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	円	騰 落 率			
(期 首) 2019年1月7日	15,011	% —	38,602.62	% —	% 98.8
1月末	16,718	11.4	42,993.79	11.4	98.7
2月末	17,116	14.0	44,060.75	14.1	98.8
3月末	17,744	18.2	45,609.74	18.2	99.2
4月末	17,691	17.9	45,466.50	17.8	99.2
5月末	17,198	14.6	44,158.46	14.4	99.1
6月末	17,246	14.9	44,255.14	14.6	98.9
7月末	17,674	17.7	45,346.95	17.5	99.2
8月末	17,534	16.8	45,002.08	16.6	98.8
9月末	18,234	21.5	46,866.47	21.4	99.0
10月末	18,854	25.6	48,408.12	25.4	99.4
11月末	18,794	25.2	48,267.58	25.0	99.0
12月末	18,596	23.9	47,729.52	23.6	99.4
(期 末) 2020年1月6日	18,377	22.4	47,161.24	22.2	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

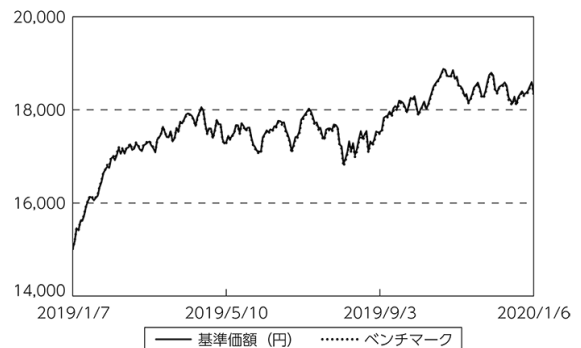
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ22.4%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(22.2%)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

(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REIT市況（現地通貨ベース）

- ・ 外国REIT市況は上昇しました。
- ・ 外国REIT市況は、米国の堅調な企業決算内容などを受けて上昇しました。

## ◎ 為替市況

- ・ 米ドル・ユーロは円に対して下落しました。
- ・ 為替市況は、期首に比べて0.4%の円高・米ドル安、2.6%の円高・ユーロ安となりました。

## ● 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22.2%の上昇になったため、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1月8日～2020年1月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 株 式 ) ( 投 資 信 託 証 券 )	円 3 ( 0 ) ( 3 )	% 0.016 (0.000) (0.016)	(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) 有 価 証 券 取 引 税 ( 株 式 ) ( 投 資 信 託 証 券 )	2 ( 0 ) ( 2 )	0.012 (0.000) (0.012)	(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
(c) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	5 ( 5 ) ( 1 )	0.030 (0.027) (0.003)	(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
合 計	10	0.058	
期中の平均基準価額は、17,648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1月8日～2020年1月6日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 — (33)	千アメリカドル — (17)	百株 0.54	千アメリカドル 1

(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す。

## 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
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	5	78	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23	791	2	75
MACERICH CO/THE	4	130	—	—
ACADIA REALTY TRUST	4	128	—	—
AGREE REALTY CORP	3	213	—	—
ALEXANDER'S INC	0.141	48	0.344	117
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6	914	0.631	96
PROLOGIS INC	28	2,262	5	469
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	6	295	1	75
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	—	( —)	(0.84625)
BRANDYWINE REALTY TRUST	5	85	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	4	506	0.683	74
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7	418	—	—
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3	106	—	—
COUSINS PROPERTIES INC	10 (△ 50)	188 ( 200)	—	—
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	6	64	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	9	1,105	1	197
EASTGROUP PROPERTIES INC	1	203	—	—
EPR PROPERTIES	3	241	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5 ( 17)	529 ( —)	0.816	102
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	893	0.692	216
EXTRA SPACE STORAGE INC	6	666	0.642	74
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	409	1	191
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5	227	1	75
GETTY REALTY CORP	1	49	—	—
WELLTOWER INC	22	1,816	2	255
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5	230	1	75
SERVICE PROPERTIES TRUST	6	152	—	—
EQUITY COMMONWEALTH	5	168	0.9	29
KILROY REALTY CORP	5	408	2	182
KITE REALTY GROUP TRUST	2	49	—	—
LEXINGTON REALTY TRUST	17	175	2	24
LTC PROPERTIES INC	1	66	—	—
MAC-KALI REALTY CORP	3	77	—	—
BOSTON PROPERTIES INC	6	856	3	423
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	44	860	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4	588	0.939	120
NATL HEALTH INVESTORS INC	1	127	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11 ( 1)	447 ( 46)	1	74
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.797	23	—	—

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
RPT REALTY	2	32	—	—
REALTY INCOME CORP	18	1,329	1	131
REGENCY CENTERS CORP	7	470	1	126
SAUL CENTERS INC	0.492	25	—	—
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	8	81	( —)	( 16)
SL GREEN REALTY CORP	3	281	1	84
LIFE STORAGE INC	1	138	—	—
SUN COMMUNITIES INC	5	720	0.699	104
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	12	174	5	76
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1	23	—	—
TAUBMAN CENTERS INC	2	101	—	—
CUBESMART	6	223	—	—
UDR INC	13	600	—	—
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.505	49	—	—
URSTADT BIDDLE - CLASS A	1	32	—	—
VENTAS INC	17	1,171	2	151
WASHINGTON REIT	2	82	—	—
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	4	126	—	—
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1	23	—	—
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.723	120	—	—
UMH PROPERTIES INC	1	24	—	—
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1	29	—	—
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	5	73	—	—
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	10	345	2	75
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	2	26	—	—
DOUGLAS EMMETT INC	6	270	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	7	199	2	74
CHESAPEAKE LODGING TRUST	1	30	( 11)	( 290)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	5	112	1	26
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	7	259	2	74
CORESITE REALTY CORP	1	147	—	—
AMERICAN ASSETS TRUST INC	3	152	—	—
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3	41	—	—
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	1	54	—	—
RLJ LODGING TRUST	5	100	—	—
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	3	70	1	28
STAG INDUSTRIAL INC	10	329	0.9	25
SABRA HEALTH CARE REIT INC	10	207	—	—
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	6	85	—	—
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	9	270	2	75
WP CAREY INC	9	745	1	124
WHITESTONE REIT	1	26	—	—
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3	305	0.927	75
CHATHAM LODGING TRUST	1	22	—	—

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
TERRENO REALTY CORP	4	199	0.7	28
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	6	286	—	—
CORECIVIC INC	5	98	—	—
GEO GROUP INC/THE	5	90	—	—
VEREIT INC	59	561	7	75
DUKE REALTY CORP	17	563	2	75
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	8	316	0.7	24
PHYSICIANS REALTY TRUST	6	117	—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	11	287	3	82
CYRUSONE INC	6	419	1	103
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	1	21	( —)	(0.63127)
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	9	134	1	26
QTS REALTY TRUST INC-CL A	3	152	—	—
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13	261	3	75
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	3	82	—	—
WASHINGTON PRIME GROUP INC	10	47	—	—
CARETRUST REIT INC	5	132	1	27
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	2	38	—	—
GAMING AND LEISURE PROPRTIE	7	286	—	—
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4	49	3	34
IRON MOUNTAIN INC	11	369	2	74
STORE CAPITAL CORP	10	387	—	—
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	4	24	—	—
URBAN EDGE PROPERTIES	7	151	5	107
EQUINIX INC	17	10,432	—	—
PARAMOUNT GROUP INC	8	116	—	—
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	8	173	3	74
XENIA HOTELS & RESORTS INC	4	90	1	28
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2	72	—	—
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.565	24	—	—
APPLE HOSPITALITY REIT INC	10	164	4	75
GLOBAL NET LEASE INC	5	101	—	—
CITY OFFICE REIT INC	5	76	—	—
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	1	23	4 ( 5)	75 ( 88)
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2	104	—	—
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1	56	—	—
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1	40	—	—
MANULIFE US REAL ESTATE INV	78 ( —)	68 (△ 4)	— ( —)	— ( 1)
TIER REIT INC	— (△ 9)	— (△ 200)	— ( —)	— ( —)
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	—	—	— ( 5)	— ( 58)

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
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	8 ( 7)	217 ( 164)	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	16	1,314	6	587
COLONY CAPITAL INC	19	101	—	—
INVITATION HOMES INC	63	1,778	3	104
JBG SMITH PROPERTIES	7	310	1	75
GLADSTONE LAND CORP	1	18	—	—
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4	52	—	—
INFREAREIT INC	1	22	—	—
VICI PROPERTIES INC	32	724	( 7)	( 157)
AMERICOLD REALTY TRUST	32	1,030	2	76
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2	50	—	—
SPIRIT MTA REIT	2	24	9	85
RETAIL VALUE INC	0.697 ( 0.064)	22 ( 1)	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	19	390	5	94
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	2	26	—	—
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.58	58	—	—
SAFEHOLD INC	0.795	32	—	—
AMERICAN FINANCE TRUST INC	12	173	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	10	236	—	—
ARA US HOSPITALITY TRUST	97	85	—	—
COREPOINT LODGING INC	7	75	—	—
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4	79	—	—
EAGLE HOSPITALITY TRUST	202	114	—	—
PRIME US REIT	111	108	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	31	567	10	181
LIBERTY PROPERTY TRUST	6	360	—	—
PUBLIC STORAGE	6	1,491	1	303
SIMON PROPERTY GROUP INC	13	2,162	3	500
VORNADO REALTY TRUST	7	474	4	276
KIMCO REALTY CORP	17	349	3	75
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	1,246	0.983	204
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	6 ( 0.823)	320 ( 41)	2 (0.811)	134 ( —)
小 計	1,667 (△ 33)	56,999 ( 249)	168 ( 31)	7,899 ( 615)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.8	32	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6	215	3	100
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5	256	—	—
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	4	54	—	—
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	0.8	24	—	—
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5	127	—	—
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1	53	—	—

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8	226	3	100
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2	140	—	—
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2	32	—	—
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	2	44	—	—
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5	68	—	—
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	2	30	19	318
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1	108	—	—
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	4	70	—	—
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4	48	—	—
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1	33	—	—
CHOICE PROPERTIES REIT	8	112	—	—
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5	73	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4	79	—	—
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	—	—	( 2)	( 29)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	10	131	6	79
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	3	24	—	—
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2	55	—	—
小 計	96	2,046	( 2)	( 29)
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
ドイツ				
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	6	89	—	—
	( —)	(△ 15)		
HAMBORNER REIT AG	2	19	—	—
小 計	8	109	—	—
	( —)	(△ 15)		
イタリア				
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	—	—	—	—
	( —)	(△0.11263)		
小 計	—	—	—	—
	( —)	(△0.11263)		
フランス				
COVIVIO	—	—	—	—
			( 1)	( 123)
GECINA SA	2	323	0.481	67
KLEPIERRE	7	235	—	—
COVIVIO	3	284	4	434
	( 1)	( 123)		
MERCIALYS	3	45	7	92
ICADE	1	136	3	301
ALTAREA	0.21	40	—	—
	( —)	(△ 7)		
小 計	18	1,065	16	896
	( 1)	( 115)	( 1)	( 123)

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ユーロ	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
オランダ				
EUROCOMMERCIAL PROPETIE-CV	0.943	24	—	—
NSI NV	0.543	20	—	—
VASTNED RETAIL NV	1	51	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5	816	1	148
WERELDHAVE NV	0.913	20	—	—
小 計	9	932	1	148
スペイン				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	3 ( —)	29 (△ 1)	3	30
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	12 ( —)	150 (△ 6)	—	—
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	11 ( —)	123 (△ 6)	9	103
小 計	27 ( —)	303 (△ 13)	13	133
ベルギー				
BEFIMMO	0.881	46	0.55	27
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	0.816	19	—	—
RETAIL ESTATES	0.868	76	—	—
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.848 ( 22)	124 ( —)	—	—
AEDIFICA	1 ( 1)	135 ( 89)	0.653	68
AEDIFICA-RTS	— ( 3)	— ( —)	— ( 3)	— ( 11)
MONTEA	1	82	—	—
MONTEA-RTS	— ( 1)	— ( —)	1	0.6412
COFINIMMO	1	183	—	—
小 計	7 ( 28)	667 ( 89)	2 ( 3)	96 ( 11)
アイルランド				
GREEN REIT PLC	18	31	— ( 133)	— ( 189)
HIBERNIA REIT PLC	39	54	—	—
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	16	28	—	—
小 計	74	115	— ( 133)	— ( 189)
ユ ー ロ 計	147 ( 29)	3,194 ( 175)	33 ( 138)	1,275 ( 323)
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	42	245	14	83
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	7	57	—	—
HAMMERSON PLC	22	64	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	33	299	7	61



銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
	INTU PROPERTIES PLC	40	14	—	—
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	114	153	—	—
	SEGREO PLC	68	518	11	90
	WORKSPACE GROUP PLC	5	50	—	—
	SHAFTESBURY PLC	4	38	—	—
	BIG YELLOW GROUP PLC	4	45	—	—
	DERWENT LONDON PLC	4	148	2	74
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	60	124	—	—
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	13	14	—	—
	RDI REIT PLC	16	20	—	—
		(△ 180)	( — )		
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	6	41	—	—
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	131	194	41	61
	ASSURA PLC	85	51	44	25
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	44	43	—	—
	REGIONAL REIT LTD	26	28	—	—
	NEWRIVER REIT PLC	11	25	—	—
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	102	104	—	—
	UNITE GROUP PLC/THE	30	347	—	—
LXI REIT PLC	34	43	—	—	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	68	60	—	—	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	117	103	—	—	
AEW UK REIT PLC	65	62	—	—	
小 計	1,164 (△ 180)	2,901 ( — )	121	396	
国	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	152	392	42	109
	ABACUS PROPERTY GROUP	25	99	—	—
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	8	38	—	—
	CHARTER HALL GROUP	13	149	—	—
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	12	45	—	—
	CROMWELL PROPERTY GROUP	90	111	—	—
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	43	114	—	—
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	7	34	—	—
	NATIONAL STORAGE REIT	35	65	—	—
	GDI PROPERTY GROUP	29	40	—	—
	APN INDUSTRIA REIT	11	32	—	—
	SCENTRE GROUP	227	893	40	160
	ARENA REIT	23	66	—	—
	VIVA ENERGY REIT	23	63	—	—
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	53	282	—	—
	PROPERTYLINK GROUP	—	—	87	101
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	79	236	—	—
	GPT GROUP	106	654	18	110
	MIRVAC GROUP	223	679	35	110
STOCKLAND	111	493	24	108	

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
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
DEXUS	64	803	12	153
BWP TRUST	15	60	—	—
CHARTER HALL RETAIL REIT	21	95	—	—
GOODMAN GROUP	70	984	16	218
小 計	1,450	6,439	278	1,073
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	29	77	—	—
KIWI PROPERTY GROUP LTD	73	115	—	—
GOODMAN PROPERTY TRUST	45	90	—	—
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	64	107	—	—
ARGOSY PROPERTY LTD	33	40	—	—
STRIDE PROPERTY GROUP	—	—	69	158
小 計	246	430	69	158
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	90	8,067	24	2,090
CHAMPION REIT	79	467	—	—
PROSPERITY REIT	134	424	73	233
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	74	393	—	—
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	35	203	—	—
FORTUNE REIT	56	564	—	—
小 計	468	10,120	97	2,324
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	92 ( — )	173 (△ 4)	—	—
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	107	216	—	—
KEPPEL REIT	88 ( — )	107 (△ 1)	—	—
FRASERS COMMERCIAL TRUST	22 ( — )	32 (△ 2)	—	—
ASCOTT TRUST	24 ( 121)	31 ( 112)	—	—
ESR-REIT	111 ( — )	58 (△0.79694)	— ( — )	— ( 0.7467)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	46 ( — )	74 (△ 1)	—	—
FRASERS CENTREPOINT TRUST	54	143	—	—
STARHILL GLOBAL REIT	40 ( — )	31 (△ 1)	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	284 ( — )	457 (△ 5)	— ( — )	— ( 4)
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	58 ( — )	90 (△ 7)	—	—
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	25 ( — )	25 (△ 3)	—	—
AIMS APAC REIT	76 ( — )	109 (△0.24471)	104	147

外

国

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
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	163 ( - )	35 (△ 2)	-	-
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	10 ( - )	30 (△ 1)	-	-
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	91 ( - )	206 (△0.56505)	-	-
	CACHE LOGISTICS TRUST	52 ( - )	38 (△0.29194)	-	-
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	144	328	48	109
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46	30	-	-
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	- ( - )	- (△ 0.1596)	-	-
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	31 ( - )	33 (△ 1)	- ( 152)	- ( 125)
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	74 ( - )	97 (△ 7)	-	-
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	48 ( - )	29 (△0.14437)	-	-
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	198 ( 306)	106 ( 144)	-	-
	QUE HOSPITALITY TRUST	48	34	72 ( 225)	51 ( 153)
	SPH REIT	61	67	-	-
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	- ( - )	- (△ 4)	-	-
	KEPPEL DC REIT	77	143	-	-
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	26 ( - )	31 (△ 6)	-	-
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	130	103	-	-
	CAPITALAND MALL TRUST	93	233	-	-
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	211 ( - )	627 (△ 10)	33	105
ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	- ( 81)	- ( - )	81	22	
小 計	2,543 ( 509)	3,732 ( 191)	340 ( 378)	435 ( 284)	
韓国		千韓国ウォン		千韓国ウォン	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5	28,311	-	-	
小 計	5	28,311	-	-	
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 I LTD	5	99	-	-	
小 計	5	99	-	-	

(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

(2019年1月8日～2020年1月6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	132千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	127千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.03

(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1月8日～2020年1月6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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 6,960	百万円 1,216	% 17.5	百万円 1,294	百万円 89	% 6.9

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1月6日現在)

## 外国株式

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) FIVE STAR SENIOR LIVING INC	百株	百株	千アメリカドル 11	千円 1,276	ヘルスケア機器・サービス	
合 計	株 数 ・ 金 額	—	32	11	1,276	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	< 0.0% >	

(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) 邦貨換算金額欄の&lt; &gt;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	%
SITE CENTERS CORP	23	29	405	43,794	0.1
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82	103	3,559	384,862	1.3
MACERICH CO/THE	18	22	587	63,561	0.2
ACADIA REALTY TRUST	13	18	466	50,484	0.2
AGREE REALTY CORP	5	8	614	66,475	0.2
ALEXANDER'S INC	0.654	0.451	150	16,217	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18	24	3,859	417,289	1.4
PROLOGIS INC	108	130	11,662	1,260,865	4.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23	28	1,309	141,555	0.5
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15	15	40	4,373	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	31	36	579	62,636	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	15	19	2,114	228,644	0.8
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	31	31	31	3,437	0.0
CEDAR REALTY TRUST INC	17	17	52	5,686	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	27	35	1,874	202,629	0.7
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	18	22	665	71,916	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	70	30	1,231	133,182	0.4
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	35	41	448	48,511	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	35	43	5,170	558,943	1.8
EASTGROUP PROPERTIES INC	6	7	1,044	112,896	0.4
EPR PROPERTIES	12	16	1,137	123,021	0.4
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15	37	2,636	284,994	0.9
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11	13	4,105	443,830	1.5
EXTRA SPACE STORAGE INC	21	27	2,924	316,179	1.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12	14	1,813	196,045	0.6
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22	25	1,082	117,026	0.4
GETTY REALTY CORP	5	7	240	26,042	0.1
WELLTOWER INC	64	83	6,828	738,221	2.4
HIGHWOODS PROPERTIES INC	18	21	1,043	112,829	0.4
SERVICE PROPERTIES TRUST	27	33	810	87,569	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	20	25	819	88,596	0.3
KILROY REALTY CORP	17	20	1,689	182,691	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	14	17	332	35,979	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	34	49	533	57,704	0.2
LTC PROPERTIES INC	6	8	364	39,427	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	14	18	422	45,654	0.2
BOSTON PROPERTIES INC	26	29	4,067	439,722	1.5
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	63	107	2,259	244,242	0.8
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19	23	3,086	333,688	1.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	7	8	719	77,810	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	34	45	1,895	204,888	0.7
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2	3	83	9,055	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12	12	62	6,743	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	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
RPT REALTY	13	15	229	24,858	0.1
REALTY INCOME CORP	50	67	4,961	536,378	1.8
REGENCY CENTERS CORP	29	34	2,142	231,609	0.8
SAUL CENTERS INC	2	2	134	14,495	0.0
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	39	48	391	42,272	0.1
SL GREEN REALTY CORP	14	17	1,520	164,376	0.5
LIFE STORAGE INC	8	9	1,035	111,919	0.4
SUN COMMUNITIES INC	14	19	2,879	311,323	1.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38	45	633	68,534	0.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16	18	261	28,296	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	10	12	394	42,612	0.1
CUBESMART	32	39	1,248	134,958	0.4
UDR INC	47	60	2,808	303,627	1.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2	2	305	32,990	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4	6	146	15,828	0.1
VENTAS INC	61	77	4,398	475,515	1.6
WASHINGTON REIT	13	16	477	51,595	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20	24	752	81,381	0.3
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5	7	103	11,182	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3	4	679	73,458	0.2
UMH PROPERTIES INC	6	7	122	13,201	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4	5	125	13,607	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	15	20	299	32,350	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	21	29	985	106,554	0.4
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	19	22	189	20,444	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2	2	157	16,977	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	27	34	1,501	162,289	0.5
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22	26	702	75,923	0.3
CHESAPEAKE LODGING TRUST	10	—	—	—	—
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21	25	575	62,270	0.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26	32	1,195	129,221	0.4
CORESITE REALTY CORP	6	7	870	94,103	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6	9	450	48,732	0.2
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	18	21	263	28,506	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7	9	304	32,953	0.1
RLJ LODGING TRUST	29	35	613	66,281	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	20	23	398	43,049	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	19	29	927	100,293	0.3
SABRA HEALTH CARE REIT INC	30	40	847	91,581	0.3
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	37	43	572	61,896	0.2
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	36	42	1,287	139,175	0.5
WP CAREY INC	27	35	2,845	307,620	1.0
WHITESTONE REIT	7	8	118	12,837	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9	11	1,004	108,568	0.4
CHATHAM LODGING TRUST	7	9	164	17,736	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	%	
TERRENO REALTY CORP	10	14	759	82,072	0.3	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14	20	1,009	109,140	0.4	
CORECIVIC INC	19	25	406	43,974	0.1	
GEO GROUP INC/THE	20	25	411	44,489	0.1	
VEREIT INC	167	219	2,016	217,982	0.7	
DUKE REALTY CORP	62	76	2,693	291,216	1.0	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	15	22	1,049	113,407	0.4	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31	37	705	76,250	0.3	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	43	52	1,368	148,001	0.5	
CYRUSONE INC	18	23	1,536	166,099	0.5	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4	6	55	5,970	0.0	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	23	30	424	45,857	0.2	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	8	11	623	67,370	0.2	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	51	60	1,257	135,897	0.4	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	20	24	501	54,189	0.2	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29	39	136	14,793	0.0	
CARETRUST REIT INC	15	19	408	44,157	0.1	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6	9	119	12,910	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPRTIE	34	42	1,820	196,766	0.7	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	17	18	261	28,264	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	49	58	1,804	195,039	0.6	
STORE CAPITAL CORP	32	43	1,614	174,535	0.6	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	11	16	127	13,793	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	20	23	435	47,028	0.2	
EQUINIX INC	—	17	10,312	1,114,910	3.7	
PARAMOUNT GROUP INC	34	42	585	63,244	0.2	
EASTERLY GOVERNMENT PROPTI	10	15	367	39,720	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	20	23	492	53,294	0.2	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9	12	412	44,619	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3	4	195	21,132	0.1	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	37	42	683	73,842	0.2	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3	3	42	4,578	0.0	
GLOBAL NET LEASE INC	13	18	382	41,309	0.1	
CITY OFFICE REIT INC	6	11	159	17,278	0.1	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	8	—	—	—	—	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4	6	273	29,561	0.1	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11	13	378	40,870	0.1	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2	3	162	17,558	0.1	
FARMLAND PARTNERS INC	4	4	28	3,096	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	214	292	290	31,423	0.1	
TIER REIT INC	9	—	—	—	—	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	5	—	—	—	—	
PARK HOTELS & RESORTS INC	34	49	1,259	136,175	0.5	
EQUITY RESIDENTIAL	63	72	5,886	636,383	2.1	
COLONY CAPITAL INC	81	100	476	51,484	0.2	

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	%	
INVITATION HOMES INC	50	110	3,328	359,821	1.2	
JBG SMITH PROPERTIES	18	24	955	103,288	0.3	
CLIPPER REALTY INC	2	2	30	3,300	0.0	
GLADSTONE LAND CORP	2	4	51	5,615	0.0	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	3	7	102	11,128	0.0	
INFRAREIT INC	6	—	—	—	—	
VICI PROPERTIES INC	62	94	2,395	259,010	0.9	
AMERICOLD REALTY TRUST	9	39	1,384	149,686	0.5	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10	12	287	31,076	0.1	
SPIRIT MTA REIT	6	—	—	—	—	
RETAIL VALUE INC	2	3	113	12,316	0.0	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	14	262	28,363	0.1	
BRT APARTMENTS CORP	2	2	37	4,107	0.0	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	8	10	137	14,875	0.0	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1	2	178	19,325	0.1	
SAFEHOLD INC	1	2	108	11,753	0.0	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	9	21	277	29,984	0.1	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	5	16	418	45,281	0.1	
ARA US HOSPITALITY TRUST	—	97	83	9,070	0.0	
COREPOINT LODGING INC	—	7	74	8,092	0.0	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	—	4	74	8,088	0.0	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	—	202	111	12,011	0.0	
PRIME US REIT	—	111	108	11,700	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	128	149	2,696	291,506	1.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	25	32	1,965	212,461	0.7	
PUBLIC STORAGE	25	31	6,629	716,750	2.4	
SIMON PROPERTY GROUP INC	53	63	9,211	995,829	3.3	
VORNADO REALTY TRUST	29	32	2,157	233,265	0.8	
KIMCO REALTY CORP	73	87	1,737	187,825	0.6	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	23	28	6,026	651,542	2.2	
APARTMENT INV T & MGMT CO -A	26	30	1,560	168,679	0.6	
小 計	口 数 ・ 金 額	3,858	5,292	203,300	21,978,777	
	銘柄 数 < 比 率 >	157	158	—	< 72.7% >	
(カナダ)				千カナダドル		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3	4	211	17,575	0.1	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10	14	445	37,099	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11	16	893	74,405	0.2	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	14	18	264	22,019	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5	6	191	15,943	0.1	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23	29	612	51,035	0.2	
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4	6	195	16,294	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26	30	826	68,821	0.2	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9	12	623	51,914	0.2	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12	14	175	14,591	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6	9	152	12,684	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	%
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		8	13	164	13,737	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV		16	—	—	—	—
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		3	5	365	30,418	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		8	12	195	16,315	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		8	12	162	13,504	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		2	4	80	6,722	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		21	30	423	35,271	0.1
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		8	13	214	17,882	0.1
SLATE RETAIL REIT - U		5	5	66	5,558	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		6	10	199	16,583	0.1
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA		2	—	—	—	—
SLATE OFFICE REIT		5	5	32	2,722	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		10	14	174	14,540	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		6	9	69	5,810	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		1	3	88	7,384	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	243	306	6,832	568,838	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	24	—	< 1.9% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		25	32	540	65,218	0.2
HAMBORNER REIT AG		13	15	151	18,231	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	39	47	691	83,449	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.3% >	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		8	8	53	6,504	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	8	8	53	6,504	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)						
COVIVIO		1	—	—	—	—
GECINA SA		9	11	1,837	221,754	0.7
KLEPIERRE		35	43	1,496	180,597	0.6
COVIVIO		9	9	941	113,591	0.4
MERCIALYS		9	5	70	8,504	0.0
ICADE		7	5	550	66,454	0.2
ALTAREA		0.575	0.785	159	19,232	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	73	75	5,055	610,135	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	6	—	< 2.0% >	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV		7	8	217	26,302	0.1
NSI NV		3	3	163	19,729	0.1
VASTNED RETAIL NV		2	4	109	13,179	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		23	28	4,030	486,424	1.6
WERELDHAVE NV		6	7	161	19,507	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	43	52	4,682	565,142	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 1.9% >	

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…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		14	14	105	12,684	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		62	74	959	115,757	0.4
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		48	50	578	69,804	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	125	139	1,642	198,246	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.7% >	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		4	4	257	31,134	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		3	4	112	13,579	0.0
RETAIL ESTATES		1	2	182	22,061	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2	26	629	76,025	0.3
AEDIFICA		3	4	567	68,452	0.2
MONTEA		1	2	195	23,649	0.1
COFINIMMO		3	5	679	82,003	0.3
小 計	口 数 ・ 金 額	19	49	2,625	316,907	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 1.0% >	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		115	—	—	—	—
HIBERNIA REIT PLC		109	149	210	25,428	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		67	84	132	16,048	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	291	233	343	41,476	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	2	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	601	607	15,095	1,821,862	
	銘柄 数 < 比 率 >	28	26	—	< 6.0% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		167	195	1,229	173,876	0.6
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		47	55	472	66,830	0.2
HAMMERSON PLC		136	159	492	69,648	0.2
LAND SECURITIES GROUP PLC		128	154	1,530	216,465	0.7
INTU PROPERTIES PLC		160	201	66	9,386	0.0
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		130	244	390	55,209	0.2
SEGRO PLC		174	231	2,070	292,804	1.0
WORKSPACE GROUP PLC		21	26	318	44,981	0.1
SHAFTESBURY PLC		39	44	416	58,958	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC		26	30	368	52,155	0.2
DERWENT LONDON PLC		19	21	852	120,527	0.4
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		112	172	407	57,675	0.2
HANSTEEN HOLDINGS PLC		76	90	105	14,991	0.0
RDI REIT PLC		225	61	80	11,317	0.0
SAFESTORE HOLDINGS PLC		37	43	353	50,058	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC		261	351	520	73,662	0.2
ASSURA PLC		438	479	370	52,433	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		99	99	56	7,951	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		86	131	127	18,020	0.1
REGIONAL REIT LTD		51	78	88	12,508	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC		75	75	19	2,730	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		
(イギリス)	千口	千口	千イギリスポンド	千円	%	
NEWRIVER REIT PLC	47	59	119	16,965	0.1	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	28	130	120	17,062	0.1	
UNITE GROUP PLC/THE	43	74	939	132,848	0.4	
LXI REIT PLC	65	99	139	19,748	0.1	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	107	176	156	22,081	0.1	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	68	68	63	8,914	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	—	117	114	16,232	0.1	
AEW UK REIT PLC	—	65	65	9,250	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,876	3,739	12,055	1,705,297	
	銘柄 数 < 比 率 >	27	29	—	< 5.6% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
VICINITY CENTRES	547	657	1,650	124,067	0.4	
ABACUS PROPERTY GROUP	50	76	277	20,885	0.1	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	38	47	234	17,596	0.1	
CHARTER HALL GROUP	82	95	1,069	80,418	0.3	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	39	52	170	12,783	0.0	
CROMWELL PROPERTY GROUP	294	384	453	34,127	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	153	196	535	40,239	0.1	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	48	55	235	17,723	0.1	
NATIONAL STORAGE REIT	119	155	294	22,165	0.1	
GDI PROPERTY GROUP	75	104	154	11,596	0.0	
APN INDUSTRIA REIT	11	23	68	5,114	0.0	
SCENTRE GROUP	912	1,099	4,264	320,597	1.1	
ARENA REIT	45	68	198	14,916	0.0	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	24	24	77	5,793	0.0	
VIVA ENERGY REIT	73	97	260	19,551	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	33	86	472	35,548	0.1	
PROPERTYLINK GROUP	87	—	—	—	—	
CENTURIA METROPOLITAN REIT	—	79	232	17,472	0.1	
RURAL FUNDS GROUP	57	57	111	8,392	0.0	
GPT GROUP	311	400	2,294	172,464	0.6	
MIRVAC GROUP	631	819	2,629	197,693	0.7	
STOCKLAND	415	502	2,346	176,433	0.6	
DEXUS	173	225	2,683	201,709	0.7	
BWP TRUST	85	100	397	29,891	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	55	77	333	25,073	0.1	
GOODMAN GROUP	276	330	4,465	335,712	1.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	4,646	5,818	25,910	1,947,973	
	銘柄 数 < 比 率 >	25	25	—	< 6.4% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	49	78	223	16,086	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	247	320	499	35,954	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	180	225	503	36,245	0.1	
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	164	228	418	30,162	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	126	160	219	15,822	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		
(ニュージーランド)		千口	千口	千ニュージーランドドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP		69	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	836	1,014	1,863	134,270	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	5	—	<0.4%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		366	433	35,397	491,674	1.6
CHAMPION REIT		328	407	2,067	28,718	0.1
PROSPERITY REIT		178	239	731	10,158	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		231	305	1,613	22,410	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		163	198	1,011	14,053	0.0
FORTUNE REIT		239	295	2,666	37,041	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	1,505	1,877	43,488	604,057	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	<2.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		379	471	872	69,880	0.2
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		476	584	1,168	93,591	0.3
KEPPEL REIT		298	386	475	38,132	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		106	128	212	16,989	0.1
ASCOTT TRUST		214	359	478	38,331	0.1
ESR-REIT		346	458	249	20,005	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		128	174	284	22,817	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		96	150	424	33,977	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		232	272	197	15,836	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		391	676	1,169	93,710	0.3
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		97	156	248	19,888	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		94	119	119	9,591	0.0
AIMS APAC REIT		120	92	132	10,610	0.0
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		281	444	100	8,015	0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		66	76	253	20,332	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		212	303	792	63,473	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST		169	221	159	12,756	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		340	436	1,043	83,613	0.3
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		143	189	142	11,388	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		133	133	61	4,955	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		121	—	—	—	—
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC		361	436	501	40,177	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		105	153	81	6,523	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		—	504	282	22,639	0.1
QUE HOSPITALITY TRUST		249	—	—	—	—
SPH REIT		105	167	179	14,361	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		139	139	100	8,054	0.0
KEPPEL DC REIT		171	248	524	42,031	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI		279	306	376	30,208	0.1
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		—	130	115	9,271	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		484	578	1,417	113,609	0.4

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) ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	千口 442	千口 619	千シンガポールドル 1,846	千円 147,976	% 0.5
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,786 30	9,120 30	14,011 —	1,122,753 < 3.7% >
(韓国) SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	—	5	千韓国ウォン 39,300	3,643	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	— —	5 1	39,300 —	3,643 < 0.0% >
(イスラエル) REIT 1 LTD	28	34	千イスラエルシェケル 710	22,074	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	28 1	34 1	710 —	22,074 < 0.1% >
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	21,385 306	27,814 305	— —	29,909,549 < 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

(2020年1月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 1,276	% 0.0
投資証券	29,909,549	98.3
コール・ローン等、その他	505,182	1.7
投資信託財産総額	30,416,007	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (29,993,436千円) の投資信託財産総額 (30,416,007千円) に対する比率は98.6%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=108.11円	1 カナダドル=83.26円	1 ユーロ=120.69円	1 イギリスポンド=141.45円
1 オーストラリアドル=75.18円	1 ニュージーランドドル=72.04円	1 香港ドル=13.89円	1 シンガポールドル=80.13円
100韓国ウォン=9.27円	1 イスラエルシェケル=31.05円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	30,658,910,093
コール・ローン等	382,706,867
株式(評価額)	1,276,206
投資証券(評価額)	29,909,549,143
未収入金	242,903,050
未収配当金	122,474,827
(B) 負債	441,385,698
未払金	439,695,901
未払解約金	1,689,444
未払利息	353
(C) 純資産総額(A-B)	30,217,524,395
元本	16,442,762,098
次期繰越損益金	13,774,762,297
(D) 受益権総口数	16,442,762,098口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,377円

<注記事項>

- ①期首元本額 13,131,720,547円  
 期中追加設定元本額 4,475,915,257円  
 期中一部解約元本額 1,164,873,706円  
 また、1口当たり純資産額は、期末18,377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	5,831,817,224円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	2,850,770,490円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	2,390,608,591円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,118,486,931円
つみたて8資産均等バランス	1,105,471,129円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	447,054,206円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	335,956,638円
eMAXIS バランス(波乗り型)	281,718,935円
eMAXIS Slim 先進国リートインデックス	184,525,411円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	166,988,820円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	147,391,505円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	127,405,434円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	105,535,929円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	69,675,804円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	50,453,807円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	50,339,632円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	39,860,695円
ファンド・マネジャー(海外リート)	39,374,546円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	26,473,577円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	25,151,799円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	22,585,769円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	11,558,325円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	10,886,982円
eMAXIS マイマネージャー1980s	1,379,975円
eMAXIS マイマネージャー1970s	885,549円

○損益の状況 (2019年1月8日~2020年1月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	975,856,384
受取配当金	971,132,051
受取利息	2,206,915
その他収益金	2,542,992
支払利息	△ 25,574
(B) 有価証券売買損益	3,670,924,043
売買益	4,234,032,992
売買損	△ 563,108,949
(C) 保管費用等	△ 7,595,824
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,639,184,603
(E) 前期繰越損益金	6,580,583,356
(F) 追加信託差損益金	3,434,388,929
(G) 解約差損益金	△ 879,394,591
(H) 計(D+E+F+G)	13,774,762,297
次期繰越損益金(H)	13,774,762,297

- (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。

e MAX I S マイマネージャー 1990s  
合計

404,395円  
16,442,762,098円

【お 知 ら せ】

- ①より適正な水準となるように信託財産留保額を引き下げるため、信託財産留保額を変更し、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2019年10月26日)
- ②当期末付で設定来のベンチマークを「課税前配当込み指数」から「税引き後配当込み指数」に変更しました。