

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2026年7月3日まで（2006年3月17日設定）	
運用方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行い、信託財産の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	TOPIXマザーファンド受益証券、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、外国株式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、日本債券インデックス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、外国債券インデックス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、TOPIX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、外国株式インデックスマザーファンド	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、日本債券インデックスマザーファンド	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、外国債券インデックスマザーファンド	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、TOPIX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、外国株式インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	(株)三菱UFJ 国内債券マザーファンド、(株)日本債券インデックスマザーファンド	(※1)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。 (※2)外貨建資産への投資は行いません。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド	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。	
	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31期（決算日：2021年7月5日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）」は、去る7月5日に第31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
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
29期(2020年7月6日)	9,854	0	△6.4	59.4	0.6	18.9	0.0	20.4	1,815
30期(2021年1月5日)	10,483	350	9.9	58.6	0.8	19.7	0.0	20.2	1,849
31期(2021年7月5日)	11,112	1,000	15.5	58.2	1.2	19.5	0.0	20.4	1,914

(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	%	%	%	%	%	%
2021年1月5日	10,483	—	58.6	0.8	19.7	0.0	20.2
1月末	10,689	2.0	57.2	1.5	19.5	0.0	20.9
2月末	10,981	4.8	57.6	0.5	19.4	0.0	21.0
3月末	11,542	10.1	57.7	1.0	18.9	0.0	20.9
4月末	11,683	11.4	57.5	1.2	18.7	0.0	21.1
5月末	11,821	12.8	57.8	1.3	19.1	0.0	20.8
6月末	12,024	14.7	57.7	1.3	18.8	0.0	20.9
(期末)							
2021年7月5日	12,112	15.5	58.2	1.2	19.5	0.0	20.4

(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。

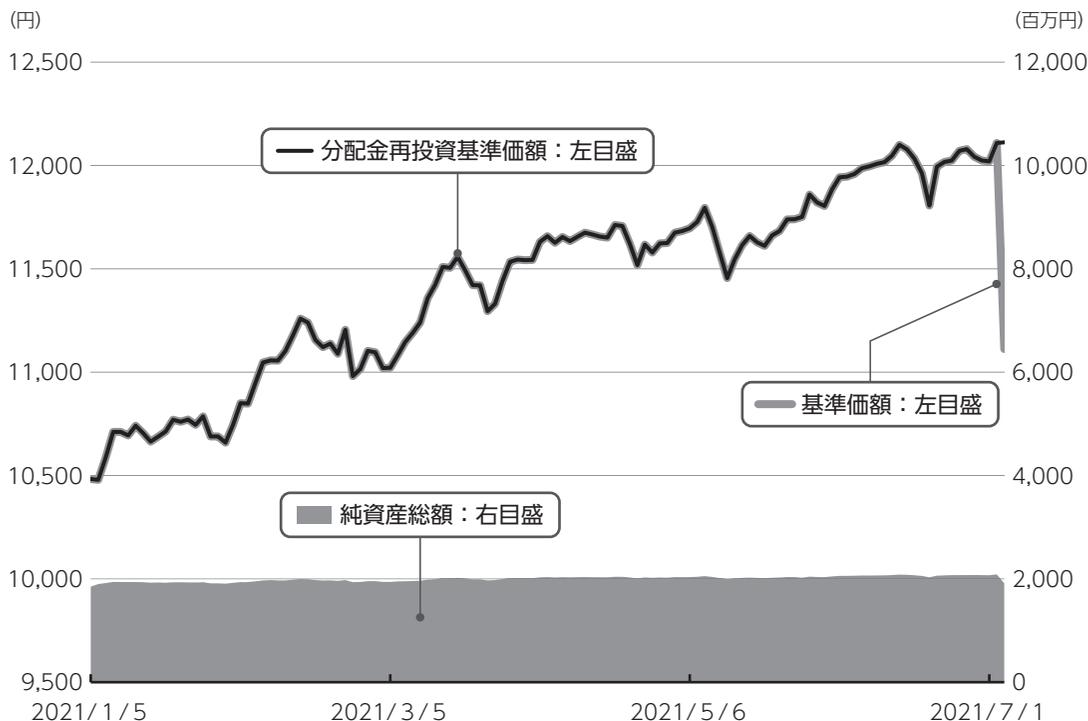
(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第31期：2021年1月6日～2021年7月5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31期首	10,483円
第31期末	11,112円
既払分配金	1,000円
騰落率	15.5%

(分配金再投資ベース)

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

※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15.5%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因**上昇要因**

主に外国株式市況が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

基準価額の主な変動要因の内訳は以下の通りです。

内訳

三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド	3.0%程度
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	7.1%程度
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	0.0%程度
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	0.3%程度
MUAM J-REITマザーファンド	2.2%程度
MUAM G-REITマザーファンド	2.9%程度
その他（信託報酬等）	0.0%程度

第31期：2021年1月6日～2021年7月5日

投資環境について

▶ 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

主要国の経済対策への期待や新型コロナウイルスのワクチン接種普及による経済正常化への期待等が支援材料となり、国内株式市況は上昇しました。

▶ 外国株式市況

外国株式市況は上昇しました。

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

▶ 国内債券市況

国内債券市況は上昇しました。

国内債券市況は、期の前半にインフレや米債増発への懸念による米金利の上昇、日銀の金融政策点検に対する警戒感などから下落しました。公表された点検結果は概ね市場予想通りとなり、長期金利の許容変動幅が明確化された安心感から、国内債券市況は反発しました。期の後半は概ね横ばいで推移し、期を通してみると国内債券市況は上昇しました。

▶ 外国債券市況

先進国の債券市況は下落しました。

先進国の債券市況は、米国での新型コロナウイルスのワクチン普及や経済正常化

期待を背景とした金利上昇等により、期首との比較では下落しました。

▶ 国内REIT市況

国内REIT市況は上昇しました。

新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な景気に対する悪影響への懸念やオフィス・ビル空室率の上昇傾向などにより一時的に弱含む局面もあったものの、各国が積極的な金融政策や財政政策を継続したこと、新型コロナウイルスワクチンの接種開始などにより経済正常化への期待が高まったことなどから、期首から期末にかけて概ね上昇基調で推移しました。

▶ 外国REIT市況

外国REIT市況は上昇しました。

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

▶ 為替市況

米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。

為替市況は、期首に比べて7.8%の円安・米ドル高、4.3%の円安・ユーロ高となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶三菱UFJ 6資産バランスファンド（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。

TOPIXマザーファンド*¹、三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド*² 30%
 外国株式インデックスマザーファンド*¹、三菱UFJ 外国株式マザーファンド*² 30%
 日本債券インデックスマザーファンド*¹、三菱UFJ 国内債券マザーファンド*² 10%
 外国債券インデックスマザーファンド*¹、三菱UFJ 外国債券マザーファンド*² 10%
 MUAMJ-REITマザーファンド 10%
 MUAMG-REITマザーファンド 10%
 ※マザーファンドの入替えのため、*1のファンドを2021年4月3日に投資対象に追加し、*2のファンドを2021年12月28日に削除する予定です。

当期は、追加した各マザーファンド（*1）の投資はありません。

▶三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込

み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

▶三菱UFJ 外国株式マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

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

▶三菱UFJ 国内債券マザーファンド

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

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

▶ 三菱UFJ 外国債券マザーファンド

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

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

▶ MUAM J-REITマザーファンド

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

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

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

組入銘柄数は54～55銘柄程度で推移させました。

主な売買動向については、新型コロナウイルスワクチン接種などを通じて旅行需要も徐々に回復していくことに期待してジャパン・ホテル・リート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ラサールロジポート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31期
	2021年1月6日～2021年7月5日
当期分配金（対基準価額比率）	1,000 (8.256%)
当期の収益	1,000
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,211

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

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

今後の運用方針 （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 トピックスインドックスマザーファンド、TOPIX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、外国株式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 国内債券マザーファンド、日本債券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 外国債券マザーファンド、外国債券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。

▶ **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着眼し、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。

国内における新型コロナウイルスワクチンについては、政府は希望する全ての対象者への接種を2021年10月から11月にかけて終わることをめざすとしています。未だ変異株の拡大による感染者数増加への懸念は残りますが、重症患者数は低下傾向を示しており、国内経済は正常化に向けて着実に進んでいると考えています。一方で、各国中央銀行による金融緩和策を背景とした低金利環境も当面続くと思われることなどから、引き続き国内REIT市況は堅調に推移するとみています。このような市場環境に対する見通しのも

と、業績が安定的かつバリュエーション面で割安感のある銘柄への投資を中心にを行います。コロナ禍における大口テナント各社の状況や業界動向に加えて、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うという運用の基本方針を堅持します。その上で、企業の合併・買収（M&A）を通じた業界再編の動きなどにも目を配りながらパフォーマンスの改善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。

2021年1月6日～2021年7月5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	62	0.545	(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）	(26)	(0.229)	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）	(32)	(0.284)	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）	(4)	(0.033)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料 = 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)	(0.002)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(c) 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	1	0.009	(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)	(0.007)	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	63	0.557	

期中の平均基準価額は、11,431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。

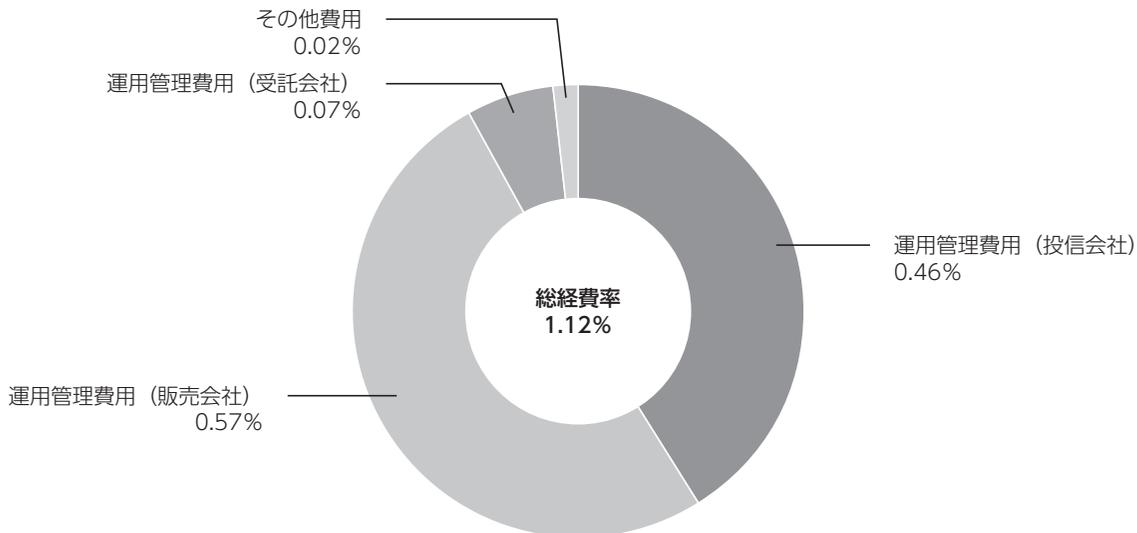
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.12%**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

(2021年1月6日～2021年7月5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	17,835	29,069	39,644	67,255
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	9,234	12,990	5,501	7,751
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	3,366	9,867	3,658	10,970
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	4,873	14,298	37,373	128,910
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	5,050	7,979	28,246	54,246
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	812	2,669	10,775	40,713

○株式売買比率

(2021年1月6日～2021年7月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	三菱UFJ トピックス インデックスマザーファンド	三菱UFJ 外国株式 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	57,670,475千円	14,095,507千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	259,888,171千円	111,298,610千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.22	0.12

(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

(2021年1月6日～2021年7月5日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）>

該当事項はございません。

<三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド>

区 分	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	29,487	9,592	32.5	28,182	1,826	6.5
貸付有価証券(株式)	427,693	271,957	63.6	431,066	263,403	61.1

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 67,158	百万円 13,499	% 20.1	百万円 43,067	百万円 7,690	% 17.9

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 11,519	百万円 4,657	% 40.4	百万円 3,125	百万円 3,043	% 97.4

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 7,264	百万円 7,160	% 98.6	百万円 18,832	百万円 17,959	% 95.4

平均保有割合 0.5%

※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 7,331	百万円 328	% 4.5	百万円 1,125	百万円 -	% -

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。

<MUAM J-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	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 834	百万円 265	% 31.8	百万円 1,647	百万円 308	% 18.7

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 399	百万円 358	百万円 4,460

<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 803	百万円 703	百万円 1,122

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド>

種類	買付額
株式	百万円 108

<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 3,800

<MUAM J-REITマザーファンド>

種類	買付額
投資信託証券	百万円 16

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)	47千円
うち利害関係人への支払額 (B)	5千円
(B) / (A)	11.3%

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

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

○組入資産の明細

(2021年7月5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	352,555	330,746	571,265
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	128,489	132,222	186,526
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	63,912	63,620	191,402
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	189,929	157,428	577,684
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	115,228	92,032	191,602
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	57,774	47,811	192,196

○有価証券の貸付及び借入の状況

三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンドにおいて、2021年7月5日現在における貸付株数の総株数は26,472,600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、19,951,000株です。

○投資信託財産の構成

（2021年7月5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	571,265	27.2
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	186,526	8.9
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	191,402	9.1
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	577,684	27.5
MUAM G-R-E-I-Tマザーファンド	191,602	9.1
MUAM J-R-E-I-Tマザーファンド	192,196	9.2
コール・ローン等、その他	187,159	9.0
投資信託財産総額	2,097,834	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（59,837,689千円）の投資信託財産総額（60,866,814千円）に対する比率は98.3%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（124,057,951千円）の投資信託財産総額（124,329,375千円）に対する比率は99.8%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（59,784,222千円）の投資信託財産総額（60,117,582千円）に対する比率は99.4%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=111.16円	1 カナダドル=90.07円	1 メキシコペソ=5.613円	1 ユーロ=131.80円
1 イギリスポンド=153.63円	1 スイスフラン=120.55円	1 スウェーデンクローネ=13.00円	1 ノルウェークローネ=12.90円
1 デンマーククローネ=17.72円	1 ポーランドズロチ=29.2169円	1 オーストラリアドル=83.53円	1 ニュージーランドドル=78.03円
1 香港ドル=14.31円	1 シンガポールドル=82.49円	1 マレーシアリングット=26.7531円	100韓国ウォン=9.85円
1 イスラエルシェケル=34.0075円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年7月5日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,097,834,151
コール・ローン等	15,313,681
三菱UFJトピックスインデックスマザーファンド(評価額)	571,265,280
三菱UFJ国内債券マザーファンド(評価額)	186,526,531
三菱UFJ外国債券マザーファンド(評価額)	191,402,529
三菱UFJ外国株式マザーファンド(評価額)	577,684,405
MUAM G-REITマザーファンド(評価額)	191,602,701
MUAM J-REITマザーファンド(評価額)	192,196,725
未収入金	171,842,299
(B) 負債	183,262,699
未払収益分配金	172,303,647
未払信託報酬	10,919,787
未払利息	13
その他未払費用	39,252
(C) 純資産総額(A-B)	1,914,571,452
元本	1,723,036,472
次期繰越損益金	191,534,980
(D) 受益権総口数	1,723,036,472口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,112円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,764,437,478円
 期中追加設定元本額 84,291,899円
 期中一部解約元本額 125,692,905円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1112円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年1月6日～ 2021年7月5日
費用控除後の配当等収益額	20,712,066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	256,443,545円
収益調整金額	212,839,042円
分配準備積立金額	63,360,727円
当ファンドの分配対象収益額	553,355,380円
1万口当たり収益分配対象額	3,211円
1万口当たり分配金額	1,000円
収益分配金金額	172,303,647円

○損益の状況（2021年1月6日～2021年7月5日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 502
支払利息	△ 502
(B) 有価証券売買損益	288,115,152
売買益	297,407,272
売買損	△ 9,292,120
(C) 信託報酬等	△ 10,959,039
(D) 当期損益金(A+B+C)	277,155,611
(E) 前期繰越損益金	63,360,727
(F) 追加信託差損益金	23,322,289
(配当等相当額)	(212,772,271)
(売買損益相当額)	(△189,449,982)
(G) 計(D+E+F)	363,838,627
(H) 収益分配金	△172,303,647
次期繰越損益金(G+H)	191,534,980
追加信託差損益金	23,322,289
(配当等相当額)	(212,839,042)
(売買損益相当額)	(△189,516,753)
分配準備積立金	168,212,691

- (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）	1,000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、2021年7月5日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

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

※法人受益者に対する課税は異なります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

*三菱UFJ国際投信では本資料のほか、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。

[お 知 ら せ]

投資の対象とするマザーファンドの追加および付随する変更を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。

(2021年4月3日)

三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド

《第21期》決算日2021年2月22日

[計算期間：2020年2月21日～2021年2月22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22日に第21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21期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)(配当込み)		株組入比率	株先物比率	純資産総額
	円	騰落率	(TOPIX)	騰落率			
17期(2017年2月20日)	12,356	21.7	2,205.76	21.7	98.6	1.3	209,506
18期(2018年2月20日)	14,375	16.3	2,565.77	16.3	99.0	1.0	206,265
19期(2019年2月20日)	13,457	△6.4	2,400.99	△6.4	99.4	0.5	207,606
20期(2020年2月20日)	14,322	6.4	2,554.63	6.4	99.2	0.7	238,603
21期(2021年2月22日)	16,988	18.6	3,029.02	18.6	99.5	0.4	268,562

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	(TOPIX) (配当込み)	騰 落 率	(TOPIX) (配当込み)		
(期 首) 2020年2月20日	円	%			%	%
	14,322	—	2,554.63	—	99.2	0.7
2月末	12,926	△ 9.7	2,305.76	△ 9.7	102.3	0.7
3月末	12,153	△15.1	2,167.60	△15.2	96.5	2.4
4月末	12,680	△11.5	2,261.88	△11.5	97.7	2.0
5月末	13,543	△ 5.4	2,416.04	△ 5.4	95.8	1.6
6月末	13,520	△ 5.6	2,411.45	△ 5.6	99.5	0.9
7月末	12,977	△ 9.4	2,314.39	△ 9.4	100.4	0.8
8月末	14,038	△ 2.0	2,503.59	△ 2.0	97.4	0.6
9月末	14,219	△ 0.7	2,536.14	△ 0.7	96.4	1.6
10月末	13,816	△ 3.5	2,464.21	△ 3.5	98.4	1.4
11月末	15,357	7.2	2,738.72	7.2	95.3	0.9
12月末	15,814	10.4	2,819.93	10.4	97.9	0.9
2021年1月末	15,851	10.7	2,826.50	10.6	98.7	0.6
(期 末) 2021年2月22日	16,988	18.6	3,029.02	18.6	99.5	0.4

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

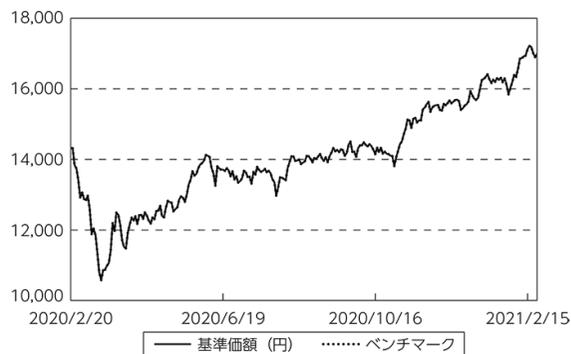
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ18.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(18.6%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について**◎ 国内株式市況**

国内株式市況は上昇しました。

- ・ 期首から2020年3月下旬にかけて、新型コロナウイルスの世界的流行（パンデミック）を受けて下落する局面もありましたが、日銀によるETF（上場投資信託）の積極的な買入れや、主要国の経済対策への期待、新型コロナウイルスのワクチン開発に関する報道等が支援材料となり、国内株式市況は上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・ 株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

● 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18.6%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)

- ・ その他の要因[※]によるものです。

[※]貸株収入要因等が含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・ 組入要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2020年2月21日～2021年2月22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	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、14,093円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2020年2月21日～2021年2月22日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株	千円	千株	千円
		24,486	48,437,753	25,943	56,015,055
		(△11,593)	()		

(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。

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	百万円	百万円	百万円
		37,667	39,040	—	—

○株式売買比率

(2020年2月21日～2021年2月22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	104,452,808千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	229,577,583千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.45

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年2月21日～2021年2月22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	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 48,437	百万円 7,350	% 15.2	百万円 56,015	百万円 2,845	% 5.1
貸付有価証券(株式)	885,241	536,431	60.6	890,445	543,023	61.0

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 663	百万円 674	百万円 4,146

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 119

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)	4,575千円
うち利害関係人への支払額 (B)	713千円
(B) / (A)	15.6%

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中京銀行、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MUFJ証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2021年2月22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
水産・農林業 (0.1%)				
極洋	4.8	4.4	13,420	
日本水産	136.3	127	63,754	
マルハニチロ	19.7	21.4	53,072	
雪国まいたけ	—	8.4	14,851	
カネコ種苗	4.1	4.1	6,547	
サカタのタネ	16.2	16.3	63,244	
ホクト	10.4	11.5	24,667	
ホクリョウ	2.1	2.1	1,425	
鉱業 (0.2%)				
住石ホールディングス	27.5	23.9	2,963	
日鉄鉱業	3.1	3.1	18,569	
三井松島ホールディングス	5.3	5.7	5,312	
国際石油開発帝石	546.7	502.8	390,172	
石油資源開発	17.8	17.9	40,078	
K&Oエナジーグループ	6.6	6.6	9,662	
建設業 (2.3%)				
ヒノキヤグループ	3.4	3.4	7,449	
ショーボンドホールディングス	21.2	19.5	92,235	
ミライト・ホールディングス	40.5	47.4	81,148	
タマホーム	7.3	8.3	15,753	
サンヨーホームズ	1.2	1.6	1,308	
日本アクア	5.4	5.4	3,412	
ファーストコーポレーション	4.2	4.2	2,931	
ベストテラ	2.3	2.6	4,547	
TATERU	28.1	25.6	4,582	
キャンディル	1.2	2.3	1,244	
スペースバリューホールディングス	16.6	16.7	13,593	
ダイセキ環境ソリューション	2.6	2.6	2,199	
第一カッター興業	1.7	3.4	4,443	
明豊ファシリティワークス	3.3	—	—	
安藤・間	81.1	87.7	68,581	
東急建設	39.9	40	21,760	
コムシスホールディングス	48.3	48.5	157,625	

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
ビーアールホールディングス	14.8	16.1	11,012	
高松コンストラクショングループ	8.5	8.5	18,079	
東建コーポレーション	4.2	4.2	35,994	
ソネック	1.4	1.4	1,164	
ヤマウラ	5.9	5.9	5,622	
大成建設	104.9	98.3	372,557	
大林組	314.7	315.7	295,495	
清水建設	319.4	295.8	241,668	
飛鳥建設	9	9.1	10,182	
長谷工コーポレーション	121.8	103.4	140,003	
松井建設	12.4	12.4	8,878	
銭高組	1.4	1.4	6,405	
鹿島建設	247	231.3	328,677	
不動テトラ	8.2	7.7	13,898	
大末建設	3.6	4	3,704	
鉄建建設	6.8	6.4	12,582	
西松建設	24.2	22.6	58,669	
三井住友建設	76	76.3	35,098	
大豊建設	7.1	6.9	25,392	
前田建設工業	78.8	79.1	78,941	
佐田建設	6.8	7.3	3,117	
ナカノフドー建設	8.6	7.5	2,782	
奥村組	17.1	17.4	46,666	
東鉄工業	13.5	13.5	35,748	
イチケン	2.3	2.3	4,813	
富士ビー・エス	4.6	4.1	2,496	
浅沼組	3.5	3.8	17,214	
戸田建設	130.7	131.1	97,407	
熊谷組	14.6	14.6	40,880	
北野建設	1.9	1.9	4,708	
植木組	1.4	1.4	4,074	
矢作建設工業	13.9	13.9	11,773	
ビーエス三菱	10.4	10.4	7,124	
日本ハウスホールディングス	21.5	21.6	7,257	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大東建託	37.7	34.5	426,075
新日本建設	13.4	13.4	11,336
N I P P O	26	26.1	73,915
東亜道路工業	2	2	8,280
前田道路	33.3	19.5	39,058
日本道路	3	3.1	24,831
東亜建設工業	9.8	8.4	18,228
日本国土開発	23	30.7	17,130
若築建設	5.7	5.7	7,278
東洋建設	35.3	35.4	19,576
五洋建設	124.7	134.1	106,609
世紀東急工業	15.1	15.2	13,528
福田組	3.6	3.7	18,574
住友林業	79.7	74.3	155,955
日本基礎技術	10.6	9.6	4,780
巴コーポレーション	14	14	5,558
大和ハウス工業	311.3	291.5	932,800
ライト工業	18	18.1	29,810
積水ハウス	344.3	342.4	712,534
日特建設	8.2	8.2	6,437
北陸電気工事	5.4	5.5	6,556
ユアテック	18	18.1	14,769
日本リーテック	—	6.6	16,460
四電工	1.7	1.7	4,766
中電工	12.7	14.5	32,059
関電工	44.8	51.3	45,349
きんでん	74.8	68.2	121,123
東京エネシス	10.4	10.5	9,639
トーエネック	3.2	3.2	11,952
住友電設	8.9	8.9	21,662
日本電設工業	17.3	17.3	33,423
協和エクシオ	47.7	47.9	130,383
新日本空調	8.3	8.3	18,841
九電工	22.1	22.2	75,258
三機工業	22.7	22.4	29,030
日揮ホールディングス	96.9	105.3	142,681
中外炉工業	3.4	3.4	5,929
ヤマト	10.1	10.1	6,756
太平電業	7.6	7	18,641

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高砂熱学工業	27.3	28.5	45,486
三晃金属工業	1.4	1.2	3,714
朝日工業社	2.1	2.3	6,923
明星工業	20.4	20.4	16,442
大気社	15.3	15.4	45,383
ダイダシ	7.5	7	19,663
日比谷総合設備	10.1	10.2	19,155
フィル・カンパニー	1.4	1.8	3,736
OSJBホールディングス	49.6	46	12,558
東洋エンジニアリング	13.2	13.3	6,729
レイズネクスト	16.9	16.9	19,891
食料品 (3.3%)			
ニッポン	29.5	29.6	47,626
日清製粉グループ本社	113.8	114.2	197,223
日東富士製粉	0.7	0.7	4,802
昭和産業	9.2	8.5	27,582
鳥越製粉	8.9	9	7,731
中部飼料	12.3	12.3	17,748
フィード・ワン	67.6	13.6	12,430
東洋精糖	1.7	1.7	2,082
日本甜菜製糖	5.3	5.3	8,930
三井製糖	8.8	8	15,504
塩水港精糖	10.9	12	2,736
日新製糖	4.8	4.8	8,976
森永製菓	23.6	23.7	94,326
中村屋	2.6	2.4	9,528
江崎グリコ	29.9	27.8	124,544
名糖産業	4.8	4.5	6,817
井村屋グループ	4.3	5.7	14,341
不二家	5.6	6.4	14,579
山崎製パン	75.5	75.7	142,845
第一屋製パン	1.7	1.9	1,844
モロゾフ	1.7	1.6	9,040
亀田製菓	5.7	5.8	27,898
寿スベリッツ	9.7	9.7	66,154
カルビー	45.9	46	133,538
森永乳業	18.6	18.7	90,321
六甲バター	6.7	6.7	11,644
ヤクルト本社	69.3	69.5	384,335

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
明治ホールディングス	66.6	66.8	465,596	
雪印メグミルク	24.2	24.3	53,192	
ブリマハム	15.7	14.2	47,428	
日本ハム	38.5	38.6	180,069	
林兼産業	3.3	3.3	2,065	
丸大食品	10.7	9.9	16,810	
S Foods	8	9.1	31,531	
柿安本店	3.5	3.5	9,534	
伊藤ハム米久ホールディングス	64.8	65.1	48,499	
サッポロホールディングス	34.4	34.5	77,418	
アサヒグループホールディングス	210.9	220.8	1,004,198	
キリンホールディングス	427.1	428.5	906,277	
宝ホールディングス	75.4	74.9	112,275	
オエノンホールディングス	26.6	28.7	11,480	
養命酒製造	3.1	3.1	5,964	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	70.7	77.4	141,796	
サントリー食品インターナショナル	67.4	67.6	254,852	
ダイドーグループホールディングス	5.2	5.7	30,837	
伊藤園	30.6	30.7	193,717	
キーコーヒー	9.9	9.9	21,354	
ユニカフェ	2.6	3	3,012	
ジャパンフーズ	1.4	1.4	1,769	
日清オイリオグループ	13	13	41,535	
不二製油グループ本社	24.6	24.6	78,474	
かどや製油	1.1	1.1	4,504	
J-オイルミルズ	5.2	4.7	17,883	
キッコーマン	72.5	72.7	537,980	
味の素	222.4	240.3	544,880	
ブルドックソース	—	3.6	9,118	
キューピー	56.1	56.3	134,782	
ハウス食品グループ本社	37.7	37.8	140,616	
カゴメ	38.2	41.3	137,942	
焼津水産化学工業	4.9	4.9	4,865	
アリアケジャパン	9.2	9.2	62,560	
ビエトロ	1.3	1.3	2,314	
エバラ食品工業	2.4	2.2	5,823	
やまみ	0.6	1.1	2,315	
ニチレイ	48	48.1	135,016	
東洋水産	51.8	52	239,980	

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
イトアンドホールディングス	3.5	3.5	6,790	
大冷	1.3	1.1	2,158	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5.5	5.6	5,359	
日清食品ホールディングス	42.8	39.6	330,264	
永谷園ホールディングス	4.9	4.9	11,554	
一正蒲鉾	3.9	3.9	4,512	
フジッコ	10.9	10.9	21,832	
ロック・フィールド	10.8	10.9	16,949	
日本たばこ産業	581.5	541.8	1,049,195	
ケンコーマヨネーズ	5.6	6.2	12,548	
わらべや日洋ホールディングス	6.6	6.6	11,325	
なとり	5.6	5.6	11,306	
イフジ産業	1.8	1.6	1,497	
ビックスコーポレーション	2.2	2.4	8,592	
ファーマフーズ	—	7.1	22,684	
北の達人コーポレーション	35.2	35.3	22,450	
ユーグレナ	43	43.7	43,263	
ミヨシ油脂	3.9	3.5	4,200	
理研ビタミン	4.8	9.5	12,948	
繊維製品 (0.5%)				
片倉工業	14.3	13.2	18,361	
グンゼ	7.2	7.2	27,288	
東洋紡	38.8	39	52,338	
ユニチカ	28.8	28.9	12,889	
富士紡ホールディングス	4.7	4.8	20,592	
倉敷紡績	9.8	9.1	17,472	
シキボウ	5.2	5.5	5,571	
日本毛織	32.3	32.4	31,039	
ダイトウボウ	15.9	15.9	1,685	
トーア紡コーポレーション	3.9	3.9	1,868	
ダイドーリミテッド	12.9	13	2,470	
帝国繊維	11	11.1	25,252	
帝人	80.2	92.8	173,814	
東レ	711.6	713.9	504,584	
サカイオーベックス	2.6	2.6	7,412	
住江織物	2.2	2.2	4,505	
日本フェルト	5.6	5.6	2,486	
イチカワ	1.4	1.3	1,726	
日東製網	1.1	1.1	1,725	

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
アツギ	8.1	7.6	4,149	
ダイニック	3.7	3.7	2,963	
セーレン	24.2	24.2	46,197	
ソトー	3.9	3.9	3,237	
東海染工	1.4	1.2	1,353	
小松マテール	16.1	16.2	16,588	
ワコールホールディングス	25.6	24.6	54,685	
ホギメディカル	11.2	13.3	42,360	
レナウン	25.2	—	—	
クラウディアホールディングス	2.4	2.4	705	
T S I ホールディングス	33	29.9	8,312	
マツオカコーポレーション	2.8	3.1	5,939	
ワールド	13.9	12.9	17,814	
三陽商会	5.1	5.1	3,712	
ナイガイ	3.6	3.6	1,188	
オンワードホールディングス	59	59.2	16,339	
ルックホールディングス	3.4	3.4	3,927	
キムラタン	51.3	55.1	1,377	
ゴールドウイン	17.8	16.3	120,294	
デサント	19.2	16.8	29,752	
キング	4.6	5.2	2,964	
ヤマトインターナショナル	6	8.7	2,923	
パルプ・紙 (0.2%)				
特種東海製紙	6.2	6.1	28,883	
王子ホールディングス	410.8	443.9	314,725	
日本製紙	43.5	43.6	61,301	
三菱製紙	11.2	14	5,054	
北越コーポレーション	65.2	70.5	36,237	
中越パルプ工業	4.2	3.8	4,567	
巴川製紙所	2.9	3.2	2,464	
大王製紙	43.1	47.5	105,640	
阿波製紙	2.5	2.5	1,127	
レンゴー	92.9	101.7	89,394	
トーモク	6	6	11,214	
ザ・バック	7.4	7.5	20,527	
化学 (7.4%)				
クラレ	154.8	155.3	185,738	
旭化成	651.4	653.6	750,006	
共和レザー	5.3	5.4	3,601	

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
昭和電工	70	74.9	194,140	
住友化学	722	776.2	405,176	
住友精化	4.4	4.8	19,296	
日産化学	55	54.4	339,456	
ラサ工業	3.5	3.2	7,193	
クレハ	8.4	8.5	61,115	
多木化学	2.9	3.8	24,282	
テイカ	7.2	7.2	10,368	
石原産業	17.6	17.7	14,531	
片倉コープアグリ	2.5	2.5	3,222	
日本曹達	14.5	13.8	46,713	
東ソー	151.9	152.4	303,123	
トクヤマ	28.3	29.3	78,582	
セントラル硝子	20.1	18.8	43,258	
東亜合成	61.7	60.2	74,828	
大阪ソーダ	10	10	26,430	
関東電化工業	23.3	23.4	20,755	
デンカ	35.9	36	148,320	
信越化学工業	168.8	182.3	3,416,302	
日本カーバイド工業	3.3	3.5	4,683	
堺化学工業	6.4	6.9	13,634	
第一稀元素化学工業	10.6	9.9	10,355	
エア・ウォーター	91.4	100.5	175,171	
日本酸素ホールディングス	94.4	81.2	163,130	
日本化学工業	3.1	2.8	9,268	
東邦アセチレン	1.5	1.5	2,053	
日本パーカライジング	49.6	49.7	54,719	
高压ガス工業	15.6	15.6	11,528	
チタン工業	1.2	1.2	2,574	
四国化成工業	15.2	13.1	16,519	
戸田工業	2.3	2.1	4,559	
ステラ ケミファ	5.4	5.4	17,685	
保土谷化学工業	3.7	2.9	14,297	
日本触媒	15.3	17.9	103,641	
大日精化工業	8.7	8.1	19,472	
カネカ	25.4	25.5	109,012	
三菱瓦斯化学	92.8	98.8	256,583	
三井化学	89.2	85.1	275,724	
J S R	91.6	99	335,610	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京応化工業	16.9	16.9	115,089
大阪有機化学工業	9.1	9.1	34,944
三菱ケミカルホールディングス	657	659.1	482,131
KHネオケム	17.3	16.3	40,880
ダイセル	134.4	132.6	102,765
住友ベークライト	15.4	15.5	68,742
積水化学工業	211.3	208.5	421,378
日本ゼオン	88.6	88.9	147,040
アイカ工業	29.5	27.5	105,600
宇部興産	49.6	49.8	106,621
積水樹脂	17.7	16.3	33,675
タキロンシーアイ	21.3	21.3	14,718
旭有機材	5.6	5.6	8,248
日立化成	45.1	—	—
ニチバン	5.2	5.2	9,474
リケンテクノス	24.7	24	11,880
大倉工業	4.6	4.7	9,400
積水化成成品工業	13.2	13.2	7,405
群衆化学工業	2.2	2.3	5,754
タイガースポリマー	5.2	5.2	2,428
ミライアル	3.5	3.2	3,891
ダイキアクシス	3.5	3.6	3,538
ダイキョーニシカワ	20.7	20.8	16,619
竹本容器	3.5	3.5	3,034
森六ホールディングス	5.3	5.3	10,849
恵和	—	1.4	2,706
日本化薬	60.8	61	64,660
カーリットホールディングス	10.5	9.8	7,134
日本精化	7.9	7.1	10,060
扶桑化学工業	10	7.8	30,966
トリケミカル研究所	2.2	8.8	37,400
ADEKA	45.2	45.4	84,580
日油	37	37.1	217,035
新日本理化	16.3	16.3	4,547
ハリマ化成グループ	8.1	7.3	6,920
花王	240.3	241.1	1,752,797
第一工業製薬	3.7	3.3	12,441
石原ケミカル	2.7	2.5	5,525
日華化学	3.3	3.3	2,930

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニイタカ	1.5	2	5,408
三洋化成工業	5.9	5.9	30,857
有機合成薬品工業	7.5	7.6	2,249
大日本塗料	11.1	11.1	10,256
日本ペイントホールディングス	81.1	81.4	708,994
関西ペイント	110.4	110.8	323,203
神東塗料	7.7	7.8	1,567
中国塗料	28	23.7	22,183
日本特殊塗料	7.4	7.4	8,539
藤倉化成	13.3	13.3	6,982
太陽ホールディングス	7.2	7.3	42,997
D I C	41.5	41.6	118,976
サカタインクス	21.5	21.5	23,714
東洋インキS Cホールディングス	20.8	20.8	41,745
T&K TOKA	7.6	7.6	6,292
富士フイルムホールディングス	192.4	176.9	1,120,307
資生堂	199.4	200	1,630,000
ライオン	130.5	130.9	284,707
高砂香料工業	6.3	6.3	16,436
マンダム	22.6	21.1	39,457
ミルボン	13.4	13.5	86,400
ファンケル	40.6	36.7	149,736
コーセー	18.9	18.9	342,090
コタ	5.3	5.8	10,602
シーボン	1.3	1.3	2,593
ポーラ・オルビスホールディングス	42.8	43	106,468
ノエビアホールディングス	9.6	8.5	41,352
アジupanコスメジャパン	2.2	2.2	2,417
新日本製薬	—	2	4,970
エステー	6.4	6.5	12,824
アグロ カネショウ	3.1	3.8	6,167
コニシ	16.5	16.5	27,687
長谷川香料	13.3	17.4	33,947
星光PMC	5.7	5.8	4,483
小林製薬	28.1	28.2	309,918
荒川化学工業	9	8.4	10,878
メック	6.9	6.9	14,303
日本高純度化学	2.8	2.8	7,526
タカラバイオ	26.3	26.3	81,135

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
JCU	12.1	11.3	38,533	
新田ゼラチン	6.3	6.3	4,284	
OATアグリオ	1.7	1.9	2,629	
デクセリアルズ	25.9	28.1	43,217	
アース製薬	7.6	7.6	46,132	
北興化学工業	10.3	9.4	9,832	
大成ラミック	3.3	3.1	9,098	
クミアイ化学工業	41.5	41.6	36,691	
日本農薬	17.9	17.9	9,487	
アキレス	6.9	6.9	10,260	
有沢製作所	15.9	14	13,748	
日東電工	69.2	64.5	608,235	
レック	10.7	11.9	16,136	
三光合成	11.5	10.6	4,706	
きもと	17.1	15.4	3,033	
藤森工業	9	9	41,670	
前澤化成工業	6.4	6.4	6,195	
未来工業	5.4	3.6	6,249	
ウェーブロックホールディングス	3.5	3.5	2,569	
JSP	5.9	5.9	10,708	
エフビコ	11	18.5	78,625	
天馬	6.7	7.5	16,125	
信越ポリマー	18	15.5	15,918	
東リ	25	25.1	6,149	
ニフコ	36.8	37	140,415	
バルカー	8.2	8.2	17,408	
ユニ・チャーム	193.4	213.5	991,494	
ショーエイコーポレーション	1.1	2.2	2,226	
医薬品 (5.6%)				
協和キリン	100.9	101.3	312,510	
武田薬品工業	834.9	837.6	3,088,231	
アステラス製薬	882.7	872.9	1,552,889	
大日本住友製薬	74.4	74.6	126,894	
塩野義製薬	128.3	126.6	735,672	
わかもと製薬	11.9	12	2,940	
あすか製薬	11.4	11.5	16,226	
日本新薬	26.3	28.5	222,585	
ピオフェルミン製薬	1.7	1.7	4,634	
中外製薬	104.6	314.9	1,653,225	

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
科研製薬	17.2	17.2	71,466	
エーザイ	120.1	111.2	847,900	
ロート製薬	51.5	48	142,416	
小野薬品工業	230.4	231.2	706,316	
久光製薬	26.5	29.3	207,151	
持田製薬	13.9	14	58,030	
参天製薬	186.9	175.1	275,257	
扶桑薬品工業	3.5	3.2	8,492	
日本ケミファ	1.3	1.2	2,754	
ツムラ	31.1	33.6	115,416	
日医工	28.4	28.5	31,521	
キッセイ薬品工業	17.8	17.8	39,818	
生化学工業	19.5	17.8	18,885	
栄研化学	17.6	17.7	37,913	
日水製薬	4.2	3.7	3,688	
鳥居薬品	6.3	6.3	18,931	
JCRファーマ	7.1	28.4	92,868	
東和薬品	12.8	14.5	32,335	
富士製薬工業	6.8	6.8	8,704	
沢井製薬	20.6	22.1	108,179	
ゼリア新薬工業	18.2	18.3	37,039	
第一三共	287.2	864.3	2,818,482	
キョーリン製薬ホールディングス	22.1	22.2	42,868	
大幸薬品	4	12.4	16,392	
ダイト	5.9	6.4	22,976	
大塚ホールディングス	191.2	209.2	934,914	
大正製薬ホールディングス	21.2	24	166,080	
ベプチドリーム	50.8	51.2	277,504	
石油・石炭製品 (0.4%)				
日本コークス工業	84.8	85.1	8,850	
ニチレキ	11.8	11.9	18,302	
ユシロ化学工業	5.6	5.6	6,076	
ビービー・カストロール	3.6	3.6	4,453	
富士石油	26.8	24.4	5,148	
MORESCO	3.6	3.6	4,140	
出光興産	112.9	111.7	306,281	
ENEOSホールディングス	1,509.6	1,514.5	701,062	
コスモエネルギーホールディングス	29.1	31.8	79,023	

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
ゴム製品 (0.6%)				
横浜ゴム	58.1	58.3	114,326	
TOYO TIRE	57.6	53	101,018	
ブリヂストン	308.4	267.7	1,124,072	
住友ゴム工業	90.1	90.4	107,937	
藤倉コンポジット	8.8	8.8	3,828	
オカモト	6.1	6.1	25,101	
フコク	4.4	4.4	3,128	
ニッタ	11.3	10.4	24,918	
住友理工	19.4	19.5	12,499	
三ツ星ベルト	13.2	12.2	21,057	
バンドー化学	17.7	17.7	13,044	
ガラス・土石製品 (0.8%)				
日東紡績	14.9	15	65,850	
AGC	99.2	92.4	360,822	
日本板硝子	48	51.1	28,207	
石塚硝子	1.8	1.7	3,279	
日本山村硝子	4.2	4.2	3,855	
日本電気硝子	40.3	37.3	93,324	
オハラ	4	4	8,208	
住友大阪セメント	19	18.1	64,436	
太平洋セメント	63.4	59.6	163,780	
日本ヒューム	10.1	9.2	7,074	
日本コンクリート工業	21.6	21.7	8,376	
三谷セキサン	4.7	4.7	22,654	
アジアパイルホールディングス	14.2	15.5	8,215	
東海カーボン	105.1	98.4	149,076	
日本カーボン	5.2	5.5	22,522	
東洋炭素	5.9	5.9	11,723	
ノリタケカンパニーリミテド	5.5	5.6	20,244	
TOTO	71.7	71.9	492,515	
日本碍子	122.5	110.8	208,414	
日本特殊陶業	78.1	76.6	143,088	
ダントーホールディングス	7.5	7.5	2,850	
MARUWA	3.9	3.5	36,995	
品川リフラクトリーズ	2.6	2.4	6,628	
黒崎播磨	2	1.7	8,202	
ヨータイ	8	7.2	7,473	
イソライト工業	5.1	4.4	2,855	

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
東京窯業	12.8	12.8	4,147	
ニッカトー	4.5	4.6	3,298	
フジミインコーポレーテッド	8.9	8.1	34,222	
クニミネ工業	4.1	3.2	3,875	
エーアンドエーマテリアル	1.7	1.9	2,033	
ニチアス	27.5	25.4	63,144	
ニチハ	14	14	42,630	
鉄鋼 (0.7%)				
日本製鉄	444.1	475.3	737,427	
神戸製鋼所	181.6	182.2	115,879	
中山製鋼所	13.8	13.8	5,533	
合同製鐵	5.3	5.4	11,232	
ジェイ エフ イー ホールディングス	268	288.1	320,655	
東京製鐵	48.3	38.8	28,013	
共英製鋼	11.2	11.2	16,038	
大和工業	21.1	21.2	57,494	
東京鐵鋼	4.1	3.8	7,626	
大阪製鐵	5.3	5.3	6,656	
淀川製鋼所	13.4	13.4	30,860	
丸一鋼管	32.2	32.3	80,814	
モリ工業	3	3	6,999	
大同特殊鋼	16.2	16.3	76,528	
日本高周波鋼業	3.7	3.7	1,346	
日本冶金工業	8.2	7.8	16,528	
山陽特殊製鋼	6.8	11.9	20,813	
愛知製鋼	5.6	5.6	18,340	
日立金属	106.9	93.8	161,523	
日本金属	2.3	2.5	2,860	
大太平洋金属	6.7	6.7	16,750	
新日本電工	63.9	64.2	19,131	
栗本鐵工所	4.9	4.5	7,942	
虹技	1.5	1.4	1,640	
日本鑄鉄管	1	1.1	1,531	
三菱製鋼	7.3	7.4	5,653	
日亜鋼業	14.5	14.6	4,292	
日本精線	1.6	1.4	5,117	
エンビプロ・ホールディングス	4.2	4.2	3,171	
シンニッタン	15.4	12	2,628	
新家工業	2.3	2.5	3,692	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
非鉄金属 (0.8%)			
大紀アルミニウム工業所	16.3	15	12,030
日本軽金属ホールディングス	251.1	27.1	58,725
三井金属鉱業	26.8	26.9	104,506
東邦亜鉛	5.1	5.5	13,282
三菱マテリアル	65.5	65.8	170,948
住友金属鉱山	126.8	127.3	710,079
DOWAホールディングス	25.1	25.2	105,210
古河機械金属	17.6	16.4	22,172
エス・サイエンス	43.9	44	1,848
大阪チタニウムテクノロジーズ	10.3	10.4	8,507
東邦チタニウム	17.8	17.8	17,461
UACJ	15.1	15.1	37,855
CKサンエツ	2.1	2.1	8,305
古河電気工業	30.8	30.9	88,713
住友電気工業	371	347.4	538,296
フジクラ	119.8	120.2	63,105
昭和電線ホールディングス	11.5	9.6	16,828
東京特殊電線	1.5	1.3	3,374
タツタ電線	19.7	17.5	11,392
カナレ電気	1.6	1.6	2,812
平河ヒューテック	3.7	5.5	6,539
リョービ	12.2	12.2	15,933
アーレスティ	13	12.2	4,941
アサヒホールディングス	17.4	18.7	80,690
金属製品 (0.6%)			
稲葉製作所	5.6	5.6	7,991
宮地エンジニアリンググループ	3	3.2	7,107
トーカロ	27.6	25.7	36,057
アルファC o	3.5	3.5	3,836
SUMCO	118.8	127.4	321,048
川田テクノロジーズ	2	2	9,360
RS Technologies	2.8	3.2	20,256
ジェイテックコーポレーション	—	0.8	2,876
信和	4.2	5.3	4,065
東洋製織グループホールディングス	63.2	63.4	86,287
ホッカンホールディングス	5.5	5.1	7,293
コロナ	5.5	5.5	5,230
横河ブリッジホールディングス	18.5	17.1	32,695

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
駒井ハルテック	1.9	2	4,178
高田機工	0.9	0.9	2,376
三和ホールディングス	95.2	93.9	123,478
文化シャッター	29.2	29.3	29,300
三協立山	12.8	12.8	10,598
アルインコ	7.2	6.6	6,428
東洋シャッター	2.4	2.2	1,546
L I X I L	146.4	137.1	414,727
日本フィルコン	7.6	6.9	3,450
ノーリツ	20.6	20.6	34,505
長府製作所	10.1	10.1	21,290
リンナイ	19.3	19.4	222,324
ダイニチ工業	5.3	4.8	4,089
日東精工	13.7	12.5	8,337
三洋工業	1.3	1.2	2,222
岡部	20.1	20.2	15,937
ジーテクト	12.3	12.4	17,955
東プレ	18.5	18.6	29,499
高周波熱練	19.1	19.2	10,368
東京製綱	7.1	7.1	10,259
サンコール	5.6	8.5	4,139
モリテック スチール	7.7	7.8	3,276
パイオラックス	14.7	14.7	23,431
エイチワン	9.7	9.8	7,565
日本発條	106.5	99.2	80,550
中央発條	1.2	1.2	3,396
アドバネクス	1.4	1.4	2,238
立川ブラインド工業	4.4	4.4	5,592
三益半導体工業	7.7	7.8	20,662
機械 (5.6%)			
日本ドライケミカル	2.5	2.5	3,955
日本製鋼所	30.1	30.2	87,187
三浦工業	42.9	43.1	264,634
タクマ	33.6	33.7	68,175
ツガミ	20.6	20.6	33,681
オークマ	11.6	11.6	69,252
芝浦機械	11.2	10.3	30,446
アマダ	126.2	145.9	188,065
アイダエンジニアリング	26	26	24,882

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
滝澤鉄工所	3.1	2.9	3,071
F U J I	42.7	39.7	105,879
牧野フライス製作所	11.6	11.7	47,092
オーエスジー	45.9	49.1	96,874
ダイジェット工業	1.1	1.1	1,520
旭ダイヤモンド工業	26	26.1	13,311
DMG森精機	62.8	63	100,737
ソディック	23.3	21.7	21,504
ディスコ	13.4	13.5	479,250
日東工器	5.4	4.8	8,918
日進工具	2.9	3.9	10,709
パンチ工業	9	8.3	4,971
富士ダイス	4.4	5	3,285
豊和工業	5.5	5.5	4,719
OKK	4.1	3.8	1,778
石川製作所	2.4	2.6	4,487
東洋機械金属	7.1	7.1	3,251
津田駒工業	1.9	1.9	1,685
エンシュウ	2.4	2.4	2,112
島精機製作所	16	14.5	33,408
オプトラン	11.1	12.5	34,687
NCホールディングス	3	3	1,983
イワキポンプ	4.7	6.3	5,266
ブリュー	9.7	9.7	10,864
ヤマシンフィルタ	21.6	20.1	17,889
日阪製作所	12.2	12.3	10,344
やまびこ	19.2	19.3	22,716
平田機工	4.7	4.7	34,216
ベガサスミシン製造	10.1	10.1	4,646
マルマエ	4.1	3.7	4,824
タツモ	4.6	4.2	6,904
ナブテスコ	58.5	58.7	285,282
三井海洋開発	10.5	10.6	18,571
レオン自動車	9.7	9.8	11,123
SMC	31.5	29.5	1,942,870
ヤマハモーターロボティクスホールディング	8.6	—	—
ホソカワミクロン	3.5	3.5	22,925
ユニオンツール	3.7	3.7	12,876
オイレス工業	12.8	13.9	23,588

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日精エー・エス・ビー機械	3.3	2.9	16,327
サトーホールディングス	14.1	13.1	32,710
技研製作所	8.7	8.8	45,672
日本エアテック	3.1	3.3	4,158
カワタ	2.9	2.7	2,443
日精樹脂工業	8.3	7.7	7,091
オカダアイオン	3.1	3.1	3,689
ワイエイシイホールディングス	4.3	4	4,016
小松製作所	454.5	456.1	1,483,693
住友重機械工業	57.4	57.6	167,097
日立建機	40.2	47.1	156,607
日工	13.7	15	10,905
巴工業	4.3	4	8,216
井関農機	10	10.1	15,564
TOWA	10.1	9.4	20,482
丸山製作所	2.2	2	3,296
北川鉄工所	4.5	4.5	6,651
ローツェ	4.4	4.4	35,684
タカキタ	3.5	3.5	2,397
クボタ	532.4	528.9	1,307,176
荏原実業	2.5	2.5	11,625
三菱化工機	3.5	3.2	9,491
月島機械	18.5	18.5	23,920
帝国電機製作所	8.3	7	8,470
東京機械製作所	4.1	4.1	1,258
新東工業	23.8	23.9	18,140
澁谷工業	8.8	8.8	31,064
アイチ コーポレーション	17.3	17.4	15,607
小森コーポレーション	25.4	25.5	18,385
鶴見製作所	7.8	7.7	13,297
住友精密工業	1.5	1.5	3,070
日本ギア工業	3	4	1,232
酒井重工業	1.9	1.8	3,758
荏原製作所	41.5	41.7	171,387
石井鐵工所	1.3	1.4	4,113
西島製作所	10.1	10.1	8,443
北越工業	10.3	10.4	11,627
ダイキン工業	127.8	128.3	2,835,430
オルガノ	3.6	3.3	20,427

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
トーヨーカネツ	4.4	3.8	10,552	
栗田工業	54.3	54.5	241,435	
椿本チエイン	14.3	14.4	42,350	
大同工業	4.8	4.8	3,720	
木村化工機	8.3	8.4	5,518	
アネスト岩田	15.6	17	18,479	
ダイフク	51.3	55.4	626,574	
サムコ	2.8	2.5	9,237	
加藤製作所	5.5	5.5	5,511	
油研工業	1.7	1.7	2,774	
タダノ	48.4	48.6	49,231	
フジテック	36.5	34.7	87,999	
CKD	27.9	23.3	57,667	
キトー	7.6	8.5	12,512	
平和	28	28.1	44,988	
理想科学工業	8.9	7.8	10,647	
SANKYO	22.3	23.9	70,600	
日本金銭機械	11.1	11.1	6,138	
マースグループホールディングス	6.4	6.4	10,208	
フクシマガリレイ	6.2	6.9	28,945	
オーイズミ	4.2	4.2	1,722	
ダイコク電機	4.6	4.6	4,342	
竹内製作所	16.8	16.8	46,687	
アマノ	26.3	26.4	63,835	
JUKI	14	14	11,620	
サンデンホールディングス	13.1	14	6,104	
蛇の目ミシン工業	9.1	9.2	7,479	
マックス	15.3	13.8	22,273	
グローリー	25.8	25.9	59,311	
新晃工業	9.3	9.4	18,565	
大和冷機工業	14.5	16.2	17,577	
セガサミーホールディングス	99.5	91.5	167,628	
日本ビストンリング	3.7	3.7	3,848	
リケン	4.6	4.7	10,570	
TPR	13.5	13.5	20,560	
ツバキ・ナカシマ	20.5	19.3	24,588	
ホシザキ	29.3	31.7	305,905	
大豊工業	8.2	8.2	6,174	
日本精工	188.9	206.8	209,695	

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
NTN	232.2	233	73,395	
ジェイテクト	96.3	96.6	110,703	
不二越	9.3	9.3	43,570	
日本トムソン	29.8	27.6	15,704	
THK	58.4	62.8	228,592	
ユーション精機	7.8	6.7	6,331	
前澤給装工業	3.6	3.7	8,262	
イーグル工業	12.4	12.4	14,297	
前澤工業	6.7	6	3,432	
日本ビラー工業	10.1	10.2	17,574	
キッツ	40.7	31.1	18,100	
マキタ	130.9	131.3	616,453	
日立造船	79.5	79.8	56,418	
三菱重工業	168.2	158.2	483,301	
IHI	72.3	67.7	128,562	
スター精密	15.5	15.5	25,079	
電気機器 (18.0%)				
日清紡ホールディングス	66.9	61.5	49,446	
イビデン	61.4	48.4	233,288	
コニカミノルタ	219.2	204.3	112,365	
ブラザー工業	122.5	122.9	277,999	
ミネベアミツミ	186.3	173.5	463,245	
日立製作所	482.2	484.1	2,388,549	
東芝	—	38	133,000	
三菱電機	1,003.4	1,006.7	1,612,230	
富士電機	60.5	60.7	283,165	
東洋電機製造	3.6	4	4,840	
安川電機	108	108.4	614,628	
シンフォニアテクノロジー	13	13	17,407	
明電舎	18.4	17.1	40,561	
オリジン	2.7	2.7	3,707	
山洋電気	4.8	4.9	29,596	
デンヨー	8.5	8.6	18,206	
東芝テック	12.6	10.8	41,688	
芝浦メカトロニクス	1.8	1.8	9,126	
マブチモーター	27.8	27.9	136,291	
日本電産	120.7	242.3	3,549,695	
ユニー・エム・シー・エレクトロニクス	6	6	5,370	
トレックス・セミコンダクター	5.8	5.4	8,688	

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
東光高岳	5.6	5.1	7,956	
ダブル・スコープ	15.9	19.8	15,681	
宮越ホールディングス	3.7	3.8	3,914	
ダイヘン	11	11	51,480	
ヤーマン	16.4	16.4	31,734	
JVCケンウッド	81.7	87.1	16,810	
ミマキエンジニアリング	9	9	5,121	
I-PEX	4.1	4.7	9,512	
日新電機	23.5	23.6	29,972	
大崎電気工業	20	20	12,180	
オムロン	90	83.8	789,396	
日東工業	14.7	14.8	30,991	
IDEC	14.5	13.5	25,393	
正興電機製作所	2.4	2.4	5,407	
不二電機工業	1.2	1.7	2,160	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	33.5	36.2	121,994	
サクサホールディングス	2.3	2.3	3,438	
メルコホールディングス	3.5	3.5	13,685	
テクノメディカ	2.3	2.3	3,714	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	1.6	2.9	12,455	
日本電気	121.7	127.9	804,491	
富士通	96.7	90.6	1,440,993	
沖電気工業	40.8	40.9	42,945	
岩崎通信機	4.4	4.4	3,841	
電気興業	4.8	4.8	14,126	
サンケン電気	10.9	11.8	65,844	
ナカヨ	1.9	1.9	2,736	
アイホン	5.7	5.7	9,992	
ルネサスエレクトロニクス	479.5	433.1	543,540	
セイコーエプソン	124.5	124.9	220,823	
ワコム	67.5	72.9	58,028	
アルバック	18.5	18.5	94,535	
アクセル	4.2	4.2	3,360	
EIZO	7.8	8.5	32,555	
ジャパンディスプレイ	290	343.8	16,502	
日本信号	25.5	23.5	22,489	
京三製作所	23.5	21.6	9,201	
能美防災	13.3	13.3	30,004	
ホーチキ	7.3	7.3	9,446	

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
星和電機	4.9	5	3,080	
エレコム	11	11.5	57,270	
パナソニック	1,146.5	1,073.7	1,547,738	
シャープ	116.1	116.5	249,310	
アンリツ	64.6	60.5	143,990	
富士通ゼネラル	27.2	30.7	91,670	
ソニー	634.5	630.7	7,555,786	
TDK	48.4	48.6	790,236	
帝国通信工業	4.4	4.4	5,029	
タムラ製作所	33.5	36.2	20,127	
アルプスアルパイン	88.8	82.2	118,121	
池上通信機	3.2	3.2	2,665	
日本電波工業	9.1	9.7	6,731	
鈴木	4.9	4.5	4,819	
日本トリム	1.3	2.2	9,658	
ローランド ディー・ジー	5.5	5.9	11,263	
フォスター電機	10.5	10.6	13,854	
SMK	2.6	2.6	7,839	
ヨコオ	6.5	7.4	22,177	
ティアック	7.2	6.3	793	
ホシデン	27.4	27.5	29,892	
ヒロセ電機	15.5	15.5	260,090	
日本航空電子工業	23	23.1	39,177	
TOA	10.8	11.9	10,745	
マクセルホールディングス	21.6	20	28,880	
古野電気	12.9	13	14,872	
ユニデンホールディングス	2.8	2.6	6,125	
スミダコーポレーション	7.7	8.6	8,832	
アイコム	5.6	4.2	11,676	
リオン	4.2	4.2	12,327	
本多通信工業	8.6	7.8	4,079	
船井電機	10.1	11.3	5,446	
横河電機	92.1	100.8	216,014	
新電元工業	3.5	3.9	12,324	
アズビル	63.3	68.1	341,181	
東亜ディーケーケー	5	5	4,160	
日本光電工業	41.5	41.6	125,632	
チノー	3.5	3.2	4,457	
共和電業	10.5	10.5	4,042	

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
日本電子材料	4	3.6	6,850	
堀場製作所	19.9	19.9	134,126	
アドバンテスト	74.6	74.9	724,283	
小野測器	4.2	4.2	2,289	
エスベック	8.9	8.9	17,150	
キーエンス	90.9	98.8	5,606,900	
日置電機	5.2	4.8	18,288	
シスメックス	71.7	78.5	923,160	
日本マイクロニクス	17.5	17.5	33,040	
メガチップス	9.3	10.1	34,794	
OBARA GROUP	5.2	5.9	23,423	
澤藤電機	1.2	1.1	2,550	
原田工業	4.7	4.1	3,747	
コーセル	13.4	12.3	14,317	
イリソ電子工業	8.4	8.5	42,840	
オブテックスグループ	16.5	16.5	29,073	
千代田インテグレ	4.6	4.2	7,560	
アイ・オー・データ機器	3.2	3.7	3,711	
レーザーテック	44.1	44.2	644,436	
スタンレー電気	70.6	70.6	242,864	
岩崎電気	3.9	3.7	5,627	
ウシオ電機	58.3	51.6	71,053	
岡谷電機産業	7.9	7.2	2,700	
ヘリオス テクノ ホールディング	9.2	9.3	3,199	
エノモト	3	2.8	5,230	
日本セラミック	10.2	10.2	27,948	
遠藤照明	5.1	5.1	3,299	
古河電池	7.2	7.2	11,433	
双信電機	4.9	4.9	2,190	
山一電機	7.3	6.6	9,768	
図研	6.5	6.5	19,175	
日本電子	19.8	18.3	78,964	
カシオ計算機	88.8	81	166,455	
ファナック	95.3	88.4	2,438,514	
日本シイエムケイ	23.6	21.7	9,482	
エンプラス	5.1	4.5	20,902	
大真空	3.7	3.4	9,112	
ローム	44.6	41.9	480,593	
浜松ホトニクス	72	72.2	492,404	

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
三井ハイテック	11.1	9.9	44,896	
新光電気工業	33.7	33.8	102,583	
京セラ	141.2	153.4	1,065,209	
太陽誘電	44.6	44.8	261,632	
村田製作所	294.8	295.7	2,922,107	
双葉電子工業	15.9	17.2	16,649	
北陸電気工業	4	3.8	3,560	
ニチコン	34	31.7	36,359	
日本ケミコン	7.6	10.2	18,839	
KOA	15.1	13.9	21,128	
市光工業	15	15	11,445	
小糸製作所	60.1	60.3	467,325	
ミツバ	18.5	18.5	11,544	
SCREENホールディングス	17.4	17.5	163,975	
キャノン電子	10.5	9.2	15,566	
キャノン	540.2	500.3	1,169,951	
リコー	255.3	256.1	242,782	
象印マホービン	29.4	27.2	49,612	
MUTOHホールディングス	1.4	1.3	2,067	
東京エレクトロン	66.9	59	2,731,700	
輸送用機器 (6.9%)				
トヨタ紡織	29.2	29.3	50,776	
芦森工業	2.1	1.9	1,958	
ユニプレス	19.4	16.5	15,873	
豊田自動織機	81.2	81.5	775,880	
モリタホールディングス	17.5	16.1	29,189	
三櫻工業	12.7	13.9	13,066	
デンソー	220.9	221.7	1,479,182	
東海理化電機製作所	26.4	26.5	47,859	
三井E&Sホールディングス	36.2	39	17,199	
川崎重工業	78.1	78.3	180,638	
名村造船所	32.3	30.2	5,828	
サノヤスホールディングス	12.2	12.3	1,869	
日本車輛製造	3.7	3.7	9,216	
三菱ロジスネクスト	13.3	13.3	15,348	
近畿車輛	1.5	1.7	2,131	
日産自動車	1,183.4	1,187.3	697,182	
いすゞ自動車	290.8	291.7	327,870	
トヨタ自動車	1,119.6	1,019.9	8,220,394	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日野自動車	125.3	125.7	127,836	
三菱自動車工業	371.4	372.7	109,201	
エフテック	7	7	4,669	
レシップホールディングス	3.9	4	2,400	
GMB	1.8	1.8	1,657	
ファルテック	1.8	1.8	1,477	
武蔵精密工業	22.3	22.4	42,492	
日産車体	19.6	14.7	11,877	
新明和工業	27	28.4	27,292	
極東開発工業	18.6	17.4	27,927	
日信工業	20.2	—	—	
トビー工業	8.3	8.3	12,018	
ティラド	3.6	3.1	5,731	
曙ブレーキ工業	55.1	55.3	9,069	
タチエス	16.5	15.4	16,955	
NOK	53.9	48.7	71,735	
フタバ産業	27.9	25.2	13,608	
KYB	11.2	11.3	34,013	
大同メタル工業	19.2	20.8	11,606	
プレス工業	49.7	49.9	16,566	
ミクニ	12.7	12.8	3,673	
太平洋工業	21	21.1	25,615	
ケーヒン	23.2	—	—	
河西工業	13.5	13.6	5,684	
アイシン精機	82.6	73.7	268,268	
マツダ	295.3	316	271,444	
今仙電機製作所	9.3	8.8	6,776	
本田技研工業	790.1	792.7	2,360,264	
スズキ	198.9	199.6	981,632	
SUBARU	311.5	288.5	587,097	
安永	4.8	4.9	5,811	
ヤマハ発動機	130.9	142.3	342,943	
ショーワ	23.4	—	—	
TBK	11.9	12	5,256	
エクセディ	13.6	13.7	22,536	
豊田合成	32.4	32.5	92,820	
愛三工業	15.7	15.8	9,132	
盟和産業	1.5	1.5	1,332	
日本プラスト	7.9	8.5	5,066	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ヨロズ	9.4	8.6	11,257	
エフ・シー・シー	16.4	16.5	28,759	
シマノ	37.6	37.7	957,768	
テイ・エス テック	23.3	23.4	71,370	
ジャムコ	5	5.9	5,239	
精密機器 (2.6%)				
テルモ	283.9	308.6	1,320,190	
クリエートメディック	3.3	3.3	3,201	
日機装	30.1	32.5	34,937	
日本エム・ディ・エム	5.8	5.8	11,634	
島津製作所	119.9	129.6	565,704	
JMS	8.5	8.5	8,355	
クボテック	2.6	2.6	967	
長野計器	7.3	7.3	7,343	
プイ・テクノロジー	4.7	4.7	27,918	
東京計器	6.4	6.4	5,932	
愛知時計電機	1.3	1.3	5,713	
インターアクション	5.4	5	13,455	
オーバル	9	9	2,745	
東京精密	18.2	17	87,210	
マニー	40	40.1	108,069	
ニコン	162.4	153.7	141,250	
トプコン	50.5	50.7	64,389	
オリンパス	555.2	557.1	1,248,182	
理研計器	8.8	8.9	24,839	
タムロン	8.1	8.1	15,948	
HOYA	200.4	199.7	2,608,082	
シード	4.3	4.3	2,820	
ノーリツ銅機	6.8	9	21,465	
エー・アンド・デイ	9.1	8.5	10,395	
朝日インテック	85.2	105.9	347,352	
シチズン時計	117.5	127.7	49,547	
リズム	3.1	3.1	2,449	
大研医器	6.9	8	4,584	
メニコン	13.8	15.5	105,555	
シンシア	1.1	1.1	849	
松風	4.5	4.6	8,316	
セイコーホールディングス	14.2	14.2	23,856	
ニプロ	69.4	75	104,100	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
その他製品 (2.5%)			
中本ボックス	2.5	2.6	4,570
スノーピーク	4.9	6	19,020
バラマウントベッドホールディングス	10.6	9.7	44,038
トランザクション	6.4	5.5	6,424
粧美堂	2.9	2.9	1,171
ニホンフラッシュ	4.7	8.6	10,543
前田工織	11.1	11.1	32,922
永大産業	13.1	13.2	3,986
アートネイチャー	10.7	9.7	6,499
バンダイナムコホールディングス	103.7	83.3	728,375
アイフィスジャパン	2.6	2.6	1,838
共立印刷	16.7	16.8	2,116
SHOEI	4.8	8.8	37,488
フランスベッドホールディングス	14.2	12.9	12,409
パイロットコーポレーション	16.4	17.8	58,829
萩原工業	5.6	5.6	8,377
トッパン・フォームズ	21.5	18	18,720
フジシールインターナショナル	22.5	20.7	44,484
タカラトミー	45	45.1	45,054
廣済堂	7	7	6,552
エステールホールディングス	2.7	2.7	1,744
アーク	38.3	—	—
タカノ	3.9	3.4	2,070
プロネクサス	8.6	8.6	10,388
ホクシン	6.2	6.2	731
ウッドワン	3.4	3.4	3,655
大建工業	6.7	6.8	13,681
凸版印刷	141.6	153	257,193
大日本印刷	131.3	121.6	236,268
共同印刷	3.1	3.1	9,610
NISSHA	20.6	20.7	29,828
光村印刷	0.9	0.9	1,611
TAKARA & COMPANY	4.8	4.9	8,550
アシックス	82.8	89	158,153
ツツミ	3.1	2.5	5,235
ローランド	—	5.8	20,300
小松ウオール工業	3.1	3.1	5,995
ヤマハ	59.7	59.9	345,623

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
河合楽器製作所	3.1	2.8	10,220
クリナップ	9.3	9.4	4,794
ビジョン	60.6	64.6	264,214
オリバー	2.1	2.1	5,403
兼松サステック	0.6	0.6	1,055
キングジム	8.3	8.4	7,450
リンテック	23.9	21.6	52,164
イトーキ	21.3	20	7,280
任天堂	61.5	57.6	3,918,528
三菱鉛筆	16.5	16.6	23,240
タカラスタンダード	20.7	20.8	32,676
コクヨ	48.1	48.3	68,730
ナカバヤシ	9.9	9.9	6,138
グローブライド	4.5	4.9	19,894
オカムラ	35	38.6	41,417
美津濃	9.1	10	22,280
電気・ガス業 (1.3%)			
東京電力ホールディングス	801	853.9	305,696
中部電力	307	308	407,330
関西電力	380.2	381.4	409,051
中国電力	138.7	145.2	189,340
北陸電力	91.7	92	62,008
東北電力	250.7	235.8	222,831
四国電力	90.4	83.7	63,695
九州電力	206.8	222.3	206,739
北海道電力	93.9	94.2	43,803
沖縄電力	18.6	19.6	28,557
電源開発	79.8	80.1	141,056
エフオン	5.4	6.1	6,392
イーレックス	14.3	14.8	25,678
レノバ	16.6	16.9	57,037
東京瓦斯	193	193.6	447,796
大阪瓦斯	194.7	182.3	358,037
東邦瓦斯	49.4	49.5	320,265
北海道瓦斯	5.4	5.4	8,677
広島ガス	20.7	20.8	7,924
西部瓦斯	11.3	11.3	33,176
静岡ガス	28.5	28.6	27,370
メタウォーター	4.8	11.3	24,634

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
陸運業 (3.5%)				
SBSホールディングス	8.7	7.4	18,803	
東武鉄道	105.8	104.9	318,896	
相鉄ホールディングス	32.1	34.5	85,318	
東急	253.1	253.9	368,916	
京浜急行電鉄	128.9	129.3	233,645	
小田急電鉄	149.2	161.3	520,192	
京王電鉄	52.1	56.3	471,794	
京成電鉄	69.8	75.4	285,766	
富士急行	13.7	13.7	79,323	
新京成電鉄	2.6	2.6	5,837	
東日本旅客鉄道	176.6	177.2	1,351,150	
西日本旅客鉄道	89.4	89.7	566,186	
東海旅客鉄道	83.4	83.7	1,473,120	
西武ホールディングス	134.6	121.3	157,447	
鴻池運輸	16	16	17,440	
西日本鉄道	27.8	27.9	84,118	
ハマキョウレックス	7.7	7.7	25,756	
サカイ引越センター	5.3	4.6	22,540	
近鉄グループホールディングス	95	95.4	435,024	
阪急阪神ホールディングス	126.8	127.2	461,100	
南海電気鉄道	45	45.2	118,017	
京阪ホールディングス	42.3	42.5	208,675	
神戸電鉄	2.3	2.3	8,464	
名古屋鉄道	78.1	78.4	216,619	
山陽電気鉄道	6.8	6.8	13,566	
アルプス物流	—	5.3	5,432	
日本通運	33.6	33	263,670	
ヤマトホールディングス	166.6	133.6	381,294	
山九	26.4	24.5	109,515	
丸運	5.4	5.4	1,382	
丸全昭和運輸	7.7	7.7	24,101	
センコーグループホールディングス	52.4	52.6	54,704	
トナミホールディングス	2.3	2.3	12,512	
ニッコンホールディングス	34	32	68,928	
日本石油輸送	1	1	2,661	
福山通運	12.2	12.2	52,887	
セイノーホールディングス	71.2	71.4	109,527	
エスライン	2.9	2.6	2,295	

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
神奈川中央交通	2.4	2.4	9,180	
日立物流	17.4	21	70,455	
丸和運輸機関	10	20.1	43,757	
C&Fロジホールディングス	9.6	9.6	17,241	
九州旅客鉄道	84.7	73.8	188,411	
SGホールディングス	99.8	180.2	478,431	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	79.5	79.7	243,483	
商船三井	60.1	56.6	189,893	
川崎汽船	29.3	29.4	60,711	
NSユナイテッド海運	5.2	4.5	7,231	
明治海運	10.1	10.1	3,838	
飯野海運	45	44.3	20,067	
共栄タンカー	1.7	1.7	1,718	
乾汽船	5.5	4.9	4,581	
空運業 (0.4%)				
日本航空	171.1	232.3	561,236	
ANAホールディングス	173.7	257.3	656,243	
バスコ	1.8	1.8	2,466	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
トランコム	2.7	2.9	23,693	
日新	8.2	7.6	10,571	
三菱倉庫	30.1	33	111,870	
三井倉庫ホールディングス	10.9	10.1	22,624	
住友倉庫	35	34.3	50,180	
澁澤倉庫	5.2	5.2	11,908	
東陽倉庫	17.2	16	5,312	
日本トランスシティ	20.9	21	11,949	
ケイヒン	1.8	1.8	2,460	
中央倉庫	5.8	5.8	6,861	
川西倉庫	1.7	1.7	2,036	
安田倉庫	7.8	7.8	7,378	
ファイズホールディングス	2	1.7	1,703	
東洋埠頭	2.9	2.9	4,141	
宇徳	8.1	6.8	3,168	
上組	54.4	53.2	106,825	
サンリツ	2.2	2.4	1,682	
キムラユニティ	2.5	2.5	2,817	
キューソー流通システム	2.4	2.4	3,775	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
近鉄エクスプレス	20.2	18	49,878
東海運	5.4	5.4	1,728
ユーアイティー	6.7	6	6,432
内外トランスライン	3.3	3.3	4,266
日本コンセプト	3	3	4,959
情報・通信業 (9.7%)			
NECネットエスアイ	9.3	32.7	61,770
クロスキャット	2.6	2.6	2,974
システナ	35.1	35.2	68,534
デジタルアーツ	4.8	5.7	62,643
日鉄ソリューションズ	14.8	14.8	47,730
キューブシステム	5.2	5.3	6,211
エイジア	1.8	1.5	2,595
コア	4.2	4.2	6,472
ラクーンホールディングス	—	7	15,617
ソリトンシステムズ	4.3	4.9	9,123
ソフトクリエイトホールディングス	4.3	3.9	9,742
T I S	32.8	98.8	223,683
J N Sホールディングス	3.9	4.8	2,995
電算システム	3.8	3.7	12,099
グリー	60.4	60.6	36,541
GMOベバボ	—	0.6	4,254
コーエーテックモホールディングス	20.1	20.2	128,674
三菱総合研究所	4.2	4.2	17,241
ボルテージ	2.1	2.6	1,502
電算	1.1	1.1	2,803
AGS	5.6	5	4,175
ファインデックス	8.3	8.3	10,142
ブレインパッド	2.5	2.6	13,208
K L a b	19	18	15,606
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	11.9	13.1	15,274
イーブックイニシアティブジャパン	1.4	1.6	3,619
ネクソン	280.4	249.5	870,755
アイスタイル	27.6	30.1	16,585
エムアップホールディングス	2.8	2.6	7,007
エイチーム	6.8	6.8	8,418
エニグモ	7	9.3	11,550
テクノスジャパン	7.6	7.7	5,336
e n i s h	4.4	5.1	2,738

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コロブラ	32.2	32.4	29,484
オルトプラス	7.3	6	2,658
ブロードリーフ	48.8	49	25,137
クロス・マーケティンググループ	4.4	4.4	1,795
デジタルハーツホールディングス	5.2	4.5	6,574
システム情報	5	7.4	7,881
メディアドゥ	3.1	3.7	23,014
じげん	24.4	24.4	9,906
ブイキューブ	6	5.4	14,952
エンカレッジ・テクノロジー	1.6	1.7	1,037
サイバーリンクス	1.5	3.2	6,422
ディー・エル・イー	7.9	7.9	2,528
フィックスターズ	10.5	10.5	10,531
CARTA HOLDINGS	4.8	4	6,268
オブティム	2.6	6.9	21,942
セレス	3.2	3.3	14,371
SHIFT	2.6	4.4	64,900
ティーガイア	8.7	10.5	19,708
セック	1.4	1.4	3,950
日本アジアグループ	10.4	9.5	11,837
豆蔵ホールディングス	6.6	—	—
テクマトリックス	6.9	15.3	26,790
プロシッパ	2.8	2.9	3,932
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	23.7	23.8	56,239
GMOペイメントゲートウェイ	16.2	20.9	330,847
ザッパラス	4.3	3.8	1,763
システムリサーチ	2.6	2.9	5,341
インターネットイニシアティブ	14.6	26.3	60,779
さくらインターネット	10.5	10.6	7,218
ヴィンクス	2.8	2.8	3,186
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1.8	2.2	18,612
SRAホールディングス	5.2	5.2	13,530
システムインテグレータ	3.1	2.8	1,867
朝日ネット	7	8	6,704
eBASE	5.9	11.8	10,974
アバント	7	10.6	14,935
アドソル日進	3.5	3.5	9,583
ODKソリューションズ	—	1.5	1,074
フリービット	5.1	5.9	5,888

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
コムチュア	11	9.1	26,271	
サイバーコム	1.7	1.8	2,860	
アステリア	6	7.1	6,503	
アイル	3.5	5.5	9,042	
マークラインズ	4.9	4.1	9,840	
メディカル・データ・ビジョン	7.5	11.3	24,385	
g u m i	12.6	13.7	13,549	
ショーケース	2.3	2.1	2,093	
モバイルファクトリー	2.2	2.2	2,290	
テラスカイ	3.5	3.2	12,480	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3.9	4.4	7,233	
P C I ホールディングス	2	3.7	4,810	
パイブドHD	1.3	2	3,016	
アイビーシー	1.8	1.6	1,654	
ネオジャパン	1.8	1.9	3,410	
P R T I M E S	0.8	2.1	7,161	
ランドコンピュータ	1.5	1.5	1,690	
ダブルスタンダード	1.3	1.3	5,401	
オープンドア	4.9	5.9	13,776	
マイネット	3.2	3.2	2,518	
アカツキ	3.5	3.9	16,926	
ベネフィットジャパン	0.7	0.7	1,250	
U b i c o m ホールディングス	2.2	2.6	8,086	
L I N E	22.4	—	—	
カナミックネットワーク	6	9	6,993	
ノムラシステムコーポレーション	2.2	4.3	1,397	
チェンジ	2	13.8	47,817	
シンクロ・フード	4.2	5.9	2,141	
オークネット	6.1	5.2	7,009	
キャピタル・アセット・プランニング	—	1.2	1,202	
セグエグループ	1.6	2.5	3,060	
エイトレッド	1.2	1.9	4,457	
A O I T Y O H o l d i n g s	9.9	10	4,770	
マクロミル	20.1	20.2	17,634	
ビーグリー	1.9	1.9	2,791	
オロ	2.6	3.1	12,245	
ユーザーローカル	0.7	1.5	6,930	
テモナ	1.3	2.1	1,986	
ニーズウェル	1.2	1.9	1,284	

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
サインポスト	1.5	2.2	2,237	
ソルクシーズ	4.2	3.8	3,963	
フェイス	3.4	3	2,427	
プロトコーポレーション	8.8	8.8	10,304	
ハイマックス	1.2	2.3	3,972	
野村総合研究所	139.6	180.3	642,769	
サイバネットシステム	7	7	5,992	
C E ホールディングス	5.6	5.2	2,844	
日本システム技術	1.6	1.8	2,840	
インテージホールディングス	12.3	12.3	14,723	
東邦システムサイエンス	2.6	2.6	2,410	
ソースネクスト	46.7	46.8	15,771	
インフォコム	10.8	9	25,272	
HEROZ	1	2.8	9,912	
ラクスル	5.2	8	30,480	
I P S	—	1.7	5,261	
F I G	10.7	10.7	2,878	
システムサポート	0.8	2.9	4,205	
イーソル	3.5	5.4	7,624	
アルテリア・ネットワークス	10.9	10.9	17,080	
E d u L a b	—	0.9	6,489	
東海ソフト	—	1.2	1,366	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	2.2	1.7	3,427	
サーバーワークス	—	0.5	2,545	
東名	—	0.5	562	
ヴィッツ	—	0.4	914	
トピックスシステムズ	—	1	1,608	
S a n s a n	—	4.5	41,850	
L i n k - U	—	0.7	983	
ギフティ	—	4.4	19,580	
ベース	—	0.8	4,568	
フォーカスシステムズ	6.1	6.6	6,157	
クレスコ	6	6.8	9,424	
フジ・メディア・ホールディングス	94.8	102.5	135,300	
オービック	34.1	31.1	601,785	
ジャストシステム	16	14.1	98,277	
TDCソフト	8.6	8.6	8,161	
Zホールディングス	1,352.2	1,357	896,977	
トレンドマイクロ	43.8	52.7	297,228	

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
IDホールディングス	3.8	3.8	4,628	
日本オラクル	20	20	238,600	
アルファシステムズ	3.1	2.6	9,360	
フューチャー	11.9	11.9	22,610	
CAC Holdings	6.4	6.4	9,196	
SBテクノロジー	3.5	3.6	10,800	
トーセ	2.7	2.7	2,197	
オービックビジネスコンサルタント	10.1	10.1	64,034	
伊藤忠テクノソリューションズ	44.9	45	154,575	
アイティフォー	11.9	12.9	11,132	
東計電算	1.5	1.5	6,427	
エクスネット	1.5	1.5	1,488	
大塚商会	53.3	53.5	274,990	
サイボウズ	11.5	11.5	28,715	
ソフトブレーン	5.8	—	—	
電通国際情報サービス	6.1	12.2	46,726	
ACCESS	—	9.3	7,765	
デジタルガレージ	17.7	16.3	72,453	
EMシステムズ	13.8	16.3	13,952	
ウェザーニューズ	3.3	3	15,900	
C I J	6.7	6.7	5,842	
ビジネスエンジニアリング	1.1	1	3,230	
日本エンタープライズ	10	10	2,550	
WOWOW	4.7	4.7	13,498	
スカラ	6.5	8.8	6,362	
インテリジェント ウェイブ	4.3	5.8	3,990	
IMAGICA GROUP	8.4	8.4	4,309	
ネットワンシステムズ	37.5	40.3	132,990	
システムソフト	23.3	21.3	2,875	
アルゴグラフィックス	8.4	7.7	23,485	
マーベラス	15	15.6	14,773	
エイベックス	16.9	17	25,381	
日本ユニシス	30.7	34.3	111,303	
兼松エレクトロニクス	5.4	5.4	19,737	
都築電気	—	3.6	5,529	
TBSホールディングス	59.9	65.5	134,471	
日本テレビホールディングス	82.2	82.5	116,902	
朝日放送グループホールディングス	9.8	9.8	7,085	
テレビ朝日ホールディングス	27	30.5	66,002	

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
スカパーJ SATホールディングス	64.8	65	29,900	
テレビ東京ホールディングス	8.1	7.2	17,870	
日本BS放送	3.3	3.3	3,854	
ビジョン	9.2	12.3	12,164	
スマートバリュー	2.6	2.6	2,371	
USEN-NEXT HOLDINGS	3.7	3.8	7,417	
ワイヤレスゲート	4.6	4	2,076	
コネクシオ	5.6	5.6	7,817	
日本通信	76.8	87.3	22,523	
クロップス	1.8	1.8	1,431	
日本電信電話	1,316.2	1,155.5	3,256,776	
KDDI	733.8	792.2	2,686,350	
ソフトバンク	894.8	897.8	1,300,014	
光通信	10.2	11.6	245,920	
NTTドコモ	727.3	—	—	
エムティーアイ	9.5	9.6	8,246	
GMOインターネット	38.8	35.4	129,033	
ファイバーゲート	2.3	3.2	6,822	
アイドママーケティングコミュニケーション	2.9	2.5	1,212	
KADOKAWA	26.5	26.6	111,188	
学研ホールディングス	3.3	13.2	20,922	
ゼンリン	19.6	17.9	24,254	
昭文社ホールディングス	4.5	4	1,872	
インプレスホールディングス	8.1	8.2	1,615	
アイネット	5.1	5.1	7,690	
松竹	6.5	6.5	101,595	
東宝	58.9	58.3	246,609	
東映	3.7	3.2	68,160	
エヌ・ティ・ティ・データ	262.2	263	425,271	
ビー・シー・エー	1.3	1.4	5,922	
ビジネスブレイン太田昭和	1.7	3.4	5,810	
DTS	22	20.5	49,323	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	42	42.1	274,071	
シーイーシー	10.5	10.6	15,529	
カブコン	46.4	42.3	283,410	
アイ・エス・ビー	1.9	4.6	5,699	
ジャステック	6.3	6.3	7,887	
SCSK	22.7	22.8	149,568	
日本システムウエア	3.2	3.3	6,774	

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
アイネス	9.7	9.7	13,550	
TKC	8.3	8.4	55,944	
富士ソフト	12.6	10.5	59,010	
NSD	31.6	31.8	60,865	
コナミホールディングス	35.8	35.9	267,814	
福井コンピュータホールディングス	3.9	4.5	16,312	
JBCCHホールディングス	6.6	6.7	9,775	
ミロク情報サービス	8.7	9.8	22,010	
ソフトバンクグループ	781.3	783.9	8,254,467	
卸売業 (4.6%)				
ハウスイ	0.8	0.8	770	
高千穂交易	3.8	3.8	4,613	
オルパヘルスケアホールディングス	—	1.6	2,496	
伊藤忠食品	2.4	2.4	12,648	
エレマテック	9.2	7.9	7,805	
JALUX	2.8	2.8	4,718	
あらた	7.9	7.9	36,616	
トーマンデバイス	1.5	1.3	5,161	
東京エレクトロン デバイス	3.6	3.3	12,919	
フィールズ	7.6	8.7	5,350	
双日	545.9	547.7	153,903	
アルフレッサ ホールディングス	109.8	102.8	223,178	
横浜冷凍	27.7	25.9	23,335	
神栄	1.4	1.4	2,097	
ラサ商事	5.2	5.2	4,747	
ラクーンホールディングス	4.2	—	—	
アルコニックス	10.5	10.5	17,146	
神戸物産	34.1	68.4	200,001	
ハイパー	—	1.5	783	
あい ホールディングス	14.1	14.2	28,982	
ディーブイエックス	3.5	3.2	3,340	
ダイワボウホールディングス	8.4	9	73,170	
マクニカ・富士エレホールディングス	23.6	23.6	49,819	
ラクト・ジャパン	3.7	4.3	11,364	
グリムス	—	2.2	3,854	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18.6	17.2	13,588	
八洲電機	7.6	7.7	7,322	
メディアスホールディングス	5.6	5.6	4,709	
レスターホールディングス	10.3	10.3	21,166	

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
ジュレットホールディングス	2.3	2.3	2,431	
大光	4.2	3.8	2,549	
OCHIホールディングス	2.9	2.9	3,906	
TOKAIホールディングス	52.2	48	45,888	
黒谷	2.2	2.7	2,130	
Cominix	1.7	1.7	1,312	
三洋貿易	9.9	10	10,780	
ビューティガレージ	1.6	1.6	4,049	
ウイン・パートナーズ	7.1	7.2	8,388	
ミタチ産業	3	2.7	1,622	
シップヘルスケアホールディングス	15.8	17.5	102,900	
明治電機工業	3.1	3.4	4,804	
デリカフーズホールディングス	3.5	3.8	2,378	
スターティアホールディングス	2.2	1.9	2,027	
コメダホールディングス	21.5	21.6	41,860	
ビーバンドットコム	0.7	1.3	1,121	
アセンテック	0.8	2.5	4,222	
富士興産	3	3	3,861	
協栄産業	1.1	1.1	1,524	
小野建	8.9	8.9	11,774	
南陽	2.2	2	3,304	
佐島電機	6.7	6.2	5,003	
エコートレーディング	2.3	2.1	1,455	
伯東	6	6	7,692	
コンドテック	7.6	7.7	8,223	
中山福	5.7	5.7	2,946	
ナガイレーベン	14.3	13.1	36,483	
三菱食品	10.9	10.9	32,285	
松田産業	7.2	7.2	13,975	
第一興商	14.7	14.8	60,902	
メディバルホールディングス	106.7	99.4	222,258	
SPK	2.1	4.2	5,325	
萩原電気ホールディングス	3.7	3.7	9,564	
アズワン	6.4	7.1	104,796	
スズデン	3.4	3.4	4,311	
尾家産業	2.9	2.9	4,051	
シモジマ	6	6.1	8,533	
ドウシシャ	9.3	9.3	17,037	
小津産業	2.2	2.2	4,221	

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
高速	5.9	5.2	8,028	
たけびし	3.5	3.5	5,390	
リックス	2.2	2.2	3,396	
丸文	8.7	8.8	4,655	
ハビネット	8.2	8.3	12,740	
橋本総業ホールディングス	2	2	5,194	
日本ライフライン	29.3	32	42,240	
タカショー	4.8	6.4	5,158	
マルカ	3.5	3.2	6,454	
I DOM	26.6	33.4	21,175	
進和	5.8	5.9	12,667	
エスケイジャパン	2.1	2.4	1,113	
ダイترون	4.2	4.2	6,581	
シークス	12.6	12.6	22,125	
田中商事	3	3	2,106	
オーハシテクニカ	5.6	5.1	7,369	
白銅	3.5	3.5	4,875	
ダイコー通産	—	0.9	1,366	
伊藤忠商事	691.3	693.5	2,253,875	
丸紅	1,028.7	977.8	769,137	
高島	1.6	1.6	2,740	
長瀬産業	55.6	55.8	97,092	
蝶理	6.3	6.3	9,960	
豊田通商	110.3	99.6	458,658	
三共生興	15	15	7,485	
兼松	36.9	39.6	54,964	
ツカモトコーポレーション	1.8	1.7	2,568	
三井物産	868.7	805.1	1,782,893	
日本紙パルプ商事	5.6	5.2	19,058	
日立ハイテク	34.3	—	—	
カメイ	12.9	12.9	15,389	
東都水産	1.3	1.1	4,279	
OUGホールディングス	1.6	1.6	4,513	
スターゼン	3.6	3.7	15,947	
山善	38.6	38.7	39,087	
椿本興業	1.8	1.8	6,804	
住友商事	623.6	625.8	979,689	
内田洋行	4.2	3.9	17,764	
三菱商事	693.5	603.7	1,800,535	

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
第一実業	4.8	4.5	18,652	
キヤノンマーケティングジャパン	28.2	24.6	58,720	
西華産業	5.6	5.2	7,269	
佐藤商事	8.1	8.2	8,191	
菱洋エレクトロ	10	7.5	21,232	
東京産業	8.9	9	6,057	
ユアサ商事	9.4	10.1	31,108	
神鋼商事	2.5	2.2	4,221	
トルク	5.9	5.9	1,516	
阪和興業	18.5	19.8	56,568	
正栄食品工業	6.4	6.4	25,024	
カナデン	8	8	10,128	
菱電商事	7.1	7.1	11,168	
フルサト工業	5.4	5	6,610	
岩谷産業	21.9	23.8	151,368	
ナイス	4.2	3.9	6,996	
昭光通商	3.2	3.2	2,406	
ニチモウ	1.5	1.5	2,901	
極東貿易	2.8	2.8	3,962	
イワキ	12.9	13	8,060	
三愛石油	24.3	24.4	26,278	
稲畑産業	21.8	23.8	36,461	
G S I クレオス	2.4	2.4	6,026	
明和産業	9.1	9.1	4,295	
クワザワホールディングス	3.5	3.5	2,352	
ヤマエ久野	—	7.2	7,653	
ワキタ	21.1	19.5	19,851	
東邦ホールディングス	31.7	31.8	62,614	
サンゲツ	27.2	26.8	42,987	
ミツウロコグループホールディングス	14.6	14.6	18,279	
シナネンホールディングス	4.1	3.7	11,951	
伊藤忠エネクス	21.8	21.9	22,622	
サンリオ	27.7	27.8	47,871	
サンワテクノス	7	6.5	6,805	
リョーサン	10.9	10.9	24,786	
新光商事	15.5	13.4	10,411	
トーホー	4.5	4.5	8,235	
三信電気	5.3	5.3	10,753	
東陽テクニカ	11.4	10.6	11,988	

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
モスフードサービス	13	14	43,680	
加賀電子	9.8	9	21,492	
ソーダニッカ	10.2	9.4	5,085	
立花エレテック	7.3	7.3	11,490	
フォーバル	4.3	3.5	2,950	
PAL TAC	15.8	15.9	90,471	
三谷産業	13	13	5,616	
太平洋興発	3.9	3.9	2,570	
西本Wismettacホールディングス	1.8	2.2	6,404	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	0.9	1,386	
コア商事ホールディングス	—	2.8	3,522	
国際紙バルブ商事	23.4	21.1	5,148	
ヤマタネ	4.9	4.3	6,200	
丸紅建材リース	1	1	1,870	
日鉄物産	7	7.1	27,938	
泉州電業	3	2.8	10,290	
トラスコ中山	20.6	22.7	60,540	
オートバックスセブン	36.7	36.8	52,660	
モリト	7.2	7.2	4,420	
加藤産業	15.5	14.3	52,838	
北恵	1.9	2.5	2,272	
イノテック	5.9	5.6	6,960	
イエローハット	18.7	18.7	32,631	
JKホールディングス	8.9	9	7,317	
日伝	8.9	8.2	18,031	
北沢産業	7.4	6.7	1,809	
杉本商事	5.3	5	12,120	
因幡電機産業	28.1	26.5	67,575	
東テック	3.3	3.3	9,177	
ミスミグループ本社	123.8	124.3	429,456	
アルテック	7.8	7.3	2,117	
タキヒヨー	3	3.3	6,233	
蔵王産業	1.9	1.9	2,641	
スズケン	41.9	42	179,130	
ジェコス	6.8	6.8	6,528	
グローセル	9.9	10.7	5,446	
小売業 (4.7%)				
ローソン	25	25.1	129,265	
サンエー	8.2	7.5	31,650	

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
カワチ薬品	7.7	6.9	20,520	
エービーシー・マート	15.4	15.5	95,015	
ハードオフコーポレーション	3.9	4.4	3,555	
アスクル	10.3	8.6	32,121	
ゲオホールディングス	17.8	13.3	15,587	
アダストリア	13.7	13.7	28,167	
ジーフット	6	6	2,514	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	1.4	1.4	593	
くら寿司	5.2	5.8	44,312	
キャンドウ	4.7	4.7	9,000	
アイケイ	—	2.1	1,757	
パルグループホールディングス	5	8.7	14,268	
エディオン	45.4	42	45,192	
サーラコーポレーション	20.1	20.1	11,738	
ワッツ	4.3	4.4	3,722	
ハローズ	3.7	4	12,000	
フジオフードグループ本社	8.3	8.4	10,886	
あみやき亭	2.1	2.1	6,161	
ひらまつ	18.2	18.2	3,276	
大黒天物産	2.4	2.4	14,808	
ハニーズホールディングス	8.7	7.8	8,057	
ファーマライズホールディングス	2.4	2.4	1,876	
アルペン	7.6	7.6	17,632	
ハブ	2.8	3.2	2,249	
クオールホールディングス	14.5	13.4	19,363	
ジンスホールディングス	5.2	5.2	38,064	
ビックカメラ	58.6	58.8	69,619	
DCMホールディングス	53.3	61.2	67,381	
ペッパーフードサービス	7.9	11.3	3,367	
Monotaro	70.3	70.5	483,630	
東京一番フーズ	2.5	2.5	1,490	
DDホールディングス	3.9	4.5	3,087	
きちりホールディングス	2.6	2.6	1,580	
アーランドサービスホールディングス	7.2	8.3	17,811	
J. フロント リテイリング	118	118.4	119,820	
ドトール・日レスホールディングス	15.8	15.7	25,983	
マツモトキヨシホールディングス	40.9	41	175,480	
ブロンコビリー	5.2	5.2	12,058	
ZOZO	68	58.4	209,656	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トレジャー・ファクトリー	2.9	2.9	2,343
物語コーポレーション	2.6	2.6	31,980
ココカラファイン	10.3	8.8	65,472
三越伊勢丹ホールディングス	172.7	173.4	126,928
H a m e e	3.5	2.5	4,180
ウエルシアホールディングス	29.4	52.4	189,426
クリエイトSDホールディングス	16.7	14.6	49,567
丸善CH1ホールディングス	11.5	11.6	4,396
ミサワ	2	2	1,334
ティーライフ	1.3	1.5	1,834
エー・ピーホールディングス	1.9	1.9	879
チムニー	3	3	4,200
シュッピン	6.7	6.7	7,390
オイシックス・ラ・大地	—	9.8	28,625
ネクステージ	14.1	16.9	29,084
ジョイフル本田	28.9	29	41,035
鳥貴族ホールディングス	3.3	2.9	5,101
キリン堂ホールディングス	3.9	—	—
ホットランド	6.6	7.4	9,079
すかいらくホールディングス	110.8	111.1	181,981
SFPホールディングス	4.2	4.8	6,940
綿半ホールディングス	3.7	7.4	9,338
ヨシックス	1.6	1.9	4,218
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	28.7	28.8	32,457
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.6	5.1	6,446
BEENOS	3.7	4.6	12,019
あさひ	7.4	7.4	11,203
日本調剤	3	6	9,570
コスモス薬品	4.4	10	158,600
トーエル	4.8	4.8	3,988
オンリー	1.7	1.7	792
セブン&アイ・ホールディングス	386.6	387.9	1,629,955
クリエイト・レストランツ・ホールディング	26.6	53.3	44,772
ツルハホールディングス	21.5	21.6	304,776
サンマルクホールディングス	7.8	7.8	12,682
フェリシモ	2.2	2.2	2,978
トリドールホールディングス	12.2	24.5	36,872
TOKYO BASE	8.9	8.9	6,425
ウイルプラスホールディングス	1.2	1.5	1,635

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
JMホールディングス	5	7.5	15,037
サツドラホールディングス	1.5	1.5	3,049
アレンザホールディングス	4.9	5.7	7,843
串カツ田中ホールディングス	1.5	2.6	4,940
パロックジャパンリミテッド	6.9	6.9	5,637
クスリのアオキホールディングス	8.8	9.9	87,516
力の源ホールディングス	4.5	4.5	2,808
スシローグローバルホールディングス	10.8	54.4	232,560
L I X I L ビバ	9.8	—	—
メディカルシステムネットワーク	9.5	8.6	6,295
はるやまホールディングス	4.6	4.6	3,279
ノジマ	17.6	17.6	51,233
カッパ・クリエイト	13.9	13.9	21,002
ライトオン	7.4	7.4	4,691
ジーンズメイト	3	3	867
良品計画	131.2	131.6	330,974
三城ホールディングス	10.5	12.3	3,726
アドヴァン	15.1	10.1	11,301
アルビス	3.7	3.2	7,859
コナカ	11.6	11.7	4,258
ハウス オブ ローゼ	1.2	1.2	2,040
G-7ホールディングス	5.8	5.8	13,427
イオン北海道	9.9	13.1	15,117
コジマ	17	17	10,965
ヒマラヤ	3.5	3.5	3,405
コーナン商事	14	14.1	42,511
エコス	3.6	3.6	7,038
ワタミ	11.7	13	13,091
マルシェ	2.6	2.6	1,339
パン・パシフィック・インターナショナルホ	217.2	198.2	505,410
西松屋チェーン	21.7	21.8	33,615
ゼンショーホールディングス	47.3	53.2	153,482
幸楽苑ホールディングス	6.3	6.3	11,333
ハークスレイ	2.1	2.1	1,898
サイゼリヤ	16.3	14.7	32,266
V Tホールディングス	40.9	37.3	15,815
魚力	2.7	3.1	5,821
ポプラ	2.6	2.6	884
フジ・コーポレーション	2.6	2.6	5,811

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
ユニテッドアローズ	10.4	11.3	22,961	
ハイデイ日高	14.3	14.3	25,768	
京都きもの友禅	6.3	6.3	1,581	
コロワイド	32.8	32.9	65,602	
ピーシーデポコーポレーション	13.1	11.5	6,118	
老番屋	7	7	34,930	
トップカルチャー	3.6	3.6	1,267	
P L A N T	2.5	2.5	1,922	
スギホールディングス	19.7	19.8	147,510	
薬王堂ホールディングス	4.3	4.3	11,678	
ヴィア・ホールディングス	12.1	12.1	2,662	
スクロール	15.2	14.1	17,639	
ヨンドシーホールディングス	10.1	9.1	17,808	
ファミリーマート	79	—	—	
木曽路	12.9	13	31,902	
S R S ホールディングス	11.6	12.3	10,701	
千趣会	17.8	17.9	6,676	
タカキュー	7.6	7.6	1,109	
リテールパートナーズ	—	12	17,796	
ケーヨー	20.3	18.3	13,834	
上新電機	11.7	11.7	36,270	
日本瓦斯	15.6	16.3	81,826	
ロイヤルホールディングス	17.3	17.3	32,610	
東天紅	0.7	0.7	658	
いなげや	12.2	11.1	18,703	
島忠	18.6	6.7	36,716	
チヨダ	10.4	10.4	10,410	
ライフコーポレーション	7.5	7.5	24,825	
リンガーハット	12.2	12.2	29,341	
M r M a x H D	13.6	13.6	10,444	
テナアライド	9.1	9.1	3,212	
A O K I ホールディングス	19.8	19.8	12,929	
オークワ	15.5	15.6	18,642	
コメリ	15.3	15.3	45,119	
青山商事	20.4	22.1	17,193	
しまむら	11.5	11.5	131,445	
はせがわ	5.2	5.2	1,523	
高島屋	72	72.2	75,954	
松屋	19.9	21.7	20,918	

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
エイチ・ツー・オー リテイリング	46.8	47	39,574	
近鉄百貨店	3.8	3.8	12,825	
ハルコ	9.4	—	—	
丸井グループ	90.6	83.9	173,001	
アクシアル リテイリング	8.2	8.2	39,278	
井筒屋	5.4	5	1,320	
イオン	380.3	381.6	1,354,680	
イズミ	20.1	20.2	78,982	
平和堂	20.1	18.3	37,679	
フジ	11.9	12	23,808	
ヤオコー	11.2	11.3	75,371	
ゼビオホールディングス	11.9	12	11,172	
ケーズホールディングス	95.4	88.3	134,480	
O l y m p i c グループ	5.1	5.1	4,794	
日産東京販売ホールディングス	14.5	14.6	3,693	
シルバライフ	0.7	1.3	2,754	
一家ダイニングプロジェクト	—	1.5	903	
Genky DrugStores	4.3	4.4	15,818	
ナルミヤ・インターナショナル	1.7	1.9	1,936	
総合メディカルホールディングス	8.6	—	—	
ブックオフグループホールディングス	5.8	5.8	5,138	
ギフト	—	0.9	1,863	
アインホールディングス	12.1	14.4	102,816	
元気寿司	2.5	2.8	7,044	
ヤマダホールディングス	301.1	332.3	180,106	
アークランドサカモト	15.5	15.5	25,001	
ニトリホールディングス	42.8	39.3	812,920	
グルメ杵屋	7	7.1	6,993	
愛眼	7.9	7.9	1,817	
ケーユーホールディングス	5.2	5.2	4,539	
吉野家ホールディングス	32.5	32.6	71,883	
松屋フーズホールディングス	4.8	4.8	17,640	
サガミホールディングス	13.2	13.4	15,637	
関西スーパーマーケット	8.2	7.5	8,587	
王将フードサービス	7.3	6.6	38,610	
ブレナス	11.1	11.1	21,345	
ミニストップ	7.3	7.3	10,431	
アークス	20.2	18.9	45,435	
パローホールディングス	21.9	20.2	47,409	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
藤久	0.8	2.3	1,660
ベルク	4.9	4.9	27,979
大庄	5.3	5.3	5,485
ファーストリテイリング	13.2	13.3	1,395,170
サンドラッグ	37.2	37.3	151,438
サックスパー ホールディングス	8.4	8.4	5,367
ヤマザワ	2.3	2.3	4,022
やまや	2	2	4,490
ペルーナ	21.2	21.3	22,088
銀行業 (4.9%)			
島根銀行	2	3.4	2,308
じもとホールディングス	66.9	6.7	5,339
めぶきフィナンシャルグループ	514.3	516	120,744
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13.4	12.5	15,387
九州フィナンシャルグループ	162.4	202.8	91,462
ゆうちょ銀行	280.4	281.3	282,987
富山第一銀行	23.6	23.7	7,038
コンコルディア・フィナンシャルグループ	582.1	604.9	257,687
西日本フィナンシャルホールディングス	67.5	66.1	46,931
関西みらいフィナンシャルグループ	58.1	46.6	28,472
三十三フィナンシャルグループ	9.2	8.6	11,773
第四北越フィナンシャルグループ	17.2	16.2	37,810
ひろぎんホールディングス	—	146.5	95,225
新生銀行	72.6	81	124,821
あおぞら銀行	59	59.2	136,219
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,812.9	6,792.5	3,826,215
りそなホールディングス	1,086.1	1,079.7	471,073
三井住友トラスト・ホールディングス	187.1	187.7	678,160
三井住友フィナンシャルグループ	684.5	687.2	2,585,933
千葉銀行	340.4	331.4	235,625
群馬銀行	194.5	204.4	71,131
武蔵野銀行	14.7	14.8	23,813
千葉興業銀行	27.1	25.3	6,881
筑波銀行	41.2	41.3	7,723
七十七銀行	33.4	31.1	44,846
青森銀行	7.7	7.7	18,957
秋田銀行	6.3	5.9	8,454
山形銀行	11.1	11.2	12,488
岩手銀行	6.5	6.5	13,923

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東邦銀行	88.5	88.8	18,914
東北銀行	4.7	4.8	5,217
みちのく銀行	6.4	6.4	6,822
ふくおかフィナンシャルグループ	83.4	89.6	181,708
静岡銀行	245.1	241.8	192,956
十六銀行	12.4	12.4	24,800
スルガ銀行	101.2	87.1	31,443
八十二銀行	238.8	223.7	81,874
山梨中央銀行	11.5	11.5	10,419
大垣共立銀行	19.5	19.6	40,709
福井銀行	8.5	8.5	16,481
北國銀行	10.2	9.2	24,748
清水銀行	4.1	4.1	6,793
富山銀行	1.9	1.9	5,591
滋賀銀行	19.8	19.9	40,914
南都銀行	16.5	14.5	26,622
百五銀行	89.1	89.4	27,803
京都銀行	35.4	35.6	235,316
紀陽銀行	35	35.2	50,899
ほくほくフィナンシャルグループ	65.9	66.1	64,513
広島銀行	146.1	—	—
山陰合同銀行	58.7	62.6	31,112
中国銀行	85.2	85.5	74,385
鳥取銀行	3.4	3.2	3,606
伊予銀行	141.2	131.6	84,355
百十四銀行	10.5	10.5	16,789
四国銀行	15	14.1	10,377
阿波銀行	16.2	15.2	34,914
大分銀行	5.7	5.7	12,283
宮崎銀行	6.6	6.2	14,191
佐賀銀行	6	5.6	7,929
沖縄銀行	9.1	9.1	25,652
琉球銀行	22.8	21.6	17,042
セブン銀行	330.6	331.8	80,627
みずほフィナンシャルグループ	13,448.4	1,349.3	2,143,363
高知銀行	3.6	3.6	3,067
山口フィナンシャルグループ	123.5	123.9	83,384
長野銀行	3.2	3.3	4,313
名古屋銀行	8	8	22,736

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
北洋銀行	149.2	149.7	35,478	
愛知銀行	3.6	3.3	9,678	
中京銀行	4.1	3.6	6,426	
大光銀行	3.4	3.4	4,688	
愛媛銀行	13.8	13.9	13,913	
トマト銀行	3.8	3.8	4,066	
京葉銀行	42.2	42.3	18,442	
栃木銀行	47.8	48	8,640	
北日本銀行	3.1	3.1	5,989	
東和銀行	17.4	17.4	12,093	
福島銀行	9.3	11.4	3,135	
大東銀行	5.1	4.8	3,168	
トモニホールディングス	76.5	76.8	23,961	
フィデアホールディングス	96.1	96.4	12,050	
池田泉州ホールディングス	113.8	114.2	18,614	
証券・商品先物取引業 (0.8%)				
F P G	30.5	30.6	18,788	
ジャパンインベストメントアドバイザー	—	5	6,565	
マーキュリアインベストメント	4.4	3.9	2,741	
S B I ホールディングス	110.5	121.7	379,704	
日本アジア投資	8.4	8.4	2,167	
ジャフコ グループ	15.2	15.3	104,958	
大和証券グループ本社	794.1	743.6	393,364	
野村ホールディングス	1,741.4	1,516.1	958,326	
岡三証券グループ	84.3	84.6	35,362	
丸三証券	29.4	29.5	18,437	
東洋証券	35.4	32.8	6,133	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	113.7	105.9	41,089	
光世証券	2.4	2.4	1,687	
水戸証券	28.6	26.5	8,082	
いちよし証券	18.5	19.9	12,676	
松井証券	56.5	48.6	45,003	
だいこう証券ビジネス	4.8	—	—	
マネックスグループ	74.7	89.1	86,783	
極東証券	13.3	13.3	11,052	
岩井コスモホールディングス	9.4	10.2	16,289	
藍澤証券	17.8	17.8	15,664	
マネーパートナーズグループ	10.5	10.6	3,529	
スパークス・グループ	34.3	45.9	15,468	

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
小林洋行	2.8	2.8	792	
保険業 (1.9%)				
かんぽ生命保険	35.1	123.1	267,373	
SOMPOホールディングス	186.1	175	721,700	
アニコム ホールディングス	8.2	27.9	30,076	
MS&ADインシュアランスグループホール	258.8	241.2	755,679	
ソニーフィナンシャルホールディングス	81.3	—	—	
第一生命ホールディングス	560	524.6	997,789	
東京海上ホールディングス	353.9	329.1	1,761,014	
T&Dホールディングス	295.8	296.8	435,405	
アドバンスクリエイト	2.3	2.1	3,817	
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	27.9	25.8	133,128	
ジェイリース	2.7	3.3	2,577	
イントラスト	3.5	2.8	2,018	
日本モーゲージサービス	2	5	5,575	
C a s a	3.4	2.8	2,833	
アルヒ	15.7	14.7	24,122	
プレミアグループ	5.4	4.6	11,187	
クレディセゾン	69.3	58	76,734	
芙蓉総合リース	10.4	10.4	74,776	
みずほリース	15.3	15.3	51,637	
東京センチュリー	19.9	23.1	169,785	
日本証券金融	43.6	42	25,662	
アイフル	151	166.6	46,481	
リコーリース	7.8	7.8	25,740	
イオンフィナンシャルサービス	60.6	60.8	84,937	
アコム	200.6	200.7	94,931	
ジャックス	10.9	11	22,913	
オリエントコーポレーション	267.7	268.6	41,364	
日立キャピタル	23.3	23.4	67,953	
アプラスフィナンシャル	47.5	—	—	
オリックス	619	616.1	1,099,122	
三菱UFJリース	251.2	224	128,352	
九州リースサービス	4.9	4.9	3,150	
日本取引所グループ	284.1	268.2	645,155	
イー・ギャランティ	10.6	11.4	24,760	
アサックス	5.1	5.2	3,842	
NECキャピタルソリューション	4	4	8,000	

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
不動産業 (1.9%)				
いちご	125.9	110.6		37,382
日本駐車場開発	108.5	98		13,916
スター・マイカ・ホールディングス	5.1	5.1		6,089
SREホールディングス	—	1.1		5,401
ADワークスグループ	—	19		2,983
ヒューリック	211.3	210.6		252,509
三栄建築設計	4	4		7,172
野村不動産ホールディングス	60	60.3		145,624
三重交通グループホールディングス	20.1	20.1		9,788
サムティ	14	14.1		24,971
ディア・ライフ	12.7	14		5,992
コーセーアールイー	2.9	2.9		1,716
エー・ディー・ワークス	183.6	—		—
日本商業開発	6.3	6.3		10,395
プレサンスコーポレーション	16.2	16.3		24,498
ユニゾホールディングス	14.9	—		—
THEグローバル社	4.7	6.2		1,661
ハウスコム	1.3	1.7		2,211
日本管理センター	6.5	5.4		6,598
サンセイランディック	2.9	2.9		2,227
エストラスト	1.3	1.2		853
フージャースホールディングス	19.7	16.2		11,210
オープンハウス	28.7	31.3		128,330
東急不動産ホールディングス	269.1	270		183,060
飯田グループホールディングス	82.6	82.8		202,777
イグランド	1.6	1.6		1,385
ムゲンエステート	6.8	6.1		2,976
ビーロット	2.3	4.7		2,961
ファーストブラザーズ	2.3	1.8		1,749
ハウスドゥ	4.9	4.9		5,733
シーアールイー	2.4	2.6		3,213
プロパティエージェント	1.6	1.6		2,553
ケイアイスター不動産	3.1	3.1		11,392
アグレ都市デザイン	1.6	1.8		1,377
グッドコムアセット	2.3	4.8		6,768
ジェイ・エス・ピー	1.1	1.8		6,246
テンポイノベーション	2.2	2.8		2,682
グローバル・リンク・マネジメント	1.6	1.7		1,426

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
パーク24	53.1	53.3		119,072
バラカ	2.6	2.6		4,212
三井不動産	488.1	452.6		1,083,977
三菱地所	693.5	652.3		1,206,428
平和不動産	18.2	17		60,775
東京建物	108.1	98.1		153,036
ダイビル	25.5	25.6		33,382
京阪神ビルディング	16.1	17.1		26,248
住友不動産	222.5	223.2		820,260
テーオーシー	19.4	19.5		15,210
東京楽天地	1.6	1.6		7,088
レオパレス21	129.7	82.4		10,712
スターツコーポレーション	13.5	11.8		34,172
フジ住宅	11.5	11.5		7,521
空港施設	9.9	9.9		5,187
明和地所	5.4	4.7		3,031
ゴールドクレスト	7.8	8.9		15,299
エスリード	3.9	3.9		6,216
日神グループホールディングス	14.6	14.7		6,482
日本エスコン	17.9	18		13,842
タカラレーベン	45.2	41.6		14,560
AVANTIA	5.6	5.6		4,978
イオンモール	49.6	49.8		92,777
毎日コムネット	2.5	2.5		1,725
ファースト住建	4.2	4.2		4,662
ランド	538.7	540.5		5,405
カチタス	12.3	24.6		74,415
トーセイ	13.6	13.7		14,069
穴吹興産	2.2	2.2		3,795
サンフロンティア不動産	13.7	12.2		11,321
エフ・ジェー・ネクスト	8.6	9.7		10,922
インテリックス	2.8	2.2		1,271
ランドビジネス	4.2	3.3		1,214
サンネクスタグループ	2.3	3.1		3,007
グランディハウス	7.7	6.7		3,061
日本空港ビルデング	31.6	31.7		165,791
サービス業 (5.7%)				
明豊ファシリティワークス	—	4.4		2,772
日本工営	6.5	6		17,346

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
L I F U L L	33.5	33.6	14,179	
ミクシィ	—	18.3	50,270	
ジェイエイシーリクルートメント	6.4	6.5	10,822	
日本M&Aセンター	72.4	78.9	480,501	
メンバーズ	2.8	2.8	7,798	
中広	1	1.3	445	
UTグループ	11.3	13.9	45,661	
アイティメディア	2.9	3.2	6,105	
タケエイ	9.2	10.7	13,610	
E・Jホールディングス	1.7	3.8	3,788	
ビーネックスグループ	11.9	12.1	17,024	
コシダカホールディングス	23.1	23.2	12,783	
アルトナー	2.3	2.3	1,927	
パソナグループ	10.4	10.4	19,999	
CDS	2.4	2.4	3,333	
リンクアンドモチベーション	21.1	17.7	9,398	
GCA	11.5	12.6	10,029	
エス・エム・エス	29.8	32.7	120,990	
サニーサイドアップグループ	2.5	3.3	2,455	
バーソルホールディングス	95.9	96.2	208,657	
リニカル	4.6	5.4	4,276	
クックパッド	33.5	30.2	9,392	
エスクリ	3	3	1,194	
アイ・ケイ・ケイ	4.7	4.7	2,867	
学情	3.4	3.4	4,814	
スタジオアリス	4.8	4.8	10,267	
シミックホールディングス	5.3	4.7	8,069	
エブコ	1.5	2.3	2,129	
NJS	2.1	2.4	4,519	
総合警備保障	38.1	38.3	190,351	
カカココム	71.8	71.1	250,983	
アイロムグループ	3.4	3.5	6,762	
セントケア・ホールディング	6.2	7	6,580	
サイネックス	1.6	1.6	1,155	
ルネサンス	5.3	6	7,044	
ディップ	13.5	15	45,375	
デジタルホールディングス	5.2	6.7	13,205	
新日本科学	10.4	11.7	7,605	
ツクイホールディングス	22.6	22.6	20,882	

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
キャリアデザインセンター	2.4	2.2	2,072	
ベネフィット・ワン	26.2	35	102,585	
エムスリー	211.4	169.7	1,493,360	
ツカダ・グローバルホールディング	6.1	7.7	2,725	
プラス	1.1	1.2	597	
アウトソーシング	54.9	55.1	81,713	
ウェルネット	9.7	9.7	5,131	
ワールドホールディングス	3.2	3.3	8,134	
ディー・エヌ・エー	47	40.7	91,697	
博報堂DYホールディングス	133.4	133.9	243,430	
ぐるなび	16.7	16.7	10,637	
タカミヤ	10.2	11.6	5,916	
ジヤパンベストレスキューシステム	6.5	7.6	6,733	
ファンコムコミュニケーションズ	26.4	26.5	10,759	
ライク	3.2	2.5	4,915	
ビジネス・ブレークスルー	4	4	1,740	
エスプール	18.5	24.7	25,144	
WDBホールディングス	4.4	4.4	11,880	
手間いらず	—	0.9	4,734	
ティア	5.6	5.6	2,962	
CDG	1	0.9	1,403	
アドウエイズ	—	11.7	11,290	
バリュエコマース	5.4	6.5	20,020	
インフォマート	105.1	97.3	101,970	
J Pホールディングス	30.1	27.5	8,057	
エコナックホールディングス	17.3	17.4	1,722	
E P Sホールディングス	14.4	13	15,613	
レッグス	2.4	2.4	4,044	
プレステージ・インターナショナル	35.9	36	27,504	
アミューズ	5.2	5.2	13,083	
ドリームインキュベータ	2.9	2.9	3,523	
クイック	6	6	7,164	
TAC	5.8	5.2	1,435	
ケネディクス	89.3	27.6	20,617	
電通グループ	98.8	108.2	397,094	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3.7	4.5	3,906	
びあ	2.7	2.7	8,977	
イオンファンタジー	3.7	3.7	9,087	
シーティーエス	10.8	10.9	9,592	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ネクシィーズグループ	3.3	2.9	3,117
H. U. グループホールディングス	26.8	26.9	88,501
アルプス技研	8.5	8.5	17,229
サニックス	16.8	15.3	4,544
ダイオーズ	1.9	1.9	1,846
日本空調サービス	10	10.1	7,433
オリエンタルランド	102	102.3	1,845,492
ダスキン	24.6	22.3	62,484
明光ネットワークジャパン	11.3	12.2	6,941
ファルコホールディングス	5.3	4.6	7,433
秀英予備校	2.1	2.1	896
田谷	1.7	1.8	1,018
ラウンドワン	26.8	32.8	36,408
リゾートトラスト	44	44.1	77,042
ビー・エム・エル	12.3	12.4	45,260
ワタベウェディング	1.5	1.2	414
りらいあコミュニケーションズ	17.3	14.6	20,381
リソー教育	43.8	48.8	16,299
早稲田アカデミー	3.1	3.6	3,589
ユー・エス・エス	107.3	107.7	226,170
東京個別指導学院	3.4	8.5	5,737
サイバーエージェント	55.1	59.3	414,507
楽天	446.9	448.4	513,418
クリーク・アンド・リバー社	4.9	5	6,470
モーニングスター	—	10.5	5,197
テー・オー・ダブリュー	7.6	16.8	5,107
山田コンサルティンググループ	4.6	5.6	5,622
セントラルスポーツ	3.6	3.6	8,744
フルキャストホールディングス	9.6	8.4	16,632
エン・ジャパン	17	17.1	57,627
リソルホールディングス	1	1	4,165
テクノプロ・ホールディングス	19.1	19.2	155,520
アトラ	2.2	2.2	866
インターワークス	1.8	2.8	1,066
アイ・アールジャパンホールディングス	3.9	3.9	54,522
Keeper 技研	3.5	6.2	12,114
ファーストロジック	2.2	1.9	1,455
三機サービス	1.8	1.9	1,919
Gunosy	6	6	4,848

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
デザインワン・ジャパン	1.9	2.8	649
イー・ガーディアン	4.9	4.2	13,482
リブセンス	6.1	5.3	1,240
ジャパンマテリアル	29.5	29.6	43,334
ベクトル	11.9	12	14,376
ウチヤマホールディングス	4.7	4.7	1,715
チャーム・ケア・コーポレーション	8.2	7.2	10,274
ライクキッズ	1.6	—	—
キャリアリンク	3.1	3.1	8,577
I B J	6.5	7.9	8,089
アサンテ	3.8	3.5	6,065
N・フィールド	6.6	6.6	7,900
パリュエーHR	1.9	3.8	7,581
M&Aキャピタルパートナーズ	6.8	7.9	38,631
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.6	3.7	6,367
ER I ホールディングス	2.7	2.7	1,668
アピスト	1.5	1.5	4,458
シグマクシス	6.5	5.3	9,434
ウィルグループ	6.3	7	6,867
エスクロー・エージェント・ジャパン	13.2	14.3	4,347
メドピア	—	4.5	27,675
レアジョブ	—	1.3	2,700
リクルートホールディングス	686.9	689.1	3,772,822
エラン	5.7	13.3	18,620
土木管理総合試験所	4.2	4.7	1,649
ネットマーケティング	2.8	4.6	2,801
日本郵政	785.9	727.8	655,020
ベルシステム24ホールディングス	16.1	16.1	29,736
鎌倉新書	7.2	9.7	8,759
SMN	1.5	2.1	1,579
一蔵	1	1.2	474
LITALICO	3.3	3.9	14,917
グローバルキッズCOMPANY	1.4	1.7	1,441
エアトリ	4.3	5.2	10,374
アトラエ	2.5	2.9	9,483
ストライク	3.6	3.6	16,974
ソラスト	26.4	23.6	35,282
セラク	3	3	5,346
インソース	4.6	8	17,992

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ベイカレント・コンサルティング	5.8	6.3	134,001
Orchestra Holdings	2	2.1	6,098
アイモバイル	3	3.4	4,698
キャリアインデックス	3.9	3.9	2,363
MS-Japan	3.1	3.9	4,469
船場	1.6	1.9	1,641
グレイステクノロジー	4.4	4.9	28,224
ジャパンエレベーターサービスホールディング	10.1	27.7	62,075
フルテック	1.3	1.3	1,790
グリーンズ	2.4	3.6	2,062
ツナググループ・ホールディングス	1.1	1.7	578
GameWith	2.1	2.9	1,757
ソウルドアウト	1.5	2.3	3,682
MS&Consulting	1.3	1.5	894
ウェルビー	—	2.1	3,082
エル・ティール・エス	—	0.7	2,530
ミダック	0.9	2.1	9,408
日総工産	6.4	7.5	6,277
キュービーネットホールディングス	3.9	4.4	7,629
RPAホールディングス	5.4	11	7,029
スプリックス	3.2	2.7	2,265
マネジメントソリューションズ	1	4.7	9,353
ブロード・パートナーズ	—	1.3	4,576
and factory	0.7	0.9	760
テノ、ホールディングス	—	0.8	875
フロンティア・マネジメント	—	1.6	3,044
ピアラ	—	0.5	912
コプロ・ホールディングス	—	0.5	1,416
ギークス	—	1.2	1,963
カーブスホールディングス	—	26.4	25,660
フォーラムエンジニアリング	—	5	5,295
ダイレクトマーケティングミックス	—	3.8	12,597
ポピンズホールディングス	—	1.9	6,108
アドバンテッジリスクマネジメント	4.8	4.9	3,606
リログループ	52.4	52.6	135,287
東祥	6	6	11,940
エイチ・アイ・エス	14.9	14	32,942
ラックランド	2.2	2.7	6,388
共立メンテナンス	15.9	15.9	61,851

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イテネンホールディングス	10.7	10	13,300
建設技術研究所	6.6	6.2	14,780
スペース	6.2	6.2	5,474
長大	3.5	3.8	5,821
燦ホールディングス	4.2	4.2	4,708
スバル興業	0.6	0.6	4,938
東京テアトル	3.7	3.8	4,959
タナベ経営	1.8	1.8	2,511
ナガワ	3.1	3.1	32,488
よみうりランド	2.1	—	—
東京都競馬	6.3	6.3	30,303
常磐興産	3.8	3.9	5,475
カナモト	15.7	17	40,766
東京ドーム	38.8	39	50,622
西尾レントオール	9.7	8.9	24,065
アゴラ・ホスピタリティール・グループ	61.4	52.8	1,372
トランス・コスモス	9.1	9.2	25,502
乃村工藝社	41.1	41.2	33,866
藤田観光	4.2	3.8	6,935
KNT-CTホールディングス	6	5.1	5,696
日本管財	10.3	10.3	21,908
トーカイ	9.3	9.3	20,757
白洋舎	1.1	1.1	2,590
セコム	101.8	94.8	917,379
セントラル警備保障	4.6	4.6	15,801
丹青社	18.1	18.2	14,978
メイテック	11.9	11.8	68,794
応用地質	10.3	11.2	14,190
船井総研ホールディングス	19.8	19.7	45,290
進学会ホールディングス	3.7	3.8	1,793
オオバ	6.9	6.8	5,045
いであ	1.8	2.3	3,976
学究社	2.8	2.8	3,721
ベネッセホールディングス	31.9	35.3	75,859
イオンディライト	11.8	11.9	37,306
ナック	5.3	4.6	4,503
ニチイ学館	13.6	—	—
ダイセキ	16.1	16.1	55,786

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
ステップ	千株	千株	千円	
	3.5	3.5	5,267	
合 計	株数・金額	118,785	105,735	267,300,754
	銘柄数<比率>	2,157	2,190	<99.5%>

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 株式先物取引 TOPIX	百万円 1,066	百万円 -

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2021年2月22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)		株 18,877,800 (12,582,600)

(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

(2021年2月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 267,300,754	% 84.8
コール・ローン等、その他	48,088,806	15.2
投資信託財産総額	315,389,560	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年2月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	315,386,616,184
コール・ローン等	47,649,250,684
株式(評価額)	267,300,754,930
未収入金	4,358,336
未収配当金	309,349,051
その他未収収益	56,643,183
差入委託証拠金	66,260,000
(B) 負債	46,824,266,069
未払金	3,270,250
未払解約金	209,363,733
未払利息	△ 426,978
受入担保金	46,612,059,064
(C) 純資産総額(A-B)	268,562,350,115
元本	158,092,879,428
次期繰越損益金	110,469,470,687
(D) 受益権総口数	158,092,879,428口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,988円

＜注記事項＞

- ①期首元本額 166,600,985,942円
 期中追加設定元本額 42,418,863,640円
 期中一部解約元本額 50,926,970,154円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.6988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 プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	47,631,951,071円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	46,417,918,397円
三菱UFJ DCトピックスオープン	14,195,735,785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)	11,800,078,186円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	9,779,461,236円
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	7,861,080,744円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	4,427,828,787円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	4,419,090,933円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,916,669,509円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,631,857,666円
三菱UFJ トピックスオープン	1,571,594,001円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	1,192,300,440円
三菱UFJ DC年金インデックス(国内株式)	491,137,452円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	422,027,762円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	403,302,407円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	350,619,305円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	196,597,609円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	157,533,506円
三菱UFJ トピックスオープンVA(適格機関投資家限定)	122,401,558円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	103,609,865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)	83,209円
合計	158,092,879,428円

○損益の状況 (2020年2月21日～2021年2月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,515,911,034
受取配当金	5,035,260,416
受取利息	403,190
その他収益金	479,572,946
支払利息	674,482
(B) 有価証券売買損益	38,113,351,419
売買益	49,986,273,767
売買損	△ 11,872,922,348
(C) 先物取引等取引損益	744,788,600
取引益	1,295,709,200
取引損	△ 550,920,600
(D) 当期損益金(A+B+C)	44,374,051,053
(E) 前期繰越損益金	72,002,826,555
(F) 追加信託差損益金	15,324,400,984
(G) 解約差損益金	△ 21,231,807,905
(H) 計(D+E+F+G)	110,469,470,687
次期繰越損益金(H)	110,469,470,687

(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) (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。

三菱UFJ 外国株式マザーファンド

《第21期》決算日2021年5月20日

[計算期間：2020年5月21日～2021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21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21期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託 証券組入比率	純資産額
	円	%	期騰落率	期中率				
17期(2017年5月22日)	20,708	20.8	663,775.10	20.5	95.7	1.7	2.5	105,751
18期(2018年5月21日)	23,482	13.4	751,162.81	13.2	95.2	2.5	2.2	106,222
19期(2019年5月20日)	24,065	2.5	767,061.93	2.1	94.3	3.1	2.5	97,464
20期(2020年5月20日)	23,411	△ 2.7	744,889.56	△ 2.9	95.4	2.3	2.4	94,605
21期(2021年5月20日)	34,278	46.4	1,088,325.89	46.1	95.5	2.4	2.1	115,732

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

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、 円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2020年5月20日	円	%		%	%	%	%
5月末	23,411	—	744,889.56	—	95.4	2.3	2.4
6月末	24,271	3.7	771,854.96	3.6	94.6	2.5	2.4
7月末	24,739	5.7	786,657.58	5.6	95.0	2.2	2.4
8月末	25,565	9.2	811,586.48	9.0	92.3	2.2	2.3
9月末	27,528	17.6	874,908.07	17.5	92.5	2.0	2.2
10月末	26,446	13.0	840,357.13	12.8	99.6	2.1	2.4
11月末	25,714	9.8	816,782.18	9.7	96.2	3.7	2.3
12月末	28,679	22.5	911,163.19	22.3	91.8	3.3	2.1
2021年1月末	29,509	26.0	937,198.09	25.8	95.7	1.8	2.1
2月末	30,122	28.7	957,202.82	28.5	93.2	4.5	2.0
3月末	31,146	33.0	991,253.74	33.1	95.0	1.2	2.1
4月末	33,231	41.9	1,054,673.72	41.6	94.7	1.7	2.1
5月末	34,795	48.6	1,104,127.55	48.2	91.7	2.8	2.1
(期 末) 2021年5月20日	34,278	46.4	1,088,325.89	46.1	95.5	2.4	2.1

(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46.4%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(46.1%)を0.3%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

◎ 外国株式市況

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

◎ 為替市況

- ・ 米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

(注) マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは46.1%の上昇になったため、カイ離は0.3%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

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

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年5月21日～2021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)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(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	0.003	(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)	(0.003)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	10	0.034	(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)	(10)	(0.034)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	12	0.040	
期中の平均基準価額は、28,820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。

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク	百株 148 (381)	千デンマーククローネ 4,950 (-)	百株 482	千デンマーククローネ 12,414
	オーストラリア	2,201 (261)	千オーストラリアドル 3,211 (78)	5,512 (223)	千オーストラリアドル 7,414 (181)
	ニュージーランド	74	千ニュージーランドドル 48	420	千ニュージーランドドル 292
国	香港	2,694 (△ 641)	千香港ドル 6,190 (-)	6,066 (170)	千香港ドル 20,448 (204)
	シンガポール	524	千シンガポールドル 339	3,412	千シンガポールドル 1,270
	イスラエル	1	千イスラエルシェケル 101	74	千イスラエルシェケル 452

(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
外	アメリカ	証券 — (2,626)	千アメリカドル — (15)	証券 2,626	千アメリカドル 11
	スイス	— (24,292)	千スイスフラン — (3)	24,292	千スイスフラン 3

(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。

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
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1	47	2	79
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.228	36	0.533	91
PROLOGIS INC	1	120	3	415
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	0.278	30
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	—	3	147
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	163	1	283
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	—	0.689	47
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.141	28	0.331	76
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.27	28	0.702	74
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.388	28	2	190
WELLTOWER INC	0.62	33	2	183
BOSTON PROPERTIES INC	—	—	0.78	69
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	—	0.777	94
REALTY INCOME CORP	1	72	1	104
REGENCY CENTERS CORP	—	—	0.757	48
SL GREEN REALTY CORP	—	—	1	78
SUN COMMUNITIES INC	0.832	120	0.935	142
UDR INC	1	54	2	98
VENTAS INC	0.782	33	1	80
WEYERHAEUSER CO	1	29	3	109
AMERICAN TOWER CORP	0.541	129	2	548
WP CAREY INC	0.441	28	1	88
VEREIT INC	—	—	10	107
	(△ 20)	(—)		
DUKE REALTY CORP	—	—	0.725	30
IRON MOUNTAIN INC	—	—	0.844	31
EQUINIX INC	0.173	133	0.43	313
CROWN CASTLE INTL CORP	1	171	2	398
EQUITY RESIDENTIAL	0.556	28	2	152
INVITATION HOMES INC	1	29	3	87
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.208	62	0.672	190
HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	2	49
PUBLIC STORAGE	0.133	29	0.757	171
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	91	2	195
VORNADO REALTY TRUST	—	—	1	48
KIMCO REALTY CORP	—	—	9	107
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.211	31	0.644	108
小計	16 (△ 20)	1,533 (—)	76	5,077
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	—	—	1	43
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	—	—	3	35
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3	66	3	63

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
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	—	2	37
小 計	3	66	11	179
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	—	—	0.371	42
KLEPIERRE	—	—	—	—
ICADE	(—)	(△ 3)	—	—
小 計	—	—	0.634	39
オランダ				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.796	23	1	61
小 計	0.796	23	1	61
ユ ー ロ 計	0.796	23	2	143
	(—)	(△ 3)		
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	12	47	14	61
SEGRO PLC	2	22	3	29
小 計	15	69	17	90
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	25	41	—	—
SCENTRE GROUP	—	—	14	40
GPT GROUP	—	—	13	60
MIRVAC GROUP	—	—	23	61
STOCKLAND	—	—	11	53
DEXUS	4	40	14	125
GOODMAN GROUP	2	42	10	195
小 計	32	124	88	537
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	3	230	15	957
小 計	3	230	15	957
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	—	—	52	76
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	58	95
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	64	132	—	—
	(—)	(△0.80742)	—	—
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△0.47528)	—	—
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	40	78	19	42
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	24	78	15	50
	(—)	(△ 3)	—	—
小 計	130	288	144	264
	(—)	(△ 4)		

(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 32,295	百万円 32,621	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

(2020年5月21日～2021年5月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	36,089,425千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	102,058,084千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.35

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月21日～2021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 16,435	百万円 17,914	% 91.7	百万円 35,334	百万円 38,320	% 92.2

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

○組入資産の明細

(2021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	167	137	2,123	231,960	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	424	354	4,125	450,729	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	73	60	785	85,864	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	104	85	1,639	179,157	ソフトウェア・サービス
AES CORP	158	136	341	37,271	公益事業
AFLAC INC	184	133	746	81,550	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	208	168	852	93,176	保険
APACHE CORP	85	—	—	—	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	254	240	1,835	200,532	半導体・半導体製造装置
ACCENTURE PLC-CL A	152	127	3,568	389,838	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	52	44	1,318	143,997	素材
ANTHEM INC	61	49	1,957	213,836	ヘルスケア機器・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	335	285	1,180	129,006	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	116	102	842	92,073	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	128	107	2,410	263,371	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	65	58	1,407	153,775	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	56	48	547	59,805	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	562	451	2,962	323,642	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	36	30	2,559	279,588	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	988	829	4,722	515,887	電気通信サービス
BALL CORP	75	68	583	63,793	素材
ALLSTATE CORP	77	59	808	88,277	保険
EVERETT DENNISON CORP	18	17	380	41,607	素材
CHUBB LTD	108	90	1,504	164,315	保険
ANALOG DEVICES INC	88	73	1,131	123,572	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	5	4	663	72,433	小売
CVS HEALTH CORP	312	261	2,335	255,155	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	201	158	684	74,736	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	750	609	9,825	1,073,413	銀行
CATERPILLAR INC	132	108	2,573	281,113	資本財
COCA-COLA CO/THE	974	817	4,430	484,027	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	112	90	1,424	155,650	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	37	34	169	18,469	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	177	153	1,506	164,561	運輸
CHEVRON CORP	454	385	3,977	434,568	エネルギー
TAPESTRY INC	59	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	267	270	1,504	164,372	エネルギー
CME GROUP INC	86	71	1,521	166,209	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	70	55	310	33,973	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	195	163	1,359	148,578	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	197	161	1,246	136,158	公益事業
DEVON ENERGY CORP	85	112	283	31,023	エネルギー
DEERE & CO	71	59	2,132	232,986	資本財
DANAHER CORP	149	127	3,188	348,390	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	432	362	6,133	670,047	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	28	26	372	40,703	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	174	147	1,488	162,648	公益事業

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	
DR HORTON INC	86	71	650	71,116	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	122	100	2,192	239,507	小売
DAVITA INC	22	16	196	21,497	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	35	27	403	44,114	資本財
DTE ENERGY COMPANY	46	39	552	60,306	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,015	846	4,991	545,312	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	50	123	1,123	122,764	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	143	115	926	101,223	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	146	119	1,112	121,588	資本財
EXELON CORP	233	195	888	97,111	公益事業
ECOLAB INC	62	53	1,141	124,712	素材
EQUIFAX INC	28	24	565	61,817	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	52	45	1,355	148,084	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	102	79	1,133	123,852	資本財
EDISON INTERNATIONAL	83	72	418	45,736	公益事業
ENTERGY CORP	51	38	409	44,730	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	9	8	222	24,292	保険
NEXTERA ENERGY INC	116	392	2,849	311,300	公益事業
FEDEX CORP	59	49	1,535	167,702	運輸
FORD MOTOR CO	991	777	941	102,895	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	70	60	202	22,086	各種金融
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	8	7	249	27,261	各種金融
FIRSTENERGY CORP	127	112	419	45,840	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	321	291	1,186	129,585	素材
GENERAL MILLS INC	146	119	750	81,972	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	60	48	915	99,972	資本財
WW GRAINGER INC	11	8	399	43,610	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,102	1,751	2,293	250,526	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	72	60	1,169	127,799	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	35	26	346	37,843	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	76	65	2,342	255,904	各種金融
HALLIBURTON CO	196	178	402	44,007	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	171	140	3,109	339,717	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	42	—	—	—	自動車・自動車部品
HP INC	368	281	894	97,741	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	88	70	464	50,729	保険
HERSHEY CO/THE	35	29	507	55,467	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	261	215	6,771	739,737	小売
HASBRO INC	29	26	250	27,352	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	56	47	847	92,640	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	212	178	2,554	279,127	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	91	71	452	49,436	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	76	63	1,468	160,447	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	92	76	248	27,105	メディア・娯楽
IDEX CORP	18	15	345	37,696	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	23	45	650	71,058	素材
JOHNSON & JOHNSON	631	526	8,955	978,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	26	19	565	61,831	運輸
KELLOGG CO	61	54	359	39,277	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	82	66	882	96,393	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	344	287	1,794	196,037	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	188	148	541	59,125	食品・生活必需品小売り

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	
KOHL'S CORP	37	—	—	—	小売
ELI LILLY & CO	207	172	3,382	369,541	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	21	20	534	58,406	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	27	31	190	20,855	運輸
LENNAR CORP-A	69	54	514	56,184	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	185	146	2,794	305,249	小売
LEGGETT & PLATT INC	27	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LAS VEGAS SANDS CORP	82	64	363	39,699	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	60	50	1,944	212,454	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	51	39	272	29,804	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	8	6	227	24,908	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	68	54	764	83,475	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	180	149	3,433	375,146	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	58	48	1,786	195,148	各種金融
MEDTRONIC PLC	321	269	3,385	369,912	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	611	505	4,013	438,506	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	265	222	1,780	194,521	半導体・半導体製造装置
3M CO	138	115	2,337	255,360	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	41	32	655	71,625	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	112	98	385	42,106	消費者サービス
MASCO CORP	70	53	328	35,870	資本財
M & T BANK CORP	33	26	433	47,401	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	120	101	1,365	149,179	保険
MOLINA HEALTHCARE INC	—	10	282	30,867	ヘルスケア機器・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	13	12	255	27,863	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	289	281	2,421	264,524	各種金融
MCKESSON CORP	39	32	652	71,238	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	183	153	997	108,988	保険
MANPOWERGROUP INC	13	—	—	—	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	40	33	1,084	118,472	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	62	50	1,420	155,183	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,047	1,557	6,538	714,318	銀行
NISOURCE INC	93	76	191	20,934	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	38	31	1,159	126,708	資本財
NEWMONT CORP	195	166	1,226	133,988	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	29	48	433	47,400	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	3	2	357	39,043	保険
NUCOR CORP	74	58	592	64,755	素材
NEWELL BRANDS INC	85	85	241	26,393	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	102	—	—	—	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	210	190	476	52,085	エネルギー
OMNICOM GROUP	53	39	325	35,553	メディア・娯楽
PEPSICO INC	333	277	4,031	440,405	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	20	19	289	31,658	素材
ALTRIA GROUP INC	449	372	1,840	201,020	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	27	23	199	21,793	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	597	496	6,781	740,849	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	104	84	1,629	177,984	銀行
PFIZER INC	1,328	1,111	4,427	483,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	98	77	829	90,618	保険
PULTEGROUP INC	63	54	302	33,062	耐久消費財・アパレル
PARKER HANFIFIN CORP	30	26	806	88,159	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	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	46	41	640	69,994	エネルギー
CITIGROUP INC	524	416	3,186	348,130	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	61	57	377	41,216	保険
PPG INDUSTRIES INC	55	48	848	92,689	素材
PENTAIR PLC	34	34	229	25,084	資本財
P G & E CORP	—	277	291	31,885	公益事業
PPL CORP	172	157	461	50,469	公益事業
PROGRESSIVE CORP	140	117	1,181	129,100	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	120	102	634	69,277	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	40	48	407	44,530	消費者サービス
REPUBLIC SERVICES INC	58	43	467	51,073	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	214	198	448	49,046	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	10	163	17,855	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	24	21	905	98,946	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	111	111	273	29,924	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	24	21	187	20,479	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	22	579	63,268	資本財
SCHLUMBERGER LTD	375	272	871	95,241	エネルギー
STRYKER CORP	81	67	1,709	186,762	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	275	305	2,177	237,934	各種金融
SEMPRA ENERGY	67	56	763	83,456	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19	49	1,380	150,785	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	40	31	656	71,669	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	64	49	775	84,732	保険
SOUTHERN CO/THE	250	211	1,351	147,645	公益事業
AT&T INC	1,751	1,427	4,133	451,615	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	71	63	450	49,194	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	88	67	568	62,066	各種金融
SYSCO CORP	117	95	773	84,496	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	37	31	172	18,873	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	224	183	3,342	365,154	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	25	—	—	—	小売
TERADYNE INC	39	33	409	44,706	半導体・半導体製造装置
GLOBE LIFE INC	23	18	192	21,046	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	186	145	918	100,354	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	96	79	3,622	395,779	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	54	46	309	33,840	資本財
UNION PACIFIC CORP	166	134	2,998	327,573	運輸
UNUM GROUP	46	—	—	—	保険
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	362	304	2,593	283,315	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	227	189	7,774	849,393	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	356	271	1,631	178,234	銀行
MARATHON OIL CORP	170	—	—	—	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	168	143	3,066	335,014	運輸
VALERO ENERGY CORP	97	84	651	71,173	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	145	114	454	49,605	メディア・娯楽
VF CORP	80	68	581	63,488	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	31	25	469	51,282	素材
WILLIAMS COS INC	314	232	604	66,018	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	179	146	803	87,736	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	74	65	621	67,887	公益事業

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	
WALMART INC	340	283	4,021	439,327	食品・生活必需品小売り
WELLS FARGO & CO	961	786	3,629	396,499	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	100	83	1,165	127,287	商業・専門サービス
WATERS CORP	16	12	395	43,188	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	13	13	315	34,508	耐久消費財・アパレル
XCEL ENERGY INC	126	107	758	82,910	公益事業
KEYCORP	229	183	421	46,023	銀行
CARMAX INC	41	34	396	43,346	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	48	40	669	73,179	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC	76	59	701	76,673	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	292	239	1,616	176,582	小売
CLOROX COMPANY	29	25	466	51,000	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	27	23	391	42,779	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	66	58	715	78,189	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	93	145	401	43,848	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	147	124	1,836	200,622	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	117	92	346	37,883	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	81	68	536	58,629	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	193	139	579	63,336	銀行
INTEL CORP	1,044	819	4,538	495,839	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,017	844	4,430	484,005	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	21	18	630	68,884	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	105	88	3,353	366,415	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	221	182	2,273	248,364	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	68	56	784	85,664	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	69	62	494	54,013	食品・飲料・タバコ
NORTONLIFELOCK INC	147	112	296	32,365	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	90	71	888	97,095	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	57	51	752	82,156	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	299	250	3,335	364,367	耐久消費財・アパレル
EXACT SCIENCES CORP	36	32	316	34,624	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	142	116	2,889	315,686	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	32	—	—	—	銀行
NORTHERN TRUST CORP	47	38	452	49,393	各種金融
MICROSOFT CORP	1,737	1,436	34,933	3,816,476	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	20	16	540	59,067	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	141	118	841	91,963	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	284	235	2,578	281,695	消費者サービス
ORACLE CORP	550	391	3,083	336,893	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	105	88	4,310	470,899	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18	14	764	83,504	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	184	154	1,458	159,349	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	41	33	550	60,107	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	31	25	199	21,769	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	26	23	431	47,179	小売
POOL CORP	—	8	362	39,589	小売
LAM RESEARCH CORP	34	28	1,728	188,884	半導体・半導体製造装置
COPART INC	49	41	499	54,604	商業・専門サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	20	15	141	15,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WYNN RESORTS LTD	20	20	256	27,982	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,088	913	4,956	541,545	メディア・娯楽
XILINX INC	60	49	602	65,780	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	
PACCAR INC	81	72	660	72,122	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	63	45	308	33,662	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	18	14	853	93,278	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	304	249	1,710	186,903	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	30	24	279	30,532	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	27	23	1,923	210,190	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	62	52	2,220	242,596	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	12	10	593	64,883	銀行
PAYCHEX INC	83	65	646	70,602	ソフトウェア・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	88	77	288	31,536	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	12	—	—	—	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	32	21	256	27,971	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	20	18	488	53,330	運輸
AUTODESK INC	53	43	1,204	131,637	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	37	37	103	11,335	電気通信サービス
SALESFORCE.COM INC	200	182	4,033	440,609	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	71	60	13,660	1,492,442	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	12	10	530	57,933	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EAST WEST BANCORP INC	34	—	—	—	銀行
MARKETAXESS HOLDINGS INC	9	7	340	37,181	各種金融
GARMIN LTD	32	27	378	41,300	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	54	47	357	39,103	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	274	226	2,957	323,105	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	59	51	321	35,077	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSIS INC	35	31	739	80,750	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	65	55	520	56,818	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	101	85	27,570	3,012,075	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	58	44	828	90,474	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	29	28	369	40,392	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	37	30	939	102,604	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	50	43	273	29,849	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	49	—	—	—	各種金融
CERNER CORP	74	64	506	55,292	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	25	20	453	49,542	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	64	53	642	70,230	商業・専門サービス
EBAY INC	183	134	802	87,692	小売
IAC/INTERACTIVECORP	19	—	—	—	メディア・娯楽
NVIDIA CORP	139	123	6,968	761,272	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	55	45	489	53,483	小売
BOOKING HOLDINGS INC	10	8	1,861	203,358	消費者サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	314	274	7,855	858,161	各種金融
TRUIST FINANCIAL CORP	322	268	1,622	177,248	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	207	163	833	91,053	各種金融
BORGWARNER INC	44	50	253	27,722	自動車・自動車部品
JM SMUCKER CO/THE	27	23	317	34,729	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	37	31	371	40,629	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	13	13	205	22,498	保険
AMEREN CORPORATION	63	46	394	43,120	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	118	99	851	93,041	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	141	107	715	78,126	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	60	58	480	52,494	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	73	73	190	20,823	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	66	—	—	—	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	13	12	230	25,190	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	55	44	191	20,874	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	39	34	389	42,519	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER INC	—	98	271	29,704	資本財
NETAPP INC	54	45	356	38,908	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	44	33	276	30,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	152	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	43	30	862	94,221	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	35	29	1,128	123,325	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	116	96	4,619	504,651	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	62	51	1,105	120,830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	251	224	237	25,911	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	133	104	740	80,861	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	39	34	416	45,529	運輸
FASTENAL CO	135	110	573	62,673	資本財
FISERV INC	138	114	1,293	141,267	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	105	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC	338	207	120	13,141	メディア・娯楽
APPLE INC	1,065	3,401	42,418	4,634,252	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	41	30	370	40,476	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	250	212	332	36,342	銀行
ZIONS BANCORP NA	43	—	—	—	銀行
COSTAR GROUP INC	9	8	666	72,822	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	52	44	779	85,191	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	29	27	268	29,352	運輸
LUMEN TECHNOLOGIES INC	239	189	272	29,820	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	31	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	123	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	97	91	484	52,892	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	56	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	34	28	241	26,345	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	16	13	252	27,635	小売
NOV INC	83	—	—	—	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	40	33	774	84,616	食品・飲料・タバコ
NVR INC	0.98	0.73	343	37,528	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	11	11	427	46,696	ヘルスケア機器・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	74	118	779	85,150	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	34	26	210	22,965	保険
DISCOVERY INC - A	29	38	128	14,089	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	95	81	738	80,685	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	33	27	455	49,774	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	47	44	237	25,892	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	103	65	180	19,720	電気通信サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	30	23	600	65,618	各種金融
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	58	55	255	27,922	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INT	133	112	1,243	135,900	各種金融
NASDAQ INC	28	21	350	38,242	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	41	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT INT	32	32	280	30,691	メディア・娯楽
AUTOLIV INC	17	17	180	19,673	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	75	68	582	63,611	不動産

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	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	5	712	77,831	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	72	59	465	50,903	食品・飲料・タバコ
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	9	288	31,549	半導体・半導体製造装置
ARROW ELECTRONICS INC	17	13	159	17,421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN & BROWN INC	56	49	257	28,097	保険
CUMMINS INC	35	29	757	82,785	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	29	26	356	38,967	商業・専門サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	57	—	—	—	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	14	12	468	51,223	素材
RALPH LAUREN CORP	11	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	60	46	270	29,514	公益事業
HANESBRANDS INC	88	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	215	178	6,428	702,334	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	99	81	201	22,059	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	32	28	293	32,032	商業・専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	26	—	—	—	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	21	—	—	—	資本財
IPG PHOTONICS CORP	7	7	153	16,751	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	81	72	254	27,786	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	47	47	81	8,897	消費者サービス
HEICO CORP	10	7	98	10,796	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	11	10	590	64,519	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	28	23	378	41,312	ソフトウェア・サービス
INSULET CORP	13	13	328	35,863	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	30	24	652	71,320	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	118	—	—	—	銀行
BLACKSTONE GROUP INC/THE	159	134	1,180	128,977	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	84	65	866	94,639	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	86	59	679	74,226	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	26	25	789	86,211	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	10	—	—	—	自動車・自動車部品
MERCADOLIBRE INC	10	8	1,184	129,438	小売
VMWARE INC-CLASS A	17	17	279	30,516	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	64	45	266	29,088	保険
SEAGEN INC	28	25	382	41,742	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MASIMO CORP	—	10	223	24,424	ヘルスケア機器・サービス
ULTA BEAUTY INC	13	10	325	35,549	小売
LKQ CORP	68	57	284	31,072	小売
HORMEL FOODS CORP	68	59	274	30,027	食品・飲料・タバコ
ESSENTIAL UTILITIES INC	50	50	232	25,397	公益事業
EASTMAN CHEMICAL CO	31	27	339	37,061	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	52	41	891	97,366	資本財
HUMANA INC	31	26	1,175	128,425	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	54	51	175	19,144	公益事業
INVESCO LTD	83	83	224	24,512	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	43	38	294	32,159	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	26	21	130	14,284	各種金融
CONCHO RESOURCES INC	44	—	—	—	エネルギー
MSCI INC	21	16	725	79,265	各種金融
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	46	38	215	23,513	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	373	311	3,003	328,145	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	410	338	7,610	831,491	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	
KEURIG DR PEPPER INC	—	113	405	44,320	食品・飲料・タバコ
CABOT OIL & GAS CORP	97	81	146	15,969	エネルギー
FLOWSERVE CORP	32	—	—	—	資本財
T-MOBILE US INC	102	112	1,507	164,728	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C	85	58	181	19,827	メディア・娯楽
RESMED INC	35	27	540	59,026	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	21	18	417	45,558	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	60	47	624	68,198	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	97	82	331	36,174	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	59	47	420	45,932	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	18	17	292	31,941	運輸
PERRIGO CO PLC	31	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP	32	27	317	34,720	素材
WABTEC CORP	44	37	296	32,369	資本財
EVERSOURCE ENERGY	78	67	561	61,391	公益事業
INGREDION INC	14	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CROWN HOLDINGS INC	32	28	308	33,744	素材
EATON VANCE CORP	29	—	—	—	各種金融
DELTA AIR LINES INC	41	31	144	15,828	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	45	37	568	62,085	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	37	32	557	60,902	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	61	49	1,002	109,551	小売
FORTINET INC	34	26	557	60,896	ソフトウェア・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	5	4	601	65,763	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	307	257	1,427	155,973	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	69	55	1,078	117,816	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	64	55	612	66,885	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	9	8	178	19,540	資本財
NORDSON CORP	—	11	227	24,847	資本財
HCA HEALTHCARE INC	64	53	1,085	118,642	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	31	—	—	—	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	158	133	795	86,878	エネルギー
ZILLOW GROUP INC - A	—	12	138	15,079	メディア・娯楽
ATMOS ENERGY CORP	29	25	247	27,032	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	34	25	263	28,750	資本財
DEXCOM INC	22	19	637	69,701	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	13	—	—	—	資本財
XYLEM INC	41	37	423	46,281	資本財
ABIOMED INC	10	9	252	27,597	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC	25	—	—	—	メディア・娯楽
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12	9	169	18,529	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	34	639	69,873	銀行
ALLEGHANY CORP	3	2	185	20,244	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	19	21	1,102	120,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	108	83	716	78,262	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	577	480	15,083	1,647,857	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	69	60	382	41,758	公益事業
ALBEMARLE CORP	24	23	369	40,319	素材
PVH CORP	15	—	—	—	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	489	397	734	80,205	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	86	—	—	—	商業・専門サービス
APTIV PLC	61	52	721	78,771	自動車・自動車部品

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	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	36	31	176	19,327	資本財
SPLUNK INC	39	32	367	40,200	ソフトウェア・サービス
HEICO CORP-CLASS A	19	16	192	21,034	資本財
OGE ENERGY CORP	45	45	153	16,739	公益事業
POLARIS INC	13	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	423	352	4,085	446,322	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8	9	373	40,771	資本財
SAREPTA THERAPEUTICS INC	15	17	135	14,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	32	151	8,545	933,650	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	51	47	393	43,003	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29	25	331	36,258	各種金融
ZOETIS INC	114	95	1,629	177,973	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	17	14	461	50,411	ヘルスケア機器・サービス
NEWS CORP - CLASS A	103	81	211	23,119	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	12	9	234	25,583	資本財
PERKINELMER INC	25	22	325	35,590	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAPRI HOLDINGS LTD	35	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	175	159	843	92,157	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	18	16	249	27,298	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	39	35	800	87,429	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	45	39	1,797	196,344	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20	15	241	26,385	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	20	17	466	50,948	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	23	19	264	28,875	資本財
ALPHABET INC-CL C	74	59	13,713	1,498,225	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	18	14	480	52,484	資本財
VOYA FINANCIAL INC	34	26	176	19,322	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	9	—	—	—	素材
IQVIA HOLDINGS INC	42	37	869	94,952	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	81	71	383	41,943	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	69	55	671	73,356	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	25	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	33	—	—	—	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	46	38	525	57,443	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	25	30	485	52,992	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-A	—	5	87	9,602	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	27	22	397	43,381	メディア・娯楽
OWENS CORNING	22	22	233	25,564	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	47	—	—	—	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	23	18	617	67,458	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	138	108	496	54,227	各種金融
QORVO INC	25	22	388	42,465	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	30	30	108	11,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	44	40	585	63,932	保険
ACUITY BRANDS INC	9	—	—	—	資本財
JONES LANG LASALLE INC	11	—	—	—	不動産
ARAMARK	53	41	152	16,714	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	104	89	436	47,643	銀行
LEAR CORP	14	12	228	25,000	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	27	24	329	35,997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	55	42	134	14,713	素材
TARGA RESOURCES CORP	51	—	—	—	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	8	8	103	11,262	ソフトウェア・サービス
GRUBHUB INC	22	—	—	—	小売
WESTROCK CO	54	51	301	32,975	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	159	136	596	65,117	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	267	222	5,450	595,424	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	12	11	504	55,164	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	11	10	320	35,059	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	28	29	314	34,335	メディア・娯楽
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	44	404	44,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	314	243	392	42,826	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	1	1	107	11,778	運輸
CDW CORP/DE	34	28	472	51,583	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	—	10	255	27,957	半導体・半導体製造装置
ARISTA NETWORKS INC	12	11	373	40,829	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	40	35	266	29,096	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	44	39	415	45,410	商業・専門サービス
GODADDY INC - CLASS A	40	35	285	31,212	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	13	—	—	—	メディア・娯楽
ZENDESK INC	—	24	330	36,057	ソフトウェア・サービス
WAYFAIR INC- CLASS A	14	14	436	47,650	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	48	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	41	31	128	13,992	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP -RIGHT	5	—	—	—	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	16	21	88	9,647	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	51	39	175	19,151	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC	10	8	249	27,294	消費者サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	5	4	270	29,517	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC	9	7	344	37,610	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	36	28	1,905	208,127	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	20	17	897	98,088	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A. O.) CORP	28	24	169	18,471	資本財
UGI CORP	44	40	177	19,445	公益事業
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	50	38	229	25,091	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	74	57	396	43,359	資本財
IHS MARKIT LTD	93	75	773	84,495	商業・専門サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	57	47	350	38,257	ソフトウェア・サービス
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	18	18	180	19,754	ソフトウェア・サービス
COUPA SOFTWARE INC	—	12	291	31,864	ソフトウェア・サービス
HOWMET AEROSPACE INC	86	71	241	26,355	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	35	29	228	24,987	食品・飲料・タバコ
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	13	12	160	17,499	保険
TELEFLEX INC	11	8	347	38,011	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	8	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TECHNIPFMC PLC	89	—	—	—	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	31	26	678	74,176	ヘルスケア機器・サービス
TWILIO INC - A	27	27	820	89,608	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	26	20	225	24,616	各種金融
SNAP INC - A	184	184	994	108,664	メディア・娯楽
DXC TECHNOLOGY CO	62	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	30	24	152	16,613	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	18	13	177	19,358	保険
HD SUPPLY HOLDINGS INC	34	—	—	—	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	
ROLLINS INC	33	37	131	14,341	商業・専門サービス
XPO LOGISTICS INC	21	18	263	28,756	運輸
FAIR ISAAC CORP	—	5	287	31,446	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	160	137	347	37,944	エネルギー
OKTA INC	25	23	541	59,118	ソフトウェア・サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	178	104	884	96,624	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	26	25	120	13,183	運輸
BLACK KNIGHT INC	34	28	201	21,998	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	85	76	1,537	167,944	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	84	82	135	14,837	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	86	74	353	38,616	資本財
NOVOCURE LTD	—	18	327	35,726	ヘルスケア機器・サービス
HUBSPOT INC	—	9	456	49,875	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	8	8	329	36,010	ソフトウェア・サービス
PTC INC	26	22	291	31,872	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC	—	14	239	26,179	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	95	80	3,576	390,696	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	56	42	266	29,160	公益事業
ALTICE USA INC- A	34	45	164	18,013	メディア・娯楽
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	8	441	48,277	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	5	5	116	12,725	保険
DOCUSIGN INC	23	36	698	76,348	ソフトウェア・サービス
TELADOC HEALTH INC	—	22	302	32,996	ヘルスケア機器・サービス
LINDE PLC	129	105	3,111	339,888	素材
WIX.COM LTD	11	10	247	26,996	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	97	81	272	29,798	各種金融
BURLINGTON STORES INC	15	13	443	48,400	小売
KKR & CO INC	119	106	583	63,724	各種金融
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	89	89	315	34,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIGNA CORP	90	72	1,896	207,164	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	33	50	488	53,363	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MONGODB INC	10	10	291	31,860	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	84	59	223	24,409	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	46	36	133	14,542	メディア・娯楽
DOW INC	181	147	1,014	110,793	素材
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	38	1,204	131,600	ソフトウェア・サービス
AVALARA INC	—	17	218	23,829	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	48	59	158	17,283	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	19	17	328	35,900	ヘルスケア機器・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	104	191	945	103,287	運輸
CORTEVA INC	192	144	646	70,613	素材
AMCOR PLC	382	298	358	39,144	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	37	735	80,388	ソフトウェア・サービス
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	—	86	359	39,251	ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	19	155	16,963	各種金融
XEROX HOLDINGS CORP	45	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROKU INC	22	22	726	79,322	メディア・娯楽
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	32	28	230	25,130	商業・専門サービス
DATADOG INC - CLASS A	—	37	311	34,050	ソフトウェア・サービス
PINTEREST INC- CLASS A	65	101	597	65,308	メディア・娯楽
CABLE ONE INC	—	1	185	20,275	メディア・娯楽
CARVANA CO	—	12	276	30,234	小売

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		
CHEWY INC - CLASS A	—	16	114	12,531		小売
PELTON INTERACTIVE INC-A	—	46	449	49,143		耐久消費財・アパレル
ETSY INC	—	26	430	47,059		小売
AVANTOR INC	—	102	318	34,832		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MODERNA INC	—	56	894	97,711		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	13	200	21,943		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	28	249	27,278		ソフトウェア・サービス
DYNATRACE INC	—	35	167	18,268		ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	41	295	32,288		ソフトウェア・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	17	14	357	39,064		ソフトウェア・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	30	25	240	26,247		素材
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	338	298	277	30,315		各種金融
AGNC INVESTMENT CORP	124	97	179	19,629		各種金融
PPD INC	—	26	119	13,100		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAC HOLDINGS INC	—	12	361	39,539		資本財
AON PLC-CLASS A	55	45	1,151	125,766		保険
OTIS WORLDWIDE CORP	93	80	622	67,971		資本財
CARRIER GLOBAL CORP	187	161	702	76,792		資本財
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	31	176	19,301		各種金融
CARLYLE GROUP INC/THE	—	33	138	15,156		各種金融
CATALENT INC	—	35	358	39,201		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MATCH GROUP INC	—	49	681	74,506		メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	—	16	397	43,477		メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	4	105	11,498		ソフトウェア・サービス
SUNRUN INC	—	27	114	12,544		資本財
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	37	148	16,173		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIATRIS INC	—	260	403	44,032		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DRAFTKINGS INC - CL A	—	37	160	17,559		消費者サービス
ENPHASE ENERGY INC	—	23	303	33,205		半導体・半導体製造装置
AIRBNB INC-CLASS A	—	11	152	16,606		消費者サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	166	740	80,930		半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	47	473	51,676		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	280	185	88	9,620		不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	53	—	—	—		資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	51	44	287	31,356		資本財
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	80	—	—	—		食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	72,003	62,982	721,434	78,816,675	
	銘柄数<比率>	602	593	—	<68.1%>	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	342	285	3,500	315,679		銀行
IMPERIAL OIL LTD	60	42	160	14,500		エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	44	34	386	34,858		商業・専門サービス
TC ENERGY CORP	224	185	1,112	100,355		エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	94	74	456	41,129		電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	154	121	788	71,082		保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	113	92	261	23,601		素材
BARRICK GOLD CORP	424	363	1,082	97,573		素材
BCE INC	33	26	154	13,935		電気通信サービス
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	48	89	8,076		資本財
BANK OF MONTREAL	160	129	1,573	141,909		銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	305	256	1,518	136,926		各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	292	242	1,918	172,976		銀行

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	
BAUSCH HEALTH COS INC	67	63	230	20,825	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	60	60	214	19,384	資本財
CAMECO CORP	75	69	161	14,546	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	45	—	—	—	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	108	88	1,177	106,161	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	301	242	973	87,764	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	172	142	1,831	165,160	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	13	10	206	18,629	小売
ENBRIDGE INC	489	404	1,860	167,717	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6	5	309	27,871	保険
CGI INC	60	43	459	41,456	ソフトウェア・サービス
IGM FINANCIAL INC	23	23	103	9,338	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	44	31	229	20,732	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	470	386	961	86,700	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	66	59	684	61,712	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	80	68	627	56,612	銀行
ONEX CORPORATION	21	14	120	10,856	各種金融
POWER CORP OF CANADA	138	116	448	40,416	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	112	90	320	28,922	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY INC	380	294	814	73,432	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	16	16	196	17,737	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34	135	1,283	115,703	運輸
AGNICO EAGLE MINES LTD	58	51	445	40,215	素材
KINROSS GOLD CORP	328	214	207	18,717	素材
GREAT-WEST LIFE CO INC	56	56	208	18,809	保険
TMX GROUP LTD	—	11	145	13,153	各種金融
METHANEX CORP	13	—	—	—	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	42	42	176	15,924	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	57	42	165	14,951	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	131	109	112	10,172	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	114	114	300	27,137	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	163	122	340	30,725	素材
YAMANA GOLD INC	—	229	144	13,008	素材
FORTIS INC	104	98	538	48,513	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	220	168	734	66,199	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	162	118	155	14,023	素材
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	36	144	13,010	素材
TORONTO-DOMINION BANK	431	363	3,179	286,697	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	46	37	663	59,836	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	109	91	518	46,746	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	37	37	151	13,685	食品・生活必需品小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	34	34	119	10,813	公益事業
METRO INC/CN	69	51	294	26,580	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	67	55	304	27,489	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	34	30	473	42,691	保険
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	—	22	164	14,800	商業・専門サービス
CENOVUS ENERGY INC	224	233	223	20,148	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	125	114	444	40,055	エネルギー
DOLLARAMA INC	70	60	320	28,906	小売
KEYERA CORP	51	51	153	13,878	エネルギー
ALTAGAS LTD	63	63	152	13,758	公益事業
ATCO LTD -CLASS I	14	14	61	5,544	公益事業

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
INTER PIPELINE LTD	98	98	175	15,835		エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	36	—	—	—		エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	5	4	691	62,360		ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	70	58	481	43,418		消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	15	18	164	14,836		素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	31	30	206	18,602		素材
HYDRO ONE LTD	80	67	201	18,202		公益事業
EMERA INC	58	49	275	24,875		公益事業
SHOPIFY INC - CLASS A	25	22	3,122	281,536		ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	142	109	791	71,338		素材
WSP GLOBAL INC	24	24	325	29,312		資本財
CANOPY GROWTH CORP	49	49	135	12,234		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STARS GROUP INC/THE	47	—	—	—		消費者サービス
IA FINANCIAL CORP INC	22	22	155	14,005		保険
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	60	51	266	24,032		素材
CRONOS GROUP INC	44	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUEBECOR INC -CL B	40	40	131	11,869		メディア・娯楽
B2GOLD CORP	—	238	149	13,520		素材
AIR CANADA	30	30	77	7,019		運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	116	106	196	17,701		公益事業
PARKLAND CORP	33	33	131	11,819		エネルギー
SSR MINING INC	—	48	107	9,699		素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	25	129	11,671		公益事業
FIRSTSERVICE CORP	—	8	155	14,004		不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	40	154	13,958		商業・専門サービス
NORTHLAND POWER INC	—	36	143	12,974		公益事業
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	15	153	13,869		資本財
小計	株数・金額	8,875	8,143	45,793	4,129,185	
	銘柄数<比率>	80	87	—	<3.6%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	253	192	123	16,474		銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	522	404	469	62,525		各種金融
SIEMENS AG-REG	184	153	2,046	272,384		資本財
RWE AG	139	132	421	56,088		公益事業
BASF SE	220	183	1,234	164,344		素材
VOLKSWAGEN AG	6	6	177	23,593		自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	219	170	1,235	164,480		自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	47	34	321	42,807		家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	559	448	469	62,512		公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	79	66	553	73,594		自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	236	196	1,094	145,600		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANZ SE-REG	99	82	1,771	235,787		保険
CONTINENTAL AG	25	22	260	34,640		自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	294	258	797	106,186		半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	37	30	256	34,187		自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	58	58	63	8,483		運輸
DEUTSCHE POST AG-REG	243	197	1,008	134,234		運輸
SAP SE	235	209	2,346	312,209		ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	47	36	510	67,907		各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	51	39	264	35,245		ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	—	—	—		運輸
ADIDAS AG	43	38	1,120	149,111		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		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	795	671	1,113	148,218	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	34	27	647	86,157	保険	
THYSSENKRUPP AG	91	—	—	—	素材	
BEIERSDORF AG	23	18	175	23,297	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	37	31	227	30,290	素材	
MERCK KGAA	30	24	355	47,357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	45	36	779	103,719	自動車・自動車部品	
PUMA SE	17	19	180	24,059	耐久消費財・アパレル	
LANXESS AG	21	16	99	13,229	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA	98	88	391	52,103	ヘルスケア機器・サービス	
HOCHTIEF AG	5	5	37	4,990	資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE	85	70	313	41,668	不動産	
GEA GROUP AG	36	26	91	12,137	資本財	
SYMRISE AG	29	26	275	36,676	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	23	20	163	21,820	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	20	27	92	12,343	電気通信サービス	
RATIONAL AG	—	0.99	74	9,889	資本財	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	13	13	96	12,883	自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	14	11	167	22,353	保険	
BRENTAG SE	36	31	237	31,661	資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	9	9	131	17,450	ヘルスケア機器・サービス	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	14	14	61	8,127	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	199	140	35	4,658	電気通信サービス	
LEG IMMOBILIEN SE	—	13	152	20,339	不動産	
VONOVIA SE	129	106	545	72,636	不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	54	37	107	14,293	素材	
ZALANDO SE	30	31	267	35,661	小売	
COVESTRO AG	41	34	189	25,216	素材	
UNIPER SE	42	37	112	15,017	公益事業	
METRO AG	48	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
KION GROUP AG	14	14	122	16,270	資本財	
MTU AERO ENGINES AG	15	11	232	30,946	資本財	
WIRECARD AG	27	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
DELIVERY HERO SE	24	24	248	33,101	小売	
SCOUT24 AG	—	20	130	17,364	メディア・娯楽	
SARTORIUS AG-VORZUG	8	7	302	40,258	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	32	53	247	32,915	ヘルスケア機器・サービス	
NEMETSCHKE SE	—	13	77	10,268	ソフトウェア・サービス	
BECHTLE AG	—	5	82	11,006	ソフトウェア・サービス	
KNORR-BREMSE AG	11	16	165	22,001	資本財	
HELLOFRESH SE	—	31	224	29,905	小売	
TEAMVIEWER AG	—	31	94	12,578	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS ENERGY AG	—	84	209	27,884	資本財	
小計	株数・金額	5,783	4,870	25,812	3,435,160	
	銘柄数<比率>	57	61	—	<3.0%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	248	221	385	51,351	保険	
INTESA SANPAOLO	3,511	3,246	763	101,604	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	2,070	2,070	89	11,974	電気通信サービス	
ENI SPA	623	506	516	68,708	エネルギー	
UNICREDIT SPA	528	410	418	55,753	銀行	
ENEL SPA	1,942	1,638	1,305	173,716	公益事業	

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…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	22	22	103	13,739	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATLANTIA SPA	105	90	139	18,568	運輸	
MEDIOBANCA SPA	154	106	103	13,738	銀行	
SNAM SPA	581	396	190	25,318	公益事業	
TELECOM ITALIA-RSP	1,411	868	40	5,393	電気通信サービス	
LEONARDO SPA	89	—	—	—	資本財	
TERNA SPA	343	277	172	22,903	公益事業	
PRYSMIAN SPA	58	49	138	18,394	資本財	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	139	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	—	56	52	6,956	電気通信サービス	
POSTE ITALIANE SPA	116	116	130	17,368	保険	
FINECOBANK SPA	128	121	163	21,731	銀行	
MONCLER SPA	43	35	187	24,907	耐久消費財・アパレル	
PIRELLI & C SPA	94	—	—	—	自動車・自動車部品	
DIASORIN SPA	—	6	85	11,365	ヘルスケア機器・サービス	
AMPLIFON SPA	—	23	81	10,893	ヘルスケア機器・サービス	
NEXI SPA	—	89	139	18,613	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額	12,215	10,354	5,207	693,001	
	銘柄数<比率>	19	20	—	<0.6%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	40	33	404	53,860	自動車・自動車部品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	66	55	3,440	457,922	耐久消費財・アパレル	
PEUGEOT SA	141	—	—	—	自動車・自動車部品	
AXA SA	455	390	870	115,876	保険	
DANONE	147	124	723	96,341	食品・飲料・タバコ	
CARREFOUR SA	140	123	214	28,523	食品・生活必需品小売り	
VIVENDI	198	171	497	66,222	メディア・娯楽	
INGENICO GROUP	12	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SOCIETE GENERALE SA	189	155	405	53,939	銀行	
AIR LIQUIDE SA	112	95	1,307	174,025	素材	
TOTAL SE	577	504	1,937	257,896	エネルギー	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	117	102	548	73,048	資本財	
VINCI SA	123	105	966	128,586	資本財	
SANOFI	270	226	1,967	261,776	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	123	108	274	36,559	公益事業	
L'OREAL	60	50	1,775	236,298	家庭用品・パーソナル用品	
ACCOR SA	36	36	116	15,478	消費者サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	131	108	1,364	181,579	資本財	
BNP PARIBAS	265	225	1,262	167,962	銀行	
ESSILORLUXOTTICA	67	57	785	104,573	耐久消費財・アパレル	
CAPGEMINI SE	38	33	500	66,652	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	14	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
VALEO SA	54	40	102	13,686	自動車・自動車部品	
HERMES INTERNATIONAL	7	6	650	86,608	耐久消費財・アパレル	
SODEXO SA	28	16	128	17,139	消費者サービス	
KERING	18	15	1,062	141,442	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SE	33	27	497	66,224	ソフトウェア・サービス	
ATOS SE	23	16	90	12,036	ソフトウェア・サービス	
ORANGE	499	395	410	54,636	電気通信サービス	
CNP ASSURANCES	36	36	54	7,285	保険	
SAFRAN SA	76	64	753	100,319	資本財	
RENAULT SA	40	40	131	17,485	自動車・自動車部品	

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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PUBLICIS GROUPE	56	44	240	32,032	メディア・娯楽
JCDECAUX SA	20	—	—	—	メディア・娯楽
BOUYGUES SA	52	41	134	17,920	資本財
THALES SA	24	21	178	23,764	資本財
PERNOD RICARD SA	51	43	759	101,050	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	255	216	262	34,907	銀行
ENGIE	430	366	481	64,086	公益事業
ALSTOM	47	52	233	31,034	資本財
ARKEMA	17	12	136	18,194	素材
LEGRAND SA	70	51	445	59,319	資本財
SCOR SE	32	25	70	9,317	保険
ADP	6	6	73	9,831	運輸
EDF	130	125	144	19,288	公益事業
NATIXIS	225	225	91	12,241	各種金融
WENDEL	6	6	72	9,678	各種金融
BUREAU VERITAS SA	66	66	163	21,732	商業・専門サービス
EURAZEO SE	9	9	64	8,618	各種金融
SUEZ	71	71	141	18,883	公益事業
EIFFAGE	24	14	128	17,060	資本財
ILIAD SA	5	3	44	5,944	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	44	—	—	—	メディア・娯楽
ORPEA	—	11	123	16,434	ヘルスケア機器・サービス
BIOMERIEUX	10	7	73	9,773	ヘルスケア機器・サービス
GETLINK SE	91	85	113	15,076	運輸
EDENRED	59	50	224	29,940	ソフトウェア・サービス
REMY COINTREAU	5	4	70	9,386	食品・飲料・タバコ
BOLLORE	225	133	55	7,445	メディア・娯楽
DASSAULT AVIATION SA	0.63	0.63	60	8,023	資本財
SEB SA	6	3	53	7,150	耐久消費財・アパレル
IPSEN	8	8	71	9,525	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	15	9	68	9,177	各種金融
FAURECIA	18	18	81	10,886	自動車・自動車部品
TELEPERFORMANCE	13	11	347	46,288	商業・専門サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	20	20	119	15,843	メディア・娯楽
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	7	5	202	26,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDBLINE SA	28	48	357	47,636	ソフトウェア・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	20	92	12,276	消費者サービス
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	6,312	5,215	29,235	3,890,696	
銘 柄 数 < 比 率 >	67	64	—	< 3.4% >	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	56	47	182	24,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	252	209	281	37,494	資本財
STELLANTIS NV	245	401	591	78,767	自動車・自動車部品
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	—	100	101	13,529	食品・飲料・タバコ
FERRARI NV	28	26	433	57,702	自動車・自動車部品
EXOR NV	25	22	149	19,881	各種金融
AIRBUS SE	137	118	1,122	149,327	資本財
STMICROELECTRONICS NV	164	131	383	50,982	半導体・半導体製造装置
WOLTERS KLUWER	66	53	413	54,967	商業・専門サービス
UNILEVER NV	352	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
KONINKLIJKE KPN NV	834	678	189	25,265	電気通信サービス
AKZO NOBEL N.V.	46	37	386	51,441	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		
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HEINEKEN NV	61	53	533	71,002	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	218	181	828	110,239	ヘルスケア機器・サービス	
AEGON NV	372	358	139	18,601	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	276	221	529	70,451	食品・生活必需品小売り	
RANDSTAD NV	27	21	131	17,443	商業・専門サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	25	23	195	25,955	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	42	35	527	70,264	素材	
ING GROEP NV	1,002	779	845	112,474	銀行	
ASML HOLDING NV	102	85	4,329	576,109	半導体・半導体製造装置	
VOPAK	15	15	59	7,883	エネルギー	
NN GROUP NV	90	60	261	34,796	保険	
ALTICE EUROPE NV	154	—	—	—	電気通信サービス	
ABN AMRO BANK NV-CVA	87	87	94	12,547	銀行	
ASM INTERNATIONAL NV	—	9	231	30,852	半導体・半導体製造装置	
ADYEN NV	2	3	613	81,658	ソフトウェア・サービス	
JUST EAT TAKEAWAY	28	25	181	24,189	小売	
PROSUS NV	115	97	805	107,258	小売	
JDE PEET'S NV	—	12	39	5,193	食品・飲料・タバコ	
ARGENX SE	—	9	200	26,729	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	4,837	3,907	14,782	1,967,241	
	銘柄 数 < 比 率 >	27	29	—	< 1.7% >	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	48	49	128	17,098	資本財	
ENDESA SA	72	72	166	22,172	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	62	45	117	15,588	資本財	
IBERDROLA SA	1,459	1,229	1,385	184,353	公益事業	
TELEFONICA SA	1,140	1,022	425	56,659	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	4,098	3,470	1,142	152,077	銀行	
BANKINTER SA	150	—	—	—	銀行	
REPSOL SA	336	308	336	44,736	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,670	1,366	682	90,812	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	62	62	133	17,783	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	262	217	696	92,705	小売	
MAPPRE SA	335	—	—	—	保険	
FERROVIAL SA	113	96	229	30,532	資本財	
ENAGAS SA	51	48	93	12,395	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	101	75	122	16,274	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,272	—	—	—	銀行	
CAIXABANK SA	784	941	263	35,123	銀行	
GRIFOLS SA	70	59	138	18,458	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	104	91	537	71,511	ソフトウェア・サービス	
BANKIA SA	331	—	—	—	銀行	
AENA SME SA	16	14	202	26,975	運輸	
CELLNEX TELECOM SA	60	66	306	40,791	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	12,607	9,238	7,108	946,052	
	銘柄 数 < 比 率 >	22	18	—	< 0.8% >	
(ユーロ…ベルギー)						
GALAPAGOS NV	10	10	59	7,974	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AGEAS	45	36	192	25,605	保険	
UCB SA	29	25	196	26,186	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	22	199	26,500	各種金融	
UMICORE	44	36	183	24,384	素材	

銘柄	株数	期首(前期末)			業種等
		当		期末	
		株数	株数		
外貨建金額	邦貨換算金額				
(ユーロ…ベルギー)					
COLRUYT SA	12	12	64	8,615	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV	61	47	321	42,727	銀行
SOLVAY SA	23	14	159	21,231	素材
PROXIMUS	37	37	64	8,575	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	10	—	—	—	メディア・娯楽
SOFINA	—	3	117	15,651	各種金融
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	180	150	915	121,886	食品・飲料・タバコ
ELIA GROUP SA/NV	—	7	67	8,979	公益事業
小計	474	406	2,542	338,318	
銘柄数<比率>	11	12	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	73	56	193	25,782	銀行
VERBUND AG	17	13	91	12,235	公益事業
OMV AG	35	29	132	17,697	エネルギー
VOESTALPINE AG	27	17	62	8,317	素材
ANDRITZ AG	13	—	—	—	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	29	29	57	7,658	銀行
小計	196	145	538	71,690	
銘柄数<比率>	6	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)					
AROUNDTOWN SA	270	204	135	18,007	不動産
TENARIS SA	110	110	104	13,868	エネルギー
SES	81	81	51	6,787	メディア・娯楽
EUROFINS SCIENTIFIC	2	26	220	29,375	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL	154	136	347	46,198	素材
小計	619	559	858	114,237	
銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)					
NOKIA OYJ	1,403	1,158	475	63,340	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	132	116	175	23,390	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ	29	—	—	—	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	129	101	324	43,182	素材
FORTUM OYJ	97	92	209	27,917	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	—	54	149	19,869	食品・生活必需品小売り
KONE OYJ-B	81	69	457	60,924	資本財
NELES OYJ	21	—	—	—	資本財
SAMPO OYJ-A SHS	119	91	374	49,847	保険
WARTSILA OYJ ABP	104	68	72	9,582	資本財
ELISA OYJ	32	32	155	20,751	電気通信サービス
NESTE OYJ	95	87	450	59,899	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	21	18	69	9,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	2,268	1,890	2,914	387,904	
銘柄数<比率>	12	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)					
KERRY GROUP PLC-A	37	33	369	49,141	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC	33	32	240	32,040	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	19	31	449	59,822	消費者サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI-NEW	0.4	—	—	—	消費者サービス
BANK OF IRELAND GROUP PLC	233	—	—	—	銀行
ATB GROUP PLC	200	—	—	—	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	57	49	214	28,554	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	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
CRH PLC	188	155	636	84,705	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	771	302	1,910	254,264	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	5	—	< 0.2% >	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	574	564	260	34,701	公益事業	
JERONIMO MARTINS	54	54	86	11,566	食品・生活必需品小売り	
GALP ENERGIA SGPS SA	133	110	110	14,659	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	762	730	457	60,926	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	46,849	37,621	91,369	12,159,495	
	銘柄 数 < 比 率 >	237	233	—	< 10.5% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC	4,413	3,458	615	95,000	銀行	
BP PLC	4,871	4,072	1,255	193,657	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	17,613	14,126	677	104,489	銀行	
ASTRAZENECA PLC	315	262	2,084	321,529	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	101	79	121	18,666	資本財	
NEXT PLC	28	28	227	35,149	小売	
DIAGEO PLC	563	468	1,568	241,946	食品・飲料・タバコ	
BAE SYSTEMS PLC	745	615	319	49,323	資本財	
UNILEVER PLC	267	526	2,253	347,633	家庭用品・パーソナル用品	
TESCO PLC	2,366	1,607	372	57,472	食品・生活必需品小売り	
RELX PLC	462	382	702	108,411	商業・専門サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	377	—	—	—	小売	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	170	142	903	139,407	家庭用品・パーソナル用品	
HALMA PLC	95	76	190	29,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PRUDENTIAL PLC	618	518	765	118,039	保険	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,570	1,211	335	51,776	保険	
SAGE GROUP PLC/THE	262	218	143	22,071	ソフトウェア・サービス	
HSBC HOLDINGS PLC	4,866	4,070	1,804	278,329	銀行	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	551	458	1,275	196,718	食品・飲料・タバコ	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	165	121	119	18,428	公益事業	
SCHRODERS PLC	28	28	99	15,296	各種金融	
NATWEST GROUP PLC	1,197	1,000	198	30,560	銀行	
BHP GROUP PLC	502	420	900	138,818	素材	
IMPERIAL BRANDS PLC	229	180	295	45,543	食品・飲料・タバコ	
WPP PLC	280	256	246	38,090	メディア・娯楽	
CENTRICA PLC	1,333	—	—	—	公益事業	
BT GROUP PLC	1,966	1,875	322	49,758	電気通信サービス	
SSE PLC	242	198	300	46,290	公益事業	
STANDARD CHARTERED PLC	636	570	286	44,117	銀行	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	409	1,673	173	26,682	資本財	
COMPASS GROUP PLC	380	353	525	81,047	消費者サービス	
KINGFISHER PLC	420	430	162	24,987	小売	
PEARSON PLC	204	153	129	20,045	メディア・娯楽	
SEVERN TRENT PLC	51	47	119	18,367	公益事業	
RTO TINTO PLC	270	224	1,355	209,116	素材	
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,197	999	1,366	210,700	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
3I GROUP PLC	235	201	243	37,602	各種金融	
VODAFONE GROUP PLC	6,387	5,287	668	103,085	電気通信サービス	
WM MORRISON SUPERMARKETS	559	559	102	15,849	食品・生活必需品小売り	
SAINSBURY (J) PLC	433	313	82	12,688	食品・生活必需品小売り	

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	
AVIVA PLC	938	744	299	46,255	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	46	34	109	16,952	素材
RENTOKIL INITIAL PLC	436	378	178	27,584	商業・専門サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	244	211	144	22,312	保険
WHITBREAD PLC	32	35	107	16,593	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	828	700	651	100,517	公益事業
BUNZL PLC	84	66	152	23,505	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	266	245	774	119,465	素材
INTERTEK GROUP PLC	38	30	176	27,144	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	88	79	167	25,817	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	51	35	169	26,206	消費者サービス
PERSIMMON PLC	73	65	199	30,714	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	321	—	—	—	資本財
ITV PLC	758	—	—	—	メディア・娯楽
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	78	61	451	69,704	各種金融
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	30	21	99	15,365	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	232	188	141	21,810	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC	208	163	246	38,026	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	780	780	134	20,698	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	984	823	1,136	175,245	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	914	742	984	151,767	エネルギー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	517	438	116	17,913	各種金融
EXPERIAN PLC	225	185	479	73,988	商業・専門サービス
MONDI PLC	103	99	189	29,258	素材
WEIR GROUP PLC/THE	59	—	—	—	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	77	76	172	26,550	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	108	81	127	19,613	素材
ADMIRAL GROUP PLC	42	42	125	19,354	保険
FRESNILLO PLC	—	32	29	4,513	素材
ST JAMES' S PLACE PLC	128	110	147	22,740	各種金融
GLENCORE PLC	2,603	1,988	623	96,216	素材
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	17	14	175	27,143	資本財
EVRAZ PLC	117	117	77	12,001	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	67	61	103	16,030	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	29	29	193	29,782	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,130	917	144	22,312	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	49	39	98	15,264	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	335	262	76	11,837	保険
AVEVA GROUP PLC	15	25	80	12,470	ソフトウェア・サービス
ASHTAD GROUP PLC	112	87	439	67,784	資本財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	35	84	13,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OCADO GROUP PLC	105	90	177	27,336	小売
AUTO TRADER GROUP PLC	221	221	122	18,935	メディア・娯楽
DCC PLC	25	21	132	20,434	資本財
ENTAIN PLC	136	121	187	28,910	消費者サービス
INFORMA PLC	310	314	169	26,177	メディア・娯楽
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	102	73	11,307	保険
FERGUSON PLC	54	46	439	67,740	資本財
M&G PLC	539	539	127	19,644	各種金融
JD SPORTS FASHION PLC	102	102	91	14,092	小売
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	72,072	58,840	34,650	5,344,096	
銘 柄	株 数	株 数	金 額	金 額	
	87	85	—	<4.6%>	

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	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
NESTLE SA-REG	711	577	6,309	762,359	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	131	103	968	117,006	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	624	502	466	56,386	各種金融
HOLCIM LTD	126	102	544	65,825	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	168	140	4,268	515,786	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG	2	1	711	85,973	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	13	11	346	41,810	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	34	30	1,134	137,103	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2	2	291	35,194	ヘルスケア機器・サービス
LONZA GROUP AG-REG	17	14	814	98,408	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	6	35	4,320	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	9	238	28,775	資本財
GEBERIT AG-REG	9	7	452	54,634	資本財
SWISS RE AG	73	59	510	61,638	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	6	6	192	23,304	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR	9	—	—	—	各種金融
NOVARTIS AG-REG	514	443	3,509	424,030	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	28	167	20,280	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	6	5	266	32,225	電気通信サービス
ABB LTD-REG	454	367	1,084	131,092	資本財
CLARIANT AG-REG	50	28	55	6,706	素材
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—	33	328	39,644	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR	—	6	209	25,255	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG	1	1	343	41,449	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	3	3	83	10,056	資本財
TEMENOS AG - REG	15	12	157	19,040	ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	12	10	315	38,111	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	10	10	152	18,482	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	7	6	290	35,148	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.02	178	21,580	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	55	47	278	33,628	各種金融
SIKA AG-REG	30	28	779	94,211	素材
SWISS PRIME SITE-REG	18	14	133	16,073	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.26	0.21	175	21,238	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4	3	459	55,572	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.72	0.58	117	14,170	食品・飲料・タバコ
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	7	61	7,417	銀行
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1	1	150	18,139	素材
UBS GROUP AG-REG	911	731	1,016	122,880	各種金融
VIFOR PHARMA AG	10	7	93	11,243	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALCON INC	105	96	591	71,427	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数 銘柄 数 < 比 率 >	4,213 38	3,471 40	28,284 —	3,417,636 < 3.0% >
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	51	51	1,198	15,670	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	756	566	6,331	82,811	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	95	78	3,394	44,400	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	387	309	3,346	43,769	銀行
INVESTOR AB-B SHS	105	374	6,915	90,458	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	365	322	3,146	41,161	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	158	133	6,687	87,469	資本財
SKF AB-B SHARES	90	76	1,644	21,508	資本財

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	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
ASSA ABLOY AB-B	236	199	4,964	64,935	資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	193	168	3,573	46,737	小売	
SANDVIK AB	292	231	5,040	65,923	資本財	
SWEDBANK AB - A SHARES	217	166	2,527	33,060	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	73	73	1,001	13,093	商業・専門サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	—	119	1,738	22,736	素材	
SKANSKA AB-B SHS	80	68	1,598	20,905	資本財	
SWEDISH MATCH AB	41	325	2,518	32,945	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	103	114	1,260	16,487	電気通信サービス	
TELIA CO AB	593	485	1,796	23,503	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS	349	290	6,163	80,612	資本財	
ALFA LAVAL AB	73	62	1,851	24,223	資本財	
LUNDIN ENERGY AB	44	29	805	10,538	エネルギー	
BOLIDEN AB	63	54	1,835	24,012	素材	
BOLIDEN AB-RED	—	54	32	428	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	107	65	764	9,995	耐久消費財・アパレル	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	24	—	—	—	電気通信サービス	
HEXAGON AB-B SHS	63	389	4,321	56,527	資本財	
KINNEVIK AB - B	49	48	1,304	17,067	各種金融	
KINNEVIK AB-B-RED	—	48	758	9,915	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	41	25	789	10,322	各種金融	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	18	965	12,624	不動産	
ICA GRUPPEN AB	20	24	975	12,757	食品・生活必需品小売り	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	62	1,967	25,728	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	20	12	595	7,794	各種金融	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	142	127	3,731	48,811	家庭用品・パーソナル用品	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	32	1,071	14,016	各種金融	
EPIROC AB-B	95	72	1,206	15,781	資本財	
EPIROC AB-B RED SHS	—	72	21	282	資本財	
EPIROC AB-A	159	131	2,414	31,579	資本財	
EPIROC AB-A RED SHS	—	131	39	514	資本財	
NORDEA BANK ABP	753	663	5,736	75,038	銀行	
EQT AB	—	47	1,250	16,358	各種金融	
EVOLUTION AB	—	31	4,242	55,497	消費者サービス	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	35	910	11,911	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,850	6,397	102,440	1,339,920	
	銘柄 数 < 比 率 >	32	42	—	< 1.2% >	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA	210	180	3,262	42,904	銀行	
NORSK HYDRO ASA	311	261	1,328	17,472	素材	
ORKLA ASA	185	145	1,214	15,976	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	244	204	3,593	47,253	エネルギー	
TELENOR ASA	173	142	2,121	27,901	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	42	33	1,457	19,168	素材	
MOWI ASA	92	86	1,793	23,585	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	50	30	568	7,473	保険	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	11	424	5,583	メディア・娯楽	
SCHIBSTED ASA-B SHS	25	25	824	10,843	メディア・娯楽	
AKER BP ASA	26	—	—	—	エネルギー	
ADEVINTA ASA	—	54	757	9,958	メディア・娯楽	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,361	1,174	17,347	228,122	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	11	—	< 0.2% >	

銘柄	株数	当 期		末		業 種 等	
		株数	株数	評 価 額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円			
NOVO NORDISK A/S-B	426	343	16,659	298,196		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	48	41	1,856	33,233		素材	
DANSKE BANK A/S	149	143	1,655	29,636		銀行	
DEMANT A/S	26	26	782	14,008		ヘルスケア機器・サービス	
H LUNDBECK A/S	18	18	362	6,488		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	49	207	4,695	84,043		資本財	
GN STORE NORD A/S	—	26	1,281	22,940		ヘルスケア機器・サービス	
CARLSBERG AS-B	29	22	2,454	43,930		食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	27	24	2,384	42,680		ヘルスケア機器・サービス	
DSV PANALPINA A/S	50	41	5,788	103,621		運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1	1	2,030	36,348		運輸	
TRYG A/S	30	30	445	7,980		保険	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.92	0.65	1,006	18,022		運輸	
PANDORA A/S	21	21	1,646	29,478		耐久消費財・アパレル	
ISS A/S	40	—	—	—		商業・専門サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	26	20	1,129	20,211		素材	
GENMAB A/S	15	12	2,903	51,966		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ORSTED A/S	44	38	3,401	60,881		公益事業	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	1	396	7,099		資本財	
AMBU A/S-B	—	32	692	12,387		ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株数	金額	1,007	1,054	51,573	923,156	
	銘柄数	<比率>	17	19	—	<0.8%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル			
BHP GROUP LTD	711	588	2,870	242,562		素材	
CSL LTD	109	90	2,493	210,713		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALUMINA LTD	616	—	—	—		素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	230	200	448	37,929		エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP	683	566	1,547	130,786		銀行	
RIO TINTO LTD	86	76	945	79,911		素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	287	274	284	24,016		保険	
LENDLEASE GROUP	144	144	173	14,682		不動産	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	427	354	3,378	285,477		銀行	
WESTPAC BANKING CORP	898	720	1,814	153,352		銀行	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	763	656	1,707	144,242		銀行	
BRAMBLES LTD	378	305	319	27,010		商業・専門サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	168	168	75	6,418		運輸	
BORAL LTD	277	—	—	—		素材	
WOOLWORTHS GROUP LTD	306	251	1,016	85,909		食品・生活必需品小売り	
TELSTRA CORP LTD	912	888	302	25,522		電気通信サービス	
AMP LTD	715	715	76	6,440		各種金融	
TABCORP HOLDINGS LTD	461	461	230	19,472		消費者サービス	
COMPUTERSHARE LTD	115	115	175	14,803		ソフトウェア・サービス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	122	116	462	39,056		消費者サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	83	70	1,058	89,416		各種金融	
CIMIC GROUP LTD	19	19	40	3,391		資本財	
ASX LTD	47	35	255	21,569		各種金融	
COCA-COLA AMATIL LTD	119	—	—	—		食品・飲料・タバコ	
COCHLEAR LTD	12	12	260	21,998		ヘルスケア機器・サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	111	93	378	32,013		素材	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	159	—	—	—		小売	
NEWCREST MINING LTD	188	167	467	39,526		素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	568	425	204	17,254		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		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
ORIGIN ENERGY LTD	383	383	149	12,642	エネルギー	
ORICA LTD	91	91	125	10,633	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	106	91	312	26,411	ヘルスケア機器・サービス	
SANTOS LTD	383	383	269	22,761	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD	401	249	262	22,181	保険	
TRANSURBAN GROUP	673	565	766	64,757	運輸	
WESFARMERS LTD	281	225	1,206	101,935	小売	
BLUESCOPE STEEL LTD	105	105	222	18,811	素材	
CHALLENGER LTD	134	—	—	—	各種金融	
SYDNEY AIRPORT	261	239	134	11,348	運輸	
AMPOL LTD	50	45	127	10,744	エネルギー	
OIL SEARCH LTD	332	377	142	12,079	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	165	140	113	9,575	公益事業	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	340	345	788	66,655	素材	
AUSNET SERVICES	543	321	57	4,821	公益事業	
CROWN RESORTS LTD	83	83	107	9,084	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD	376	—	—	—	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	127	—	—	—	銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	432	432	149	12,611	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	167	167	182	15,434	食品・飲料・タバコ	
APA GROUP	288	215	200	16,949	公益事業	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	38	33	210	17,773	ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	—	—	—	消費者サービス	
SEEK LTD	84	62	175	14,835	メディア・娯楽	
REA GROUP LTD	13	9	141	11,956	メディア・娯楽	
TPG CORP LTD	104	—	—	—	電気通信サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	687	505	150	12,683	保険	
SOUTH32 LTD	1,061	970	283	23,938	素材	
EVOLUTION MINING LTD	—	254	131	11,139	素材	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	31	31	141	11,923	各種金融	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	235	260	22,032	素材	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	27	27	78	6,612	エネルギー	
COLES GROUP LTD	311	277	451	38,189	食品・生活必需品小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	32	32	83	7,093	ソフトウェア・サービス	
AFTERPAY LTD	—	40	350	29,606	ソフトウェア・サービス	
TPG TELECOM LTD	—	104	52	4,403	電気通信サービス	
XERO LTD	—	26	305	25,775	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数	金 額	17,868	14,595	29,122	2,460,884
株 銘 柄 数 < 比 率 >	61	57	—	—	< 2.1% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
SPARK NEW ZEALAND LTD	483	389	172	13,515	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	216	203	149	11,697	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	138	123	401	31,423	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	177	—	—	—	素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	104	58	84	6,650	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	265	265	138	10,830	公益事業	
MERCURY NZ LTD	145	145	91	7,163	公益事業	
A2 MILK CO LTD	182	182	100	7,841	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数	金 額	1,714	1,368	1,137	89,122
株 銘 柄 数 < 比 率 >	8	7	—	—	< 0.1% >	
(香港)			千香港ドル			
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	120	120	719	10,121	不動産	

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		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	641	516	3,212	45,202	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	375	270	3,172	44,637	不動産	
MTR CORP	365	310	1,370	19,278	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	2,433	2,255	3,013	42,393	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,520	330	1,357	19,106	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	315	240	1,137	16,006	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	286	240	10,900	153,374	各種金融	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	450	450	887	12,485	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	400	350	2,766	38,928	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	353	283	1,005	14,144	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	329	329	526	7,406	銀行	
HANG SENG BANK LTD	180	157	2,521	35,476	銀行	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	71	71	726	10,219	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	682	682	821	11,553	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	120	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	150	150	717	10,088	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	885	745	2,179	30,660	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	330	270	3,701	52,082	資本財	
PCCW LTD	800	810	354	4,991	電気通信サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	185	—	—	—	不動産	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	—	320	894	12,584	資本財	
NWS HOLDINGS LTD	310	—	—	—	資本財	
SANDS CHINA LTD	692	476	1,592	22,402	消費者サービス	
WHEELOCK & CO LTD	210	—	—	—	不動産	
WYNN MACAU LTD	316	316	412	5,806	消費者サービス	
SJM HOLDINGS LTD	580	240	208	2,934	消費者サービス	
ATA GROUP LTD	2,908	2,414	25,033	352,216	保険	
SWIRE PROPERTIES LTD	250	250	577	8,125	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	530	440	2,783	39,156	消費者サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	780	690	727	10,232	電気通信サービス	
WH GROUP LTD	2,195	1,640	1,115	15,690	食品・飲料・タバコ	
CK ASSET HOLDINGS LTD	616	521	2,539	35,725	不動産	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	650	650	512	7,215	公益事業	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	300	320	1,422	20,013	不動産	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	180	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	291	409	1,102	15,508	食品・飲料・タバコ	
ESR CAYMAN LTD	—	350	859	12,089	不動産	
小 計	株 数	金 額	21,801	17,617	80,871	1,137,860
株 銘	数 < 比 率 >		36	33	—	< 1.0% >
(シンガポール)			千シンガポールドル			
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	746	680	813	66,615	銀行	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	306	—	—	—	メディア・娯楽	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	293	—	—	—	公益事業	
CAPITALAND LTD	612	445	157	12,939	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	102	102	75	6,174	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	—	—	—	小売	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	409	352	1,033	84,622	銀行	
KEPPEL CORP LTD	348	235	121	9,990	資本財	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	285	235	596	48,892	銀行	
VENTURE CORP LTD	70	65	119	9,807	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	385	203	76	6,268	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,934	1,629	392	32,174	電気通信サービス	

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
SINGAPORE AIRLINES LTD	141	308	144	11,872	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	187	187	191	15,669	各種金融	
UOL GROUP LTD	88	88	64	5,254	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	562	—	—	—	運輸	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	444	367	176	14,489	食品・飲料・タバコ	
GENTING SINGAPORE LTD	1,397	1,397	109	8,982	消費者サービス	
SATS LTD	210	—	—	—	運輸	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	635	—	—	—	資本財	
小計	株数・金額	9,182	6,294	4,074	333,754	
	銘柄数<比率>	20	14	—	<0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
ICL GROUP LTD	141	141	313	10,474	素材	
BANK HAPOALIM BM	251	251	697	23,293	銀行	
NICE LTD	13	13	943	31,526	ソフトウェア・サービス	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	354	297	744	24,869	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	5	5	253	8,452	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	269	269	432	14,466	銀行	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	38	26	252	8,420	銀行	
AZRIELI GROUP LTD	11	6	158	5,281	不動産	
小計	株数・金額	1,086	1,012	3,794	126,785	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	263,885	220,574	—	110,506,695	
	銘柄数<比率>	1,236	1,229	—	<95.5%>	

(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) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	12	11	366	40,092	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	2	465	50,827	0.0	
PROLOGIS INC	17	14	1,715	187,441	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	1	241	26,382	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3	—	—	—	—	
DIGITAL REALTY TRUST INC	6	5	822	89,825	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3	3	227	24,818	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	393	42,953	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	2	395	43,209	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	—	—	—	—	
WELLTOWER INC	10	8	586	64,034	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	3	2	324	35,462	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	11	11	246	26,896	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	2	357	39,030	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	5	5	182	19,909	0.0	
REALTY INCOME CORP	7	7	478	52,229	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	3	3	197	21,580	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	1	—	—	—	—	
SUN COMMUNITIES INC	2	2	333	36,453	0.0	
UDR INC	6	5	258	28,239	0.0	
VENTAS INC	8	7	421	45,996	0.0	
WEYERHAEUSER CO	17	15	570	62,342	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	10	8	2,193	239,634	0.2	
WP CAREY INC	4	3	245	26,813	0.0	
VEREIT INC	35	3	181	19,791	0.0	
DUKE REALTY CORP	8	7	346	37,891	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	6	5	246	26,919	0.0	
EQUINIX INC	2	1	1,280	139,894	0.1	
CROWN CASTLE INTL CORP	9	8	1,575	172,128	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	9	7	538	58,858	0.1	
INVITATION HOMES INC	12	10	383	41,917	0.0	
VICI PROPERTIES INC	10	10	329	36,048	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	2	2	647	70,763	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	15	12	220	24,054	0.0	
PUBLIC STORAGE	3	3	869	95,016	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	6	785	85,865	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	3	2	123	13,486	0.0	
KIMCO REALTY CORP	9	—	—	—	—	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	2	561	61,364	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	295	214	19,113	2,088,179	
	銘柄 数 < 比 率 >	39	35	—	<1.8%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		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	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		1	1	95	8,605	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3	—	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		4	4	88	7,960	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		2	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	13	5	183	16,566	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	0.715	91	12,217	0.0
KLEPIERRE		4	4	93	12,430	0.0
COVIVIO		1	1	87	11,618	0.0
ICADE		0.634	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	7	6	272	36,266	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3	2	202	27,002	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	3	2	202	27,002	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	10	8	475	63,268	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		17	15	79	12,334	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		15	15	110	17,079	0.0
SEGRO PLC		25	24	251	38,850	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	58	55	442	68,264	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		63	88	134	11,340	0.0
SCENTRE GROUP		117	103	271	22,918	0.0
GPT GROUP		45	32	146	12,372	0.0
MIRVAC GROUP		91	68	185	15,692	0.0
STOCKLAND		57	45	200	16,965	0.0
DEXUS		27	18	182	15,381	0.0
GOODMAN GROUP		40	31	586	49,570	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	444	388	1,706	144,241	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		54	42	3,137	44,145	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	54	42	3,137	44,145	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		100	48	69	5,664	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		58	—	—	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		—	64	127	10,440	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		45	45	94	7,711	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		64	86	177	14,528	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)	千口	千口	千シンガポールドル	千円	%	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	63	73	214	17,567	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	333	318	682	55,911	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,209	1,034	—	2,480,576	
	銘柄 数 < 比 率 >	65	57	—	< 2.1% >	

(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
	百万円	百万円
外 国		
株式先物取引		
SP EMINI	1,976	—
SP/TSE60	83	—
SWISS IX	79	—
EURO ST	355	—
SPI 200	102	—
FTSE100	128	—

(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

(2021年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	110,506,695	95.4
投資証券	2,480,576	2.1
コール・ローン等、その他	2,860,584	2.5
投資信託財産総額	115,847,855	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(115,680,098千円)の投資信託財産総額(115,847,855千円)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=109.25円	1 カナダドル=90.17円	1 ユーロ=133.08円	1 イギリスポンド=154.23円
1 スイスフラン=120.83円	1 スウェーデンクローネ=13.08円	1 ノルウェークローネ=13.15円	1 デンマーククローネ=17.90円
1 オーストラリアドル=84.50円	1 ニュージーランドドル=78.34円	1 香港ドル=14.07円	1 シンガポールドル=81.91円
1 イスラエルシェケル=33.4107円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月20日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	115,846,448,751
コール・ローン等	1,701,671,828
株式(評価額)	110,506,695,263
投資証券(評価額)	2,480,576,849
未収入金	36,331,770
未収配当金	123,364,845
差入委託証拠金	997,808,196
(B) 負債	113,582,800
未払金	18,437,221
未払解約金	95,145,539
未払利息	40
(C) 純資産総額(A-B)	115,732,865,951
元本	33,763,246,044
次期繰越損益金	81,969,619,907
(D) 受益権総口数	33,763,246,044口
1万口当たり基準価額(C/D)	34,278円

<注記事項>

- ①期首元本額 40,411,414,293円
 期中追加設定元本額 7,879,302,356円
 期中一部解約元本額 14,527,470,605円
 また、1口当たり純資産額は、期末3,4278円です。

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

三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	11,786,661,025円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	11,437,519,849円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	3,172,329,406円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,166,937,234円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,651,585,683円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	1,092,664,145円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	964,699,014円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国株式)	584,972,620円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	264,367,621円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	194,918,388円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	178,397,729円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	135,073,106円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	78,458,992円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	29,302,323円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	25,338,947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)	19,962円
合計	33,763,246,044円

○損益の状況 (2020年5月21日~2021年5月20日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	1,898,682,300
受取配当金	1,879,495,424
受取利息	4,793
その他収益金	22,261,761
支払利息	△ 3,079,678
(B) 有価証券売買損益	38,772,867,611
売買益	40,434,124,261
売買損	△ 1,661,256,650
(C) 先物取引等取引損益	793,814,287
取引益	995,536,233
取引損	△ 201,721,946
(D) 保管費用等	△ 37,396,152
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	41,427,968,046
(F) 前期繰越損益金	54,194,155,819
(G) 追加信託差損益金	13,799,769,653
(H) 解約差損益金	△27,452,273,611
(I) 計(E+F+G+H)	81,969,619,907
次期繰越損益金(I)	81,969,619,907

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

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

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

【お知らせ】

信託契約を解約し、信託を終了させる場合を追加するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2021年4月3日)

三菱UFJ 国内債券マザーファンド

《第21期》決算日2021年5月20日

[計算期間：2020年5月21日～2021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21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21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
17期(2017年5月22日)	13,798	△2.0	379.387	△2.0	99.3	0.3	212,031
18期(2018年5月21日)	13,877	0.6	381.504	0.6	99.2	0.4	225,098
19期(2019年5月20日)	14,116	1.7	388.062	1.7	99.3	0.2	239,103
20期(2020年5月20日)	14,135	0.1	388.555	0.1	99.5	0.2	242,398
21期(2021年5月20日)	14,062	△0.5	386.560	△0.5	99.5	0.2	289,699

(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	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年5月20日	円 14,135	% —	388.555	% —	% 99.5	% 0.2
5月末	14,117	△0.1	388.127	△0.1	102.0	0.2
6月末	14,062	△0.5	386.558	△0.5	99.7	0.2
7月末	14,110	△0.2	387.913	△0.2	99.7	0.2
8月末	14,046	△0.6	386.087	△0.6	102.5	0.1
9月末	14,087	△0.3	387.219	△0.3	99.8	0.1
10月末	14,064	△0.5	386.633	△0.5	98.9	0.1
11月末	14,083	△0.4	387.118	△0.4	103.8	0.1
12月末	14,085	△0.4	387.203	△0.3	101.0	0.1
2021年1月末	14,051	△0.6	386.252	△0.6	100.3	0.1
2月末	13,934	△1.4	383.056	△1.4	102.1	0.1
3月末	14,031	△0.7	385.724	△0.7	101.6	0.2
4月末	14,058	△0.5	386.440	△0.5	99.5	0.2
(期 末) 2021年5月20日	14,062	△0.5	386.560	△0.5	99.5	0.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

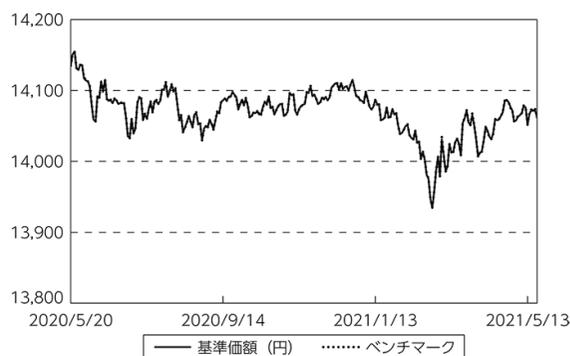
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.5%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(−0.5%)とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

● 投資環境について

◎ 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、期の前半はやや下落したあと概ね横ばいで推移しましたが、期の後半にインフレや米債増発への懸念による米金利の上昇、日本銀行の金融政策点検に対する警戒感などから下落しました。公表された点検結果は概ね市場予想通りとなり、長期金利の許容変動幅が明確化された安心感から、国内債券市況は反発したものの、期を通してみると国内債券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

- ・資産のほぼ全額を債券(先物を含む)に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
 - ・ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました[※]。
- ※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは0.5%の下落になったため、カイ離は△0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・取引要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2020年5月21日～2021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
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、14,068円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2020年5月21日～2021年5月20日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	105,426,153	61,331,968
	地方債証券	9,001,225	5,851,777 (340,000)
内	特殊債券	3,906,698	3,468,954 (438,668)
	社債券	19,927,717	16,288,590 (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	債券先物取引	百万円 1,969	百万円 1,819	百万円 -	百万円 -

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月21日～2021年5月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
公社債	百万円 138,261	百万円 30,671	22.2	百万円 86,941	百万円 22,077	25.4

(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 1,620	百万円 1,713	百万円 1,122

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 10,700

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HCキャピタル、アコムです。

○組入資産の明細

(2021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	226,364,000	241,609,431	83.4	—	57.1	17.5	8.9
地方債証券	13,539,800	14,310,611	4.9	—	2.0	1.9	1.0
	(13,539,800)	(14,310,611)	(4.9)	(—)	(2.0)	(1.9)	(1.0)
特殊債券 (除く金融債)	14,111,426	14,885,739	5.1	—	2.6	1.7	0.8
	(14,111,426)	(14,885,739)	(5.1)	(—)	(2.6)	(1.7)	(0.8)
金融債券	900,000	900,786	0.3	—	—	0.1	0.2
	(900,000)	(900,786)	(0.3)	(—)	(—)	(0.1)	(0.2)
普通社債券	16,171,000	16,436,529	5.7	—	1.9	3.4	0.4
	(16,171,000)	(16,436,529)	(5.7)	(—)	(1.9)	(3.4)	(0.4)
合 計	271,086,226	288,143,098	99.5	—	63.6	24.5	11.3
	(44,722,226)	(46,533,667)	(16.1)	(—)	(6.6)	(7.0)	(2.5)

(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413回利付国債 (2年)	0.1	830,000	831,967	2022/6/1
第414回利付国債 (2年)	0.1	100,000	100,267	2022/7/1
第415回利付国債 (2年)	0.1	1,350,000	1,353,874	2022/8/1
第416回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,616	2022/9/1
第417回利付国債 (2年)	0.1	1,100,000	1,103,608	2022/10/1
第418回利付国債 (2年)	0.1	1,300,000	1,304,524	2022/11/1
第421回利付国債 (2年)	0.1	2,000,000	2,008,000	2023/2/1
第422回利付国債 (2年)	0.1	1,420,000	1,426,191	2023/3/1
第423回利付国債 (2年)	0.005	1,650,000	1,654,306	2023/4/1
第132回利付国債 (5年)	0.1	2,170,000	2,175,273	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)	0.1	2,710,000	2,718,130	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)	0.1	1,920,000	1,926,988	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	1,200,000	1,205,172	2023/3/20
第136回利付国債 (5年)	0.1	710,000	713,479	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	1,860,000	1,870,230	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	2,420,000	2,434,737	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	2,280,000	2,295,207	2024/3/20
第140回利付国債 (5年)	0.1	2,780,000	2,799,765	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	2,540,000	2,559,126	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	2,150,000	2,167,393	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	2,250,000	2,269,035	2025/3/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	2,360,000	2,380,791	2025/6/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	1,440,000	1,453,478	2025/9/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	1,720,000	1,736,236	2025/12/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	220,000	318,131	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	415,000	582,377	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	285,000	401,516	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	470,000	664,467	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	460,000	629,188	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	550,000	742,082	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	600,000	778,884	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	630,000	766,344	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	1,020,000	930,403	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	1,030,000	1,100,029	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	840,000	870,970	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	740,000	693,653	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	1,080,000	1,009,422	2060/3/20
第323回利付国債 (10年)	0.9	470,000	475,217	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	989,819	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,390,000	1,407,180	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)	0.7	100,000	101,309	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	880,000	892,909	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,770,000	1,793,700	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	1,530,000	1,559,865	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,450,000	1,481,740	2023/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第331回利付国債 (10年)	0.6	640,000	651,014	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,680,000	1,711,785	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	700,000	714,616	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,160,000	1,186,204	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	1,520,000	1,551,798	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	180,000	184,048	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	980,000	994,984	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,350,000	1,377,000	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	2,160,000	2,205,619	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	2,420,000	2,474,280	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,450,000	1,477,376	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	2,030,000	2,049,203	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	2,750,000	2,775,960	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	2,440,000	2,463,521	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	3,490,000	3,524,236	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	2,670,000	2,696,566	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	1,860,000	1,878,730	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	3,450,000	3,485,086	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	2,100,000	2,121,504	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	2,830,000	2,858,101	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	1,260,000	1,272,070	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	1,700,000	1,715,606	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	2,200,000	2,220,042	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	2,650,000	2,672,816	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	960,000	967,756	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	3,080,000	3,103,069	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	2,030,000	2,043,905	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	2,960,000	2,978,233	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	2,620,000	2,634,200	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	2,840,000	2,851,842	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	1,910,000	1,916,360	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	830,000	831,618	2031/3/20
第1回利付国債 (30年)	2.8	120,000	147,756	2029/9/20
第2回利付国債 (30年)	2.4	170,000	205,263	2030/2/20
第3回利付国債 (30年)	2.3	190,000	228,596	2030/5/20
第4回利付国債 (30年)	2.9	125,000	158,612	2030/11/20
第5回利付国債 (30年)	2.2	180,000	217,954	2031/5/20
第6回利付国債 (30年)	2.4	170,000	210,742	2031/11/20
第7回利付国債 (30年)	2.3	225,000	278,541	2032/5/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	160,000	190,292	2032/11/22
第9回利付国債 (30年)	1.4	90,000	102,984	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	263,000	292,040	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	100,000	118,323	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	205,000	253,103	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	390,000	477,925	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	380,000	486,096	2034/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第15回利付国債 (30年)	2.5	440,000	570,468	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	345,000	448,641	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	350,000	451,825	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	360,000	461,120	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	290,000	372,389	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	260,000	342,136	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	250,000	322,792	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	285,000	377,237	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	140,000	185,781	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	230,000	305,971	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	205,000	267,231	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	430,000	568,610	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	400,000	537,864	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	415,000	560,374	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	480,000	642,912	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	625,000	830,231	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	725,000	953,614	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	570,000	762,984	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	623,000	803,327	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	765,000	1,018,926	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	910,000	1,181,571	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	970,000	1,263,551	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	920,000	1,184,279	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	785,000	997,632	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	560,000	724,550	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	590,000	751,642	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	520,000	652,579	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	650,000	816,517	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	560,000	704,160	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	620,000	780,356	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	610,000	741,814	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	880,000	1,070,792	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	770,000	955,131	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	600,000	717,150	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	770,000	920,704	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	800,000	845,536	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	760,000	714,179	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	810,000	797,445	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	720,000	724,816	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	520,000	547,544	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	790,000	831,253	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	700,000	736,015	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	800,000	840,536	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	1,050,000	1,102,342	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	620,000	635,183	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	670,000	718,883	2048/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第61回利付国債 (30年)		0.7	660,000	674,018	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)		0.5	490,000	474,912	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)		0.4	720,000	678,052	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)		0.4	750,000	704,287	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)		0.4	510,000	478,109	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)		0.4	810,000	758,070	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)		0.6	820,000	807,995	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)		0.6	800,000	788,200	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)		0.7	940,000	950,481	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)		0.7	160,000	161,393	2051/3/20
第56回利付国債 (20年)		2.0	370,000	378,517	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)		1.9	160,000	163,510	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)		1.9	350,000	359,471	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)		1.7	590,000	607,080	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)		1.4	230,000	235,563	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	260,000	265,387	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)		0.8	560,000	570,869	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)		1.8	275,000	286,079	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)		1.9	480,000	502,809	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)		1.9	430,000	452,566	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)		1.8	170,000	178,481	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)		1.9	80,000	84,600	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)		2.2	395,000	421,081	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)		2.1	120,000	127,582	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)		2.4	510,000	549,841	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)		2.2	200,000	214,386	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)		2.1	645,000	692,929	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)		2.0	200,000	215,258	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)		2.1	380,000	410,358	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	230,000	249,598	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)		1.9	210,000	226,277	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)		2.0	260,000	281,153	2025/3/20
第79回利付国債 (20年)		2.0	100,000	108,652	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)		2.1	370,000	403,529	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)		2.1	620,000	679,668	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)		2.1	182,000	200,482	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	410,000	449,749	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)		2.1	230,000	254,435	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)		2.3	532,000	593,680	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)		2.2	170,000	188,885	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)		2.3	460,000	515,995	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)		2.2	130,000	145,161	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)		2.2	470,000	527,405	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)		2.3	80,000	90,199	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)		2.1	650,000	729,267	2026/12/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	260,000	293,027	2027/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第95回利付国債 (20年)	2.3	490,000	560,760	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	120,000	135,864	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	330,000	377,421	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	340,000	386,695	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	635,000	725,417	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	370,000	426,906	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	350,000	408,628	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	190,000	222,845	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	320,000	373,049	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	310,000	356,989	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	350,000	404,645	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	210,000	244,330	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	240,000	278,642	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	500,000	572,910	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	60,000	68,980	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	280,000	326,295	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	450,000	530,010	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	610,000	713,529	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	360,000	422,654	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	580,000	683,373	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	290,000	344,172	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	215,000	256,086	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	510,000	602,973	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	444,000	522,747	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	240,000	278,222	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	520,000	593,403	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	690,000	808,597	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	800,000	955,504	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	340,000	402,849	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	910,000	1,098,697	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	200,000	237,568	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	90,000	106,027	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	1,020,000	1,205,058	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	800,000	939,584	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	420,000	488,985	2031/9/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	1,150,000	1,354,734	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	890,000	1,050,974	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	50,000	58,508	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	60,000	69,567	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	1,320,000	1,548,096	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	130,000	149,619	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	100,000	116,186	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	820,000	964,336	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	820,000	966,361	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	630,000	749,630	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	1,350,000	1,578,447	2033/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第144回利付国債 (20年)	1.5	10,000	11,575	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,380,000	1,632,857	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,340,000	1,588,637	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	930,000	1,093,168	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	840,000	979,045	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,090,000	1,272,269	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,170,000	1,352,344	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,320,000	1,492,576	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,000,000	1,131,530	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,480,000	1,696,006	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	1,160,000	1,314,314	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	1,480,000	1,636,169	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	1,220,000	1,242,606	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	1,100,000	1,086,470	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	880,000	907,130	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	1,390,000	1,453,161	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	1,110,000	1,176,200	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	900,000	939,258	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	1,210,000	1,261,606	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	1,280,000	1,333,286	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	1,330,000	1,361,707	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	1,180,000	1,206,573	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	1,050,000	1,107,340	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	1,000,000	1,019,770	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	1,050,000	1,051,743	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	1,090,000	1,070,707	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	710,000	696,084	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	1,070,000	1,047,861	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	970,000	965,770	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	1,150,000	1,142,904	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	1,370,000	1,360,231	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)	0.5	1,290,000	1,303,944	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	300,000	303,006	2041/3/20
小 計		226,364,000	241,609,431	
地方債証券				
第5回東京都公募公債 (20年)	2.11	100,000	108,020	2025/3/19
第7回東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	109,292	2025/9/19
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	70,000	93,950	2038/9/17
第8回東京都公募公債 (7年)	0.238	100,000	100,306	2022/9/20
第10回東京都公募公債 (30年)	2.31	100,000	132,086	2039/9/20
第710回東京都公募公債	0.81	100,000	100,868	2022/6/20
第713回東京都公募公債	0.77	100,000	101,017	2022/9/20
第719回東京都公募公債	0.86	200,000	203,116	2023/3/20
第724回東京都公募公債	0.7	800,000	812,896	2023/9/20
第728回東京都公募公債	0.65	400,000	406,564	2023/12/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	101,839	2024/3/19

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
地方債証券	%	千円	千円
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	400,000	425,420
平成24年度第9回北海道公募公債	0.79	50,000	50,558
平成26年度第13回北海道公募公債	0.461	100,000	101,569
第29回1号宮城県公募公債	0.68	200,000	203,250
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	100,000	136,706
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	135,368
第190回神奈川県公募公債	0.88	100,000	100,944
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	100,000	117,895
第372回大阪府公募公債	0.656	200,000	202,578
第435回大阪府公募公債	0.2	130,000	130,986
第451回大阪府公募公債	0.063	140,000	139,141
第460回大阪府公募公債	0.115	194,000	193,111
第464回大阪府公募公債	0.072	400,000	396,176
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	2.19	100,000	117,235
平成23年度第2回京都府公募公債	1.2	66,000	66,070
平成26年度第5回京都府公募公債(20年)	1.455	100,000	115,134
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	50,000	66,762
平成23年度第11回兵庫県公募公債	0.95	50,000	50,321
平成24年度第18回兵庫県公募公債	0.77	200,000	202,124
第27回兵庫県公募公債(20年)	0.387	200,000	200,764
第6回静岡県公募公債(15年)	1.062	300,000	323,211
第11回静岡県公募公債(20年)	1.841	200,000	231,436
平成25年度第7回静岡県公募公債	0.801	100,000	101,848
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	29,800	30,297
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	2.04	200,000	229,476
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	2.28	400,000	470,168
平成23年度第11回愛知県公募公債	1.03	70,000	70,314
平成24年度第5回愛知県公募公債	0.886	300,000	302,910
平成24年度第8回愛知県公募公債	0.835	200,000	202,108
平成30年度第5回愛知県公募公債	0.195	100,000	100,777
平成26年度第7回広島県公募公債	0.46	260,000	264,446
平成30年度第1回広島県公募公債	0.2	100,000	100,801
平成30年度第4回広島県公募公債	0.259	200,000	202,498
第8回埼玉県公募公債(20年)	2.19	100,000	117,235
第10回埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	116,771
第14回埼玉県公募公債(20年)	1.546	200,000	232,258
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	0.02	140,000	140,021
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	2.116	400,000	475,732
平成24年度第6回福岡県公募公債	0.8	100,000	101,133
平成23年度第5回千葉県公募公債	1.06	80,000	80,434
平成27年度第3回千葉県公募公債	0.524	200,000	204,170
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	300,000	303,597
第123回共同発行市場公募地方債	0.87	200,000	203,598
第124回共同発行市場公募地方債	0.91	300,000	305,886
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	101,835
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	102,001

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	101,838	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	200,000	203,956	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	200,000	203,444	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	200,000	202,428	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債		0.47	200,000	203,498	2025/3/25
第185回共同発行市場公募地方債		0.245	300,000	303,465	2028/8/25
平成24年度第1回長崎県公募公債		0.82	100,000	101,101	2022/9/28
平成24年度第1回静岡市公募公債		0.82	400,000	404,892	2022/11/22
平成24年度第6回大阪市公募公債		0.797	100,000	101,180	2022/11/18
平成26年度第7回大阪市公募公債		0.535	100,000	101,831	2024/11/28
第1回名古屋市長募公債(20年)		1.99	100,000	105,107	2023/12/20
第2回名古屋市長募公債(15年)		0.905	100,000	106,645	2029/11/16
第9回名古屋市長募公債(20年)		2.07	100,000	114,964	2028/12/20
第9回名古屋市長募公債(30年)		2.095	90,000	118,010	2042/9/19
第3回京都市公募公債(20年)		2.09	100,000	109,505	2025/12/19
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)		2.54	110,000	123,887	2026/6/19
第5回横浜市公募公債(20年)		2.17	100,000	108,799	2025/6/20
第7回横浜市公募公債(20年)		2.06	250,000	273,420	2025/12/19
第27回横浜市公募公債(20年)		1.599	40,000	46,395	2033/5/20
第35回横浜市公募公債(20年)		0.443	200,000	202,128	2036/10/28
平成24年度第7回札幌市公募公債		0.75	100,000	100,991	2022/9/20
令和2年度第7回札幌市公募公債		0.115	200,000	199,242	2030/12/20
第7回川崎市公募公債(20年)		2.08	100,000	116,033	2029/7/17
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	70,801	2022/10/31
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	50,018	2021/5/31
小	計		13,539,800	14,310,611	
特殊債券(除く金融債)					
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	200,000	233,358	2029/9/28
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	131,287	2040/5/31
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	123,970	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	116,441	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	14,018	2021/6/30
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	128,834	2042/2/28
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	100,000	101,012	2022/6/30
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.791	100,000	101,168	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	30,442	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	344,144	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	101,852	2023/6/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	208,000	211,704	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	100,000	101,817	2024/3/29
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	100,000	101,944	2024/4/30
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	101,956	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	300,000	305,076	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	101,625	2024/12/27
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.45	200,000	203,358	2025/3/31
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.509	133,000	135,644	2025/5/30

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249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.484	101,000	102,946	2025/6/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	100,000	101,432	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.145	100,000	100,620	2026/2/27
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.12	108,000	108,522	2028/4/28
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.9	35,000	35,261	2022/3/14
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.819	100,000	101,106	2022/9/16
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.734	200,000	202,360	2022/12/16
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.834	104,000	105,475	2023/1/20
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	38,551	2023/2/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.541	100,000	101,067	2023/4/21
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	101,855	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	305,000	310,377	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.645	100,000	101,792	2024/3/15
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	500,000	500,115	2026/3/13
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	102,000	102,017	2026/4/17
第25回政府保証日本政策金融公庫債券		0.815	143,000	145,096	2023/2/24
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	91,506	2023/10/20
第4回政府保証新関西国際空港債券		0.484	104,000	105,982	2025/6/13
第19回政府保証日本政策投資銀行		0.668	100,000	101,242	2023/3/15
第26回政府保証日本政策投資銀行		0.466	100,000	101,606	2024/12/12
第6回神奈川県住宅供給公社債券		0.215	100,000	99,305	2029/4/23
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)		2.23	30,000	33,805	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	150,951	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	156,304	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	147,162	2047/3/20
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.28	200,000	225,656	2027/4/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.67	110,000	159,921	2047/3/20
第28回道路債券(財投機関債)		2.83	100,000	131,090	2033/12/20
第42回道路債券(財投機関債)		2.22	200,000	216,740	2025/3/21
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	116,910	2032/9/17
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.038	200,000	203,768	2023/3/20
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.94	100,000	101,917	2023/6/20
第121回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.689	100,000	101,716	2023/12/20
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.133	200,000	220,928	2035/3/20
第3回回営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	100,000	101,874	2023/3/22
第4回回営企業債券(30年)(財投機関債)		2.95	100,000	133,097	2034/3/24
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.22	100,000	117,716	2030/1/28
第7回回営企業債券(20年)(財投機関債)		2.2	100,000	106,172	2024/3/22
第8回回営企業債券(20年)(財投機関債)		2.25	100,000	106,314	2024/3/22
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.132	100,000	118,577	2031/1/28
第24回回営企業債券(20年)(財投機関債)		2.29	100,000	114,921	2028/4/25
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	202,640	2023/1/27
第47回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.576	200,000	202,194	2023/4/28
F54回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.588	200,000	208,846	2024/3/19
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	70,000	79,333	2031/7/30
F151回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.348	100,000	107,981	2027/11/5

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	
F 203回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)	1.063	100,000	106,341	2028/2/28
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.1	600,000	613,602	2022/6/20
第4回中部国際空港(財投機関債)	0.305	200,000	202,232	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	23,228	23,780	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	25,900	26,802	2042/6/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	20,076	20,181	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	31,236	31,433	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	10,859	11,022	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	32,688	33,168	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	12,792	13,139	2042/12/10
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	92,373	92,230	2034/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	13,298	13,803	2043/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	22,258	22,465	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	22,378	22,602	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	11,143	11,240	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	10,569	10,674	2039/6/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	24,772	26,531	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	11,512	11,729	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	24,731	26,436	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	12,317	12,604	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	48,232	51,008	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	49,030	51,805	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	23,742	24,242	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	26,471	27,656	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	23,270	23,872	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3	23,574	24,150	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	89,310	95,098	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	50,568	53,534	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	49,140	52,031	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	25,053	26,450	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	26,418	27,865	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	28,334	29,911	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	26,222	27,201	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	31,093	32,780	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	32,435	34,204	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	35,943	37,919	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	38,089	40,243	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	39,325	41,397	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	76,430	80,158	2047/6/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	129,018	134,732	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	45,422	47,283	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	89,548	93,087	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	116,901	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	101,898	105,334	2049/11/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	63,247	64,989	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	235,490	2032/4/16

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106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	141,810	144,093	2051/3/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	230,010	231,212	2051/6/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	162,368	164,186	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	162,296	164,230	2052/3/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	82,887	83,790	2052/7/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	84,791	85,448	2052/12/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,629	86,630	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	85,536	86,363	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	85,557	86,250	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	85,708	86,431	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	172,792	174,483	2053/6/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	88,538	89,683	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	88,771	90,106	2053/11/10
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	92,140	91,556	2054/8/10
第149回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.704	200,000	203,846	2024/3/19
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	93,597	92,981	2054/11/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	94,429	94,702	2055/1/10
第161回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.713	100,000	103,611	2027/6/18
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	196,548	197,288	2055/11/10
第164回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.514	100,000	102,033	2025/8/20
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	99,077	99,507	2056/2/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	100,000	100,747	2056/5/10
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	99,918	2026/10/20
第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.24	100,000	100,753	2027/3/19
第231回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	0.06	100,000	100,083	2023/6/20
小 計		14,111,426	14,885,739	
金融債券				
い第843号商工債券	0.12	200,000	200,212	2025/8/27
第333回信金中金債	0.09	100,000	100,083	2022/8/26
第337回信金中金債	0.11	100,000	100,128	2022/12/27
第338回信金中金債	0.11	200,000	200,252	2023/1/27
第341回信金中金債	0.11	100,000	100,145	2023/4/27
第239号商工債券(3年)	0.02	200,000	199,966	2022/12/27
小 計		900,000	900,786	
普通社債券				
第548回東京電力	2.347	100,000	111,108	2028/9/29
第499回中部電力	1.194	50,000	51,206	2023/6/23
第510回関西電力	0.49	300,000	304,656	2027/7/23
第518回関西電力	0.44	100,000	101,181	2028/6/20
第524回関西電力	0.514	200,000	203,286	2028/10/25
第532回関西電力	0.18	100,000	100,270	2024/7/25
第383回中国電力	0.764	100,000	102,322	2024/10/25
第393回中国電力	0.26	100,000	100,409	2026/11/25
第485回東北電力	0.25	100,000	100,487	2026/7/24
第494回東北電力	0.425	200,000	202,832	2027/6/25
第509回東北電力	0.2	400,000	401,572	2024/5/24

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
普通社債券	%	千円	千円
第529回東北電力	0.07	200,000	199,490
第427回九州電力	1.024	100,000	102,854
第468回九州電力	0.435	100,000	101,283
第471回九州電力	0.455	300,000	304,278
第482回九州電力	0.17	300,000	300,825
第484回九州電力	0.375	200,000	201,242
第1回国際石油開発帝石	0.08	100,000	100,150
第21回大和ハウス工業	0.001	300,000	299,844
第10回明治ホールディングス (サステナビリティ)	0.05	100,000	99,980
第16回アサヒグループホールディングス	0.08	100,000	99,981
第3回 キュービー	0.23	100,000	99,982
第6回ヒューリック	0.494	200,000	200,284
第4回トヨタ紡織	0.21	200,000	199,974
第42回王子ホールディングス	0.08	100,000	100,029
第6回花王	0.13	200,000	200,100
第3回ヤフー	0.37	100,000	99,962
第15回Zホールディングス	0.35	200,000	200,252
第11回ブリヂストン	0.295	200,000	200,654
第4回新日本製鐵	0.375	100,000	100,035
第51回日本精工	0.19	100,000	99,406
第17回パナソニック	0.47	100,000	101,510
第18回J A三井リース	0.16	100,000	99,862
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,023
第9回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.22	100,000	100,050
第26回トヨタ自動車 (サステナビリティ)	0.05	100,000	100,024
第16回アイシン精機	0.16	100,000	99,215
第1回明治安田生命2018基金	0.315	100,000	100,144
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	100,019
第51回住友商事	1.241	100,000	107,167
第86回クレディセゾン	0.09	200,000	199,328
第1回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.94	100,000	101,642
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	100,000	101,084
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	300,000	300,018
第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	100,628
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	1.95	100,000	106,802
第88回三菱東京UFJ銀行	2.34	100,000	112,321
第15回住友信託銀行 (劣後特約付)	1.62	100,000	101,231
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)	2.14	100,000	108,185
第28回芙蓉総合リース	0.14	200,000	199,570
第4回みずほリース	0.24	100,000	100,224
第16回エス・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	100,000	100,417
第17回エス・ティ・ティ・ファイナンス	0.28	200,000	201,446
第31回東京センチュリー	0.01	200,000	199,536
第32回東京センチュリー	0.09	100,000	99,662
第64回ホンダファイナンス	0.001	200,000	199,754
第65回ホンダファイナンス	0.16	200,000	200,186

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95回トヨタファイナンス	0.001	200,000	200,010	2024/4/15
第96回トヨタファイナンス	0.06	300,000	299,979	2026/4/15
第35回リコーリース	0.04	100,000	99,959	2022/7/12
第39回リコーリース	0.05	200,000	199,836	2023/7/14
第40回リコーリース	0.04	200,000	199,686	2024/4/19
第41回リコーリース	0.14	200,000	199,670	2026/4/17
第7回イオンフィナンシャルサービス	0.19	100,000	99,895	2023/3/20
第79回アコム	0.29	100,000	99,820	2025/2/28
第80回アコム	0.28	100,000	99,653	2026/2/26
第201回オリックス	0.07	200,000	199,326	2026/4/21
第21回三井住友ファイナンス&リース	0.18	100,000	100,268	2023/11/27
第69回三菱UFJリース	0.24	200,000	200,826	2026/7/10
第24回野村ホールディングス	2.329	100,000	107,978	2025/6/24
第36回京王電鉄	0.325	100,000	100,819	2027/9/17
第32回東日本旅客鉄道	2.26	100,000	106,279	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道	2.53	100,000	107,642	2024/6/20
第53回東日本旅客鉄道	2.35	300,000	344,745	2028/4/21
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	125,329	2044/1/29
第102回東日本旅客鉄道	0.63	100,000	101,858	2024/7/25
第163回東日本旅客鉄道	0.05	200,000	199,594	2026/4/15
第73回西日本旅客鉄道	0.05	200,000	199,588	2026/4/22
第6回東海旅客鉄道	2.39	21,000	21,371	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道	2.312	100,000	116,581	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	114,598	2030/10/25
第83回東海旅客鉄道	0.001	400,000	399,820	2023/9/19
第2回東京地下鉄	2.36	500,000	535,590	2024/6/20
第28回東京地下鉄	0.25	300,000	301,662	2028/5/24
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	100,000	100,798	2028/9/13
第58回阪急阪神ホールディングス	0.09	100,000	99,887	2026/2/26
第64回名古屋鉄道	0.09	100,000	99,741	2026/3/23
第8回ニッコンホールディングス	0.23	100,000	100,020	2024/9/18
第5回ソフトバンク	0.1	600,000	599,628	2023/7/28
第8回電源開発	2.11	100,000	107,189	2024/12/20
第50回電源開発	0.415	200,000	202,570	2027/7/20
第15回東京電力パワーグリッド	0.89	100,000	101,334	2030/7/24
第16回東京電力パワーグリッド	0.57	200,000	201,970	2025/9/12
第28回東京電力パワーグリッド	1.01	200,000	205,100	2029/7/10
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	100,000	102,304	2029/10/9
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	200,000	202,106	2025/7/16
第44回東京電力パワーグリッド	0.4	100,000	100,077	2026/4/22
第13回広島ガス	0.405	100,000	100,758	2028/9/13
第6回SSK	0.14	100,000	99,993	2022/7/21
第14回フランス相互信用連合銀行	0.563	100,000	100,151	2021/10/15
第26回フランス相互信用連合銀行	0.443	100,000	100,268	2023/10/12
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	99,866	2024/10/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券 第8回新韓銀行	% 0.52	千円 300,000	千円 300,405	2022/11/2
小 計		16,171,000	16,436,529	
合 計		271,086,226	288,143,098	

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 605	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2021年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 288,143,098	% 99.4
コール・ローン等、その他	1,704,546	0.6
投資信託財産総額	289,847,644	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	289,846,084,512
コール・ローン等	1,120,593,931
公社債(評価額)	288,143,098,675
未収入金	1,275,600
未収利息	562,672,313
前払費用	17,123,993
差入委託証拠金	1,320,000
(B) 負債	146,509,694
未払解約金	146,509,391
未払利息	303
(C) 純資産総額(A-B)	289,699,574,818
元本	206,012,246,620
次期繰越損益金	83,687,328,198
(D) 受益権総口数	206,012,246,620口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,062円

<注記事項>

- ①期首元本額 171,486,959,342円
 期中追加設定元本額 55,973,800,561円
 期中一部解約元本額 21,448,513,283円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,062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 プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	72,060,077,529円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	44,909,131,566円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	31,982,561,458円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	19,246,154,095円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	9,530,096,034円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	8,582,663,820円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	6,680,202,281円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	5,478,928,501円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,505,038,212円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	1,623,311,801円
三菱UFJ J D C年金バランス(株式15)	1,400,369,556円
三菱UFJ J D C年金バランス(株式40)	935,896,238円
三菱UFJ J D C年金バランス(株式25)	459,242,641円
三菱UFJ J D C年金バランス(株式65)	303,695,388円
三菱UFJ J 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	178,590,588円
三菱UFJ J 6資産バランスファンド(成長型)	136,164,871円
三菱UFJ J 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)	122,041円
合計	206,012,246,620円

[お知らせ]

信託契約を解約し、信託を終了させる場合を追加するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2021年4月3日)

○損益の状況 (2020年5月21日~2021年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,083,906,020
受取利息	2,084,234,091
支払利息	△ 328,071
(B) 有価証券売買損益	△ 3,321,538,486
売買益	212,488,097
売買損	△ 3,534,026,583
(C) 先物取引等取引損益	△ 837,500
取引益	2,832,400
取引損	△ 3,669,900
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,238,469,966
(E) 前期繰越損益金	70,912,008,756
(F) 追加信託差損益金	22,727,947,786
(G) 解約差損益金	△ 8,714,158,378
(H) 計(D+E+F+G)	83,687,328,198
次期繰越損益金(H)	83,687,328,198

(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) (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。

三菱UFJ 外国債券マザーファンド

《第21期》決算日2021年5月20日

[計算期間：2020年5月21日～2021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21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21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
17期(2017年5月22日)	25,920	0.8	441.3251	1.0	98.9	—	54,433
18期(2018年5月21日)	26,312	1.5	446.7912	1.2	98.7	—	48,418
19期(2019年5月20日)	26,691	1.4	453.5333	1.5	98.6	—	51,055
20期(2020年5月20日)	28,109	5.3	479.0346	5.6	98.3	—	46,870
21期(2021年5月20日)	29,509	5.0	500.6569	4.5	97.9	—	56,667

(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) 2020年5月20日	円	%		%	%	%
	28,109	—	479.0346	—	98.3	—
5月末	28,230	0.4	481.0488	0.4	99.5	—
6月末	28,679	2.0	488.8139	2.0	97.8	—
7月末	28,964	3.0	494.1351	3.2	98.4	—
8月末	28,936	2.9	492.6490	2.8	99.3	—
9月末	29,073	3.4	494.8770	3.3	97.8	—
10月末	28,642	1.9	488.0379	1.9	97.8	—
11月末	28,936	2.9	493.2010	3.0	100.6	—
12月末	29,177	3.8	497.3313	3.8	98.0	—
2021年1月末	29,138	3.7	496.2129	3.6	97.9	—
2月末	28,879	2.7	494.1478	3.2	99.0	—
3月末	29,516	5.0	501.1200	4.6	98.2	—
4月末	29,503	5.0	502.9265	5.0	97.3	—
(期 末) 2021年5月20日	円	%		%	%	%
	29,509	5.0	500.6569	4.5	97.9	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

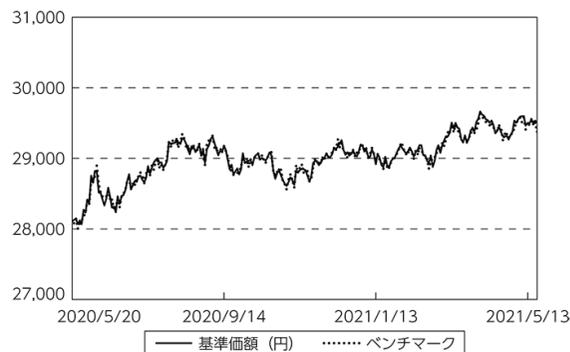
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ5.0%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(4.5%)を0.5%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**◎ 外国債券市況**

- ・ 先進国の債券市況は下落しました。
- ・ 先進国の債券市況は、米国での新型コロナウイルスのワクチン普及や経済正常化期待を背景とした金利上昇等により、期首との比較では下落しました。

◎ 為替市況

- ・ 米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

● 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4.5%の上昇になったため、乖離は0.5%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)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年5月21日～2021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 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)	8	0.027	
(そ の 他)	(8)	(0.027)	
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は、29,014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。

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月21日～2021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 17,997	百万円 9,319	% 51.8	百万円 10,542	百万円 8,352	% 79.2

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

○組入資産の明細

(2021年5月20日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 212,580	千アメリカドル 226,544	千円 24,749,943	% 43.7	% —	% 19.7	% 18.8	% 5.2
カナダ	千カナダドル 12,030	千カナダドル 12,785	1,152,864	2.0	—	0.9	0.8	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 77,400	千メキシコペソ 81,633	447,734	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	25,130	29,943	3,984,935	7.0	—	4.7	2.2	0.2
イタリア	34,230	40,681	5,413,947	9.6	—	6.0	2.8	0.7
フランス	35,490	42,188	5,614,472	9.9	—	6.8	2.9	0.2
オランダ	6,150	7,429	988,723	1.7	—	1.4	0.3	—
スペイン	23,000	27,818	3,702,056	6.5	—	4.4	2.2	—
ベルギー	7,800	9,729	1,294,852	2.3	—	1.8	0.5	—
オーストリア	4,950	5,928	788,917	1.4	—	1.0	0.4	—
フィンランド	2,220	2,392	318,403	0.6	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	2,980	3,373	448,894	0.8	—	0.5	0.2	0.0
イギリス	千イギリスポンド 17,960	千イギリスポンド 23,754	3,663,691	6.5	—	5.1	1.1	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 13,690	千スウェーデンクローネ 14,836	194,060	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 9,750	千ノルウェークローネ 10,002	131,535	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 12,320	千デンマーククローネ 14,961	267,807	0.5	—	0.3	0.1	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 10,550	千ポーランドズロチ 11,455	336,866	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 13,520	千オーストラリアドル 14,707	1,242,785	2.2	—	1.5	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,630	千シンガポールドル 2,899	237,480	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 9,720	千マレーシアリンギット 10,304	271,553	0.5	—	0.3	0.1	0.0
イスラエル	千イスラエルシェケル 5,610	千イスラエルシェケル 6,929	231,530	0.4	—	0.3	0.1	—
合 計	—	—	55,483,057	97.9	—	56.4	34.1	7.4

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

(注) 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	0.125 T-NOTE 220731	0.125	1,500	1,500	163,939	2022/7/31
	0.125 T-NOTE 230515	0.125	2,000	1,998	218,329	2023/5/15
	0.125 T-NOTE 231215	0.125	1,850	1,843	201,417	2023/12/15
	0.25 T-NOTE 230615	0.25	1,300	1,301	142,230	2023/6/15
	0.375 T-NOTE 250430	0.375	1,870	1,852	202,374	2025/4/30
	0.5 T-NOTE 230315	0.5	1,900	1,912	208,920	2023/3/15
	0.5 T-NOTE 270430	0.5	3,350	3,232	353,135	2027/4/30
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	1,800	1,730	189,106	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 270831	0.5	2,150	2,059	224,969	2027/8/31
	0.625 T-NOTE 271231	0.625	2,530	2,426	265,054	2027/12/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	2,470	2,267	247,690	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	3,450	3,152	344,447	2030/8/15
	0.875 T-NOTE 301115	0.875	3,270	3,047	332,951	2030/11/15
	1.125 T-NOTE 250228	1.125	1,600	1,633	178,507	2025/2/28
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,700	1,739	190,005	2023/7/31
	1.375 T-BOND 500815	1.375	2,410	1,885	205,944	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 221015	1.375	3,300	3,357	366,848	2022/10/15
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,000	2,052	224,261	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,650	2,722	297,406	2023/9/30
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	1,270	1,308	143,002	2025/1/31
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,700	1,742	190,404	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241130	1.5	1,350	1,397	152,718	2024/11/30
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	2,120	2,180	238,223	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 220831	1.625	1,500	1,529	167,056	2022/8/31
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,050	2,108	230,375	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	850	874	95,575	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,900	1,964	214,621	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	2,540	2,636	288,020	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	1,880	1,949	212,987	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	1,300	1,344	146,940	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	1,210	1,250	136,602	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	2,360	2,383	260,448	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	1,550	1,592	173,947	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	2,000	2,063	225,413	2023/5/15
	1.75 T-NOTE 240630	1.75	2,550	2,658	290,492	2024/6/30
	1.75 T-NOTE 240731	1.75	2,450	2,556	279,257	2024/7/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,650	1,687	184,332	2022/8/31
	2 T-NOTE 230215	2.0	1,900	1,961	214,272	2023/2/15
	2 T-NOTE 240531	2.0	1,950	2,046	223,589	2024/5/31
	2 T-NOTE 250215	2.0	3,600	3,795	414,608	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	1,970	2,079	227,194	2025/8/15
	2 T-NOTE 261115	2.0	2,350	2,478	270,747	2026/11/15
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	1,950	2,012	219,861	2022/12/31
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	3,700	3,875	423,346	2023/11/30

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			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	国債証券	2.125	T-NOTE 240229	2.125	3,000	3,152	344,380	2024/2/29
		2.125	T-NOTE 240331	2.125	3,000	3,154	344,675	2024/3/31
		2.125	T-NOTE 240731	2.125	1,400	1,477	161,433	2024/7/31
		2.125	T-NOTE 240930	2.125	1,400	1,478	161,565	2024/9/30
		2.125	T-NOTE 250515	2.125	1,870	1,982	216,635	2025/5/15
		2.125	T-NOTE 260531	2.125	1,000	1,061	115,941	2026/5/31
		2.25	T-BOND 460815	2.25	1,050	1,023	111,808	2046/8/15
		2.25	T-BOND 490815	2.25	1,490	1,444	157,790	2049/8/15
		2.25	T-NOTE 231231	2.25	1,520	1,598	174,628	2023/12/31
		2.25	T-NOTE 240131	2.25	2,450	2,579	281,829	2024/1/31
		2.25	T-NOTE 240430	2.25	1,700	1,795	196,128	2024/4/30
		2.25	T-NOTE 241115	2.25	2,300	2,441	266,734	2024/11/15
		2.25	T-NOTE 270215	2.25	1,900	2,028	221,594	2027/2/15
		2.25	T-NOTE 270815	2.25	2,390	2,546	278,252	2027/8/15
		2.25	T-NOTE 271115	2.25	2,390	2,543	277,926	2027/11/15
		2.375	T-NOTE 230131	2.375	1,200	1,245	136,057	2023/1/31
		2.375	T-NOTE 240815	2.375	3,290	3,500	382,416	2024/8/15
		2.375	T-NOTE 270515	2.375	1,720	1,846	201,739	2027/5/15
		2.5	T-BOND 450215	2.5	940	963	105,274	2045/2/15
		2.5	T-BOND 460215	2.5	1,030	1,053	115,085	2046/2/15
		2.5	T-BOND 460515	2.5	1,050	1,073	117,298	2046/5/15
		2.5	T-NOTE 230815	2.5	1,800	1,891	206,697	2023/8/15
		2.5	T-NOTE 240515	2.5	1,800	1,915	209,293	2024/5/15
		2.5	T-NOTE 260228	2.5	3,450	3,725	407,036	2026/2/28
		2.625	T-NOTE 230228	2.625	2,100	2,192	239,525	2023/2/28
		2.625	T-NOTE 230630	2.625	1,600	1,682	183,806	2023/6/30
		2.625	T-NOTE 250331	2.625	1,010	1,089	119,053	2025/3/31
		2.625	T-NOTE 251231	2.625	1,600	1,734	189,514	2025/12/31
		2.75	T-BOND 421115	2.75	850	913	99,812	2042/11/15
		2.75	T-BOND 470815	2.75	770	825	90,221	2047/8/15
		2.75	T-BOND 471115	2.75	780	836	91,346	2047/11/15
		2.75	T-NOTE 230731	2.75	2,700	2,850	311,452	2023/7/31
		2.75	T-NOTE 231115	2.75	2,350	2,496	272,713	2023/11/15
		2.75	T-NOTE 240215	2.75	2,300	2,454	268,186	2024/2/15
		2.75	T-NOTE 250228	2.75	1,630	1,763	192,636	2025/2/28
		2.75	T-NOTE 250630	2.75	1,370	1,488	162,605	2025/6/30
		2.75	T-NOTE 250831	2.75	2,410	2,618	286,114	2025/8/31
		2.75	T-NOTE 280215	2.75	2,430	2,663	290,967	2028/2/15
		2.875	T-BOND 430515	2.875	950	1,040	113,691	2043/5/15
		2.875	T-BOND 450815	2.875	750	821	89,743	2045/8/15
		2.875	T-BOND 461115	2.875	890	975	106,549	2046/11/15
		2.875	T-BOND 490515	2.875	1,300	1,430	156,310	2049/5/15
		2.875	T-NOTE 230930	2.875	950	1,009	110,282	2023/9/30
		2.875	T-NOTE 250430	2.875	2,200	2,396	261,812	2025/4/30
		2.875	T-NOTE 280515	2.875	2,300	2,538	277,325	2028/5/15

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.875 T-NOTE 280815	2.875	2,500	2,761	301,664	2028/8/15
	3 T-BOND 420515	3.0	1,390	1,554	169,878	2042/5/15
	3 T-BOND 441115	3.0	940	1,051	114,898	2044/11/15
	3 T-BOND 450515	3.0	480	536	58,640	2045/5/15
	3 T-BOND 451115	3.0	600	671	73,385	2045/11/15
	3 T-BOND 470215	3.0	790	886	96,863	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	700	785	85,846	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	1,050	1,179	128,863	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	1,240	1,394	152,387	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	1,250	1,407	153,808	2049/2/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	1,500	1,648	180,083	2025/9/30
	3 T-NOTE 251031	3.0	1,000	1,099	120,128	2025/10/31
	3.125 T-BOND 411115	3.125	620	706	77,175	2041/11/15
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,380	1,574	172,013	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	780	889	97,135	2043/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	1,060	1,210	132,221	2044/8/15
	3.125 T-BOND 480515	3.125	1,010	1,160	126,837	2048/5/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	2,740	3,075	336,049	2028/11/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	920	1,093	119,414	2044/5/15
	3.375 T-BOND 481115	3.375	1,270	1,529	167,076	2048/11/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	790	974	106,444	2044/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	970	1,206	131,811	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	730	915	100,005	2043/11/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,060	1,395	152,419	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	660	872	95,358	2040/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	900	1,194	130,457	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,300	1,738	189,914	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,330	1,785	195,085	2040/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	670	889	97,175	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	760	1,023	111,772	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	810	1,098	120,011	2039/8/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	900	1,242	135,696	2040/2/15
	5 T-BOND 370515	5.0	880	1,239	135,369	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	900	1,148	125,525	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	800	1,025	112,070	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	760	1,018	111,221	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	1,080	1,391	152,013	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	850	1,055	115,334	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	1,180	1,544	168,777	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	900	1,021	111,625	2023/8/15
小 計					24,749,943	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	1 CAN GOVT 220901	1.0	1,360	1,373	123,817	2022/9/1
	1 CAN GOVT 270601	1.0	430	426	38,475	2027/6/1
	1.25 CAN GOVT 300601	1.25	1,230	1,203	108,551	2030/6/1

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	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,760	1,801	162,450	2023/6/1	
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	130	133	12,016	2026/6/1	
		2 CAN GOVT 280601	2.0	350	367	33,155	2028/6/1	
		2 CAN GOVT 511201	2.0	740	707	63,835	2051/12/1	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,850	1,958	176,642	2025/6/1	
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	390	416	37,570	2029/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,150	1,218	109,848	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	850	872	78,660	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	250	280	25,254	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	230	262	23,696	2064/12/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	300	378	34,094	2045/12/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	220	290	26,225	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	190	271	24,461	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	370	493	44,469	2029/6/1	
5.75 CAN GOVT 330601	5.75	230	328	29,634	2033/6/1			
小 計					1,152,864			
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	7,650	8,653	47,463	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	1,600	1,993	10,935	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	13,200	12,937	70,956	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	5,600	5,692	31,222	2022/6/9	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	2,500	2,570	14,097	2023/3/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,100	7,484	41,047	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	4,100	4,358	23,907	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	1,700	1,786	9,801	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	5,150	5,173	28,372	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	11,700	12,412	68,080	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	3,800	3,896	21,369	2047/11/7	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	7,200	8,018	43,979	2029/5/31	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	6,100	6,654	36,499	2038/11/18	
		小 計					447,734	
ユーロ	ドイツ	国債証券		千ユーロ	千ユーロ			
			0 BUND 260815	—	940	964	128,410	2026/8/15
			0 BUND 290815	—	990	1,010	134,461	2029/8/15
			0 BUND 300215	—	750	763	101,653	2030/2/15
			0 BUND 350515	—	360	353	47,058	2035/5/15
			0 BUND 500815	—	570	500	66,670	2050/8/15
			0 OBL 231013	—	550	559	74,403	2023/10/13
			0 OBL 240405	—	670	682	90,851	2024/4/5
			0 OBL 241018	—	1,100	1,123	149,528	2024/10/18
			0.25 BUND 270215	0.25	940	978	130,274	2027/2/15
			0.25 BUND 280815	0.25	800	834	111,077	2028/8/15
			0.25 BUND 290215	0.25	1,000	1,042	138,761	2029/2/15
			0.5 BUND 250215	0.5	1,600	1,667	221,904	2025/2/15
			0.5 BUND 270815	0.5	850	899	119,729	2027/8/15

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	0.5 BUND 280215	0.5	760	805	107,242	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	730	769	102,385	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,040	1,110	147,793	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	660	803	106,972	2048/8/15
		1.5 BUND 230515	1.5	800	834	111,113	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,110	1,182	157,342	2024/5/15
		1.75 BUND 240215	1.75	720	768	102,229	2024/2/15
		2 BUND 230815	2.0	730	774	103,036	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	650	970	129,160	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	810	1,231	163,863	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	460	744	99,092	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	680	1,089	144,976	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	500	864	115,047	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	550	755	100,488	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	710	1,154	153,621	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	570	1,058	140,893	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	750	1,166	155,262	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	350	492	65,593	2028/1/4
6.25 BUND 240104	6.25	480	568	75,638	2024/1/4		
6.25 BUND 300104	6.25	390	613	81,580	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	560	802	106,816	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,060	1,069	142,394	2025/2/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	800	815	108,540	2023/10/15
		0.85 ITALY GOVT 270115	0.85	600	613	81,580	2027/1/15
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	150	152	20,262	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,350	1,379	183,556	2023/3/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	630	658	87,614	2026/12/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	650	685	91,168	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	750	796	106,042	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	720	755	100,484	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	400	422	56,236	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	720	776	103,386	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	730	794	105,797	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	580	632	84,203	2027/8/1
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	600	660	87,840	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	810	890	118,466	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 231001	2.45	550	583	77,716	2023/10/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	650	733	97,626	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	410	444	59,112	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	730	792	105,476	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	620	682	90,828	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	490	559	74,481	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	800	919	122,345	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	520	581	77,346	2067/3/1
		3 ITALY GOVT 290801	3.0	950	1,110	147,843	2029/8/1

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	3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	410	513	68,382	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	430	532	70,843	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	430	557	74,172	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,270	1,544	205,553	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	850	954	126,988	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	350	485	64,623	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,030	1,375	183,066	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	750	819	109,029	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	900	1,014	134,989	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	640	767	102,194	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,250	1,386	184,514	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	770	988	131,591	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	480	736	98,066	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	980	1,160	154,502	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	730	1,048	139,482	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	780	1,185	157,828	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	790	1,209	161,014	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,120	1,519	202,178	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	570	617	82,214	2022/11/1
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	660	983	130,838	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	770	1,129	150,304	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	750	1,029	137,019	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	550	752	100,176	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	700	856	114,016	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 250325	—	1,080	1,098	146,204	2025/3/25
		0 O. A. T 301125	—	1,330	1,306	173,849	2030/11/25
		0.25 O. A. T 261125	0.25	900	924	123,086	2026/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,220	1,266	168,517	2025/5/25
		0.5 O. A. T 260525	0.5	1,110	1,155	153,826	2026/5/25
		0.75 O. A. T 280525	0.75	1,660	1,758	233,986	2028/5/25
		0.75 O. A. T 281125	0.75	1,460	1,545	205,724	2028/11/25
		0.75 O. A. T 520525	0.75	660	603	80,356	2052/5/25
		1 O. A. T 251125	1.0	1,230	1,307	173,985	2025/11/25
		1 O. A. T 270525	1.0	920	987	131,351	2027/5/25
		1.25 O. A. T 340525	1.25	1,070	1,178	156,865	2034/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	1,090	1,198	159,541	2036/5/25
		1.5 O. A. T 310525	1.5	1,080	1,217	161,997	2031/5/25
		1.5 O. A. T 500525	1.5	870	974	129,733	2050/5/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	1,740	1,823	242,625	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	1,220	1,317	175,275	2024/11/25
		1.75 O. A. T 390625	1.75	810	960	127,870	2039/6/25
		1.75 O. A. T 660525	1.75	420	505	67,269	2066/5/25
		2 O. A. T 480525	2.0	740	921	122,642	2048/5/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	850	922	122,702	2024/5/25
2.5 O. A. T 300525	2.5	1,950	2,367	315,067	2030/5/25		

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	2.75 O.A.T 271025	2.75	1,230	1,463	194,715	2027/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	690	1,046	139,230	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	1,030	1,226	163,262	2026/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	720	1,121	149,296	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	490	897	119,424	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	440	839	111,713	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	2,060	2,304	306,666	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	950	1,615	214,967	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	720	1,139	151,658	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	1,230	1,768	235,367	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	830	1,341	178,482	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	850	1,094	145,595	2025/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	840	988	131,608	2023/4/25
		オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 240115	—	90	91
0 NETH GOVT 520115	—			220	186	24,831	2052/1/15
0.25 NETH GOVT 250715	0.25			420	433	57,686	2025/7/15
0.5 NETH GOVT 260715	0.5			420	440	58,572	2026/7/15
0.5 NETH GOVT 400115	0.5			300	307	40,938	2040/1/15
0.75 NETH GOVT 270715	0.75			510	543	72,376	2027/7/15
0.75 NETH GOVT 280715	0.75			1,190	1,273	169,468	2028/7/15
1.75 NETH GOVT 230715	1.75			490	515	68,643	2023/7/15
2 NETH GOVT 240715	2.0			250	270	36,032	2024/7/15
2.5 NETH GOVT 330115	2.5			460	588	78,318	2033/1/15
2.75 NETH GOVT 470115	2.75			390	608	80,991	2047/1/15
3.75 NETH GOVT 420115	3.75			440	737	98,098	2042/1/15
4 NETH GOVT 370115	4.0			450	710	94,504	2037/1/15
5.5 NETH GOVT 280115	5.5			520	721	96,076	2028/1/15
スペイン	国債証券	0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	550	560	74,543	2023/7/30
		0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	750	751	100,049	2030/4/30
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	880	894	118,995	2029/10/31
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	390	337	44,920	2050/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	660	714	95,129	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	670	726	96,654	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	950	1,031	137,220	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	650	706	94,019	2029/4/30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,000	1,087	144,709	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,110	1,191	158,604	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	980	1,080	143,762	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	650	735	97,828	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,000	1,104	147,018	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	930	1,097	146,025	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	350	443	59,027	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,030	1,139	151,704	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	420	549	73,073	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	430	634	84,493	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	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
スペイン	国債証券	3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	940	1,056	140,639	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	790	1,153	153,501	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	750	840	111,808	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	910	1,097	146,024	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	570	918	122,291	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,070	1,221	162,618	2024/1/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	620	1,014	134,960	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	550	748	99,604	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	400	703	93,581	2044/10/31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,050	1,623	216,089	2032/7/30
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,170	1,534	204,211	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	780	1,119	148,943	2029/1/31
		ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	300	305
0.8 BEL GOVT 250622	0.8			570	599	79,846	2025/6/22
0.8 BEL GOVT 270622	0.8			700	744	99,071	2027/6/22
0.8 BEL GOVT 280622	0.8			500	533	70,941	2028/6/22
0.9 BEL GOVT 290622	0.9			560	601	79,985	2029/6/22
1 BEL GOVT 310622	1.0			300	324	43,174	2031/6/22
1.45 BEL GOVT 370622	1.45			380	428	56,989	2037/6/22
1.6 BEL GOVT 470622	1.6			370	422	56,180	2047/6/22
2.15 BEL GOVT 660622	2.15			230	306	40,780	2066/6/22
2.25 BEL GOVT 230622	2.25			100	106	14,116	2023/6/22
2.25 BEL GOVT 570622	2.25			180	240	32,043	2057/6/22
2.6 BEL GOVT 240622	2.6			500	549	73,114	2024/6/22
3 BEL GOVT 340622	3.0			520	691	91,999	2034/6/22
3.75 BEL GOVT 450622	3.75			300	484	64,440	2045/6/22
4 BEL GOVT 320328	4.0			270	378	50,416	2032/3/28
4.25 BEL GOVT 410328	4.25			590	968	128,856	2041/3/28
4.5 BEL GOVT 260328	4.5			350	434	57,775	2026/3/28
5 BEL GOVT 350328	5.0			490	789	105,035	2035/3/28
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	590	821	109,374	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 300220	—	450	448	59,633	2030/2/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	250	261	34,817	2027/4/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	340	354	47,195	2029/2/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	290	307	40,875	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	410	435	57,971	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	250	268	35,703	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	250	297	39,546	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	80	98	13,137	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	500	537	71,554	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	550	581	77,370	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	170	261	34,816	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	220	278	37,123	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	240	373	49,657	2044/6/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	100	200	26,667	2062/1/26

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
オーストリア	国債証券	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	390	614	81,788	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	250	314	41,803	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	210	294	39,254	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 230915	—	50	50	6,753	2023/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	160	153	20,368	2036/4/15
		0.125 FINNISH GOV 520415	0.125	80	66	8,880	2052/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	350	365	48,633	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	330	345	45,943	2028/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	170	180	24,049	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	130	137	18,312	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	110	121	16,145	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	180	211	28,191	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	120	124	16,629	2023/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	220	236	31,517	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	60	84	11,298	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	200	241	32,196	2028/7/4
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	60	71	9,483	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	230	245	32,658	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	420	447	59,504	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	250	270	35,996	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	350	387	51,502	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	230	255	33,963	2031/3/18
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	160	179	23,855	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	230	268	35,690	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	210	261	34,813	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	330	396	52,759	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	120	133	17,737	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	150	162	21,601	2023/3/20
5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	300	366	48,810	2025/3/13		
小 計						22,555,205	
イギリス							
国債証券	0.125 GILT 230131	0.125	800	800	123,514	2023/1/31	
	0.125 GILT 260130	0.125	400	395	61,012	2026/1/30	
	0.375 GILT 301022	0.375	550	525	81,014	2030/10/22	
	0.75 GILT 230722	0.75	330	334	51,651	2023/7/22	
	1.25 GILT 270722	1.25	630	657	101,470	2027/7/22	
	1.5 GILT 260722	1.5	580	612	94,499	2026/7/22	
	1.625 GILT 281022	1.625	290	310	47,923	2028/10/22	
	1.625 GILT 711022	1.625	320	373	57,583	2071/10/22	
	1.75 GILT 370907	1.75	530	567	87,531	2037/9/7	
	2 GILT 250907	2.0	660	709	109,362	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,250	1,312	202,397	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	500	706	109,004	2065/7/22	
	3.25 GILT 440122	3.25	830	1,133	174,846	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	710	1,014	156,517	2045/1/22	

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	3.5 GILT 680722	3.5	520	937	144,534	2068/7/22
		3.75 GILT 520722	3.75	400	641	98,942	2052/7/22
		4 GILT 600122	4.0	400	728	112,322	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	650	804	124,146	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	710	953	147,064	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	560	792	122,235	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	320	474	73,225	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	340	511	78,933	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	630	1,017	156,948	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	710	1,191	183,715	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	560	1,010	155,869	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	600	851	131,393	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	740	1,175	181,248	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	460	624	96,359	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	400	620	95,724	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	1,120	1,322	203,976	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	460	640	98,720	2028/12/7
小	計					3,663,691	
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	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	1,400	1,354	17,714	2031/5/12
		0.75 SWD GOVT 280512	0.75	1,050	1,089	14,252	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	1,700	1,758	23,002	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	2,900	3,051	39,919	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	1,640	1,712	22,398	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	1,750	1,934	25,305	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	1,900	1,975	25,837	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	1,350	1,959	25,631	2039/3/30
小	計					194,060	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	1.25	500	486	6,398	2031/9/17
		1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	1,400	1,387	18,249	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	700	714	9,390	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	950	979	12,880	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	1,000	1,030	13,553	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	1,000	1,026	13,492	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	1,750	1,802	23,696	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	1,750	1,831	24,082	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	700	744	9,791	2024/3/14
小	計					131,535	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 521115	0.25	920	819	14,664	2052/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	1,700	1,774	31,769	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	2,900	3,020	54,074	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	2,200	2,311	41,380	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	1,460	1,599	28,635	2025/11/15

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
デンマーク		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
国債証券	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	3,140	5,434	97,282	2039/11/15
小 計					267,807	
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	1.25 POLAND 301025	1.25	340	322	9,471	2030/10/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	900	956	28,115	2026/7/25
	2.5 POLAND 270725	2.5	1,160	1,230	36,182	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	1,400	1,511	44,459	2028/4/25
	2.75 POLAND 291025	2.75	1,000	1,079	31,730	2029/10/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,350	2,564	75,404	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	1,600	1,741	51,213	2023/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,300	1,397	41,105	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	500	652	19,184	2029/4/25
小 計					336,866	
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 AUST GOVT 301221	1.0	830	781	66,039	2030/12/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	1,200	1,133	95,738	2032/5/21
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	390	315	26,643	2051/6/21
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	150	154	13,093	2022/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	550	588	49,766	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	990	1,068	90,315	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	800	862	72,863	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	540	596	50,386	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	650	716	60,563	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	580	628	53,119	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	320	334	28,268	2041/5/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	290	310	26,277	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,310	1,451	122,641	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	750	856	72,379	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	210	237	20,089	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	280	338	28,573	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,070	1,252	105,833	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	710	912	77,114	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	850	1,035	87,537	2027/4/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	300	331	27,988	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	750	799	67,551	2022/7/15
小 計					1,242,785	
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	1.75 SINGAPORGVT 230201	1.75	200	204	16,767	2023/2/1
	2.125 SINGAPORGVO 260601	2.125	120	127	10,414	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGVT 360801	2.25	250	264	21,684	2036/8/1
	2.75 SINGAPORGVT 230701	2.75	350	367	30,087	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGVT 420401	2.75	200	231	18,921	2042/4/1
	2.75 SINGAPORGVT 460301	2.75	250	294	24,153	2046/3/1
	2.875 SINGAPORGVO 290701	2.875	200	222	18,241	2029/7/1
	2.875SINGAPORGVT 300901	2.875	290	324	26,584	2030/9/1

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	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	400	431	35,378	2024/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	220	260	21,314	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	150	170	13,932	2027/3/1
小		計				237,480	
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	356	9,395	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	250	256	6,760	2023/3/15
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	700	725	19,119	2027/5/31
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	500	524	13,826	2028/6/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	250	256	6,753	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	350	362	9,556	2023/8/17
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	300	302	7,969	2033/4/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	550	582	15,342	2027/11/16
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	430	456	12,019	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	790	834	21,995	2025/9/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	400	422	11,127	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	4.232	1,030	1,104	29,109	2031/6/30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	200	207	5,462	2035/5/31
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	400	431	11,364	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,070	1,174	30,955	2030/4/15
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	200	216	5,707	2033/11/7
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	700	738	19,462	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	900	970	25,563	2037/4/7
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	350	381	10,061	2043/9/30
小		計				271,553	
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券	1.5 ISRAEL FIXED 370531	1.5	230	219	7,342	2037/5/31
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	1,300	1,438	48,055	2028/9/28
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	1,950	2,154	71,981	2024/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	1,080	1,716	57,354	2042/1/31
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	1,050	1,400	46,796	2026/10/30
小		計				231,530	
合		計				55,483,057	

(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

(2021年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 55,483,057	% 97.7
コール・ローン等、その他	1,306,116	2.3
投資信託財産総額	56,789,173	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (56,669,025千円) の投資信託財産総額 (56,789,173千円) に対する比率は99.8%です。

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

1 アメリカドル=109.25円	1 カナダドル=90.17円	1 メキシコペソ=5.4847円	1 ユーロ=133.08円
1 イギリスポンド=154.23円	1 スウェーデンクローネ=13.08円	1 ノルウェークローネ=13.15円	1 デンマーククローネ=17.90円
1 ポーランドズロチ=29.4055円	1 オーストラリアドル=84.50円	1 シンガポールドル=81.91円	1 マレーシアリングgit=26.3535円
1 イスラエルシェケル=33.4107円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	56,827,892,484
コール・ローン等	918,473,085
公社債(評価額)	55,483,057,540
未収入金	53,482,719
未収利息	327,422,164
前払費用	45,456,976
(B) 負債	159,904,482
未払金	96,122,337
未払解約金	63,782,129
未払利息	16
(C) 純資産総額(A-B)	56,667,988,002
元本	19,203,331,473
次期繰越損益金	37,464,656,529
(D) 受益権総口数	19,203,331,473口
1万口当たり基準価額(C/D)	29,509円

<注記事項>

- ①期首元本額 16,674,794,007円
 期中追加設定元本額 6,498,823,027円
 期中一部解約元本額 3,970,285,561円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,9509円です。

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

三菱UFJ ブライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	4,085,864,763円
三菱UFJ ブライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	2,696,084,742円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	2,324,959,799円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	2,145,874,536円
三菱UFJ ブライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,596,240,774円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	1,489,715,548円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	1,336,010,178円
三菱UFJ 外国債券オープン	869,988,688円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	486,643,704円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	447,882,965円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	378,772,761円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	349,057,149円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	227,400,417円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	194,741,830円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	159,198,085円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	149,323,189円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	127,628,782円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	66,808,465円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	57,560,921円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	13,567,258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)	6,919円
合計	19,203,331,473円

○損益の状況 (2020年5月21日~2021年5月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,098,907,858
受取利息	1,101,615,447
支払利息	△ 2,707,589
(B) 有価証券売買損益	1,314,059,176
売買益	4,132,357,073
売買損	△ 2,818,297,897
(C) 保管費用等	△ 13,599,081
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,399,367,953
(E) 前期繰越損益金	30,195,559,586
(F) 追加信託差損益金	12,399,402,266
(G) 解約差損益金	△ 7,529,673,276
(H) 計(D+E+F+G)	37,464,656,529
次期繰越損益金(H)	37,464,656,529

- (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。

【お 知 ら せ】

信託契約を解約し、信託を終了させる場合を追加するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2021年4月3日)

MUAM J-REITマザーファンド

《第17期》決算日2021年3月10日

[計算期間：2020年3月11日～2021年3月10日]

「MUAM J-REITマザーファンド」は、3月10日に第17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17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
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
13期(2017年3月10日)	26,870	△ 4.4	3,310.28	△ 0.7	97.8	16,702
14期(2018年3月12日)	26,458	△ 1.5	3,203.75	△ 3.2	96.7	11,617
15期(2019年3月11日)	31,019	17.2	3,730.52	16.4	97.7	12,917
16期(2020年3月10日)	33,369	7.6	3,981.30	6.7	95.1	14,957
17期(2021年3月10日)	34,809	4.3	4,126.53	3.6	98.1	16,265

(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)		投 資 信 託 券 率 組 入 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期首) 2020年3月10日	円	%			%
	33,369	—	3,981.30	—	95.1
3月末	28,621	△14.2	3,343.59	△16.0	96.5
4月末	28,298	△15.2	3,313.25	△16.8	97.2
5月末	30,335	△9.1	3,586.37	△9.9	97.5
6月末	29,821	△10.6	3,525.99	△11.4	97.0
7月末	30,346	△9.1	3,535.10	△11.2	96.5
8月末	31,717	△5.0	3,735.15	△6.2	96.7
9月末	31,390	△5.9	3,698.94	△7.1	97.3
10月末	29,853	△10.5	3,512.43	△11.8	96.3
11月末	30,784	△7.7	3,635.82	△8.7	96.5
12月末	32,618	△2.3	3,854.76	△3.2	96.6
2021年1月末	33,826	1.4	4,004.00	0.6	97.9
2月末	35,490	6.4	4,207.24	5.7	97.8
(期末) 2021年3月10日	34,809	4.3	4,126.53	3.6	98.1

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

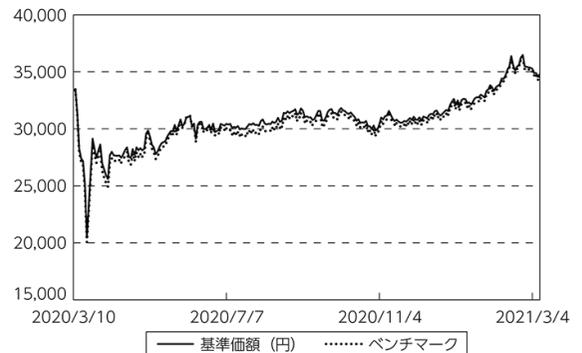
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(3.6%)を0.7%上回りました。

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

各国が積極的な金融政策や財政政策を打ち出したことや、新型コロナウイルスワクチンの接種開始などにより経済正常化への期待が高まったことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

各国で新型コロナウイルスが爆発的に感染拡大したことにより世界的な景気への悪影響が懸念されたことなどが、基準価額の一時的な下落要因となりました。

(銘柄要因)

上位5銘柄…日本都市ファンド投資法人、G L P投資法人、産業ファンド投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、大和ハウスリート投資法人

下位5銘柄…日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、オリックス不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人

● 投資環境について

◎ J-REIT市況

J-REIT市況は上昇しました。

- ・期首から2020年3月中旬にかけては、各国で新型コロナウイルスが爆発的に感染拡大したことにより世界的な景気への悪影響が懸念されて大幅に下落しました。3月下旬から期末にかけては、オフィス・ビル空室率の上昇傾向などにより一時的に弱含む局面もあったものの、各国が積極的な金融政策や財政政策を打ち出したことや、新型コロナウイルスワクチンの接種開始などにより経済正常化への期待が高まったことなどから、上昇基調で推移しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・銘柄選定およびポートフォリオの構築は主に、定性的評価・定量的評価を経て行っています。
- ・定性的評価については、事業内容および財務内容などの分析を中心に行い、定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、投資口価格純資産倍率（PBR）などの分析を行いました。
- ・組入銘柄数は54～55銘柄程度で推移させました。
- ・主な売買動向については、保有物件の売却益なども活用しながら持続的な分配金成長が期待できると判断したG L P投資法人のウェイトを引き上げたことや、業績見通しや各種バリュエーションの相対的な割安度を勘案してジャパンエクセレント投資法人のウェイトを引き下げたことなどが挙げられます。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について (プラス要因)

- ・伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人、日本都市ファンド投資法人をベンチマークに対してオーバーウェイトとしていたことがプラスに寄与しました。

(マイナス要因)

- ・フロンティア不動産投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人をベンチマークに対してアンダーウェイトとしていたことがマイナスに影響しました。

○今後の運用方針

- ・REITの組入比率については、高水準（90%以上）を維持する方針です。
- ・配当利回りやPBR等のバリュエーション、また物件ポートフォリオのクオリティ等に着目し、安定した分配金が見込め相対的に割安と思われる銘柄への投資ウェイトを高めた運用を行います。
- ・新型コロナウイルスワクチンの接種が国内において開始され、また国内外における新規感染者数も減少傾向にあります。ワクチンが広く普及するには相応の時間を要することから、当面の経済の回復ペースは緩やかなものになると考えていますが、着実に経済活動正常化に向けた動きが広がってくると見ています。また、各国中央銀行による金融緩和策を背景とした低金利環境も当面続くとみられることなどから、引き続きJ-REIT市況は堅調に推移するとみています。
- ・このような市場環境に対する想定のもと、物流や小売など大口テナントの業界動向に加えて、スポンサーのサポート体制にも着目しつつ、REIT各社に対する綿密な調査を継続することにより、個別銘柄ごとの業績動向や中長期的な成長性を慎重に見極めて選別投資を行い、パフォーマンスの向上に努めてまいります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年3月11日～2021年3月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 10 (10)	% 0.033 (0.033)	(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
合 計	10	0.033	
期中の平均基準価額は、30,796円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2020年3月11日～2021年3月10日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付		
		口数	金額	口数	金額	
		千口	千円	千口	千円	
国	エスコンジャパンリート投資法人	1	133,192	0.8	75,629	
	サンケイリアルエステート投資法人	0.6	58,901	1	130,805	
	SOSiLA物流リート投資法人	0.8	108,651	0.1	13,486	
	日本アコモデーションファンド投資法人	—	—	0.1	60,410	
	MCUBS MidCity投資法人	—	—	0.1	6,577	
		(△ 1)	(△ 116,040)			
	森ヒルズリート投資法人	0.1	13,720	0.4	50,955	
	産業ファンド投資法人	0.3	56,191	0.2	30,302	
	アドバンス・レジデンス投資法人	0.15	44,894	0.15	47,205	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.2	36,051	—	—	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.07	27,519	0.27	97,779	
	GLP投資法人	1	206,288	0.051	8,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.1	30,227	0.3	91,946	
	日本プロロジスリート投資法人	0.4	119,152	0.4	126,598	
	星野リゾート・リート投資法人	0.25	119,128	—	—	
	Oneリート投資法人	0.05	11,942	0.1	22,846	
	イオンリート投資法人	1	119,934	0.2	18,993	
	ヒューリックリート投資法人	—	—	0.5	59,881	
	日本リート投資法人	0.3	114,949	—	—	
	インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	—	—	3	39,274	
	積水ハウス・リート投資法人	0.5	33,770	1	83,416	
	ケネディクス商業リート投資法人	0.95	193,003	0.35	72,706	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	0.07	8,640	—	—	
	野村不動産マスターファンド投資法人	0.9	122,656	0.1	12,698	
	内	ラサールロジポート投資法人	0.2	28,346	0.6	93,369
		スターアジア不動産投資法人	—	—	0.18	7,539
		(1)	(72,163)			
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		0.1	43,443	0.1	48,481	
さくら総合リート投資法人		1	78,413	0.2	13,203	
		(△ 1)	(△ 72,163)			
投資法人みらい		—	—	0.1	3,332	
森トラスト・ホテルリート投資法人		1	116,099	—	—	
三菱地所物流リート投資法人		0.3	108,538	0.05	21,035	
CREロジスティクスファンド投資法人		0.1	12,148	—	—	
ザイマックス・リート投資法人	—	—	0.1	8,478		
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.7	80,744	1	225,122		
日本ビルファンド投資法人	0.4	270,986	0.05	34,051		
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.25	155,556	0.1	59,650		

○利害関係人との取引状況等

(2020年3月11日～2021年3月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
投資信託証券	百万円 4,053	百万円 811	20.0	百万円 2,457	百万円 506	20.6

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 111

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)	4,657千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,014千円
(B) / (A)	21.8%

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

○組入資産の明細

(2021年3月10日現在)

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率	
	千口	千口	千円		%
エスコンジャパンリート投資法人	0.5	1	123,900		0.8
サンケイリアルエステート投資法人	1	0.7	77,420		0.5
SOSiLA物流リート投資法人	0.5	1	150,360		0.9
日本アコモデーションファンド投資法人	0.6	0.5	289,000		1.8
MCUBS Midcity投資法人	1	—	—		—
森ヒルズリート投資法人	2	2	336,720		2.1
産業ファンド投資法人	2	2	431,000		2.6
アドバンス・レジデンス投資法人	1	1	467,250		2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1	1	245,180		1.5
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	0.8	368,800		2.3
GLP投資法人	3	4	708,300		4.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.8	0.6	185,100		1.1
日本プロジスリート投資法人	2	2	698,050		4.3
星野リゾート・リート投資法人	0.05	0.3	175,200		1.1
Oneリート投資法人	0.25	0.2	56,620		0.3
イオンリート投資法人	1	2	287,400		1.8
ヒューリックリート投資法人	1	0.8	132,880		0.8
日本リート投資法人	0.3	0.6	233,400		1.4
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6	3	52,560		0.3
積水ハウス・リート投資法人	4	3	319,580		2.0
ケネディクス商業リート投資法人	0.2	0.8	209,840		1.3
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.03	0.1	13,060		0.1
野村不動産マスターファンド投資法人	4	5	906,950		5.6
ラサールロジポート投資法人	2	2	296,000		1.8
スターアジア不動産投資法人	—	1	83,680		0.5
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.6	0.6	281,100		1.7
さくら総合リート投資法人	0.1	—	—		—
投資法人みらい	1	0.9	39,735		0.2
森トラスト・ホテルリート投資法人	—	1	129,200		0.8
三菱地所物流リート投資法人	0.05	0.3	117,150		0.7
CREロジスティクスファンド投資法人	0.6	0.7	104,370		0.6
ザイマックス・リート投資法人	0.2	0.1	10,440		0.1
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1	0.5	63,900		0.4
日本ビルファンド投資法人	1	1	1,158,500		7.1
ジャパンリアルエステイト投資法人	1	1	1,122,000		6.9
日本都市ファンド投資法人	2	8	923,100		5.7
オリックス不動産投資法人	2	2	493,640		3.0
日本プライムリアルティ投資法人	0.8	1	385,000		2.4
プレミアム投資法人	1	1	214,950		1.3
東急リアル・エステート投資法人	1	1	264,150		1.6
グローバル・ワン不動産投資法人	2	1	118,300		0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	2	2	395,280		2.4
森トラスト総合リート投資法人	0.5	1	196,820		1.2

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	%	
インヴィンシブル投資法人	4	8	337,025	2.1	
フロンティア不動産投資法人	0.15	0.1	46,050	0.3	
平和不動産リート投資法人	1	1	147,000	0.9	
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.3	0.6	174,180	1.1	
福岡リート投資法人	0.05	1	199,080	1.2	
ケネディクス・オフィス投資法人	0.43	0.5	361,500	2.2	
いちごオフィスリート投資法人	1	0.8	69,440	0.4	
大和証券オフィス投資法人	0.4	0.4	290,400	1.8	
阪急阪神リート投資法人	0.3	0.2	28,980	0.2	
大和ハウスリート投資法人	2	2	612,260	3.8	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1	6	374,400	2.3	
大和証券リビング投資法人	3	3	311,400	1.9	
ジャパンエクセレント投資法人	2	1	132,900	0.8	
合 計	口 数 ・ 金 額	78	93	15,950,500	
	銘 柄 数<比 率>	54	54	<98.1%>	

(注) 比率および合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) エスコンジャパンリート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、SOS i LA物流リート投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、MCUBS Mid City投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、Oneリート投資法人、イオンリート投資法人、ヘ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、スターアジア不動産投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、さくら総合リート投資法人、投資法人みらい、森トラスト・ホテルリート投資法人、三菱地所物流リート投資法人、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、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、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急阪神リート投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、大和証券リビング投資法人、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2020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

(2021年3月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	15,950,500	97.2
コール・ローン等、その他	461,674	2.8
投資信託財産総額	16,412,174	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	16,412,174,791
コール・ローン等	101,859,957
投資証券(評価額)	15,950,500,000
未収入金	166,472,184
未収配当金	193,342,650
(B) 負債	146,706,819
未払金	90,756,767
未払解約金	55,950,024
未払利息	28
(C) 純資産総額(A-B)	16,265,467,972
元本	4,672,753,293
次期繰越損益金	11,592,714,679
(D) 受益権総口数	4,672,753,293口
1万口当たり基準価額(C/D)	34,809円

<注記事項>

- ①期首元本額 4,482,527,378円
 期中追加設定元本額 1,180,634,059円
 期中一部解約元本額 990,408,144円
 また、1口当たり純資産額は、期末3.4809円です。

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

三菱UFJ <DC> J-REITファンド	4,205,529,228円
MUAM J-REITファンド(適格機関投資家転売制限付)	323,212,226円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	74,612,664円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	55,585,240円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	5,540,613円
ファンド・マネジャー(国内リート)	3,786,341円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	2,408,836円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	2,078,145円
合計	4,672,753,293円

○損益の状況 (2020年3月11日~2021年3月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	583,823,750
受取配当金	577,803,572
受取利息	2,076
その他収益金	6,105,803
支払利息	△ 87,701
(B) 有価証券売買損益	135,540,397
売買益	1,134,679,509
売買損	△ 999,139,112
(C) 当期損益金(A+B)	719,364,147
(D) 前期繰越損益金	10,475,216,117
(E) 追加信託差損益金	2,377,776,716
(F) 解約差損益金	△ 1,979,642,301
(G) 計(C+D+E+F)	11,592,714,679
次期繰越損益金(G)	11,592,714,679

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

MUAM G-REITマザーファンド

《第15期》決算日2021年1月5日

〔計算期間：2020年1月7日～2021年1月5日〕

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

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国 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
11期(2017年1月5日)	16,039	6.2	41,801.16	5.5	98.8	18,949
12期(2018年1月5日)	16,420	2.4	42,522.26	1.7	98.0	18,551
13期(2019年1月7日)	15,011	△ 8.6	38,602.62	△ 9.2	98.8	19,712
14期(2020年1月6日)	18,377	22.4	47,161.24	22.2	99.0	30,217
15期(2021年1月5日)	15,806	△14.0	40,236.52	△14.7	99.0	40,409

(注) S & P先進国REITインデックスとは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS & Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。なお、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）は、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み）をもとに、委託会社が計算したものです。S & P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJ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、SPDJ、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 先 進 国 R E I T イ ン デ ッ ク ス (除く日本、配当込 み、円換算ベース)	騰 落 率	投 資 信 託 券 率 組 入 比 率
	円	騰 落 率			
(期 首) 2020年1月6日	18,377	% —	47,161.24	% —	% 99.0
1月末	18,923	3.0	48,553.04	3.0	99.0
2月末	17,805	△3.1	45,640.42	△3.2	98.8
3月末	13,378	△27.2	34,126.01	△27.6	99.0
4月末	14,298	△22.2	36,418.41	△22.8	99.4
5月末	14,433	△21.5	36,769.78	△22.0	99.3
6月末	14,590	△20.6	37,151.26	△21.2	98.8
7月末	14,857	△19.2	37,787.41	△19.9	99.3
8月末	15,317	△16.7	39,001.97	△17.3	99.3
9月末	14,683	△20.1	37,350.97	△20.8	99.1
10月末	14,203	△22.7	36,104.61	△23.4	99.5
11月末	15,983	△13.0	40,687.85	△13.7	99.7
12月末	16,149	△12.1	41,107.17	△12.8	98.7
(期 末) 2021年1月5日	15,806	△14.0	40,236.52	△14.7	99.0

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.0%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

● 投資環境について

◎ 外国REIT市況

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

◎ 為替市況

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

● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ その他の要因によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(2020年1月7日～2021年1月5日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(4)	(0.025)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.022	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(3)	(0.022)	
(c) そ の 他 費 用	19	0.120	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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（権利割当にかかる現地徴収税等）
(保 管 費 用)	(6)	(0.037)	
(そ の 他)	(13)	(0.082)	
合 計	26	0.167	
期中の平均基準価額は、15,486円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2020年1月7日～2021年1月5日)

株式

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

(注) 金額は受渡代金。

投資信託証券

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

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

外

国

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

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

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

外 国

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
HAMMERSON PLC-NIL PAID-RTS	— (1,024)	— (—)	1,024	82
LAND SECURITIES GROUP PLC	93	583	7	46
INTU PROPERTIES PLC	329	23	530	20
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	176	267	15	25
SEGRO PLC	177	1,524	28	253
WORKSPACE GROUP PLC	20	145	3	28
SHAFESBURY PLC	53	303	3	20
BIG YELLOW GROUP PLC	20	203	—	—
DERWENT LONDON PLC	15	451	1	45
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	132	277	20	47
HANSTEEN HOLDINGS PLC	—	—	90	105
RDI REIT PLC	27	25	—	—
SAFESTORE HOLDINGS PLC	24	170	2	20
TRITAX BIG BOX REIT PLC	247	338	48	79
ASSURA PLC	357	278	—	—
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	117	50	—	—
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	94	65	27	20
REGIONAL REIT LTD	83	65	—	—
CAPITAL & REGIONAL PLC	— (△ 68)	— (—)	7	3
NEWRIVER REIT PLC	109	82	85	64
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	69	66	—	—
UNITE GROUP PLC/THE	50	456	—	—
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	108	112	—	—
LXI REIT PLC	57	66	—	—
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	149	93	77	50
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46	41	—	—
PICTON PROPERTY INCOME LTD	136	96	80	61
AEW UK REIT PLC	29	18	39	25
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	288	465	17	33
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	307	217	41	25
CUSTODIAN REIT PLC	125	116	—	—
GCP STUDENT LIVING PLC	147	197	—	—
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	223	242	27	29
STANDARD LIFE INV PROP INC	126	67	—	—
小 計	5,383 (785)	8,181 (—)	2,239	1,262
オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
VICINITY CENTRES	768	1,206	197	276
ABACUS PROPERTY GROUP	67	181	20	54
INGENIA COMMUNITIES GROUP	71	324	27	129
CHARTER HALL GROUP	56	567	1	21
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	58	138	15	52
CROMWELL PROPERTY GROUP	176	167	—	—
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	158	364	—	—

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

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

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

(注) 金額は受渡代金。

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

○株式売買比率

(2020年1月7日～2021年1月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	1,141千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	-千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	-

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年1月7日～2021年1月5日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2021年1月5日現在)

外国株式

2021年1月5日現在の組入れはございません。

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

外国投資信託証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2021年1月5日現在)

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

(注) 期末における外貨建純資産(40,358,023千円)の投資信託財産総額(40,849,626千円)に対する比率は98.8%です。

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

1 アメリカドル=103.15円	1 カナダドル=80.68円	1 ユーロ=126.42円	1 イギリスポンド=139.93円
1 オーストラリアドル=79.07円	1 ニュージーランドドル=74.00円	1 香港ドル=13.30円	1 シンガポールドル=78.15円
100韓国ウォン=9.51円	1 イスラエルシェケル=32.11円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月5日現在)

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

<注記事項>

- ①期首元本額 16,442,762,098円
 期中追加設定元本額 13,706,779,891円
 期中一部解約元本額 4,583,748,796円
 また、1口当たり純資産額は、期末15,806円です。

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

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

○損益の状況 (2020年1月7日~2021年1月5日)

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

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

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