

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／インデックス型	
信 託 期 間	無期限（2012年2月15日設定）	
運 用 方 針	各マザーファンド受益証券および短期金融資産等への投資を通じて、合成ベンチマークに連動する成果をめざして運用を行います。 三菱UFJ トビックスインデックスマザーファンド受益証券16%、三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券20%、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券4%、三菱UFJ 国内債券マザーファンド受益証券42%、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券5%、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券4%、東証REIT指数マザーファンド受益証券3%、MUAM G-REITマザーファンド受益証券3%および短期金融資産3%の比率配分として基準ポートフォリオを構築します。基準ポートフォリオは原則として年1回見直し（確認）を行うこととします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱UFJ トビックスインデックスマザーファンド受益証券、三菱UFJ 外国株式マザーファンド受益証券、新興国株式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、三菱UFJ 外国債券マザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数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。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	三菱UFJ トビックスインデックスマザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 外国株式マザーファンド	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックスマザーファンド	新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	新興国債券インデックスマザーファンド	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
	東証REIT指数マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）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。
	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。
	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60%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	三菱UFJ トビックスインデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	三菱UFJ 外国株式マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）および外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分 配 方 針	新興国株式インデックスマザーファンド	株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	三菱UFJ 国内債券マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	三菱UFJ 外国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興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制限を設けません。
	東証REIT指数マザーファンド	株式およ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割合に制限を設けません。
	MUAM G-REITマザーファンド	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分 配 方 針	経費等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。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※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。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ プライムバランス （8資産）（確定拠出年金）

第9期（決算日：2020年5月20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 プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）」は、去る5月20日に第9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

お客さま専用 フリーダイヤル	0120-151034
	（受付時間：営業日の9:00～17:00、 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。	

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			合成ベンチマーク		株 式	株 式	債 券	債 券	投資信託	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率	組 入 比 率	先 物 比 率	組 入 比 率	先 物 比 率	証 券 組 入 比 率	
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
５期(2016年５月20日)	14,761	0	△5.6	14,943	△5.4	38.0	1.1	50.9	0.1	6.4	6,511
６期(2017年５月22日)	15,894	0	7.7	16,141	8.0	38.9	1.0	50.2	0.1	6.4	8,677
７期(2018年５月21日)	16,886	0	6.2	17,201	6.6	39.2	1.0	49.8	0.2	6.4	11,979
８期(2019年５月20日)	16,816	0	△0.4	17,183	△0.1	37.4	1.1	51.3	0.1	6.5	16,393
９期(2020年５月20日)	16,517	0	△1.8	16,947	△1.4	38.9	1.0	50.4	0.1	6.3	20,326

(注) 当ファンドのベンチマークは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）16%、MSC I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）20%、MSC I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）4%、NOMURA-BPI 総合42%、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）5%、JPMorgan Global Diversified（円換算ベース）4%、東証REIT指数（配当込み）3%、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）3%および短期金融資産（有担保コール（翌日物））3%で組み合わせた合成指数です。ベンチマークは、設定日の前営業日の値を10,000として委託会社が計算したものです。

(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) 株式先物比率には、不動産投信指数先物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合わせるので、「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		合 成 ベ ン チ マ ー ク		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	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2019年 5月20日	16,816	—	17,183	—	37.4	1.1	51.3	0.1	6.5
5月末	16,652	△1.0	17,026	△0.9	37.3	1.1	51.0	0.1	6.7
6月末	16,967	0.9	17,344	0.9	38.7	1.0	50.5	0.1	6.5
7月末	17,136	1.9	17,523	2.0	38.5	0.8	50.5	0.1	6.7
8月末	16,896	0.5	17,284	0.6	37.4	1.6	50.6	0.1	6.7
9月末	17,184	2.2	17,590	2.4	39.1	0.9	50.5	0.1	6.7
10月末	17,530	4.2	17,934	4.4	39.0	0.9	50.4	0.1	6.7
11月末	17,678	5.1	18,098	5.3	38.7	1.3	50.4	0.1	6.5
12月末	17,853	6.2	18,283	6.4	39.1	1.0	50.6	0.1	6.3
2020年 1月末	17,818	6.0	18,251	6.2	38.0	1.2	50.5	0.1	6.6
2月末	17,192	2.2	17,622	2.6	36.9	1.1	51.7	0.1	6.3
3月末	15,917	△5.3	16,325	△5.0	37.9	1.8	52.1	0.1	5.3
4月末	16,444	△2.2	16,861	△1.9	39.1	1.2	49.6	0.1	6.4
(期 末)									
2020年 5月20日	16,517	△1.8	16,947	△1.4	38.9	1.0	50.4	0.1	6.3

(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) 株式先物比率には、不動産投信指数先物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。

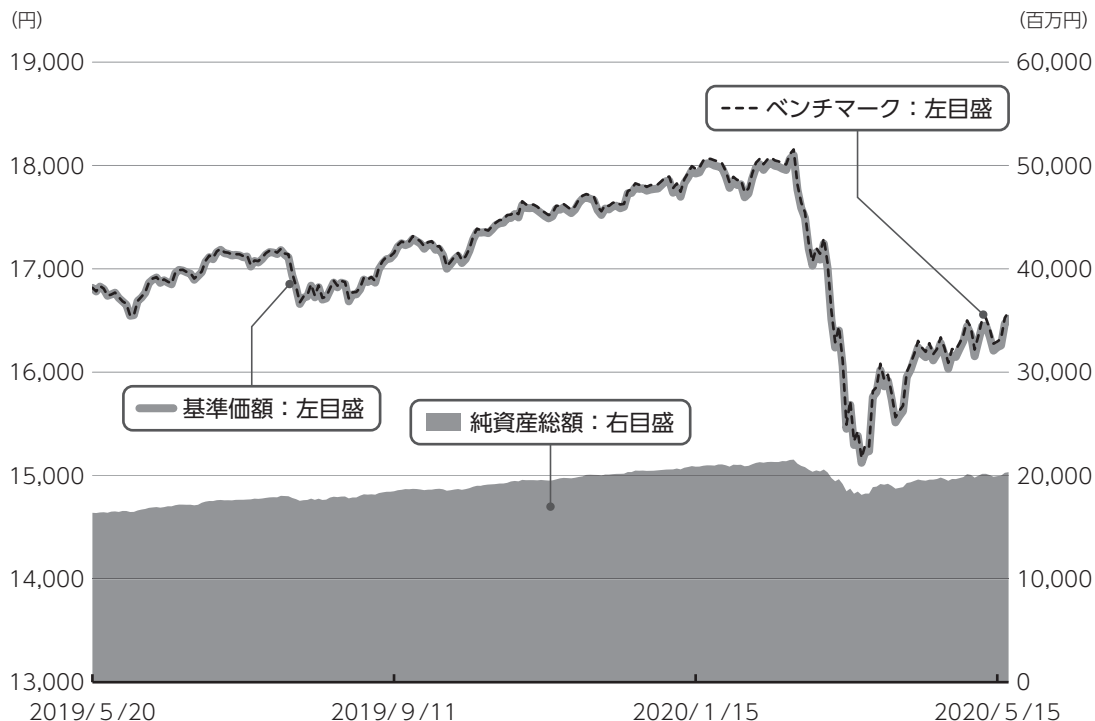
(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第９期：2019年5月21日～2020年5月20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 9 期 首	16,816円
第 9 期 末	16,517円
既払分配金	0円
騰 落 率	－1.8%

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

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

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.8%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（－1.4%）を0.4%下回りました。

基準価額の主な変動要因**下落要因**

主に内外ＲＥＩＴ市況が下落したことなどが、基準価額の下落要因となりました。

組入ファンド	騰落率	組入比率（対純資産総額）
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	－1.3%	16.3%
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	0.1%	41.7%
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	5.3%	5.0%
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	－2.7%	20.0%
MUAM G－ＲＥＩＴマザーファンド	－23.4%	2.8%
新興国株式インデックスマザーファンド	－7.0%	4.0%
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	－14.5%	3.1%
新興国債券インデックスマザーファンド	－2.8%	4.1%

第９期：２０１９年５月２１日～２０２０年５月２０日

投資環境について

▶ 国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

期首から２０２０年１月末にかけて、米中貿易摩擦問題や英国の欧州連合（ＥＵ）離脱問題の進退等を受け、国内株式市況は上下する展開になりました。１月末以降は、新型肺炎の世界的流行（パンデミック）を受けて投資家心理が冷え込み、国内株式市況は下落しました。

▶ 外国株式市況

外国株式市況はほぼ横ばいとなりました。

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

▶ 新興国株式市況

新興国株式市況は下落しました。

新興国株式市況は、新型肺炎の世界的な感染拡大懸念などを受けて下落しました。

▶ 国内債券市況

国内債券市況は上昇しました。

期の前半は、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことなどから国内債券市況は上昇しましたが、その後下落しました。また、期の後半は、新型肺炎による景気後退懸念などから上昇後、

すぐに財政拡張による国債増発懸念などから下落しましたが、期を通して見ると国内債券市況は上昇しました。

▶ 外国債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

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

▶ 新興国債券市況

新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首に比べて上昇しました。

▶ 国内ＲＥＩＴ市況

国内ＲＥＩＴ市況は下落しました。

２０２０年２月下旬から３月下旬にかけて、新型肺炎の世界的流行（パンデミック）により投資家のリスク回避姿勢が強まる中、運用資産を現金化する動き等から国内ＲＥＩＴ市場も売りが加速したこと等を受け、国内ＲＥＩＴ市況は下落しました。

▶ 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、ユーロ、ブラジルレアルが対円でそれぞれ下落しました。

米ドル、ユーロは円に対して下落しました。

世界景気の減速懸念が高まったことなどから、多くの新興国通貨は対円で売られました。特に新型コロナウイルスの感染者数拡大と政治混乱が嫌気されたブラジルレアルなどが対円で大きく下落しました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産） （確定拠出年金）

新興国を含む内外の株式・債券および日本と先進国のリートに投資し、各資産の指数を独自に合成した指数に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

各マザーファンド受益証券および短期金融資産等への投資を通じて、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）１６％、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）２０％、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）４％、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合４２％、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）５％、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）４％、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）３％、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）３％および短期金融資産（有担保コール（翌日物））３％で組み合わせた合成ベンチマークに連動する成果をめざして運用を行いました。

▶ 三菱ＵＦＪ トピックスインデックス マザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

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

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

▶ 三菱UFJ 外国株式マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）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

▶ 新興国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている新興国の株式（先物・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。

▶ 新興国債券インデックスマザーファンド

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（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。

▶ 東証REIT指数マザーファンド

資産のほぼ全額をREIT（先物を含む）に投資しました。

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

▶ MUAMG-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REIT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。

REIT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

▶ 三菱UFJ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）

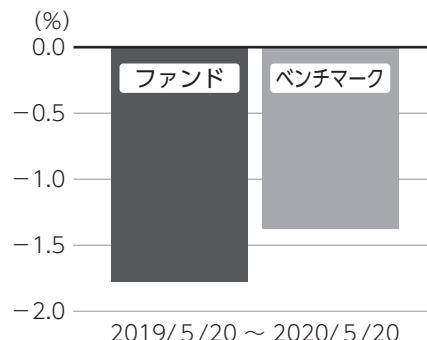
基準価額の騰落率は、1.8%の下落となり、ベンチマークの1.4%の下落を0.4%下回りました。

差異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	0.0%程度
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	0.1%程度
新興国株式インデックスマザーファンド	0.0%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	0.0%程度
新興国債券インデックスマザーファンド	0.0%程度
東証REIT指数マザーファンド	0.0%程度
MUAMG-REITマザーファンド	△0.1%程度
その他（信託報酬等）	△0.4%程度

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



▶ **三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド**

ベンチマーク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：その他の要因*によるものです。

※配当評価差異等が含まれます。

▶ **三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド**

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。

▶ **新興国株式インデックスマザーファンド**

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：銘柄選択要因によるものです。

主なマイナス要因：為替評価差異要因*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為替レートが異なるため生じる要因です。

▶ **三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド**

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶ **三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド**

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

主なマイナス要因：評価時価差異要因*によるものです。

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

▶ **新興国債券インデックスマザーファンド**

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶ **東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド**

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。

※留保金等が含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶ **MUAM G－REITマザーファンド**

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。

＞ 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 9 期 2019年5月21日～2020年5月20日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	6,516

（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 プライムバランス（８資産） （確定拠出年金）

資産配分方針は、従前通り基準ポートフォリオを維持します。また、各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

▶ 三菱ＵＦＪ トピックスインデックス マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 新興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

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 新興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。

▶ 東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

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 G－ＲＥＩＴマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2019年5月21日～2020年5月20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	60	0.350	(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 ）	(31)	(0.181)	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 ）	(21)	(0.126)	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 ）	(7)	(0.044)	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	1	0.005	(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 ）	(1)	(0.003)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(c)有価証券取引税	1	0.004	(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 ）	(1)	(0.003)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(d)そ の 他 費 用	4	0.022	(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 ）	(3)	(0.017)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.004)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	66	0.381	

期中の平均基準価額は、17,057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。

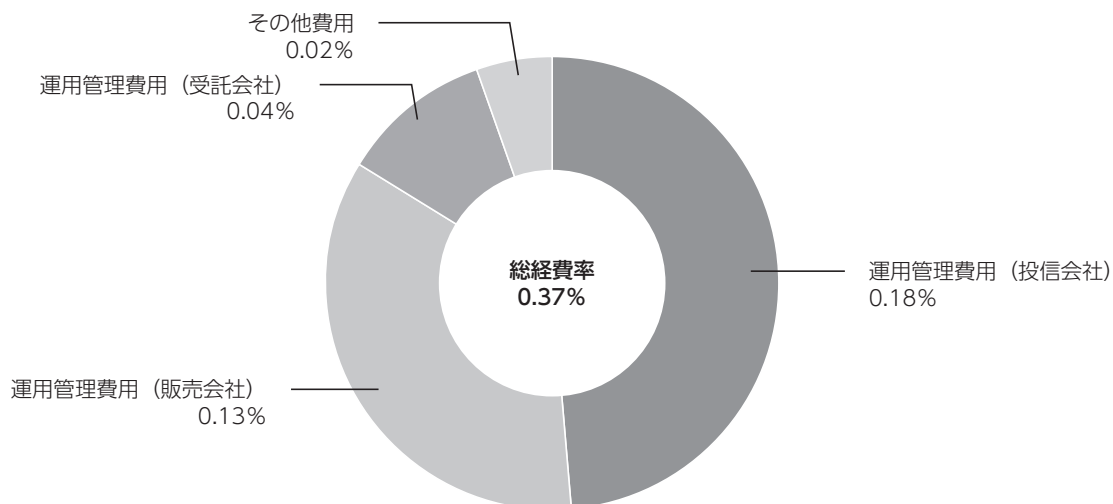
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.37%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2019年５月21日～2020年５月20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	1,174,558	1,543,525	577,057	755,504
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	2,552,492	3,636,937	1,521,175	2,168,204
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	145,082	399,064	91,809	255,895
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	842,843	1,968,860	444,233	1,055,558
MUAM G－R E I Tマザーファンド	874,167	1,313,962	730,013	1,073,627
新興国株式インデックスマザーファンド	244,153	548,582	125,997	293,864
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	116,734	356,200	51,155	167,303
新興国債券インデックスマザーファンド	398,088	526,409	238,397	318,837

○株式売買比率

(2019年５月21日～2020年５月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期			
	三菱ＵＦＪ トピックスインデックス マザーファンド	三菱ＵＦＪ 外国株式 マザーファンド	MUAM G－R E I T マザーファンド	新興国株式 インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	102,031,555千円	36,370,795千円	1,273千円	58,597,508千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	225,721,075千円	94,146,450千円	127千円	92,735,025千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.45	0.38	9.95	0.63

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年５月21日～2020年５月20日)

利害関係人との取引状況

<三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）>

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 65,689	百万円 15,102	% 23.0	百万円 36,342	百万円 3,218	% 8.9
新株予約権証券	—	—	—	0.674	0.674	100.0
貸付有価証券(株式)	705,733	391,271	55.4	704,269	390,470	55.4

平均保有割合 1.3%

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

平均保有割合 3.3%

※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 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 14,598	百万円 10,696	% 73.3	百万円 21,485	百万円 12,717	% 59.2

平均保有割合 2.0%

※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 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 27,533	百万円 20,925	% 76.0	百万円 29,437	百万円 26,347	% 89.5

平均保有割合 3.9%

※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 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 13,345	百万円 846	% 6.3	百万円 1,733	百万円 23	% 1.3

平均保有割合 2.0%

※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。

＜新興国株式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	$\frac{B}{A}$	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 75,077	百万円 2,690	% 3.6	百万円 42,933	百万円 3,012	% 7.0

平均保有割合 0.8%

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

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 18,780	百万円 7,863	% 41.9	百万円 8,436	百万円 3,776	% 44.8
不動産投信指数先物取引	12,576	4,357	34.6	12,170	3,993	32.8

平均保有割合 1.9%

※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。

＜新興国債券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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 862	百万円 268	% 31.1	百万円 857	百万円 291	% 34.0
為替直物取引	16,620	4,600	27.7	7,386	2,039	27.6

平均保有割合 2.9%

※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 1,084	百万円 543	百万円 3,269

＜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 703	百万円 302	百万円 1,209

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<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 1

<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 2,200

<東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド>

種 類	買 付 額
投資信託証券	百万円 891

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）	885千円
うち利害関係人への支払額（Ｂ）	12千円
（Ｂ）／（Ａ）	1.4%

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

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

○組入資産の明細

(2020年５月20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	1,954,669	2,552,170	3,303,529
三菱UFJ 国内債券マザーファンド	4,959,627	5,990,944	8,468,199
三菱UFJ 外国債券マザーファンド	310,674	363,947	1,023,021
三菱UFJ 外国株式マザーファンド	1,338,929	1,737,539	4,067,752
MUAM G-R E I Tマザーファンド	281,849	426,004	576,724
新興国株式インデックスマザーファンド	262,037	380,192	822,546
東証R E I T指数マザーファンド	162,955	228,534	620,082
新興国債券インデックスマザーファンド	496,803	656,494	838,211

○有価証券の貸付及び借入の状況

三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンドにおいて、2020年５月20日現在における貸付株数の総株数は32,788,100株です。

うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUFG証券に対する貸付は、18,674,300株です。

東証R E I T指数マザーファンドにおいて、2020年５月20日現在における貸付口数の総口数は81,546口です。

○投資信託財産の構成

(2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	3,303,529	16.2
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	8,468,199	41.6
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	1,023,021	5.0
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	4,067,752	20.0
MUAM G-R E I Tマザーファンド	576,724	2.8
新興国株式インデックスマザーファンド	822,546	4.0
東証REIT指数マザーファンド	620,082	3.0
新興国債券インデックスマザーファンド	838,211	4.1
コール・ローン等、その他	650,365	3.3
投資信託財産総額	20,370,429	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（46,788,998千円）の投資信託財産総額（46,964,533千円）に対する比率は99.6%です。

(注) 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（94,539,008千円）の投資信託財産総額（94,629,119千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 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（28,853,861千円）の投資信託財産総額（29,567,144千円）に対する比率は97.6%です。

(注) 新興国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（106,793,719千円）の投資信託財産総額（107,018,130千円）に対する比率は99.8%です。

(注) 新興国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（29,545,677千円）の投資信託財産総額（29,606,064千円）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＝107.98円	1 カナダドル＝77.58円	1 アルゼンチンペソ＝1.59円	1 メキシコペソ＝4.57円
1 ブラジルレアル＝18.76円	100チリペソ＝13.20円	100コロンビアペソ＝2.82円	1 ペルーヌエボソル＝31.49円
1 ウルグアイペソ＝2.47円	1 ドミニカペソ＝1.90円	1 ユーロ＝118.10円	1 イギリスポンド＝132.43円
1 スイスフラン＝111.26円	1 スウェーデンクローネ＝11.15円	1 ノルウェークローネ＝10.83円	1 デンマーククローネ＝15.84円
1 トルコリラ＝15.91円	1 チェココルナ＝4.30円	100ハンガリーフォリント＝33.71円	1 ポーランドズロチ＝25.94円
1 ロシアルーブル＝1.50円	1 ルーマニアレイ＝24.39円	1 オーストラリアドル＝70.75円	1 ニュージーランドドル＝65.95円
1 香港ドル＝13.93円	1 シンガポールドル＝76.26円	1 マレーシアリングgit＝24.81円	1 タイバーツ＝3.38円
1 フィリピンペソ＝2.13円	100インドネシアルピア＝0.74円	100韓国ウォン＝8.82円	1 ニュー台湾ドル＝3.61円
1 インドルピー＝1.44円	1 中国元＝15.21円	1 オフショア元＝15.18円	1 アラブディルハム＝29.45円
1 サウジアラビアリアル＝28.81円	1 イスラエルシェケル＝30.73円	1 カタールリアル＝29.51円	1 南アフリカランド＝5.90円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月20日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	20,370,429,209
コール・ローン等	615,504,224
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド(評価額)	3,303,529,879
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド(評価額)	8,468,199,642
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド(評価額)	1,023,021,334
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド(評価額)	4,067,752,787
MUAM G-R E I Tマザーファンド(評価額)	576,724,454
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	822,546,731
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド(評価額)	620,082,379
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	838,211,657
未収入金	34,856,122
(B) 負債	43,952,257
未払解約金	8,262,328
未払信託報酬	35,291,814
未払利息	1,140
その他未払費用	396,975
(C) 純資産総額(A-B)	20,326,476,952
元本	12,306,682,000
次期繰越損益金	8,019,794,952
(D) 受益権総口数	12,306,682,000口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,517円

<注記事項>

- ①期首元本額 9,748,723,158円
 期中追加設定元本額 4,082,466,547円
 期中一部解約元本額 1,524,507,705円
 また、1口当たり純資産額は、期末16,517円です。

②分配金の計算過程

項 目	2019年5月21日～ 2020年5月20日
費用控除後の配当等収益額	284,500,711円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	6,782,936,597円
分配準備積立金額	952,357,644円
当ファンドの分配対象収益額	8,019,794,952円
1万口当たり収益分配対象額	6,516円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況（2019年5月21日～2020年5月20日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 230,802
受取利息	1,686
支払利息	△ 232,488
(B) 有価証券売買損益	△ 389,998,472
売買益	193,569,214
売買損	△ 583,567,686
(C) 信託報酬等	△ 67,587,441
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 457,816,715
(E) 前期繰越損益金	737,602,665
(F) 追加信託差損益金	7,740,009,002
(配当等相当額)	(5,153,565,307)
(売買損益相当額)	(2,586,443,695)
(G) 計(D+E+F)	8,019,794,952
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	8,019,794,952
追加信託差損益金	7,740,009,002
(配当等相当額)	(5,161,334,585)
(売買損益相当額)	(2,578,674,417)
分配準備積立金	1,236,858,355
繰越損益金	△ 957,072,405

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

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

【お 知 ら せ】

- ①株式等インデックスファンドのベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2019年7月1日)
- ②有価証券の貸付の範囲について、マザーファンドの約款にあわせて、投資信託証券の貸付ができるように記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2020年2月20日)

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド

《第20期》決算日2020年2月20日

〔計算期間：2019年2月21日～2020年2月20日〕

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

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

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

○最近5期の運用実績

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

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

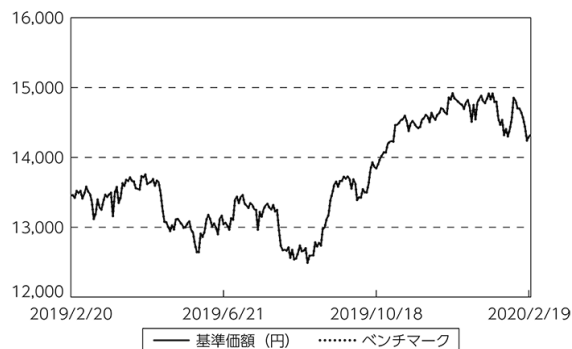
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因
(上昇要因)

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

●投資環境について

◎国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは6.4%の上昇となったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・その他の要因※によるものです。

※貸株収入要因等が含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

(2019年２月21日～2020年２月20日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年２月21日～2020年２月20日)

株式

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

(注) 金額は受渡代金。

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

新株予約権証券

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

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株主割当および権利行使等による増減分です。

先物取引の種類別取引状況

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

○株式売買比率

(2019年2月21日～2020年2月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年2月21日～2020年2月20日)

利害関係人との取引状況

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

利害関係人の発行する有価証券等

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

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 2

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

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

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

○組入資産の明細

(2020年2月20日現在)

国内株式

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
昭和電工	58.3	70	185,850	
住友化学	690.4	722	319,124	
住友精化	4.3	4.4	13,926	
日産化学	53.9	55	277,750	
ラサ工業	3.1	3.5	5,005	
クレハ	8.1	8.4	49,980	
多木化学	2.6	2.9	12,832	
テイカ	7.2	7.2	11,743	
石原産業	16.9	17.6	14,484	
片倉コープアグリ	2.6	2.5	3,077	
日東エフシー	5.5	—	—	
日本曹達	13.8	14.5	46,037	
東ソー	135.6	151.9	249,267	
トクヤマ	25.3	28.3	76,834	
セントラル硝子	19.1	20.1	45,727	
東亜合成	55	61.7	75,582	
大阪ソーダ	9.5	10	27,300	
関東電化工業	21	23.3	23,300	
デンカ	34.5	35.9	105,653	
信越化学工業	154.5	168.8	2,320,156	
日本カーバイド工業	3	3.3	4,194	
堺化学工業	5.8	6.4	13,990	
第一稀元素化学工業	7.3	10.6	9,020	
エア・ウォーター	71.8	91.4	139,750	
大陽日酸	72.2	94.4	207,113	
日本化学工業	3	3.1	8,233	
東邦アセチレン	1.3	1.5	2,002	
日本バーカライジング	47.9	49.6	54,659	
高压ガス工業	13.7	15.6	11,731	
チタン工業	1.1	1.2	2,617	
四国化成工業	14.7	15.2	18,422	
戸田工業	1.9	2.3	4,726	
ステラ ケミファ	5.2	5.4	17,442	
保土谷化学工業	3.1	3.7	16,076	
日本触媒	14.7	15.3	92,565	
大日精化工業	7.2	8.7	22,872	
カネカ	23.4	25.4	84,074	
三菱瓦斯化学	90.2	92.8	168,988	
三井化学	79.6	89.2	226,657	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 1,694	百万円 —

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2020年2月20日現在)

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

(注) ()内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

(2020年2月20日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年2月20日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2019年2月21日～2020年2月20日)

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

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

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

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

【お 知 ら せ】

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

(2019年7月1日)

三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

《第20期》決算日2020年5月20日

[計算期間：2019年5月21日～2020年5月20日]

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

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

○最近5期の運用実績

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

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

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

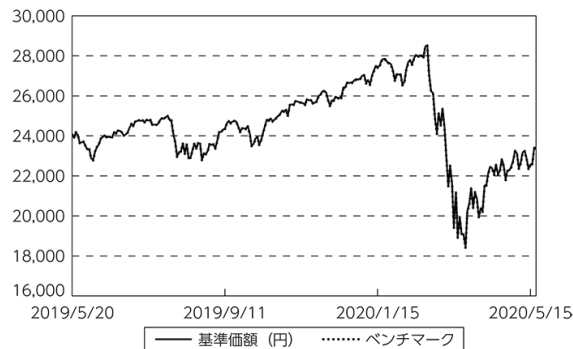
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

●投資環境について

◎外国株式市況

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

◎為替市況

- ・米ドル、ユーロは円に対して下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

(注) マルチファクターモデル

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

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

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

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月21日～2020年5月20日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年5月21日～2020年5月20日)

株式

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

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

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

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

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.534 (△ 3)	25 (△ 172)	—	—
	PUBLIC STORAGE	0.85	190	0.692	145
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1	182	1	195
	VORNADO REALTY TRUST	0.389	25	0.799	53
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.524	109	0.448	94
	小 計	97 (3)	5,436 (531)	38 (46)	3,050 (529)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1	93	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3	88	3	87
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	— (4)	— (86)	1	36
	小 計	5 (4)	181 (86)	5	124
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	0.466	56	0.498	66
	KLEPIERRE	0.755	22	1	56
	ICADE	—	—	0.298	22
	小 計	1	79	2	145
	オランダ				
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	100	1	101
	小 計	1	100	1	101
	ユ ー ロ 計	2	180	3	247
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	—	—	5	32
	HAMMERSON PLC	—	—	17	49
	LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	2	18
	小 計	—	—	25	100
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	VICINITY CENTRES	—	—	20	54
	SCENTRE GROUP	20	79	23	93
	GPT GROUP	6	37	—	—
	MIRVAC GROUP	12	36	15	46
	STOCKLAND	9	42	—	—
	DEXUS	13	172	7	94
	GOODMAN GROUP	9	109	7	107
	小 計	71	479	74	396
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	9	675	6	515
	小 計	9	675	6	515
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	106 (—)	156 (△0.28038)	58	110

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

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

先物取引の種類別取引状況

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

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

○株式売買比率 (2019年5月21日～2020年5月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等 (2019年5月21日～2020年5月20日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2020年5月20日現在)

外国株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	株数	当期		業種等
		株数	評価額	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円
ANDRITZ AG	19	13	40	4,771
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	40	29	44	5,306
小計	株数・金額	197	437	51,636
	銘柄数<比率>	6	—	<0.1%>
(ユーロ…ルクセンブルク)				
RTL GROUP	10	—	—	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA	192	270	128	不動産
TENARIS SA	110	110	62	エネルギー
SES	94	81	48	メディア・娯楽
EUROFINS SCIENTIFIC	2	2	142	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL	153	154	132	素材
小計	株数・金額	564	619	60,806
	銘柄数<比率>	6	5	<0.1%>
(ユーロ…フィンランド)				
NOKIA OYJ	1,278	1,403	476	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS	132	132	140	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ	29	29	52	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	120	129	329	素材
FORTUM OYJ	97	97	152	公益事業
KONE OYJ-B	78	81	467	資本財
METSO OYJ	29	21	57	資本財
SAMPO OYJ-A SHS	105	119	356	保険
WARTSILA OYJ ABP	104	104	72	資本財
ELISA OYJ	31	32	170	電気通信サービス
NESTE OYJ	89	95	316	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	27	21	94	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	2,124	2,268	317,317
	銘柄数<比率>	12	12	<0.3%>
(ユーロ…アイルランド)				
KERRY GROUP PLC-A	37	37	384	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC	37	33	167	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	20	19	233	消費者サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW	—	0.4	4	消費者サービス
BANK OF IRELAND GROUP PLC	233	233	36	銀行
AIB GROUP PLC	200	200	20	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	47	57	165	素材
CRH PLC	189	188	516	素材
小計	株数・金額	766	771	1,529
	銘柄数<比率>	7	8	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)				
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	634	574	233	公益事業
JERONIMO MARTINS	54	54	79	食品・生活必需品小売り
GALP ENERGIA SGPS SA	109	133	139	エネルギー
小計	株数・金額	799	762	452
	銘柄数<比率>	3	3	<0.1%>
ユーロ計	株数・金額	45,514	46,849	79,166
	銘柄数<比率>	239	237	—
(イギリス)			千イギリスポンド	
BARCLAYS PLC	3,989	4,413	462	銀行
BP PLC	4,671	4,871	1,530	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	16,655	17,613	521	銀行
ASTRAZENECA PLC	295	315	2,734	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

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

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

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

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

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーククローネ	千円	公益事業
ORSTED A/S		41	44	3,214	50,914	
小 計	株 数 ・ 金 額	998	1,007	46,081	729,931	
銘 柄 数 < 比 率 >		17	17	—	<0.8%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BHP GROUP LTD		686	711	2,492	176,364	素材
CSL LTD		105	109	3,311	234,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD		460	616	90	6,437	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		223	230	520	36,844	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP		668	683	1,055	74,651	銀行
RIO TINTO LTD		84	86	819	57,952	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		297	287	223	15,791	保険
LENLEASE GROUP		146	144	168	11,955	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		412	427	2,551	180,516	銀行
WESTPAC BANKING CORP		800	898	1,368	96,841	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		639	763	1,182	83,644	銀行
BRAMBLES LTD		389	378	418	29,575	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		—	168	58	4,161	運輸
BORAL LTD		277	277	71	5,069	素材
WOOLWORTHS GROUP LTD		301	306	1,073	75,958	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD		1,017	912	283	20,077	電気通信サービス
AMP LTD		715	715	105	7,493	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD		458	461	150	10,618	消費者サービス
AMCOR LIMITED		287	—	—	—	素材
COMPUTERSHARE LTD		94	115	140	9,933	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		127	122	329	23,316	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD		74	83	882	62,463	各種金融
CIMIC GROUP LTD		27	19	46	3,270	資本財
ASX LTD		43	47	398	28,208	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD		119	119	103	7,292	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		14	12	229	16,214	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		91	111	265	18,785	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		159	159	46	3,312	小売
NEWCREST MINING LTD		187	188	604	42,771	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		508	568	309	21,927	保険
ORIGIN ENERGY LTD		430	383	217	15,362	エネルギー
ORICA LTD		73	91	153	10,880	素材
SONIC HEALTHCARE LTD		106	106	289	20,511	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD		377	383	195	13,825	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD		321	401	352	24,939	保険
TRANSURBAN GROUP		612	673	930	65,853	運輸
WESFARMERS LTD		260	281	1,091	77,194	小売
BLUESCOPE STEEL LTD		130	105	108	7,641	素材
CHALLENGER LTD		134	134	59	4,228	各種金融
SYDNEY AIRPORT		261	261	146	10,357	運輸
AMPOL LTD		62	50	131	9,337	エネルギー
OIL SEARCH LTD		332	332	107	7,573	エネルギー
WORLEY LTD		77	—	—	—	エネルギー
AGL ENERGY LTD		164	165	275	19,517	公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD		367	340	472	33,398	素材
AUSNET SERVICES		572	543	104	7,361	公益事業
CROWN RESORTS LTD		83	83	79	5,590	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD		376	376	73	5,194	素材

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

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

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

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

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

外国投資信託証券

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

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

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

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引		百万円	百万円
		SP EMINI	1,528	—
		SP/TSE60	55	—
		SWISS IX	65	—
		EURO ST	290	—
		SPI 200	98	—
		FTSE100	119	—

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

○投資信託財産の構成

(2020年5月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	90,255,775	95.4
投資証券	2,246,139	2.4
コール・ローン等、その他	2,127,205	2.2
投資信託財産総額	94,629,119	100.0

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

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

1 アメリカドル=107.98円	1 カナダドル=77.58円	1 ユーロ=118.10円	1 イギリスポンド=132.43円
1 スイスフラン=111.26円	1 スウェーデンクローネ=11.15円	1 ノルウェークローネ=10.83円	1 デンマーククローネ=15.84円
1 オーストラリアドル=70.75円	1 ニュージーランドドル=65.95円	1 香港ドル=13.93円	1 シンガポールドル=76.26円
1 イスラエルシェケル=30.73円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月20日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2019年5月21日～2020年5月20日)

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

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

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

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

【お 知 ら せ】

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

新興国株式インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2020年5月12日

[計算期間：2019年5月14日～2020年5月12日]

「新興国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第11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11期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、MSCI エマージング・マーケット・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。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。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	新興国の株式等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		MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	円	%	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率				
7期(2016年5月12日)	17,338	△27.7	37,865.45	△27.9	92.8	6.4	0.5	百万円 35,618
8期(2017年5月12日)	23,115	33.3	50,445.91	33.2	92.6	6.5	0.4	49,734
9期(2018年5月14日)	26,349	14.0	57,589.21	14.2	94.0	5.6	0.4	71,556
10期(2019年5月13日)	23,990	△9.0	52,573.03	△8.7	95.6	3.6	0.3	85,987
11期(2020年5月12日)	21,268	△11.3	46,859.15	△10.9	94.8	5.4	0.1	104,071

(注) MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、MSCI エマージング・マーケット・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 エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他の知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		M S C I エマージング・ マーケット・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 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(期 首) 2019年5月13日	円 23,990	% —	52,573.03	% —	% 95.6	% 3.6	% 0.3
5月末	23,052	△ 3.9	50,540.40	△ 3.9	92.3	6.1	1.6
6月末	24,283	1.2	53,098.32	1.0	93.8	4.7	1.6
7月末	24,281	1.2	53,171.46	1.1	93.2	5.4	1.6
8月末	22,206	△ 7.4	48,562.79	△ 7.6	93.2	4.0	2.8
9月末	23,227	△ 3.2	50,932.52	△ 3.1	93.4	3.9	2.7
10月末	24,483	2.1	53,500.15	1.8	92.5	5.0	2.5
11月末	24,824	3.5	54,320.61	3.3	91.4	5.9	2.6
12月末	26,440	10.2	58,006.54	10.3	96.7	6.3	0.2
2020年1月末	25,249	5.2	55,392.34	5.4	94.5	5.3	0.2
2月末	24,333	1.4	53,436.53	1.6	95.2	4.5	0.2
3月末	19,575	△18.4	43,007.66	△18.2	97.3	2.9	0.1
4月末	21,321	△11.1	46,748.89	△11.1	95.7	4.1	0.1
(期 末) 2020年5月12日	21,268	△11.3	46,859.15	△10.9	94.8	5.4	0.1

(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

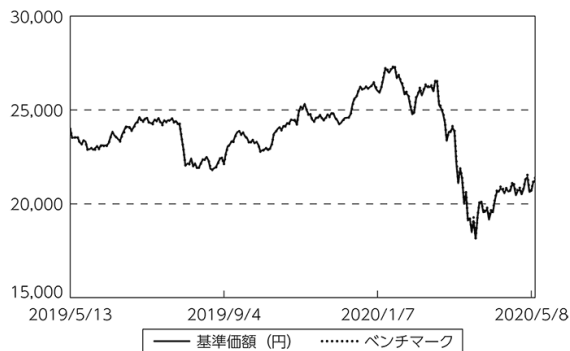
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ11.3%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
(－10.9%) を0.4%下回りました。

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

(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

◎新興国株式市況

新興国株式市況は下落しました。

- ・新興国株式市況は、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、香港ドルは対円で下落しました。

- ・為替市況は、期首に比べて2.0%の円高・米ドル安、0.8%の円高・香港ドル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている新興国の株式等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10.9%の下落になったため、乖離は△0.4%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・銘柄選択要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月14日～2020年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 16	% 0.067	(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)	(14)	(0.061)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	9	0.040	(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)	(9)	(0.040)	
(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	25	0.107	(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)	(24)	(0.100)	
(そ の 他)	(2)	(0.007)	
合 計	50	0.214	
期中の平均基準価額は、23,590円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年5月14日～2020年5月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 1,282,210 (215)	千アメリカドル 54,389 (ー)	百株 41,801	千アメリカドル 11,936
	メキシコ	44,173 (ー)	千メキシコペソ 135,189 (△ 433)	23,597	千メキシコペソ 63,139
	ブラジル	35,182 (4,125)	千ブラジルリアル 107,846 (△ 151)	10,791 (2)	千ブラジルリアル 32,779 (0.71204)
	チリ	394,611 (14,066)	千チリペソ 2,351,967 (ー)	153,414 (0.01)	千チリペソ 706,259 (ー)
	コロンビア	6,276	千コロンビアペソ 3,506,987	4,023	千コロンビアペソ 2,048,014
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	オランダ	ー (670)	ー (4,648)	670	4,535
	ベルギー	ー (77)	ー (141)	ー	ー
	ギリシャ	6,810 (△ 77)	1,194 (△ 141)	946	331
	イギリス	232	千イギリスポンド 286	138	千イギリスポンド 160
	トルコ	3,810 (290)	千トルコリラ 5,616 (ー)	3,777	千トルコリラ 2,173
	チェコ	337	千チェココルナ 7,834	50	千チェココルナ 3,250
	ハンガリー	633	千ハンガリーフォリント 319,285	251	千ハンガリーフォリント 118,383
	ポーランド	4,463	千ポーランドズロチ 11,979	1,724	千ポーランドズロチ 5,708
	香港	546,591 (971)	千香港ドル 599,317 (△ 503)	281,636	千香港ドル 213,072
	マレーシア	39,891	千マレーシアリンギット 29,445	30,593	千マレーシアリンギット 12,875
	タイ	121,946 (15,787)	千タイバーツ 412,672 (4,263)	24,837 (758)	千タイバーツ 98,141 (4,410)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	フィリピン	百株 19,639 (340)	千フィリピンペソ 173,960 (—)	百株 18,866	千フィリピンペソ 80,930
	インドネシア	199,187 (39,268)	千インドネシアルピア 90,714,338 (—)	91,516	千インドネシアルピア 35,420,645
	韓国	9,311 (115)	千韓国ウォン 43,422,502 (△ 4,858)	3,994	千韓国ウォン 16,900,746
	台湾	197,880 (3,592)	千ニュー台湾ドル 1,123,624 (△ 1,612)	86,300	千ニュー台湾ドル 440,395
	インド	44,290 (2,906)	千インドルピー 2,569,865 (18,372)	30,353 (609)	千インドルピー 831,124 (5,851)
	中国オフショア	198,878 (684)	千オフショア元 248,062 (—)	12,253	千オフショア元 13,210
	アラブ首長国連邦	5,778	千アラブディルハム 3,903	3,892	千アラブディルハム 652
	サウジアラビア	28,918 (434)	千サウジアラビアリヤル 103,407 (—)	—	千サウジアラビアリヤル —
	カタール	10,743 (29,187)	千カタールリアル 10,053 (—)	1,127	千カタールリアル 855
	南アフリカ	23,767 (226)	千南アフリカランド 247,809 (—)	10,326 (—)	千南アフリカランド 95,123 (75,337)

(注) 金額は受渡代金。

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

新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 — (123,420)	千タイバーツ — (146)	証券 123,420	千タイバーツ 152

(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
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ET	774	24,445	774	22,565
	小計	774	24,445	774	22,565
	メキシコ		千メキシコペソ		千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	246 (－)	6,084 (△ 592)	105	2,834
	小計	246 (－)	6,084 (△ 592)	105	2,834
	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	214	4,636	122	2,777
	REDEFINE PROPERTIES LTD	528	3,726	317	2,070
	HYPROP INVESTMENTS LTD	－	－	39	2,644
国内	RESILIENT REIT LTD	－ (2)	－ (142)	47	2,658
	FORTRESS REIT LTD-A	－	－	－	－
				(－)	(142)
	FORTRESS REIT LTD-B	－	－	89	933
	小計	743 (2)	8,363 (142)	615 (－)	11,085 (142)

(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 54,419	百万円 51,169	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2019年5月14日～2020年5月12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	55,907,734千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	92,735,025千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.60

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月14日～2020年5月12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 72,586	百万円 3,413	% 4.7	百万円 41,348	百万円 3,100	% 7.5

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

○組入資産の明細

(2020年5月12日現在)

外国株式

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR		—	148	112	12,097	電気通信サービス
YPF S. A. -SPONSORED ADR		—	290	119	12,835	エネルギー
SINA CORP		94	116	392	42,156	メディア・娯楽
NETEASE INC-ADR		113	127	4,533	487,456	メディア・娯楽
TRIP.COM GROUP LTD-ADR		601	833	2,052	220,666	小売
51JOB INC-ADR		33	45	283	30,449	商業・専門サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR		247	354	284	30,642	素材
BAIDU INC - SPON ADR		401	491	4,897	526,553	メディア・娯楽
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR		701	893	770	82,864	電気通信サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR		209	255	3,206	344,714	消費者サービス
SOUTHERN COPPER CORP		144	163	554	59,654	素材
CREDICORP LTD		97	124	1,762	189,519	銀行
HUAZHU GROUP LTD-ADR		196	230	767	82,546	消費者サービス
JOYY INC		71	107	571	61,457	メディア・娯楽
TAL EDUCATION GROUP- ADR		510	690	3,738	401,944	消費者サービス
TRANSNEFT PJSC		0.62	0.93	170	18,342	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ		2,104	2,743	472	50,819	各種金融
AUTOHOME INC-ADR		86	106	864	92,974	メディア・娯楽
MMC NORILSK NICKEL PJSC		90	112	3,063	329,381	素材
TATNEFT PJSC		2,248	2,754	2,040	219,431	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC		1,810	2,271	1,071	115,215	エネルギー
VTB BANK PJSC		5,388,800	6,581,300	315	33,937	銀行
SURGUTNEFTEGAS PJSC		10,396	13,378	674	72,545	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE		10,843	12,999	631	67,875	エネルギー
SEVERSTAL PJSC		316	439	519	55,878	素材
DP WORLD PLC		247	296	471	50,726	運輸
ALROSA PJSC		4,066	4,857	410	44,185	素材
JD.COM INC-ADR		1,062	1,320	6,170	663,492	小売
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR		620	767	1,322	142,191	小売
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		1,881	3,108	63,851	6,865,353	小売
MOMO INC-SPON ADR		216	265	589	63,368	メディア・娯楽
WEIBO CORP-SPON ADR		77	95	346	37,204	メディア・娯楽
58.COM INC-ADR		130	166	859	92,420	メディア・娯楽
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR		—	165	146	15,717	銀行
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR		445	572	1,857	199,680	運輸
YUM CHINA HOLDINGS INC		521	641	3,139	337,547	消費者サービス
INTER RAO UES PJSC		41,700	71,920	475	51,140	公益事業
BANCO MACRO SA-ADR		—	75	147	15,897	銀行
NOVOLIPETSK STEEL PJSC		1,821	2,432	412	44,331	素材
GLOBANT SA		—	61	762	81,936	ソフトウェア・サービス
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR		70	108	239	25,705	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GDS HOLDINGS LTD - ADR		83	103	650	69,961	ソフトウェア・サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS		44	56	152	16,434	各種金融
BAOZUN INC-SPN ADR		62	87	257	27,650	小売
IQIYI INC-ADR		173	219	392	42,173	メディア・娯楽

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		
PINDUODUO INC-ADR		264	345	1,899	204,227	小売	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR		124	153	175	18,852	メディア・娯楽	
NIO INC - ADR		—	1,316	492	52,954	自動車・自動車部品	
ZAI LAB LTD-ADR		—	63	440	47,402	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEST INC - ADR		—	292	159	17,142	運輸	
HUYA INC-ADR		—	91	146	15,752	メディア・娯楽	
LUCKIN COFFEE INC - ADR		—	140	61	6,608	消費者サービス	
LUKOIL PJSC-SPON ADR		686	696	4,594	494,010	エネルギー	
GAZPROM PJSC-SPON ADR		7,693	9,151	4,484	482,142	エネルギー	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S		133	164	2,276	244,745	エネルギー	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR		178	230	697	74,978	食品・生活必需品小売り	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS		531	674	748	80,435	食品・生活必需品小売り	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR		3,808	4,473	4,608	495,460	銀行	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG		2,337	2,572	1,021	109,787	銀行	
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS		290	290	195	21,017	素材	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S		141	264	325	35,044	素材	
POLYUS PJSC-REG S-GDR		72	95	762	82,016	素材	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B		1,569	1,569	95	10,240	エネルギー	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B		1,058	1,968	166	17,864	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,492,233	6,732,858	139,878	15,039,766		
	銘 柄 数 < 比 率 >	54	64	—	<14.5%>		
(メキシコ)				千メキシコペソ			
ALFA S.A.B.-A		4,732	4,718	4,633	20,709	資本財	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1		727	727	3,584	16,024	資本財	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L		48,785	60,157	91,378	408,461	電気通信サービス	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		2,147	2,519	8,690	38,846	家庭用品・パーソナル用品	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV		7,591	9,224	53,434	238,852	食品・生活必需品小売り	
CEMEX SAB-CPO		22,875	26,141	13,410	59,945	素材	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO		3,702	4,208	10,553	47,174	メディア・娯楽	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A		2,239	3,240	11,770	52,616	食品・飲料・タバコ	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		3,759	4,662	35,552	158,919	銀行	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		2,853	3,426	55,134	246,451	食品・飲料・タバコ	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		189	226	4,133	18,475	素材	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV		1,500	1,983	6,384	28,538	素材	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		5,121	6,330	33,033	147,660	素材	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O		3,392	3,707	5,519	24,673	銀行	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B		512	626	9,366	41,869	運輸	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		682	899	9,026	40,347	食品・飲料・タバコ	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1		260	423	2,482	11,095	小売	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B		318	330	8,037	35,929	運輸	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		300	386	6,594	29,476	運輸	
GRUMA S.A.B.-B		277	361	8,812	39,392	食品・飲料・タバコ	
ALSEA SAB DE CV		614	1,003	1,950	8,720	消費者サービス	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N		776	996	7,318	32,714	公益事業	
MEGACABLE HOLDINGS-CPO		507	516	3,448	15,414	メディア・娯楽	
BANCO SANTANDER MEXICO SA IN		2,700	—	—	—	銀行	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		733	1,060	10,240	45,775	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	117,296	137,872	404,493	1,808,085		
	銘 柄 数 < 比 率 >	25	24	—	<1.7%>		

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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,209	1,637	1,359	25,106	公益事業	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	373	493	1,217	22,491	公益事業	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	5,669	7,604	13,801	254,909	エネルギー	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	516	608	2,536	46,850	公益事業	
GERDAU SA-PREF	1,466	1,870	2,337	43,173	素材	
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	673	777	3,645	67,328	電気通信サービス	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	7,036	8,668	19,399	358,311	銀行	
COSAN SA	253	253	1,538	28,415	エネルギー	
BRF SA	722	1,152	2,401	44,363	食品・飲料・タバコ	
JBS SA	1,369	1,873	4,337	80,120	食品・飲料・タバコ	
NATURA COSMETICOS SA	276	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
VALE SA	4,603	5,687	27,145	501,377	素材	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,106	1,166	1,563	28,879	エネルギー	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	310	420	1,586	29,295	公益事業	
PORTO SEGURO SA	154	154	613	11,332	保険	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	4,339	6,655	12,664	233,912	エネルギー	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	250	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
LOJAS RENNER S. A.	1,113	1,383	4,523	83,540	小売	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	1,042	1,337	3,513	64,901	小売	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	6,349	8,062	6,788	125,379	銀行	
EMBRAER SA	1,043	1,126	809	14,953	資本財	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	294	415	903	16,679	公益事業	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	960	967	775	14,324	素材	
CCR SA	1,746	2,156	2,423	44,759	運輸	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	2,946	3,702	13,626	251,674	各種金融	
B2W CIA DIGITAL	240	380	3,303	61,019	小売	
BRASKEM SA-PREF A	235	323	713	13,172	素材	
BANCO BRADESCO SA-PREF	5,831	7,785	13,741	253,806	銀行	
BANCO DO BRASIL S. A.	1,238	1,584	4,319	79,782	銀行	
CIELO SA	1,655	2,071	753	13,924	ソフトウェア・サービス	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	621	741	1,816	33,545	銀行	
HYPERA SA	560	739	2,077	38,368	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANCO BRADESCO S. A.	1,776	2,524	4,124	76,186	銀行	
WEG SA	1,284	1,558	6,051	111,769	資本財	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	1,310	1,275	1,014	18,729	不動産	
LOCALIZA RENT A CAR	812	1,165	3,274	60,471	運輸	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	403	453	832	15,378	不動産	
SUL AMERICA SA - UNITS	273	566	2,371	43,794	保険	
TIM PARTICIPACOES SA	1,297	1,493	1,935	35,756	電気通信サービス	
RAIA DROGASIL SA	325	398	4,179	77,186	食品・生活必需品小売り	
M DIAS BRANCO SA	128	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	237	1,345	2,406	44,442	公益事業	
MAGAZINE LUIZA SA	118	1,332	7,319	135,188	小売	
COGNA EDUCACAO	1,997	2,942	1,330	24,568	消費者サービス	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	981	1,271	2,993	55,284	保険	
AMBEV SA	6,890	8,314	9,926	183,350	食品・飲料・タバコ	
KLABIN SA - UNIT	986	1,174	2,542	46,967	素材	
ENERGISA SA-UNITS	—	286	1,180	21,805	公益事業	
RUMO SA	1,570	1,869	3,732	68,937	運輸	
ATACADAO SA	578	747	1,447	26,738	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	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
SUZANO SA		798	963	4,584	84,683	素材
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE		—	355	1,750	32,338	ヘルスケア機器・サービス
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA		467	1,380	2,471	45,650	小売
IRB BRASIL RESSEGUROS SA		204	1,199	923	17,052	保険
NOTRE DAME INTERMED PAR SA		—	844	4,538	83,820	ヘルスケア機器・サービス
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		—	372	1,379	25,477	各種金融
NATURA &CO HOLDING SA		—	1,230	4,200	77,582	家庭用品・パーソナル用品
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC		—	303	1,997	36,891	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	78,641	107,155	234,745	4,335,751	
	銘 柄 数 < 比 率 >	52	55	—	<4.2%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION		71	94	267,029	34,847	銀行
CENCOSUD SA		1,825	2,203	213,937	27,918	食品・生活必需品小売り
EMPRESAS CMPC SA		1,837	1,884	324,013	42,283	素材
COLBUN SA		9,588	13,513	156,740	20,454	公益事業
EMPRESAS COPEC SA		546	784	399,885	52,185	エネルギー
ITAU CORPBANCA		198,652	333,659	72,737	9,492	銀行
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		251	261	131,840	17,205	電気通信サービス
FALABELLA SA		1,010	1,411	338,724	44,203	小売
AGUAS ANDINAS SA-A		3,366	4,722	124,198	16,207	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA		422	395	92,746	12,103	運輸
BANCO SANTANDER CHILE		90,457	118,265	389,565	50,838	銀行
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		166	215	411,179	53,658	素材
ENEL AMERICAS SA		38,665	69,485	916,513	119,605	公益事業
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		225	225	123,377	16,100	食品・飲料・タバコ
BANCO DE CHILE		37,338	84,086	592,809	77,361	銀行
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		570	570	109,643	14,308	食品・飲料・タバコ
ENEL CHILE SA		37,598	46,083	280,186	36,564	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	422,597	677,861	4,945,130	645,339	
	銘 柄 数 < 比 率 >	17	17	—	<0.6%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF		5,576	6,470	511,135	14,107	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		681	875	2,100,264	57,967	銀行
ECOPETROL SA		7,249	8,772	1,811,568	49,999	エネルギー
INTERCONEXION ELECTRICA SA		583	727	1,315,960	36,320	公益事業
GRUPO ARGOS SA		419	591	526,844	14,540	素材
BANCOLOMBIA SA		331	396	934,654	25,796	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA		304	380	746,541	20,604	各種金融
CEMENTOS ARGOS SA		618	—	—	—	素材
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		195	—	—	—	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	15,961	18,213	7,946,968	219,336	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	7	—	<0.2%>	
(ユーロ…ベルギー)				千ユーロ		
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T		—	77	91	10,609	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	—	77	91	10,609	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…ギリシャ)						
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		306	424	474	55,067	電気通信サービス
ALPHA BANK AE		2,009	2,512	150	17,490	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		—	1,026	116	13,538	銀行

銘柄		期首(前期末) 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…ギリシャ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A		—	4,108	136	15,800	銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.		74	—	—	—	素材
OPAP SA		290	394	309	35,939	消費者サービス
MOTOR OIL (HELLAS) SA		90	90	112	13,061	エネルギー
FF GROUP		58	58	28	3,279	耐久消費財・アパレル
JUMBO SA		166	166	238	27,671	小売
小 計	株 数 ・ 金 額	2,996	8,782	1,567	181,849	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	8	—	<0.2%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	2,996	8,860	1,658	192,458	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	9	—	<0.2%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		294	387	643	85,063	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	294	387	643	85,063	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T.A.S.		3,742	4,463	2,490	37,903	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C		1,937	2,683	1,307	19,892	銀行
TURKIYE GARANTI BANKASI		3,306	3,746	2,907	44,252	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		1,558	2,159	2,854	43,443	電気通信サービス
ANADOLU EFES BIRACILIK VE		272	504	857	13,048	食品・飲料・タバコ
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		184	201	1,709	26,014	エネルギー
HACI OMER SABANCI HOLDING		1,367	1,367	1,109	16,882	各種金融
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		2,149	2,149	1,700	25,878	素材
KOC HOLDING AS		1,045	1,558	2,322	35,341	資本財
ARCELIK AS		296	296	447	6,818	耐久消費財・アパレル
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		1,128	—	—	—	資本財
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		67	142	789	12,012	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO		862	862	915	13,937	運輸
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		269	269	459	6,995	運輸
TURKIYE HALK BANKASI		1,069	—	—	—	銀行
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		290	785	4,004	60,945	食品・生活必需品小売り
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS		1,317	—	—	—	素材
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		553	553	1,487	22,640	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	21,419	21,743	25,361	386,008	
	銘柄 数 < 比 率 >	18	15	—	<0.4%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
CEZ AS		242	304	14,247	59,983	公益事業
KOMERCNI BANKA AS		122	124	6,498	27,357	銀行
MONETA MONEY BANK AS		795	1,018	5,091	21,433	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	1,159	1,446	25,836	108,773	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT		183	268	186,494	61,710	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OTP BANK PLC		326	402	372,910	123,396	銀行
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL		544	765	156,835	51,896	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	1,054	1,436	716,240	237,004	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.2%>	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		434	517	3,254	82,720	エネルギー
ORANGE POLSKA SA		1,106	1,106	734	18,669	電気通信サービス

銘柄	株数	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
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランドズロチ	千円		
PKO BANK POLSKI SA	1,276	1,648	3,403	86,510	銀行	
BANK PEKAO SA	235	300	1,456	37,029	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	184	220	1,662	42,257	素材	
SANTANDER BANK POLSKA SA	54	65	949	24,136	銀行	
MBANK SA	23	23	425	10,810	銀行	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	2,723	3,788	1,391	35,363	エネルギー	
GRUPA LOTOS SA	124	158	964	24,524	エネルギー	
AMREST HOLDINGS SE	—	106	265	6,758	消費者サービス	
BANK MILLENNIUM SA	760	1,215	287	7,318	銀行	
CYFROWY POLSAT SA	371	480	1,162	29,556	メディア・娯楽	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	56	—	—	—	銀行	
PGE SA	1,118	1,483	567	14,425	公益事業	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	854	1,140	3,345	85,032	保険	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	68	—	—	—	素材	
ALIOR BANK SA	155	—	—	—	銀行	
LPP SA	1	2	1,625	41,307	耐久消費財・アパレル	
CCC SA	45	45	184	4,693	耐久消費財・アパレル	
CD PROJEKT SA	98	118	4,300	109,317	メディア・娯楽	
DINO POLSKA SA	68	78	1,266	32,187	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	9,762	12,500	27,247	692,619	
	銘 柄 数 < 比 率 >	20	18	—	<0.7%>	
(香港)			千香港ドル			
PETROCHINA CO LTD-H	30,810	37,770	10,386	144,064	エネルギー	
WHARF HOLDINGS LTD	—	2,000	2,880	39,945	不動産	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	37,080	45,800	17,220	238,852	エネルギー	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	8,980	10,740	5,380	74,630	電気通信サービス	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	1,430	1,780	2,392	33,181	ソフトウェア・サービス	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	4,460	5,620	4,091	56,747	自動車・自動車部品	
CITIC LTD	8,530	10,720	8,458	117,313	資本財	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	2,420	4,100	1,217	16,889	運輸	
CNOOC LTD	25,870	32,190	28,166	390,665	エネルギー	
YANZHOU COAL MINING CO-H	2,880	2,800	1,699	23,573	エネルギー	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	5,310	5,310	1,109	15,392	素材	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	2,080	3,100	1,630	22,616	運輸	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	1,960	2,380	1,454	20,169	運輸	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	2,060	2,660	10,546	146,285	食品・飲料・タバコ	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,860	3,540	4,991	69,230	食品・飲料・タバコ	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	600	800	1,041	14,446	資本財	
CHINA TRAVEL INTL INV HK	2,160	—	—	—	消費者サービス	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,980	2,580	2,585	35,856	運輸	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	2,480	3,600	1,497	20,771	運輸	
BYD CO LTD-H	945	1,160	5,330	73,929	自動車・自動車部品	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	2,360	2,360	1,024	14,206	エネルギー	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	19,720	26,300	6,785	94,113	電気通信サービス	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	—	1,060	902	12,511	運輸	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	5,580	5,580	585	8,126	公益事業	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	775	965	2,619	36,339	公益事業	
CHINA EVERBRIGHT LTD	1,400	1,860	2,161	29,977	各種金融	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	1,940	1,940	1,831	25,400	運輸	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	2,200	2,800	991	13,747	運輸	

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
ANGANG STEEL CO LTD-H	1,080	—	—	—	素材
CHINA MOBILE LTD	8,920	10,985	64,976	901,220	電気通信サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	6,520	6,780	1,878	26,048	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-H	2,860	2,860	703	9,758	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,790	2,170	13,139	182,242	素材
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	6,640	8,180	12,908	179,034	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LENOVO GROUP LTD	10,200	12,760	5,576	77,340	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	2,348	3,092	3,982	55,237	保険
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	580	760	3,811	52,864	食品・飲料・タバコ
SINOTRANS LIMITED-H	3,580	3,580	630	8,739	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	5,660	8,580	1,389	19,278	素材
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2,430	2,470	1,111	15,416	素材
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2,850	4,060	1,270	17,625	資本財
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	9,780	12,620	9,099	126,203	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	10,850	13,450	21,466	297,736	保険
KINGBOARD HOLDINGS LTD	1,045	1,080	2,084	28,910	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	4,384	5,289	9,012	125,002	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	2,600	3,160	2,837	39,358	公益事業
LI NING CO LTD	—	3,675	9,518	132,018	耐久消費財・アパレル
CHINA MENGNIU DAIRY CO	4,090	5,010	14,203	197,000	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	7,550	9,950	78,804	1,093,011	保険
AIR CHINA LTD-H	2,800	2,800	1,464	20,311	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	9,720	12,170	14,384	199,519	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	2,880	2,780	1,812	25,140	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD	8,286	10,252	445,962	6,185,492	メディア・娯楽
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	12,119	15,589	7,607	105,515	銀行
ZTE CORP-H	1,119	1,449	3,463	48,043	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	8,560	10,620	3,462	48,019	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	139,255	171,545	106,701	1,479,947	銀行
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	1,464	2,112	2,059	28,561	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	1,077	1,333	12,463	172,869	耐久消費財・アパレル
CHINA POWER INTERNATIONAL	7,050	7,050	1,135	15,743	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	4,020	4,400	2,384	33,077	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	4,280	4,280	992	13,772	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	4,820	6,250	8,487	117,721	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2,480	3,150	2,290	31,762	素材
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	2,480	2,920	2,601	36,085	不動産
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,490	2,570	1,909	26,484	素材
SHENZHEN INVESTMENT LTD	5,260	5,420	1,344	18,643	不動産
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	2,680	3,440	4,114	57,064	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF CHINA LTD-H	114,860	142,180	41,658	577,806	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	5,131	7,491	3,535	49,041	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,555	2,030	6,404	88,832	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	990	1,240	4,929	68,365	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H	5,585	6,940	25,783	357,623	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	100,473	115,993	59,968	831,765	銀行
MAANSHAN IRON & STEEL-H	2,320	2,320	542	7,529	素材
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	1,138	1,413	12,738	176,678	公益事業
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	1,835	1,835	1,396	19,368	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	3,980	4,040	2,222	30,819	資本財

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 株 数	期 末		業 種 等
			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	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	6,320	8,540	4,329	60,054	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	3,170	3,170	646	8,969	エネルギー
SHENZHEN INTL HOLDINGS	1,305	1,895	2,861	39,688	運輸
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	980	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	5,440	6,780	17,763	246,381	不動産
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	3,480	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	13,330	15,630	5,923	82,162	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,590	1,910	12,892	178,818	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	5,620	7,410	3,408	47,277	資本財
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	18,980	15,720	1,399	19,405	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	1,080	1,250	8,056	111,740	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	4,040	5,680	17,977	249,343	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	2,685	3,390	2,756	38,226	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	4,440	5,140	8,121	112,641	公益事業
FOSUN INTERNATIONAL LTD	3,650	4,570	4,579	63,512	資本財
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	4,975	4,975	1,004	13,938	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	5,200	6,780	6,732	93,380	素材
SHUI ON LAND LTD	3,745	7,170	975	13,524	不動産
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,858	3,428	5,162	71,604	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	4,405	4,405	951	13,197	運輸
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	7,380	8,920	5,004	69,407	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	4,740	7,080	3,610	50,081	公益事業
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	11,162	13,952	14,287	198,163	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1,240	1,580	6,944	96,314	公益事業
SOHO CHINA LTD	3,175	3,175	977	13,563	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	8,120	8,120	2,395	33,224	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	7,270	8,860	11,588	160,737	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	4,240	5,620	2,124	29,464	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	9,048	12,258	6,864	95,211	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	3,900	4,688	11,626	161,255	保険
CRRC CORP LTD - H	5,545	8,165	3,339	46,321	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	839	1,059	2,705	37,528	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	41,760	52,830	17,011	235,946	銀行
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,810	3,190	4,823	66,898	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	3,929	5,289	3,887	53,923	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	1,760	2,584	5,374	74,547	ヘルスケア機器・サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	2,530	4,646	12,822	177,854	公益事業
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	1,172	1,172	882	12,240	資本財
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	7,080	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	2,130	3,230	11,789	163,520	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	1,050	1,286	15,509	215,112	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES CEMENT	3,660	4,400	4,593	63,713	素材
SSY GROUP LTD	2,240	3,280	1,830	25,385	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	—	2,194	1,423	19,749	資本財
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	4,860	6,190	3,342	46,361	自動車・自動車部品
BBMG CORP-H	4,160	4,160	815	11,309	素材
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	7,220	9,620	5,377	74,587	不動産
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1,555	2,360	2,171	30,114	素材
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3,060	4,140	2,537	35,199	資本財
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	3,340	4,290	5,036	69,855	ソフトウェア・サービス

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
CITIC SECURITIES CO LTD-H	3,205	3,585	5,219	72,398	各種金融	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	3,150	4,495	5,376	74,565	食品・生活必需品小売り	
FAR EAST HORIZON LTD	2,870	3,730	2,413	33,472	各種金融	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3,020	3,610	1,194	16,573	銀行	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	10,560	15,000	2,205	30,583	不動産	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	2,040	2,040	1,674	23,230	食品・飲料・タバコ	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,830	2,220	4,795	66,509	耐久消費財・アパレル	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	2,300	4,060	1,246	17,287	不動産	
MMG LTD	4,120	—	—	—	素材	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	935	935	3,221	44,676	小売	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	1,896	2,844	486	6,745	素材	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,159	1,566	2,120	29,409	ヘルスケア機器・サービス	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	—	4,920	1,156	16,036	耐久消費財・アパレル	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	4,524	5,212	3,523	48,868	各種金融	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	3,550	4,320	15,076	209,115	不動産	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	4,620	4,920	2,902	40,261	不動産	
SEAZEN GROUP LTD	2,860	3,700	2,726	37,822	不動産	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	905	—	—	—	不動産	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1,150	1,517	4,088	56,704	保険	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	11,680	13,660	3,496	48,502	保険	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	7,220	—	—	—	公益事業	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	4,665	6,575	2,544	35,292	各種金融	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	2,430	2,810	2,787	38,662	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	2,900	3,040	1,106	15,347	素材	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	735	1,260	2,119	29,394	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	890	835	2,292	31,791	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	790	1,180	1,873	25,990	資本財	
TOWNGAS CHINA CO LTD	1,040	2,120	750	10,409	公益事業	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	1,915	1,915	704	9,774	資本財	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	3,720	3,720	—	—	食品・飲料・タバコ	
HANERGY THIN FILM POWER GROU	9,600	9,600	3,753	52,062	半導体・半導体製造装置	
KINGSOFT CORP LTD	1,270	1,490	4,097	56,832	ソフトウェア・サービス	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	13,150	16,730	2,509	34,806	各種金融	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	2,325	2,975	10,457	145,040	資本財	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	4,640	6,760	3,819	52,975	半導体・半導体製造装置	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	4,900	6,600	12,342	171,183	ヘルスケア機器・サービス	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	4,390	6,260	2,003	27,784	銀行	
CHINA VANKE CO LTD-H	1,824	2,605	6,644	92,152	不動産	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	19,500	24,000	2,496	34,619	メディア・娯楽	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	3,020	3,640	1,248	17,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CGN POWER CO LTD-H	16,240	19,310	3,553	49,280	公益事業	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	2,620	2,620	917	12,718	自動車・自動車部品	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	510	890	1,445	20,047	半導体・半導体製造装置	
LUYE PHARMA GROUP LTD	2,125	2,225	854	11,850	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GF SECURITIES CO LTD-H	2,298	2,278	1,874	26,003	各種金融	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	2,410	3,042	3,814	52,909	各種金融	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	2,090	2,090	2,445	33,916	不動産	
3SBIO INC	1,890	2,600	2,303	31,950	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	549	549	471	6,533	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	—	1,650	1,778	24,670	資本財	

銘柄		期首(前期末)	当		期		業種等
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円		
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H		2,370	2,370	884	12,261	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H		7,830	7,830	681	9,448	保険	
CAR INC		760	—	—	—	運輸	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H		796	796	1,440	19,983	自動車・自動車部品	
SINOTRUK HONG KONG LTD		955	1,160	2,111	29,282	資本財	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H		13,810	20,240	1,740	24,142	各種金融	
FULLSHARE HOLDINGS LTD		8,750	—	—	—	資本財	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD		23,560	—	—	—	小売	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC		675	1,390	17,653	244,847	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA LITERATURE LTD		392	392	1,462	20,280	メディア・娯楽	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H		5,400	7,410	1,852	25,694	素材	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC		2,350	2,350	1,142	15,840	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEITU INC		2,090	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD		1,510	1,580	714	9,905	自動車・自動車部品	
DALI FOODS GROUP CO LTD		2,860	3,360	1,585	21,996	食品・飲料・タバコ	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L		2,000	2,700	3,245	45,013	不動産	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H		4,670	4,670	607	8,420	資本財	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H		—	762	3,225	44,735	商業・専門サービス	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN		—	600	6,552	90,876	ヘルスケア機器・サービス	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT		4,740	—	—	—	自動車・自動車部品	
GENSCRIPT BIOTECH CORP		1,220	1,540	2,411	33,449	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
YUZHOU PROPERTIES CO		1,720	3,360	1,176	16,311	不動産	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H		11,110	13,960	6,407	88,873	銀行	
BOC AVIATION LTD		310	328	1,636	22,701	資本財	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H		874	1,314	1,421	19,719	各種金融	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP		1,400	—	—	—	不動産	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H		1,436	2,492	3,060	42,444	各種金融	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H		316	602	1,751	24,297	保険	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L		1,220	1,660	1,769	24,543	商業・専門サービス	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD		1,680	2,260	8,203	113,786	商業・専門サービス	
CHINA TOWER CORP LTD-H		58,040	74,260	12,698	176,127	電気通信サービス	
MEITUAN DIANPING-CLASS B		464	1,817	19,932	276,463	小売	
XIAOMI CORP-CLASS B		4,772	18,988	21,836	302,868	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INNOVENT BIOLOGICS INC		—	1,595	6,156	85,393	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS		1,200	—	—	—	各種金融	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD		1,480	—	—	—	素材	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING		610	870	5,663	78,555	食品・飲料・タバコ	
WUXI APPTTEC CO LTD-H		—	285	3,164	43,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA AOYUAN GROUP LTD		—	1,890	1,753	24,326	不動産	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN		—	1,430	1,944	26,974	消費者サービス	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI		—	770	2,614	36,258	消費者サービス	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING		—	1,045	1,368	18,987	消費者サービス	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP		—	920	2,815	39,046	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD		—	2,280	1,103	15,305	不動産	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD		—	2,130	1,980	27,475	小売	
小計		株数・金額	1,355,005	1,620,933	1,749,150	24,260,716	
銘柄数<比率>			206	207	—	<23.3%>	
(マレーシア)				千マレーシアリンギット			
GENTING MALAYSIA BHD		4,635	4,641	1,104	27,293	消費者サービス	
GENTING BHD		2,923	4,417	1,833	45,294	消費者サービス	

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
(マレーシア)		百株	百株	千マレーシアリンギット	千円	
TELEKOM MALAYSIA BHD		1,355	2,148	912	22,557	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD		4,430	5,508	6,796	167,950	公益事業
KUALA LUMPUR KEPONG BHD		593	827	1,703	42,096	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD		5,556	6,921	5,128	126,724	銀行
IOI CORP BHD		2,419	3,161	1,226	30,306	食品・飲料・タバコ
AMMB HOLDINGS BHD		2,319	2,715	790	19,522	銀行
YTL CORP BHD		6,372	3,487	258	6,377	公益事業
GAMUDA BHD		2,862	2,827	947	23,401	資本財
MISC BHD		1,590	2,281	1,801	44,527	運輸
CIMB GROUP HOLDINGS BHD		7,354	8,497	2,922	72,226	銀行
PETRONAS GAS BHD		1,039	1,378	2,047	50,598	公益事業
SP SETIA BHD		2,669	—	—	—	不動産
SIME DARBY BERHAD		3,509	4,932	971	24,008	資本財
PUBLIC BANK BERHAD		4,185	5,634	8,867	219,126	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD		173	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD		819	1,083	1,759	43,475	食品・飲料・タバコ
IJM CORP BHD		4,797	4,576	768	18,996	資本財
DIGI.COM BHD		4,856	5,673	2,541	62,800	電気通信サービス
MAXIS BHD		3,327	3,932	2,072	51,203	電気通信サービス
AXIATA GROUP BERHAD		4,065	5,451	2,120	52,396	電気通信サービス
HONG LEONG BANK BERHAD		993	1,237	1,657	40,958	銀行
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD		3,417	4,619	2,531	62,546	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD		261	563	1,154	28,519	エネルギー
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD		1,204	1,583	775	19,166	運輸
IIHH HEALTHCARE BHD		3,539	3,561	1,837	45,404	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG FINANCIAL GROUP		333	333	426	10,548	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED		970	1,331	955	23,614	資本財
TOP GLOVE CORP BHD		1,776	2,904	2,122	52,454	ヘルスケア機器・サービス
GENTING PLANTATIONS BHD		392	392	364	9,008	食品・飲料・タバコ
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B		—	275	760	18,795	食品・飲料・タバコ
WESTPORTS HOLDINGS BHD		1,484	1,484	543	13,421	運輸
DIALOG GROUP BHD		5,613	6,672	2,188	54,082	エネルギー
IOI PROPERTIES GROUP BHD		1,728	—	—	—	不動産
QL RESOURCES BHD		808	1,014	821	20,295	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD		157	245	772	19,094	食品・飲料・タバコ
HARTALEGA HOLDINGS BHD		2,300	2,847	2,098	51,847	ヘルスケア機器・サービス
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD		93	115	1,589	39,271	食品・飲料・タバコ
RHB BANK BHD		1,379	3,192	1,487	36,761	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD		1,462	—	—	—	銀行
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN		1,691	2,417	932	23,053	素材
SIME DARBY PLANTATION BHD		3,518	3,907	1,863	46,050	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY PROPERTY BHD		4,517	—	—	—	不動産
AIRASIA GROUP BHD		2,152	2,152	166	4,121	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額	111,636	120,934	71,626	1,769,898	
	銘 柄 数 < 比 率 >	44	40	—	<1.7%>	
(タイ)				千タイバーツ		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR		1,961	3,989	18,947	63,285	不動産
KASIKORNBANK PCL-NVDR		2,527	3,081	26,188	87,469	銀行
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR		—	1,180	4,897	16,355	電気通信サービス
TMB BANK PCL-NVDR		15,421	33,932	3,121	10,426	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		
(タイ)		百株	百株	千タイバーツ	千円		
CP ALL PCL-NVDR		7,244	10,446	77,300	258,183	食品・生活必需品小売り	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR		480	728	7,134	23,828	銀行	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR		1,553	2,154	41,679	139,210	電気通信サービス	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR		2,756	1,780	12,104	40,427	銀行	
SIAM CEMENT PCL-NVDR		571	1,403	47,578	158,912	素材	
PTT PCL-NVDR		15,509	20,293	72,040	240,614	エネルギー	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR		2,090	2,434	20,202	67,475	エネルギー	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR		6,405	7,671	46,026	153,726	運輸	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR		2,706	7,685	4,265	14,245	エネルギー	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR		4,665	7,444	20,471	68,373	食品・飲料・タバコ	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR		2,309	2,930	8,204	27,401	素材	
IRPC PCL - NVDR		15,255	20,385	5,748	19,200	エネルギー	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		3,037	4,569	18,506	61,813	素材	
THAI OIL PCL-NVDR		1,623	1,711	7,400	24,716	エネルギー	
KRUNG THAI BANK - NVDR		5,334	7,914	8,151	27,225	銀行	
GLOW ENERGY PCL - NVDR		669	—	—	—	公益事業	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR		—	4,115	22,221	74,218	電気通信サービス	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR		6,006	17,430	34,511	115,268	ヘルスケア機器・サービス	
LAND & HOUSES PUB - NVDR		3,759	13,501	9,045	30,212	不動産	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR		2,622	5,521	7,122	23,787	食品・飲料・タバコ	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR		5,007	11,563	16,072	53,682	小売	
RATCH GROUP PCL-NVDR		—	1,105	7,265	24,266	公益事業	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR		211	480	12,960	43,286	公益事業	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR		7,818	12,597	14,864	49,647	運輸	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR		534	670	7,705	25,734	ヘルスケア機器・サービス	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR		606	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRUE CORP PCL-NVDR		16,580	20,450	6,585	21,994	電気通信サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		3,554	5,099	9,841	32,869	消費者サービス	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR		1,715	2,437	9,504	31,744	食品・生活必需品小売り	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR		1,775	2,746	10,709	35,769	公益事業	
ROBINSON PCL-NVDR		758	—	—	—	小売	
BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR		10,780	13,003	12,612	42,127	運輸	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR		—	1,428	7,568	25,278	各種金融	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR		824	1,013	4,761	15,902	各種金融	
B GRIMM POWER PCL-NVDR		—	1,117	5,082	16,975	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR		542	4,890	19,193	64,105	公益事業	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR		—	1,459	10,541	35,207	公益事業	
OSOTSPA PCL-NVDR		—	1,105	4,641	15,500	食品・飲料・タバコ	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR		—	3,886	14,378	48,025	小売	
小計	株数・金額	155,207	267,346	697,154	2,328,495		
	銘柄数<比率>	35	40	—	<2.2%>		
(フィリピン)				千フィリピンペソ			
PLDT INC		112	147	17,269	36,956	電気通信サービス	
SM PRIME HOLDINGS INC		14,919	18,559	56,883	121,730	不動産	
AYALA LAND INC		10,397	12,835	42,741	91,466	不動産	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN		1,356	1,356	7,951	17,016	銀行	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC		1,231	2,119	17,930	38,370	運輸	
MEGAWORLD CORP		17,930	17,930	4,625	9,899	不動産	
JOLLIBEE FOODS CORP		637	852	11,976	25,629	消費者サービス	
SM INVESTMENTS CORP		371	427	34,550	73,937	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
(フィリピン)		百株	百株	千フィリピンペソ	千円	
MANILA ELECTRIC COMPANY		340	501	12,800	27,393	公益事業
AYALA CORPORATION		385	505	35,316	75,578	資本財
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		2,639	3,422	14,033	30,031	資本財
ABOITIZ POWER CORP		1,953	2,495	6,661	14,255	公益事業
METROPOLITAN BANK & TRUST		2,507	4,021	14,799	31,670	銀行
BDO UNIBANK INC		2,685	3,429	33,613	71,931	銀行
DMCI HOLDINGS INC		5,719	—	—	—	資本財
UNIVERSAL ROBINA CORP		1,164	1,749	22,562	48,282	食品・飲料・タバコ
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC		5,593	—	—	—	資本財
JG SUMMIT HOLDINGS INC		4,407	5,080	24,791	53,053	資本財
GLOBE TELECOM INC		42	62	13,020	27,864	電気通信サービス
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		22,665	22,665	6,731	14,405	各種金融
SECURITY BANK CORP		420	420	4,213	9,016	銀行
ROBINSONS LAND CO		3,047	3,047	4,479	9,585	不動産
GT CAPITAL HOLDINGS INC		139	150	6,322	13,530	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	100,665	101,779	393,273	841,605	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	21	—	<0.8%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
KALBE FARMA TBK PT		28,041	35,836	4,963,286	36,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER		73,487	90,513	29,145,186	212,759	電気通信サービス
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P		5,863	7,439	4,853,947	35,433	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT		12,449	16,313	2,707,958	19,768	食品・飲料・タバコ
BANK CENTRAL ASIA TBK PT		14,504	17,927	47,461,732	346,470	銀行
INDOCEMENT TUNGKAL PRAKARSA		2,582	3,106	3,540,840	25,848	素材
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT		29,629	37,772	14,806,624	108,088	自動車・自動車部品
GUDANG GARAM TBK PT		731	960	4,310,400	31,465	食品・飲料・タバコ
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER		80,831	102,010	26,726,620	195,104	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK		4,415	4,832	3,865,600	28,218	素材
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT		17,073	17,073	1,528,033	11,154	公益事業
UNITED TRACTORS TBK PT		2,655	3,281	5,159,372	37,663	エネルギー
BUKIT ASAM TBK PT		3,873	5,905	1,210,525	8,836	エネルギー
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT		27,466	34,506	14,596,038	106,551	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT		2,229	14,056	11,350,220	82,856	家庭用品・パーソナル用品
ADARO ENERGY TBK PT		21,136	21,136	2,177,008	15,892	エネルギー
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT		2,812	5,000	1,900,000	13,870	運輸
BANK NEGARA INDONESIA PERSER		10,642	12,333	4,686,540	34,211	銀行
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO		5,806	5,806	499,316	3,645	銀行
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT		10,072	12,160	5,472,000	39,945	食品・飲料・タバコ
XL AXIATA TBK PT		—	5,147	1,235,280	9,017	電気通信サービス
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK		4,389	4,389	2,260,335	16,500	素材
PAKUWON JATI TBK PT		19,000	25,572	920,592	6,720	不動産
BUMI SERPONG DAMAI PT		9,750	11,250	748,125	5,461	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T		3,833	3,857	3,760,575	27,452	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE		2,126	—	—	—	電気通信サービス
ACE HARDWARE INDONESIA		—	10,630	1,472,255	10,747	小売
SURYA CITRA MEDIA PT TBK		8,664	—	—	—	メディア・娯楽
BARITO PACIFIC TBK PT		—	41,743	5,092,646	37,176	素材
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT		1,837	2,282	1,099,924	8,029	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	405,895	552,834	207,550,979	1,515,122	
	銘柄 数 < 比 率 >	27	28	—	<1.5%>	

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,928	8,540	41,335,778	3,625,147	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA ELECTRIC POWER CORP	365	441	967,410	84,841	公益事業
SHINSEGAE INC	11	11	287,573	25,220	小売
CJ CORP	21	32	253,342	22,218	資本財
SK TELECOM	28	38	782,895	68,659	電気通信サービス
HYUNDAI MOTOR CO	198	267	2,503,851	219,587	自動車・自動車部品
POSCO	112	140	2,478,960	217,404	素材
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	76	95	1,115,254	97,807	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KT CORP	22	—	—	—	電気通信サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	98	99	283,261	24,842	各種金融
HYUNDAI MOBIS CO LTD	96	120	2,081,385	182,537	自動車・自動車部品
CHEIL WORLDWIDE INC	95	101	174,501	15,303	メディア・娯楽
KB FINANCIAL GROUP INC	570	709	2,281,364	200,075	銀行
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	44	53	995,472	87,302	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	81	100	2,883,489	252,881	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	627	823	2,432,703	213,348	銀行
LG ELECTRONICS INC	157	185	1,009,503	88,533	耐久消費財・アパレル
AMOREPACIFIC GROUP	46	46	262,920	23,058	家庭用品・パーソナル用品
HYUNDAI DEPT STORE CO	20	20	136,600	11,979	小売
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	39	45	364,165	31,937	資本財
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	77	101	248,323	21,777	資本財
KT&G CORP	171	210	1,648,203	144,547	食品・飲料・タバコ
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	48	65	111,269	9,758	資本財
NCSOFT CORP	25	29	2,069,040	181,454	メディア・娯楽
LG DISPLAY CO LTD	338	458	493,414	43,272	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	53	74	594,935	52,175	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	643	843	354,429	31,083	資本財
AMOREPACIFIC CORP	48	57	1,010,002	88,577	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP	442	556	1,460,340	128,071	銀行
LG CHEM LTD	64	81	2,808,382	246,295	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	13	16	2,373,708	208,174	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	92	97	954,037	83,669	エネルギー
KAKAO CORP	72	93	1,939,087	170,057	メディア・娯楽
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	62	86	414,091	36,315	各種金融
HANMI SCIENCE CO LTD	17	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COWAY CO LTD	80	95	613,796	53,829	耐久消費財・アパレル
S-1 CORPORATION	23	36	315,114	27,635	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORP	380	479	1,466,033	128,571	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	842	977	8,259,959	724,398	半導体・半導体製造装置
LG CORP	141	166	1,029,944	90,326	資本財
HYUNDAI STEEL CO	118	172	356,277	31,245	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,195	1,472	6,109,090	535,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	25	33	130,878	11,478	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	373	541	411,304	36,071	銀行
PAN OCEAN CO LTD	331	399	131,399	11,523	運輸
KANGWON LAND INC	162	193	474,540	41,617	消費者サービス
NAVER CORP	204	250	5,382,019	472,003	メディア・娯楽
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	623	624	344,845	30,242	各種金融
CELLTRION INC	119	169	3,567,554	312,874	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA GAS CORPORATION	36	36	101,420	8,894	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	
(韓国)		百株	百株	千韓国ウォン	千円	
LG UPLUS CORP		138	362	487,064	42,715	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO		15	21	198,919	17,445	小売
YUHAN CORP		13	92	483,340	42,388	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DB INSURANCE CO LTD		73	96	444,952	39,022	保険
S-OIL CORP		64	82	562,245	49,308	エネルギー
KCC CORP		8	7	113,985	9,996	素材
POSCO INTERNATIONAL CORP		75	75	105,434	9,246	資本財
SAMSUNG CARD CO		57	45	134,077	11,758	各種金融
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD		204	258	293,465	25,736	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF		52	77	454,825	39,888	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST		113	158	535,992	47,006	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD		57	95	179,131	15,709	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT		99	134	628,945	55,158	保険
LOTTE CHEMICAL CORP		24	33	621,214	54,480	素材
GS HOLDINGS		77	104	395,010	34,642	エネルギー
NH INVESTMENT & SECURITIES C		208	208	195,941	17,184	各種金融
HANWHA SOLUTIONS CORP		164	164	246,256	21,596	素材
HANWHA CORPORATION		54	101	194,745	17,079	資本財
CJ CHEILJEDANG CORP		13	17	480,266	42,119	食品・飲料・タバコ
BNK FINANCIAL GROUP INC		364	488	233,670	20,492	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD		27	30	305,121	26,759	運輸
DGB FINANCIAL GROUP INC		304	—	—	—	銀行
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF		35	35	200,043	17,543	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD		11	13	508,090	44,559	素材
E-MART INC		29	33	374,417	32,836	食品・生活必需品小売り
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD		30	29	210,740	18,481	素材
SK HOLDINGS CO LTD		45	65	1,174,956	103,043	資本財
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO		86	102	263,628	23,120	保険
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES		95	121	290,528	25,479	資本財
LOTTE CORP		39	39	149,583	13,118	資本財
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD		398	398	67,663	5,934	保険
LG INNOTEK CO LTD		16	25	341,904	29,984	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD-PREFERENCE		13	13	214,619	18,822	素材
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO		103	116	250,257	21,947	自動車・自動車部品
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR		260	260	92,023	8,070	資本財
HANON SYSTEMS		296	296	271,853	23,841	自動車・自動車部品
CJ ENM CO LTD		16	16	194,121	17,024	小売
CJ LOGISTICS		11	18	257,543	22,586	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD		46	51	411,528	36,091	小売
SAMSUNG SDS CO LTD		50	61	1,112,421	97,559	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG C&T CORP		107	158	1,623,292	142,362	資本財
AMOREPACIFIC CORP-PREF		12	12	75,397	6,612	家庭用品・パーソナル用品
HANMI PHARM CO LTD		8	10	292,409	25,644	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GS RETAIL CO LTD		40	40	153,379	13,451	食品・生活必需品小売り
OTTOGI CORPORATION		1	1	99,858	8,757	食品・飲料・タバコ
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF		2	3	241,815	21,207	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD		24	28	1,680,062	147,341	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETMARBLE CORP		38	48	486,100	42,630	メディア・娯楽
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL		15	20	509,903	44,718	資本財
DOOSAN BOBCAT INC		55	80	195,566	17,151	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	
(韓国)		百株	百株	千韓国ウォン	千円		
MEDY-TOX INC		6	6	108,696	9,532	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA		34	47	583,167	51,143	食品・飲料・タバコ	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD		76	95	851,414	74,669	ヘルスケア機器・サービス	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD		60	—	—	—	保険	
SILLAJEN INC		80	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BGF RETAIL CO LTD		13	13	202,350	17,746	食品・生活必需品小売り	
POSCO CHEMICAL CO LTD		30	39	202,317	17,743	素材	
HLB INC		50	60	689,135	60,437	耐久消費財・アパレル	
HLB INC -RIGHTS		—	6	33,154	2,907	耐久消費財・アパレル	
CELLTRION PHARM INC		16	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HELIXMITH CO LTD		20	31	211,365	18,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HELIXMITH CO LTD-NEW		—	7	52,807	4,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PEARL ABYSS CORP		8	11	231,420	20,295	メディア・娯楽	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E		40	91	180,238	15,806	資本財	
FILA HOLDINGS CORP		74	76	253,671	22,246	耐久消費財・アパレル	
WOORI FINANCIAL GROUP INC		691	1,054	844,614	74,072	銀行	
MERITZ SECURITIES CO LTD		—	585	187,492	16,443	各種金融	
KMW CO LTD		—	39	237,900	20,863	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小 計		株 数 ・ 金 額	21,792	27,224	131,711,924	11,551,135	
		銘 柄 数 < 比 率 >	114	112	—	<11.1%>	
(台湾)				千ニュー台湾ドル			
COMPAL ELECTRONICS		5,477	8,067	15,167	54,602	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA ELECTRONICS INC		2,942	3,502	49,030	176,510	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP		4,551	5,871	15,999	57,598	資本財	
FORMOSA PLASTICS CORP		6,446	7,916	69,265	249,354	素材	
HON HAI PRECISION INDUSTRY		19,052	22,282	175,810	632,918	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNITED MICROELECTRONICS CORP		17,130	19,450	30,342	109,231	半導体・半導体製造装置	
NAN YA PLASTICS CORP		7,325	9,315	60,178	216,642	素材	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP		880	1,000	30,450	109,620	食品・生活必需品小売り	
TAIWAN CEMENT		6,612	8,995	38,816	139,738	素材	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		35,690	44,050	1,325,905	4,773,258	半導体・半導体製造装置	
ASUSTEK COMPUTER INC		977	1,257	25,406	91,462	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WINBOND ELECTRONICS CORP		4,030	4,600	6,302	22,687	半導体・半導体製造装置	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP		577	927	23,175	83,432	半導体・半導体製造装置	
YAGEO CORPORATION		359	439	18,174	65,426	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QUANTA COMPUTER INC		3,891	4,721	31,114	112,012	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO		12,163	13,703	54,266	195,359	保険	
ACER INC		4,321	5,731	9,428	33,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS		16,680	18,610	21,960	79,056	銀行	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE		5,194	6,234	46,570	167,652	素材	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO		10,030	11,790	48,578	174,882	保険	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD		697	1,017	8,120	29,235	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MEDIATEK INC		2,142	2,702	110,796	398,868	半導体・半導体製造装置	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING		14,137	17,323	21,827	78,577	銀行	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT		25,249	33,069	66,139	238,100	銀行	
TAIWAN MOBILE CO LTD		2,324	2,834	30,607	110,185	電気通信サービス	
CHINA STEEL CORP		18,729	20,869	41,425	149,133	素材	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR		880	1,020	20,808	74,908	半導体・半導体製造装置	
ADVANTECH CO LTD		466	646	18,885	67,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD		1,230	1,630	9,358	33,690	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(台湾)		百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD		990	1,160	27,956	100,641	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP		11,620	14,280	11,181	40,252	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TATUNG CO LTD		2,440	2,970	6,355	22,880	耐久消費財・アパレル
POWERTECH TECHNOLOGY INC		1,113	1,473	15,245	54,883	半導体・半導体製造装置
INVENTEC CORP		3,854	4,884	11,478	41,321	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD		5,540	6,750	74,250	267,300	電気通信サービス
PHISON ELECTRONICS CORP		210	230	6,532	23,515	半導体・半導体製造装置
WPG HOLDINGS LTD		1,981	2,581	10,016	36,060	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO		1,080	1,380	12,930	46,550	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GIANT MANUFACTURING		490	490	9,187	33,075	耐久消費財・アパレル
RUENTEX INDUSTRIES LTD		456	836	5,643	20,314	耐久消費財・アパレル
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP		2,311	2,371	9,464	34,070	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO		14,253	17,193	28,712	103,365	各種金融
INNOLUX CORP		11,951	17,331	11,178	40,242	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C		11,468	13,598	26,313	94,729	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING		15,858	19,098	16,023	57,685	保険
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD		2,420	2,910	19,613	70,608	電気通信サービス
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD		3,164	3,224	10,913	39,289	自動車・自動車部品
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP		1,811	2,191	19,482	70,136	エネルギー
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT		16,037	19,057	57,934	208,565	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO		14,542	18,458	40,607	146,188	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD		148	178	74,844	269,438	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO		6,916	8,726	61,956	223,042	食品・飲料・タバコ
CHANG HWA COMMERCIAL BANK		8,005	9,795	18,758	67,531	銀行
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL		18,982	22,252	20,249	72,899	保険
LITE-ON TECHNOLOGY CORP		3,071	3,911	18,364	66,113	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA CEMENT CORP		3,172	3,972	17,679	63,644	素材
POU CHEN		3,155	4,195	11,787	42,436	耐久消費財・アパレル
WISTRON CORP		3,758	5,258	14,619	52,628	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEGATRON CORP		2,929	3,489	23,346	84,047	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD		4,050	4,050	3,264	11,751	運輸
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO		14,123	18,571	50,234	180,844	銀行
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD		3,540	4,550	9,396	33,828	保険
HIWIN TECHNOLOGIES CORP		353	474	14,031	50,514	資本財
EVA AIRWAYS CORP		3,256	5,963	6,738	24,260	運輸
EVERGREEN MARINE CORP LTD		2,638	4,398	4,728	17,023	運輸
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP		190	250	14,200	51,120	資本財
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL		13,531	16,788	33,744	121,479	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD		410	520	27,248	98,092	小売
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD		517	1,087	4,816	17,338	不動産
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP		1,180	1,710	7,643	27,517	不動産
TAIWAN BUSINESS BANK		4,779	9,058	9,828	35,382	銀行
STANDARD FOODS CORP		610	610	4,015	14,455	食品・飲料・タバコ
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		670	870	10,266	36,957	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORMOSA TAFFETA CO.		1,110	1,310	4,408	15,869	耐久消費財・アパレル
CHAILEASE HOLDING CO LTD		1,761	2,184	25,452	91,629	各種金融
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI		1,450	1,470	10,319	37,149	半導体・半導体製造装置
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD		237	317	8,947	32,210	耐久消費財・アパレル
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD		439	543	8,826	31,776	耐久消費財・アパレル
NANYA TECHNOLOGY CORP		1,520	2,170	14,039	50,543	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
(台湾)		百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD		280	280	6,706	24,141	耐久消費財・アパレル
TAIMED BIOLOGICS INC		210	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WIN SEMICONDUCTORS CORP		540	610	17,232	62,037	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD		310	420	16,212	58,363	半導体・半導体製造装置
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP		2,930	3,860	13,066	47,037	運輸
WALSIN TECHNOLOGY CORP		500	650	13,325	47,970	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT		5,052	6,222	42,876	154,353	半導体・半導体製造装置
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA		4,350	5,790	25,504	91,817	銀行
ACCTON TECHNOLOGY CORP		—	930	19,437	69,973	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WIWYNN CORP		—	150	13,095	47,142	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計		株数・金額	474,469	589,642	3,556,145	12,802,122
銘柄数<比率>			87	88	—	<12.3%>
(インド)				千インドルピー		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE		2,368	2,930	485,972	690,080	銀行
TATA CONSULTANCY SVCS LTD		1,305	1,608	311,223	441,937	ソフトウェア・サービス
ITC LTD		4,981	6,141	97,307	138,176	食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD		930	1,468	300,826	427,173	家庭用品・パーソナル用品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD		3,656	4,898	37,742	53,594	エネルギー
HINDALCO INDUSTRIES LTD		1,720	1,855	22,221	31,554	素材
COAL INDIA LTD		1,798	2,384	30,622	43,483	エネルギー
GAIL INDIA LTD		1,176	2,507	23,083	32,778	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD		821	952	16,561	23,516	素材
HERO MOTOCORP LTD		68	181	37,881	53,792	自動車・自動車部品
BAJAJ AUTO LTD		112	149	38,438	54,582	自動車・自動車部品
SUN PHARMACEUTICAL INDUS		1,276	1,463	67,870	96,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASIAN PAINTS LTD		424	494	77,575	110,157	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD		2,574	3,219	51,123	72,595	公益事業
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE		202	153	11,321	16,076	各種金融
VEDANTA LTD		1,957	3,325	26,474	37,593	素材
TATA POWER CO LTD		1,689	1,689	4,612	6,550	公益事業
BHARTI AIRTEL LTD		2,079	4,429	237,492	337,239	電気通信サービス
BHARTI AIRTEL LTD-RIGHT		589	—	—	—	電気通信サービス
CIPLA LTD		521	652	38,237	54,297	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NTPC LTD		3,494	4,280	37,091	52,669	公益事業
INFOSYS LTD		5,068	6,092	416,080	590,834	ソフトウェア・サービス
ULTRATECH CEMENT LTD		139	177	59,700	84,774	素材
DLF LTD		—	878	11,711	16,630	不動産
DR. REDDY'S LABORATORIES		164	204	79,024	112,214	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ICICI BANK LTD		3,402	8,530	273,099	387,801	銀行
LUPIN LTD		320	433	36,777	52,223	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD		155	190	93,862	133,284	自動車・自動車部品
RELIANCE INDUSTRIES LTD		4,137	5,100	804,306	1,142,115	エネルギー
STATE BANK OF INDIA		2,543	3,064	50,704	72,000	銀行
TATA STEEL LTD		545	548	15,145	21,506	素材
LIC HOUSING FINANCE LTD		396	502	13,477	19,137	銀行
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		1,151	1,155	36,388	51,672	エネルギー
VODAFONE IDEA LTD		12,669	—	—	—	電気通信サービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD		489	698	36,092	51,251	家庭用品・パーソナル用品
REC LTD		876	1,266	11,293	16,036	各種金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE		669	1,475	22,923	32,551	メディア・娯楽

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	
(インド)		百株	百株	千インドルピー	千円	
DABUR INDIA LTD		776	945	42,205	59,931	家庭用品・パーソナル用品
JSW STEEL LTD		1,168	1,400	24,438	34,702	素材
LARSEN & TOUBRO LTD		691	883	72,554	103,027	資本財
UNITED SPIRITS LTD		409	533	26,314	37,366	食品・飲料・タバコ
TITAN CO LTD		474	549	45,625	64,788	耐久消費財・アパレル
SIEMENS LTD		—	106	10,993	15,610	資本財
WIPRO LTD		2,097	2,209	40,818	57,962	ソフトウェア・サービス
AXIS BANK LTD		2,788	3,724	141,361	200,733	銀行
MAHINDRA & MAHINDRA LTD		1,076	1,423	55,536	78,861	自動車・自動車部品
TATA MOTORS LTD		2,283	2,909	25,054	35,577	自動車・自動車部品
HCL TECHNOLOGIES LTD		804	1,969	103,886	147,519	ソフトウェア・サービス
DIVI'S LABORATORIES LTD		104	139	32,399	46,007	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON		815	1,181	34,228	48,603	運輸
PIRAMAL ENTERPRISES LTD		119	158	14,736	20,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS		450	603	9,528	13,530	各種金融
YES BANK LTD		2,575	—	—	—	銀行
NESTLE INDIA LTD		33	42	74,551	105,862	食品・飲料・タバコ
TECH MAHINDRA LTD		714	828	43,913	62,357	ソフトウェア・サービス
AUROBINDO PHARMA LTD		408	420	27,970	39,717	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD		1,514	1,514	12,184	17,302	自動車・自動車部品
BOSCH LTD		10	11	11,015	15,641	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD		11	14	27,596	39,187	素材
CONTAINER CORP OF INDIA LTD		273	323	11,800	16,756	運輸
MARICO LTD		649	726	22,018	31,266	家庭用品・パーソナル用品
BHARTI INFRATEL LTD		491	491	9,027	12,818	電気通信サービス
EICHER MOTORS LTD		19	24	34,750	49,346	自動車・自動車部品
BHARAT FORGE LTD		317	317	9,090	12,908	自動車・自動車部品
UPL LTD		535	1,051	38,703	54,959	素材
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD		197	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAVELLS INDIA LTD		357	517	25,271	35,886	資本財
INDIABULLS HOUSING FINANCE L		385	—	—	—	銀行
PETRONET LNG LTD		798	1,026	24,050	34,151	エネルギー
PIDILITE INDUSTRIES LTD		161	205	28,339	40,242	素材
ASHOK LEYLAND LTD		1,700	1,700	8,289	11,770	資本財
CADILA HEALTHCARE LTD		271	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTERGLOBE AVIATION LTD		136	156	14,997	21,296	運輸
BAJAJ FINANCE LTD		251	334	67,322	95,598	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD		56	75	34,353	48,782	保険
HINDUSTAN PETROLEUM CORP		997	1,052	20,268	28,780	エネルギー
GRASIM INDUSTRIES LTD		468	547	27,621	39,222	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD		198	231	53,628	76,151	食品・生活必需品小売り
INDIAN OIL CORP LTD		2,915	3,737	28,165	39,994	エネルギー
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)		—	136	18,529	26,312	家庭用品・パーソナル用品
BRITANNIA INDUSTRIES LTD		91	113	34,589	49,116	食品・飲料・タバコ
BERGER PAINTS INDIA LTD		—	446	20,210	28,699	素材
PAGE INDUSTRIES LTD		8	10	18,666	26,505	耐久消費財・アパレル
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA		—	354	45,962	65,266	保険
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD		—	897	47,110	66,896	保険
BANDHAN BANK LTD		—	738	17,700	25,135	銀行
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD		—	89	22,734	32,283	各種金融

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
			株数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)		百株	百株	千インドルピー	千円	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA		—	631	25,123	35,675	保険
INFO EDGE INDIA LTD		—	100	25,709	36,507	メディア・娯楽
SBI LIFE INSURANCE CO LTD		—	614	46,080	65,434	保険
小計	株数・金額	97,092	113,326	5,571,300	7,911,246	
	銘柄数＜比率＞	79	84	—	<7.6%>	
(中国オフショア)				千オフショア元		
SAIC MOTOR CORP LTD-A		144	970	1,950	29,492	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A		23	128	17,037	257,610	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A		116	757	2,270	34,326	保険
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A		271	2,410	4,136	62,546	公益事業
CHINA JUSHI CO LTD -A		—	332	300	4,542	素材
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A		35	183	336	5,091	ヘルスケア機器・サービス
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A		36	184	1,644	24,865	小売
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A		75	388	944	14,285	半導体・半導体製造装置
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A		85	437	292	4,420	資本財
HAIER SMART HOME CO LTD-A		113	579	901	13,637	耐久消費財・アパレル
AVICOPTER PLC-A		—	55	242	3,669	資本財
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A		27	139	194	2,946	資本財
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A		177	910	903	13,662	食品・生活必需品小売り
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A		100	776	281	4,259	小売
MIDEA GROUP CO LTD-A		122	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A		170	1,029	3,295	49,823	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A		—	300	299	4,522	商業・専門サービス
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A		18	90	287	4,347	耐久消費財・アパレル
GOERTEK INC -A		60	308	654	9,900	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNISPLENDOR CORP LTD-A		13	161	678	10,258	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEICHAI POWER CO LTD-A		112	568	818	12,369	資本財
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A		—	159	544	8,236	資本財
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A		383	2,283	3,743	56,594	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A		775	3,989	2,086	31,550	資本財
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A		56	284	1,658	25,077	耐久消費財・アパレル
S F HOLDING CO LTD-A		24	155	730	11,050	運輸
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A		72	411	5,830	88,150	食品・飲料・タバコ
PING AN BANK CO LTD-A		317	2,031	2,844	43,005	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A		573	2,950	1,542	23,327	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A		342	1,763	867	13,122	素材
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A		81	480	4,499	68,031	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A		128	809	336	5,088	運輸
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A		625	3,218	1,271	19,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A		112	579	1,691	25,580	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A		390	2,008	993	15,028	銀行
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A		226	1,395	710	10,736	メディア・娯楽
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A		219	1,130	1,779	26,909	不動産
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A		42	255	2,746	41,525	食品・飲料・タバコ
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A		188	1,212	444	6,725	資本財
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A		239	1,232	532	8,047	公益事業
SUNING.COM CO LTD-A		172	884	769	11,639	小売
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO-A		92	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A		—	579	507	7,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A		—	298	1,393	21,064	素材

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア元	千円	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	19	121	1,079	16,319	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	542	3,279	3,420	51,716	銀行
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	41	210	277	4,200	資本財
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	58	299	679	10,275	自動車・自動車部品
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	15	102	371	5,610	素材
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	130	1,680	601	9,093	素材
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	—	108	263	3,984	資本財
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	20	103	502	7,601	素材
TIANQI LITHIUM CORP-A	21	266	468	7,078	素材
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	—	84	320	4,852	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	67	345	319	4,825	素材
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	470	2,422	1,068	16,151	エネルギー
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	212	1,093	1,077	16,294	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	—	2,911	1,679	25,396	資本財
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	18	93	269	4,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY-A	32	—	—	—	自動車・自動車部品
CHINA SPACESAT CO LTD -A	22	112	385	5,822	資本財
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	130	818	429	6,493	運輸
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	33	170	180	2,727	メディア・娯楽
CHINA VANKE CO LTD -A	179	1,113	2,940	44,466	不動産
CHINESE UNIVERSE PUBLISHIN-A	25	130	159	2,409	メディア・娯楽
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	72	370	398	6,025	自動車・自動車部品
CITIC GUOAN INFORMATION-A	72	372	121	1,839	メディア・娯楽
CITIC SECURITIES CO-A	182	1,194	2,815	42,567	各種金融
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	146	751	144	2,191	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	141	613	217	3,281	運輸
CRRC CORP LTD-A	374	2,313	1,431	21,650	資本財
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	274	1,412	983	14,868	運輸
DHC SOFTWARE CO LTD -A	58	295	405	6,133	ソフトウェア・サービス
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	12	62	192	2,904	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONGXING SECURITIES CO LT-A	42	262	283	4,290	各種金融
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	101	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	72	372	418	6,327	各種金融
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	33	258	222	3,357	資本財
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	55	283	187	2,832	不動産
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	65	332	234	3,549	各種金融
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	152	783	562	8,512	各種金融
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	42	215	696	10,532	不動産
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37	189	396	5,998	自動車・自動車部品
GEMDALE CORP-A	83	429	563	8,516	不動産
GF SECURITIES CO LTD-A	109	562	772	11,675	各種金融
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	25	128	217	3,295	メディア・娯楽
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	150	772	440	6,653	不動産
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	104	538	125	1,903	運輸
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	39	226	237	3,598	自動車・自動車部品
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	26	134	421	6,369	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	43	218	282	4,271	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	76	390	425	6,427	各種金融
AECC AVIATION POWER CO-A	42	214	532	8,047	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,375	7,081	2,421	36,616	銀行

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)		百株	百株	千オフショア元	千円	
AIR CHINA LTD-A		86	378	262	3,966	運輸
AISINO CORP-A		34	178	308	4,658	ソフトウェア・サービス
ANGANG STEEL CO LTD-A		76	506	133	2,022	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A		74	490	3,035	45,897	素材
ANXIN TRUST CO LTD-A		101	520	130	1,965	各種金融
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A		51	263	474	7,177	資本財
AVIC CAPITAL CO LTD -A		166	853	338	5,120	各種金融
BANK OF CHINA LTD-A		907	3,339	1,155	17,468	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A		724	3,730	1,921	29,047	銀行
BANK OF GUIYANG CO LTD-A		42	304	240	3,640	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A		95	487	416	6,295	銀行
BANK OF JIANGSU CO LTD-A		213	1,096	661	9,994	銀行
BANK OF NANJING CO LTD -A		157	806	619	9,371	銀行
BANK OF NINGBO CO LTD -A		94	534	1,388	20,996	銀行
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A		202	1,349	1,094	16,550	銀行
BBMG CORPORATION-A		154	791	266	4,030	素材
BEIJING CAPITAL CO LTD-A		89	—	—	—	公益事業
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A		78	403	396	5,989	食品・飲料・タバコ
BEIJING SHIJI INFORMATION -A		16	84	276	4,181	ソフトウェア・サービス
BEIJING TONGRENTANG CO-A		25	130	328	4,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BYD CO LTD -A		33	172	1,012	15,312	自動車・自動車部品
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A		102	525	337	5,104	各種金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A		105	539	276	4,180	銀行
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A		51	260	214	3,247	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-A		177	912	582	8,811	銀行
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A		151	888	379	5,733	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A		735	3,783	1,399	21,164	銀行
CHINA FILM CO LTD-A		34	147	193	2,924	メディア・娯楽
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A		55	285	664	10,044	不動産
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A		23	143	107	1,621	資本財
CHINA LIFE INSURANCE CO-A		51	264	748	11,312	保険
CHINA MERCHANTS BANK-A		381	2,159	7,551	114,176	銀行
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A		106	543	985	14,901	各種金融
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A		122	752	1,258	19,028	不動産
CHINA MINSHENG BANKING-A		654	4,309	2,508	37,920	銀行
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A		91	468	279	4,231	資本財
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A		139	714	1,178	17,823	各種金融
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A		62	319	263	3,988	各種金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A		149	768	981	14,834	各種金融
HLA CORP LTD -A		41	280	173	2,616	小売
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A		51	262	1,089	16,471	食品・飲料・タバコ
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A		35	180	324	4,898	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HESTEEL CO LTD-A		196	1,008	208	3,154	素材
HUAAN SECURITIES CO LTD-A		67	344	255	3,869	各種金融
HUADIAN POWER INTL CORP-A		150	644	236	3,583	公益事業
HUADONG MEDICINE CO LTD-A		27	166	352	5,331	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG POWER INTL INC-A		90	1,572	679	10,268	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A		121	698	1,263	19,102	各種金融
HUAXIA BANK CO LTD-A		237	1,987	1,291	19,533	銀行
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A		76	470	262	3,972	保険

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千円	千円	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	80	413	148	2,248	公益事業
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	11	77	792	11,977	ソフトウェア・サービス
IND & COMM BK OF CHINA-A	995	5,125	2,634	39,832	銀行
IFLYTEK CO LTD - A	38	210	725	10,967	ソフトウェア・サービス
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	124	636	384	5,808	各種金融
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	701	4,334	481	7,273	素材
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	28	142	1,404	21,234	食品・飲料・タバコ
JIANGXI COPPER CO LTD-A	38	197	255	3,860	素材
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	50	255	153	2,324	素材
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	99	507	422	6,393	不動産
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	35	178	322	4,876	ヘルスケア機器・サービス
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	28	145	257	3,895	小売
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	52	504	1,553	23,486	半導体・半導体製造装置
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	76	507	2,368	35,809	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	27	139	1,150	17,401	食品・飲料・タバコ
MAANSHAN IRON & STEEL-A	110	566	148	2,250	素材
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	58	355	417	6,306	ヘルスケア機器・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	329	1,696	444	6,719	資本財
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	32	228	2,658	40,196	食品・飲料・タバコ
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	38	197	901	13,635	保険
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	78	400	1,234	18,670	食品・飲料・タバコ
NINESTAR CORP-A	13	101	316	4,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	—	836	286	4,335	運輸
OFILM GROUP CO LTD-A	50	257	414	6,267	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	82	420	212	3,213	エネルギー
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	110	568	535	8,090	各種金融
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	63	326	300	4,539	メディア・娯楽
PERFECT WORLD CO LTD-A	16	122	549	8,300	メディア・娯楽
PETROCHINA CO LTD-A	299	1,540	688	10,408	エネルギー
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	200	1,129	8,344	126,175	保険
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	80	413	335	5,076	不動産
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	54	907	1,072	16,223	素材
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	142	795	1,631	24,670	資本財
SDIC CAPITAL CO LTD-A	72	335	410	6,209	各種金融
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	125	645	490	7,411	公益事業
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	123	792	588	8,897	エネルギー
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	16	107	236	3,576	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	34	246	885	13,389	素材
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	82	548	166	2,513	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	—	845	272	4,114	資本財
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	145	773	362	5,481	資本財
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	37	192	649	9,826	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	18	91	624	9,438	運輸
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	57	297	170	2,570	資本財
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	55	284	160	2,421	エネルギー
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	52	269	191	2,899	各種金融
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	—	541	198	2,993	素材
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	16	83	888	13,440	食品・飲料・タバコ
SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	58	299	142	2,151	エネルギー
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	84	466	246	3,720	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
(中国オフショア)		百株	百株	千オフショア元	千円	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A		346	2,142	961	14,542	各種金融
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A		61	313	171	2,588	公益事業
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A		151	780	499	7,547	消費者サービス
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A		16	82	155	2,348	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A		66	339	122	1,850	素材
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A		81	418	374	5,662	公益事業
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A		27	136	280	4,236	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A		56	287	294	4,447	各種金融
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A		90	581	230	3,478	素材
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A		55	285	224	3,395	各種金融
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A		—	537	245	3,718	各種金融
SPRING AIRLINES CO LTD-A		14	87	308	4,661	運輸
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A		49	254	215	3,264	資本財
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A		28	143	210	3,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TBEA CO LTD-A		69	352	273	4,140	資本財
TIANMA MICROELECTRONICS-A		38	194	273	4,141	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A		38	193	264	3,994	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONGLING NONFERROUS METALS-A		194	1,001	196	2,966	素材
TONGWEI CO LTD-A		72	370	529	7,999	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A		13	66	361	5,467	食品・飲料・タバコ
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A		26	135	110	1,671	商業・専門サービス
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A		51	261	132	2,004	自動車・自動車部品
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A		15	79	166	2,513	自動車・自動車部品
WESTERN SECURITIES CO LTD-A		65	332	269	4,071	各種金融
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A		33	200	741	11,216	メディア・娯楽
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A		145	744	474	7,177	資本財
XIAMEN C & D INC-A		52	269	239	3,615	資本財
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A		159	817	251	3,804	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A		54	328	337	5,108	資本財
YOUNGOR GROUP CO-A		66	—	—	—	不動産
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A		—	148	197	2,989	不動産
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A		11	58	843	12,747	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A		101	—	—	—	不動産
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A		40	205	528	7,987	資本財
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A		53	285	493	7,463	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A		60	309	379	5,741	素材
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A		167	—	—	—	公益事業
ZHONGJIN GOLD CORP-A		64	327	273	4,128	素材
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A		319	2,813	1,111	16,800	素材
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A		118	609	423	6,399	資本財
ZTE CORP-A		63	442	1,902	28,763	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A		17	88	307	4,643	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A		81	417	663	10,025	エネルギー
GD POWER DEVELOPMENT CO -A		362	1,864	367	5,552	公益事業
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A		40	557	789	11,933	素材
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A		85	439	866	13,102	資本財
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A		18	114	252	3,812	自動車・自動車部品
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A		250	1,286	622	9,411	耐久消費財・アパレル
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A		45	235	1,109	16,771	ソフトウェア・サービス
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A		—	294	1,341	20,287	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア元	千円	
NAVINFO CO LTD-A	—	186	283	4,291	耐久消費財・アパレル
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	—	57	355	5,369	半導体・半導体製造装置
ANGEL YEAST CO LTD-A	—	78	297	4,505	食品・飲料・タバコ
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	19	128	229	3,468	ソフトウェア・サービス
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY-A	407	2,174	919	13,904	資本財
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	54	261	243	3,685	資本財
OPPEIN HOME GROUP INC-A	4	26	303	4,588	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	49	171	127	1,933	耐久消費財・アパレル
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	225	1,244	352	5,323	素材
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	99	378	548	8,298	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	140	645	161	2,438	エネルギー
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	36	249	256	3,881	各種金融
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	—	343	268	4,066	銀行
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	—	341	327	4,958	各種金融
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	—	165	360	5,445	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	—	125	1,007	15,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	—	208	2,863	43,297	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	—	638	1,164	17,613	各種金融
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	—	70	543	8,221	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	—	270	331	5,011	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	—	51	610	9,235	各種金融
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	—	803	230	3,485	素材
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	—	311	560	8,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	—	169	657	9,939	ヘルスケア機器・サービス
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	—	252	1,210	18,305	メディア・娯楽
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	—	329	113	1,716	不動産
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	—	60	808	12,221	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	—	106	2,757	41,686	ヘルスケア機器・サービス
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	—	138	424	6,419	消費者サービス
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	—	153	405	6,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	—	309	188	2,850	素材
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	—	146	625	9,453	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	—	232	199	3,009	ソフトウェア・サービス
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	—	504	1,495	22,609	食品・飲料・タバコ
YANZHOU COAL MINING CO-A	—	210	176	2,661	エネルギー
WUXI APPTec CO LTD-A	—	139	1,428	21,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUNDA HOLDING CO LTD-A	—	142	451	6,823	運輸
ZHONGJI INNOVATION CO LTD-A	—	57	379	5,732	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	—	150	194	2,941	資本財
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	—	64	202	3,065	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	—	109	145	2,206	資本財
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	—	259	177	2,682	資本財
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	—	36	525	7,940	食品・飲料・タバコ
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	—	56	243	3,686	食品・飲料・タバコ
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	—	22	401	6,069	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OVCTEK CHINA INC-A	—	38	252	3,824	ヘルスケア機器・サービス
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	—	27	354	5,354	ヘルスケア機器・サービス
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	—	343	282	4,273	資本財
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	—	100	364	5,511	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	—	245	157	2,381	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	
(中国オフショア)		百株	百株	千オフショア元	千円	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	—	279	302	4,577	メディア・娯楽	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	—	161	398	6,032	資本財	
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	—	142	553	8,369	素材	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	—	70	381	5,767	食品・飲料・タバコ	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	—	147	410	6,201	ソフトウェア・サービス	
BEIJING SL PHARMACEUTICAL -A	—	98	110	1,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	—	99	340	5,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	—	268	162	2,463	食品・飲料・タバコ	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	—	38	376	5,694	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BGI GENOMICS CO LTD-A	—	38	399	6,046	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOHAI LEASING CO LTD-A	—	588	166	2,524	資本財	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	—	94	147	2,225	消費者サービス	
BY-HEALTH CO LTD-A	—	150	282	4,263	家庭用品・パーソナル用品	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	—	158	276	4,180	商業・専門サービス	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	—	16	976	14,757	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	—	26	289	4,383	自動車・自動車部品	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	—	69	263	3,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	—	284	136	2,056	公益事業	
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	—	387	161	2,440	不動産	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	—	278	371	5,611	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA MEHECO CO LTD -A	—	102	146	2,217	資本財	
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	—	577	378	5,723	エネルギー	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	—	47	405	6,132	ソフトウェア・サービス	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	—	36	147	2,228	ヘルスケア機器・サービス	
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	—	72	227	3,441	ヘルスケア機器・サービス	
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	—	211	209	3,161	資本財	
CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	—	99	128	1,935	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	—	141	345	5,221	ソフトウェア・サービス	
CHONGQING BREWERY CO-A	—	46	257	3,896	食品・飲料・タバコ	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	—	75	251	3,806	食品・飲料・タバコ	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	—	260	197	2,991	エネルギー	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	—	263	916	13,854	各種金融	
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	—	735	127	1,933	運輸	
DAWNING INFORMATION INDUST-A	—	120	471	7,123	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EVE ENERGY CO LTD-A	—	92	616	9,328	資本財	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	—	111	405	6,130	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	—	98	228	3,458	食品・飲料・タバコ	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	—	7	291	4,408	メディア・娯楽	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	—	483	124	1,876	半導体・半導体製造装置	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	—	43	956	14,461	半導体・半導体製造装置	
GLODON CO LTD-A	—	107	539	8,157	ソフトウェア・サービス	
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	—	311	161	2,445	不動産	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	—	229	308	4,663	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	—	150	652	9,865	食品・飲料・タバコ	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	—	287	191	2,894	素材	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	—	196	275	4,161	運輸	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	—	44	301	4,563	ヘルスケア機器・サービス	
GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	—	134	111	1,689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	—	125	185	2,806	半導体・半導体製造装置	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	—	64	270	4,083	資本財	

銘柄	柄	期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(中国オフショア)		百株	百株	千円	千円	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A		—	169	289	4,374	食品・飲料・タバコ
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A		—	296	166	2,510	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A		—	71	226	3,432	資本財
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A		—	172	643	9,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUAXIN CEMENT CO LTD-A		—	129	367	5,562	素材
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A		—	78	180	2,721	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A		—	402	170	2,571	素材
HYTERA COMMUNICATIONS CORP-A		—	175	124	1,876	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A		—	161	160	2,422	資本財
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A		—	550	136	2,070	公益事業
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A		—	123	521	7,881	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A		—	40	453	6,852	ヘルスケア機器・サービス
JIANGSU CHANGSHU RURAL COM-A		—	260	178	2,700	銀行
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A		—	84	607	9,189	資本財
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A		—	118	420	6,364	食品・飲料・タバコ
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A		—	29	234	3,540	素材
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A		—	95	332	5,025	ヘルスケア機器・サービス
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A		—	292	368	5,576	資本財
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A		—	352	288	4,364	不動産
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A		—	232	400	6,054	食品・飲料・タバコ
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A		—	111	171	2,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A		—	107	277	4,196	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A		—	184	245	3,714	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A		—	76	379	5,734	食品・飲料・タバコ
JUEWEI FOOD CO LTD-A		—	55	295	4,472	食品・飲料・タバコ
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A		—	156	148	2,252	運輸
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A		—	95	149	2,253	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A		—	27	207	3,138	食品・生活必需品小売り
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A		—	242	143	2,166	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A		—	542	498	7,531	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A		—	58	240	3,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOMON BILLIONS GROUP CO -A		—	193	327	4,949	素材
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A		—	139	113	1,710	素材
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A		—	482	223	3,374	小売
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A		—	234	356	5,384	メディア・娯楽
NANJING IRON & STEEL CO-A		—	421	138	2,100	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A		—	57	333	5,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NANJING SECURITIES CO LTD-A		—	313	461	6,975	各種金融
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A		—	44	671	10,147	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A		—	99	169	2,558	ソフトウェア・サービス
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A		—	123	257	3,892	自動車・自動車部品
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A		—	222	184	2,782	各種金融
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A		—	648	215	3,262	各種金融
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A		—	817	168	2,544	素材
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A		—	32	605	9,153	ソフトウェア・サービス
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A		—	233	169	2,564	素材
SEALAND SECURITIES CO LTD -A		—	400	176	2,673	各種金融
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A		—	308	233	3,534	小売
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A		—	155	277	4,197	素材
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A		—	1,137	237	3,593	素材

銘	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(中国オフショア)		百株	百株	千オフショア元	千円	
SHANDONG SINCERA FUNCTION-A		—	92	223	3, 373	素材
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A		—	246	213	3, 221	素材
SHANDONG XINCHAO ENERGY CO-A		—	648	114	1, 734	エネルギー
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD-A		—	154	122	1, 846	各種金融
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A		—	80	428	6, 483	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A		—	248	183	2, 778	公益事業
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A		—	64	228	3, 452	家庭用品・パーソナル用品
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A		—	64	175	2, 653	消費者サービス
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A		—	88	458	6, 932	商業・専門サービス
SHANGHAI MECHANICAL AND EL-A		—	77	115	1, 746	資本財
SHANGHAI WAIGAOQIAO FTZ-A		—	74	105	1, 595	資本財
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A		—	390	267	4, 039	エネルギー
SHANYING INTL HLDG CO LTD-A		—	437	132	2, 008	素材
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A		—	167	120	1, 823	素材
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A		—	216	678	10, 254	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A		—	32	805	12, 173	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN AIRPORT CO-A		—	195	154	2, 338	運輸
GEM CO LTD-A		—	394	183	2, 776	素材
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A		—	99	230	3, 483	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A		—	36	876	13, 248	半導体・半導体製造装置
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A		—	82	143	2, 166	ソフトウェア・サービス
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A		—	92	398	6, 019	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A		—	115	396	5, 997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A		—	148	199	3, 018	資本財
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL-A		—	841	116	1, 754	素材
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A		—	286	160	2, 421	不動産
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A		—	46	208	3, 159	食品・飲料・タバコ
SINOCHEM INTL CORP-A		—	257	128	1, 939	資本財
SINOTRANS LIMITED-A		—	416	139	2, 107	運輸
YANGO GROUP CO LTD-A		—	385	270	4, 092	不動産
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A		—	147	235	3, 554	資本財
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A		—	87	176	2, 666	耐久消費財・アパレル
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A		—	128	278	4, 205	素材
TANGSHAN PORT GROUP CO LTD-A		—	564	129	1, 961	運輸
TECH-BANK FOOD CO LTD-A		—	110	128	1, 947	食品・飲料・タバコ
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A		—	393	119	1, 800	資本財
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A		—	265	460	6, 963	半導体・半導体製造装置
TOLY BREAD CO LTD-A		—	52	251	3, 809	食品・飲料・タバコ
TONGKUN GROUP CO LTD-A		—	176	211	3, 196	素材
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A		—	30	374	5, 657	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A		—	138	260	3, 939	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VENUSTECH GROUP INC-A		—	85	354	5, 366	ソフトウェア・サービス
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A		—	130	168	2, 551	半導体・半導体製造装置
VISUAL CHINA GROUP CO LTD-A		—	67	121	1, 831	小売
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A		—	198	338	5, 116	メディア・娯楽
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A		—	49	272	4, 113	素材
WESTONE INFORMATION INDUST-A		—	80	184	2, 794	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A		—	55	1, 136	17, 188	半導体・半導体製造装置
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A		—	154	387	5, 856	ヘルスケア機器・サービス
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A		—	89	399	6, 038	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄		株数	株数	当 期 末		業 種 等
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)		百株	百株	千オフショア元	千円	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A		—	164	440	6,662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A		—	134	155	2,348	素材
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A		—	204	96	1,458	素材
XINXING DUCTILE IRON PIPES-A		—	379	131	1,988	素材
XINYU IRON & STEEL CO LTD-A		—	303	127	1,924	素材
YANTAI JEREH OILFIELD-A		—	91	249	3,770	エネルギー
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A		—	47	446	6,751	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A		—	117	236	3,582	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A		—	36	334	5,052	食品・生活必需品小売り
YINTAI GOLD CO LTD-A		—	189	293	4,443	素材
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A		—	84	161	2,438	メディア・娯楽
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A		—	125	228	3,449	食品・飲料・タバコ
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C		—	64	353	5,341	素材
YUNNAN TIN CO LTD-A		—	159	135	2,050	素材
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A		—	253	134	2,027	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A		—	33	294	4,448	資本財
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A		—	126	340	5,149	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG JIAHUA ENERGY CHE-A		—	136	121	1,834	素材
ZHEJIANG JUHUA CO-A		—	261	174	2,640	素材
ZHEJIANG NHU CO LTD-A		—	204	544	8,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A		—	262	584	8,831	資本財
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A		—	52	356	5,390	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A		—	208	137	2,075	自動車・自動車部品
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A		—	50	268	4,055	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A		—	264	266	4,031	各種金融
PICC HOLDING CO-A		—	810	519	7,850	保険
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A		—	100	1,134	17,146	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,654 238	217,964 463	289,672 —	4,379,850 <4.2%>	
(アラブ首長国連邦)				千アラブディルハム		
EMAAR PROPERTIES PJSC		5,277	6,208	1,502	44,051	不動産
ALDAR PROPERTIES PJSC		6,240	6,240	1,073	31,469	不動産
ABU DHABI COMMERCIAL BANK		4,115	5,004	2,011	58,981	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC		3,929	5,027	5,841	171,287	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK		2,278	2,837	947	27,786	銀行
EMAAR MALLS PJSC		2,567	4,274	482	14,160	不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO		2,593	3,188	4,687	137,446	電気通信サービス
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO		2,753	—	—	—	不動産
EMAAR DEVELOPMENT PJSC		1,138	—	—	—	不動産
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,894 9	32,780 7	16,547 —	485,184 <0.5%>	
(サウジアラビア)				千サウジアラビリアル		
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP		—	1,357	9,909	284,203	素材
AL RAJHI BANK		—	2,207	11,722	336,201	銀行
NATIONAL COMMERCIAL BANK		—	2,130	7,052	202,251	銀行
SAUDI TELECOM CO		—	705	6,325	181,406	電気通信サービス
RIYAD BANK		—	2,257	3,517	100,867	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP		—	1,813	3,703	106,207	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI		—	955	2,761	79,200	銀行
SAUDI ARABIAN MINING CO		—	761	2,577	73,931	素材

銘柄		株数	株数	当 期 末		業 種 等
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(サウジアラビア)		百株	百株	千サウジアラビリアル	千円	
SAUDI ELECTRICITY CO		—	1,500	2,340	67,139	公益事業
ALINMA BANK		—	1,738	2,506	71,886	銀行
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO		—	314	2,168	62,191	素材
ALMARAI CO		—	469	2,176	62,423	食品・飲料・タバコ
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL		—	437	2,023	58,029	素材
SAUDI BRITISH BANK		—	1,250	2,872	82,374	銀行
BANK ALBILAD		—	602	1,244	35,685	銀行
ETIHAD ETISALAT CO		—	625	1,603	45,987	電気通信サービス
JARIR MARKETING CO		—	96	1,246	35,757	小売
SAVOLA		—	435	1,630	46,752	食品・飲料・タバコ
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO		—	1,442	1,152	33,060	素材
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH		—	774	1,079	30,950	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV		—	1,170	797	22,864	不動産
BANK AL-JAZIRA		—	815	890	25,552	銀行
ADVANCED PETROCHEMICALS CO		—	235	1,050	30,134	素材
SAUDI IND INVESTMENT GROUP		—	329	592	16,999	素材
SAUDI CEMENT		—	112	477	13,699	素材
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C		—	489	455	13,053	素材
RABIGH REFINING AND PETROCHE		—	327	427	12,248	エネルギー
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE		—	91	603	17,319	保険
EMAAR ECONOMIC CITY		—	571	378	10,861	不動産
SAUDI AIRLINES CATERING CO		—	97	708	20,327	消費者サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE		—	41	412	11,816	保険
ARAB NATIONAL BANK		—	1,063	1,890	54,210	銀行
SAUDI ARABIAN OIL CO		—	2,132	6,588	188,967	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	—	29,352	84,887	2,434,568	
	銘柄 数 < 比 率 >	—	33	—	<2.3%>	
(カタール)				千カタールリアル		
MASRAF AL RAYAN		523	6,815	2,574	75,707	銀行
OOREDOO QPSC		128	1,287	803	23,618	電気通信サービス
QATAR NATIONAL BANK		662	8,114	13,868	407,859	銀行
INDUSTRIES QATAR		251	3,085	2,406	70,773	資本財
QATAR ELECTRICITY & WATER CO		69	886	1,315	38,700	公益事業
QATAR ISLAMIC BANK		181	2,004	3,006	88,428	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		249	3,346	948	27,883	不動産
COMMERCIAL BANK PSQC		271	3,352	1,303	38,322	銀行
QATAR INSURANCE CO		225	3,578	704	20,733	保険
EZDAN HOLDING GROUP		1,127	—	—	—	不動産
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI		—	7,751	1,550	45,593	素材
QATAR FUEL QSC		—	832	1,339	39,402	エネルギー
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC		—	1,440	1,158	34,067	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	3,692	42,495	30,979	911,092	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	12	—	<0.9%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
SAPPI LIMITED		782	—	—	—	素材
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD		84	96	8,966	52,272	素材
NEDBANK GROUP LTD		578	657	6,015	35,071	銀行
SASOL LTD		804	935	7,454	43,457	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		562	736	34,738	202,525	素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD		—	1,506	15,159	88,382	素材

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカランド	千円	
GOLD FIELDS LTD		1,207	1,462	21,593	125,891	素材
MONDI LTD		173	—	—	—	素材
NORTHAM PLATINUM LTD		—	568	4,600	26,819	素材
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		1,458	2,078	6,152	35,867	小売
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD		706	—	—	—	小売
TELKOM SA SOC LTD		412	412	748	4,363	電気通信サービス
TIGER BRANDS LTD		237	264	5,049	29,435	食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD		2,623	3,466	20,256	118,097	保険
SHOPRITE HOLDINGS LTD		656	847	9,440	55,036	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD		1,874	2,294	21,286	124,099	銀行
RMB HOLDINGS LTD		1,075	1,372	6,989	40,747	各種金融
REMGRO LTD		794	907	12,699	74,035	各種金融
NETCARE LTD		1,498	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS		636	795	243,607	1,420,233	小売
MTN GROUP LTD		2,470	3,139	15,688	91,464	電気通信サービス
KUMBA IRON ORE LTD		101	100	3,548	20,687	素材
INVESTEC LTD		390	453	1,542	8,995	各種金融
FIRSTRAND LTD		4,839	6,196	23,801	138,765	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD		317	385	2,652	15,464	小売
EXXARO RESOURCES LTD		378	530	5,581	32,540	エネルギー
BIDVEST GROUP LTD		467	519	7,555	44,050	資本財
ABSA GROUP LTD		1,032	1,329	10,805	62,996	銀行
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		548	753	9,695	56,526	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DISCOVERY LTD		512	634	6,109	35,619	保険
VODACOM GROUP LTD		940	1,157	14,781	86,174	電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD		557	557	3,317	19,339	食品・生活必需品小売り
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDIN		1,441	1,441	2,448	14,273	保険
SPAR GROUP LIMITED/THE		260	322	5,953	34,708	食品・生活必需品小売り
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL		1,026	1,393	3,420	19,942	保険
LIBERTY HOLDINGS LTD		174	221	1,429	8,335	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		1,788	2,306	3,975	23,179	ヘルスケア機器・サービス
MR PRICE GROUP LTD		383	413	5,422	31,615	小売
PSG GROUP LTD		210	333	5,080	29,620	各種金融
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		60	87	7,097	41,380	銀行
CLICKS GROUP LTD		348	456	10,568	61,612	食品・生活必需品小売り
BID CORP LTD		479	571	13,722	80,004	食品・生活必需品小売り
NEPI ROCKCASTLE PLC		537	824	6,833	39,841	不動産
REINET INVESTMENTS SCA		223	263	7,901	46,067	各種金融
OLD MUTUAL LTD		7,178	8,364	10,999	64,129	保険
MULTICHOICE GROUP LTD		603	814	7,001	40,818	メディア・娯楽
PEPKOR HOLDINGS LTD		—	1,236	1,322	7,710	小売
SIBANYE STILLWATER LTD		—	3,897	13,270	77,366	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	43,441	57,110	636,289	3,709,566	
	銘柄 数 < 比 率 >	44	44	—	<3.6%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	8,993,865	11,494,059	—	98,650,813	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,125	1,395	—	<94.8%>	

(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
		千口	千口	外貨建金額 千メキシコペソ	邦貨換算金額 千円	
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		481	621	11,783	52,670	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	481	621	11,783	52,670	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		444	537	7,126	41,547	0.0
REDEFINE PROPERTIES LTD		845	1,056	1,891	11,029	0.0
HYPROP INVESTMENTS LTD		39	—	—	—	—
RESILIENT REIT LTD		45	—	—	—	—
FORTRESS REIT LTD-A		180	180	1,780	10,379	0.0
FORTRESS REIT LTD-B		89	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	1,644	1,774	10,798	62,955	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	3	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	2,126	2,396	—	115,626	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	4	—	<0.1%>	

(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
外国		百万円	百万円
株式先物取引	MINI MS	5,652	—

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

○投資信託財産の構成

(2020年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 98,650,813	% 94.8
投資証券	115,626	0.1
コール・ローン等、その他	5,330,026	5.1
投資信託財産総額	104,096,465	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (104,007,741千円) の投資信託財産総額 (104,096,465千円) に対する比率は99.9%です。

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

1 アメリカドル=107.52円	1 メキシコペソ=4.47円	1 ブラジルリアル=18.47円	100チリペソ=13.05円
100コロンビアペソ=2.76円	1 ユーロ=116.02円	1 イギリスポンド=132.25円	1 トルコリラ=15.22円
1 チェココルナ=4.21円	100ハンガリーフォリント=33.09円	1 ポーランドズロチ=25.42円	1 香港ドル=13.87円
1 マレーシアリンギット=24.71円	1 タイバーツ=3.34円	1 フィリピンペソ=2.14円	100インドネシアルピア=0.73円
100韓国ウォン=8.77円	1 ニュー台湾ドル=3.60円	1 インドルピー=1.42円	1 オフショア元=15.12円
1 アラブディルハム=29.32円	1 サウジアラビアリヤル=28.68円	1 カタールリアル=29.41円	1 南アフリカランド=5.83円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	104,474,660,388
コール・ローン等	4,023,825,240
株式(評価額)	98,650,813,442
投資証券(評価額)	115,626,115
未収入金	568,682,282
未収配当金	108,208,938
差入委託証拠金	1,007,504,371
(B) 負債	403,044,802
未払金	378,470,105
未払解約金	24,574,645
未払利息	52
(C) 純資産総額(A－B)	104,071,615,586
元本	48,933,775,702
次期繰越損益金	55,137,839,884
(D) 受益権総口数	48,933,775,702口
1万口当たり基準価額(C／D)	21,268円

<注記事項>

- ①期首元本額 35,842,976,285円
期中追加設定元本額 21,858,278,344円
期中一部解約元本額 8,767,478,927円
また、1口当たり純資産額は、期末2.1268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 新興国株式インデックス	11,943,689,005円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	11,785,993,969円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	10,599,433,428円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	2,838,263,369円
つみたて新興国株式	2,074,351,967円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,667,943,368円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,547,679,831円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)	1,422,660,020円
つみたて8資産均等バランス	1,146,011,161円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	1,016,687,297円
eMAXIS 全世界株式インデックス	478,833,975円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	473,655,635円
新興国株式インデックスオープン	402,049,795円
三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	377,528,707円
新興国株式インデックス・オープン(ラップ向け)	262,117,982円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	243,705,734円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	141,074,462円
eMAXIS 最適化バランス(マイフワード)	112,087,381円
MAXIS 全世界株式(オール・カントリー) 上場投信	96,035,045円
MUKAM バランスファンド2020-04(適格機関投資家限定)	95,846,646円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	92,148,260円

○損益の状況 (2019年5月14日～2020年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,285,101,368
受取配当金	2,244,222,767
受取利息	40,139,337
その他収益金	932,964
支払利息	△ 193,700
(B) 有価証券売買損益	△14,112,477,764
売買益	8,589,288,515
売買損	△22,701,766,279
(C) 先物取引等取引損益	△ 568,522,478
取引益	1,249,972,014
取引損	△ 1,818,494,492
(D) 保管費用等	△ 105,351,610
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△12,501,250,484
(F) 前期繰越損益金	50,144,108,001
(G) 追加信託差損益金	29,580,008,504
(H) 解約差損益金	△12,085,026,137
(I) 計(E+F+G+H)	55,137,839,884
次期繰越損益金(I)	55,137,839,884

(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。

e M A X I S バランス（波乗り型）	72,187,258円
e M A X I S 最適化バランス（マイディフェンダー）	24,793,001円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	13,328,223円
e M A X I S マイマネージャー 1990s	2,462,875円
e M A X I S マイマネージャー 1980s	1,107,617円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	912,172円
e M A X I S マイマネージャー 1970s	795,873円
コアバランス	254,328円
つみたて全世界株式	137,318円
合計	48,933,775,702円

【お 知 ら せ】

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

(2019年7月1日)

三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド

《第20期》決算日2020年5月20日

[計算期間：2019年5月21日～2020年5月20日]

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

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

○最近5期の運用実績

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

●投資環境について

◎国内債券市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

(2019年５月21日～2020年５月20日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年５月21日～2020年５月20日)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

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

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月21日～2020年5月20日)

利害関係人との取引状況

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

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

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

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 2,200

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱ＵＦＪ銀行、三菱ＵＦＪ信託銀行、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券、三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ、三菱ＵＦＪリース、アコム、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2020年5月20日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

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

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

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

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第323回利付国債 (10年)	0.9	470,000	480,556	2022/ 6 /20
第324回利付国債 (10年)	0.8	980,000	999,962	2022/ 6 /20
第325回利付国債 (10年)	0.8	1,390,000	1,421,761	2022/ 9 /20
第326回利付国債 (10年)	0.7	100,000	102,257	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	880,000	902,149	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	1,770,000	1,808,745	2023/ 3 /20
第329回利付国債 (10年)	0.8	1,530,000	1,575,731	2023/ 6 /20
第330回利付国債 (10年)	0.8	1,450,000	1,496,661	2023/ 9 /20
第331回利付国債 (10年)	0.6	640,000	656,300	2023/ 9 /20
第332回利付国債 (10年)	0.6	1,680,000	1,725,696	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	700,000	720,223	2024/ 3 /20
第334回利付国債 (10年)	0.6	1,160,000	1,195,484	2024/ 6 /20
第335回利付国債 (10年)	0.5	1,520,000	1,562,408	2024/ 9 /20
第336回利付国債 (10年)	0.5	180,000	185,270	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	980,000	999,423	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	1,350,000	1,384,776	2025/ 3 /20
第339回利付国債 (10年)	0.4	2,160,000	2,218,557	2025/ 6 /20
第340回利付国債 (10年)	0.4	2,420,000	2,488,873	2025/ 9 /20
第341回利付国債 (10年)	0.3	1,450,000	1,485,061	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	2,130,000	2,158,137	2026/ 3 /20
第343回利付国債 (10年)	0.1	1,430,000	1,449,705	2026/ 6 /20
第344回利付国債 (10年)	0.1	1,810,000	1,835,991	2026/ 9 /20
第345回利付国債 (10年)	0.1	1,690,000	1,714,657	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	1,390,000	1,410,572	2027/ 3 /20
第347回利付国債 (10年)	0.1	2,770,000	2,812,519	2027/ 6 /20
第348回利付国債 (10年)	0.1	1,600,000	1,624,832	2027/ 9 /20
第349回利付国債 (10年)	0.1	1,140,000	1,157,863	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	1,860,000	1,888,606	2028/ 3 /20
第351回利付国債 (10年)	0.1	1,090,000	1,106,404	2028/ 6 /20
第352回利付国債 (10年)	0.1	2,680,000	2,719,315	2028/ 9 /20
第353回利付国債 (10年)	0.1	2,530,000	2,564,914	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	1,600,000	1,620,560	2029/ 3 /20
第355回利付国債 (10年)	0.1	1,650,000	1,670,295	2029/ 6 /20
第356回利付国債 (10年)	0.1	2,540,000	2,569,692	2029/ 9 /20
第357回利付国債 (10年)	0.1	1,500,000	1,515,825	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	1,190,000	1,201,697	2030/ 3 /20
第 1 回利付国債 (30年)	2.8	120,000	151,574	2029/ 9 /20
第 2 回利付国債 (30年)	2.4	170,000	209,895	2030/ 2 /20
第 3 回利付国債 (30年)	2.3	190,000	233,453	2030/ 5 /20
第 4 回利付国債 (30年)	2.9	125,000	162,555	2030/11/20
第 5 回利付国債 (30年)	2.2	180,000	222,325	2031/ 5 /20
第 6 回利付国債 (30年)	2.4	170,000	215,192	2031/11/20
第 7 回利付国債 (30年)	2.3	225,000	284,017	2032/ 5 /20
第 8 回利付国債 (30年)	1.8	160,000	193,358	2032/11/22
第 9 回利付国債 (30年)	1.4	90,000	104,345	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	263,000	295,377	2033/ 3 /20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第11回利付国債 (30年)		1.7	100,000	120,195	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	205,000	257,762	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	390,000	486,369	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	380,000	495,508	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	440,000	581,394	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	345,000	457,483	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	350,000	460,414	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	360,000	469,562	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	290,000	379,436	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	260,000	348,969	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	250,000	328,842	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	285,000	384,695	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)		2.5	140,000	189,579	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)		2.5	230,000	312,192	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	205,000	272,350	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	430,000	579,777	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	400,000	549,072	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	415,000	572,915	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	480,000	658,032	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	625,000	850,818	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	725,000	979,409	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	570,000	784,838	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)		2.0	623,000	825,973	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	765,000	1,048,929	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	790,000	1,056,103	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	790,000	1,060,804	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	820,000	1,087,787	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	605,000	792,132	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	560,000	746,967	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	450,000	591,394	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)		1.7	250,000	323,525	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	570,000	738,440	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)		1.7	560,000	727,098	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	620,000	805,882	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)		1.5	550,000	690,046	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	680,000	853,767	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)		1.6	650,000	832,546	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	600,000	740,574	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	770,000	950,911	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	770,000	839,153	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	480,000	464,275	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	570,000	578,749	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)		0.6	610,000	634,735	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	400,000	436,124	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)		0.8	700,000	762,825	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)		0.8	620,000	676,103	2047/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第57回利付国債 (30年)		0.8	580,000	632,136	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)		0.8	780,000	850,675	2048/ 3 /20
第59回利付国債 (30年)		0.7	310,000	330,143	2048/ 6 /20
第60回利付国債 (30年)		0.9	1,000,000	1,118,700	2048/ 9 /20
第61回利付国債 (30年)		0.7	660,000	703,566	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)		0.5	190,000	192,422	2049/ 3 /20
第63回利付国債 (30年)		0.4	380,000	374,148	2049/ 6 /20
第64回利付国債 (30年)		0.4	1,280,000	1,260,147	2049/ 9 /20
第66回利付国債 (30年)		0.4	380,000	374,018	2050/ 3 /20
第51回利付国債 (20年)		2.0	140,000	143,325	2021/ 6 /21
第52回利付国債 (20年)		2.1	260,000	267,943	2021/ 9 /21
第53回利付国債 (20年)		2.1	80,000	82,883	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)		2.2	530,000	549,943	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)		2.0	240,000	249,573	2022/ 3 /21
第56回利付国債 (20年)		2.0	370,000	386,816	2022/ 6 /20
第57回利付国債 (20年)		1.9	160,000	166,937	2022/ 6 /20
第58回利付国債 (20年)		1.9	350,000	367,020	2022/ 9 /20
第59回利付国債 (20年)		1.7	590,000	618,709	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)		1.4	230,000	239,400	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	260,000	268,650	2023/ 3 /20
第62回利付国債 (20年)		0.8	560,000	576,738	2023/ 6 /20
第63回利付国債 (20年)		1.8	275,000	291,739	2023/ 6 /20
第64回利付国債 (20年)		1.9	480,000	513,057	2023/ 9 /20
第65回利付国債 (20年)		1.9	430,000	461,759	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)		1.8	170,000	181,942	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)		1.9	80,000	86,300	2024/ 3 /20
第68回利付国債 (20年)		2.2	395,000	430,672	2024/ 3 /20
第69回利付国債 (20年)		2.1	120,000	130,375	2024/ 3 /20
第70回利付国債 (20年)		2.4	510,000	563,182	2024/ 6 /20
第71回利付国債 (20年)		2.2	200,000	219,214	2024/ 6 /20
第72回利付国債 (20年)		2.1	645,000	707,848	2024/ 9 /20
第73回利付国債 (20年)		2.0	200,000	219,642	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)		2.1	380,000	419,071	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	230,000	254,867	2025/ 3 /20
第76回利付国債 (20年)		1.9	210,000	230,664	2025/ 3 /20
第77回利付国債 (20年)		2.0	260,000	286,847	2025/ 3 /20
第79回利付国債 (20年)		2.0	100,000	110,868	2025/ 6 /20
第80回利付国債 (20年)		2.1	370,000	412,106	2025/ 6 /20
第82回利付国債 (20年)		2.1	620,000	694,077	2025/ 9 /20
第83回利付国債 (20年)		2.1	182,000	204,768	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	410,000	458,986	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)		2.1	230,000	260,054	2026/ 3 /20
第86回利付国債 (20年)		2.3	532,000	607,762	2026/ 3 /20
第87回利付国債 (20年)		2.2	170,000	193,211	2026/ 3 /20
第88回利付国債 (20年)		2.3	460,000	528,204	2026/ 6 /20
第89回利付国債 (20年)		2.2	130,000	148,478	2026/ 6 /20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第90回利付国債 (20年)		2.2	470,000	539,597	2026/ 9 /20
第91回利付国債 (20年)		2.3	80,000	92,356	2026/ 9 /20
第92回利付国債 (20年)		2.1	650,000	745,504	2026/12/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	260,000	299,540	2027/ 3 /20
第95回利付国債 (20年)		2.3	490,000	574,289	2027/ 6 /20
第96回利付国債 (20年)		2.1	120,000	138,928	2027/ 6 /20
第97回利付国債 (20年)		2.2	330,000	386,218	2027/ 9 /20
第98回利付国債 (20年)		2.1	340,000	395,409	2027/ 9 /20
第99回利付国債 (20年)		2.1	635,000	741,749	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	370,000	436,814	2028/ 3 /20
第101回利付国債 (20年)		2.4	350,000	418,722	2028/ 3 /20
第102回利付国債 (20年)		2.4	190,000	228,330	2028/ 6 /20
第103回利付国債 (20年)		2.3	320,000	381,952	2028/ 6 /20
第104回利付国債 (20年)		2.1	310,000	364,972	2028/ 6 /20
第105回利付国債 (20年)		2.1	350,000	413,668	2028/ 9 /20
第106回利付国債 (20年)		2.2	210,000	249,960	2028/ 9 /20
第107回利付国債 (20年)		2.1	240,000	284,604	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)		1.9	500,000	584,300	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)		1.9	60,000	70,314	2029/ 3 /20
第110回利付国債 (20年)		2.1	280,000	333,096	2029/ 3 /20
第111回利付国債 (20年)		2.2	450,000	541,386	2029/ 6 /20
第112回利付国債 (20年)		2.1	610,000	728,321	2029/ 6 /20
第113回利付国債 (20年)		2.1	360,000	431,571	2029/ 9 /20
第114回利付国債 (20年)		2.1	580,000	697,392	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)		2.2	290,000	351,477	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)		2.2	215,000	261,495	2030/ 3 /20
第117回利付国債 (20年)		2.1	510,000	615,279	2030/ 3 /20
第118回利付国債 (20年)		2.0	444,000	532,990	2030/ 6 /20
第119回利付国債 (20年)		1.8	240,000	283,267	2030/ 6 /20
第120回利付国債 (20年)		1.6	520,000	603,272	2030/ 6 /20
第121回利付国債 (20年)		1.9	690,000	823,777	2030/ 9 /20
第123回利付国債 (20年)		2.1	500,000	608,870	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)		2.0	340,000	410,444	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	810,000	998,122	2031/ 3 /20
第126回利付国債 (20年)		2.0	330,000	399,531	2031/ 3 /20
第127回利付国債 (20年)		1.9	90,000	107,992	2031/ 3 /20
第128回利付国債 (20年)		1.9	440,000	529,416	2031/ 6 /20
第130回利付国債 (20年)		1.8	580,000	693,221	2031/ 9 /20
第131回利付国債 (20年)		1.7	420,000	497,259	2031/ 9 /20
第133回利付国債 (20年)		1.8	1,030,000	1,234,032	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	890,000	1,068,765	2032/ 3 /20
第135回利付国債 (20年)		1.7	50,000	59,457	2032/ 3 /20
第136回利付国債 (20年)		1.6	60,000	70,646	2032/ 3 /20
第137回利付国債 (20年)		1.7	620,000	738,860	2032/ 6 /20
第138回利付国債 (20年)		1.5	130,000	151,816	2032/ 6 /20
第139回利付国債 (20年)		1.6	100,000	117,977	2032/ 6 /20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第140回利付国債 (20年)		1.7	480,000	573,220	2032/ 9 /20
第141回利付国債 (20年)		1.7	820,000	981,818	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)		1.8	480,000	580,680	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	1,380,000	1,638,060	2033/ 3 /20
第144回利付国債 (20年)		1.5	240,000	281,848	2033/ 3 /20
第145回利付国債 (20年)		1.7	1,320,000	1,586,574	2033/ 6 /20
第146回利付国債 (20年)		1.7	900,000	1,083,780	2033/ 9 /20
第147回利付国債 (20年)		1.6	720,000	858,974	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	760,000	897,795	2034/ 3 /20
第149回利付国債 (20年)		1.5	1,190,000	1,407,662	2034/ 6 /20
第150回利付国債 (20年)		1.4	1,210,000	1,416,268	2034/ 9 /20
第151回利付国債 (20年)		1.2	330,000	377,295	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	930,000	1,063,938	2035/ 3 /20
第153回利付国債 (20年)		1.3	1,240,000	1,438,635	2035/ 6 /20
第154回利付国債 (20年)		1.2	1,100,000	1,260,842	2035/ 9 /20
第155回利付国債 (20年)		1.0	810,000	904,510	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	960,000	982,675	2036/ 3 /20
第157回利付国債 (20年)		0.2	840,000	832,860	2036/ 6 /20
第158回利付国債 (20年)		0.5	750,000	778,200	2036/ 9 /20
第159回利付国債 (20年)		0.6	1,020,000	1,074,274	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	910,000	972,990	2037/ 3 /20
第161回利付国債 (20年)		0.6	820,000	862,771	2037/ 6 /20
第162回利付国債 (20年)		0.6	1,210,000	1,272,956	2037/ 9 /20
第163回利付国債 (20年)		0.6	880,000	925,636	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	1,010,000	1,044,178	2038/ 3 /20
第165回利付国債 (20年)		0.5	1,360,000	1,405,437	2038/ 6 /20
第166回利付国債 (20年)		0.7	480,000	512,918	2038/ 9 /20
第167回利付国債 (20年)		0.5	1,000,000	1,032,470	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	590,000	598,378	2039/ 3 /20
第169回利付国債 (20年)		0.3	770,000	766,535	2039/ 6 /20
第170回利付国債 (20年)		0.3	1,020,000	1,014,430	2039/ 9 /20
第171回利付国債 (20年)		0.3	370,000	367,957	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)		0.4	320,000	324,166	2040/ 3 /20
小	計		183,704,000	200,679,370	
地方債証券					
第 5 回東京都公募公債 (20年)		2.11	100,000	110,032	2025/ 3 /19
第 7 回東京都公募公債 (20年)		2.16	100,000	111,166	2025/ 9 /19
第 7 回東京都公募公債 (30年)		2.51	70,000	95,777	2038/ 9 /17
第10回東京都公募公債 (20年)		2.33	100,000	114,174	2026/ 9 /18
第10回東京都公募公債 (30年)		2.31	100,000	135,207	2039/ 9 /20
第700回東京都公募公債		1.02	100,000	101,315	2021/ 9 /17
第710回東京都公募公債		0.81	100,000	101,625	2022/ 6 /20
第719回東京都公募公債		0.86	200,000	204,726	2023/ 3 /20
第730回東京都公募公債		0.664	100,000	102,425	2024/ 3 /19
第 3 回東京都公募公債 (20年)		2.26	100,000	108,531	2024/ 3 /19
平成24年度第 9 回北海道公募公債		0.79	50,000	50,911	2022/10/31

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成26年度第13回北海道公募公債		0.461	100,000	101,887	2024/12/26
平成29年度第13回北海道公募公債		0.21	108,000	108,773	2027/12/28
第2回神奈川県公募公債（30年）		2.87	100,000	138,890	2036/6/20
第4回神奈川県公募公債（30年）		2.62	100,000	137,738	2038/3/19
第227回神奈川県公募公債		0.18	100,000	100,633	2027/6/18
第5回大阪府公募公債（20年）		2.16	100,000	119,609	2030/5/28
第348回大阪府公募公債		1.32	50,000	50,550	2021/3/30
第358回大阪府公募公債		0.97	70,000	71,155	2022/2/28
第419回大阪府公募公債		0.196	200,000	201,392	2027/4/27
第423回大阪府公募公債		0.185	130,000	130,750	2027/8/30
第435回大阪府公募公債		0.2	130,000	130,851	2028/8/30
第451回大阪府公募公債		0.063	140,000	138,793	2029/12/26
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）		2.19	100,000	119,058	2029/9/20
平成23年度第2回京都府公募公債		1.2	66,000	66,841	2021/6/22
平成26年度第5回京都府公募公債（20年）		1.455	100,000	115,602	2034/8/10
平成29年度第4回京都府公募公債		0.19	100,000	100,704	2027/6/21
第2回兵庫県公募公債（30年）		2.36	50,000	68,351	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債（12年）		0.73	200,000	207,844	2026/8/6
平成23年度第11回兵庫県公募公債		0.95	50,000	50,767	2022/1/27
第27回兵庫県公募公債（20年）		0.387	200,000	200,064	2036/5/12
平成28年度第3回兵庫県公募公債		0.08	100,000	99,910	2026/5/22
平成29年度第1回兵庫県公募公債		0.187	200,000	201,278	2027/5/21
第3回静岡県公募公債（15年）		1.368	100,000	109,449	2027/10/29
平成25年度第7回静岡県公募公債		0.801	100,000	102,572	2023/9/20
平成25年度第8回静岡県公募公債		0.699	29,800	30,483	2023/10/24
平成20年度第8回愛知県公募公債（20年）		2.04	200,000	232,932	2028/12/20
平成23年度第11回愛知県公募公債		1.03	70,000	71,007	2021/10/28
平成23年度第13回愛知県公募公債		1.529	200,000	218,696	2026/11/13
平成23年度第20回愛知県公募公債		1.082	100,000	101,952	2022/3/29
平成24年度第8回愛知県公募公債		0.835	200,000	203,680	2022/8/29
平成28年度第13回愛知県公募公債		0.13	100,000	100,324	2026/11/30
平成26年度第7回広島県公募公債		0.46	260,000	265,408	2025/3/25
平成27年度第5回広島県公募公債		0.41	200,000	203,966	2026/1/26
平成30年度第4回広島県公募公債		0.259	200,000	202,596	2028/11/22
第8回埼玉県公募公債（20年）		2.19	100,000	119,058	2029/9/20
第10回埼玉県公募公債（20年）		1.94	100,000	118,107	2030/11/12
第14回埼玉県公募公債（20年）		1.546	200,000	233,428	2034/5/8
平成22年度第11回埼玉県公募公債		1.28	40,000	40,384	2021/2/25
平成23年度第6回埼玉県公募公債		1.02	100,000	101,422	2021/10/27
平成22年度第10回福岡県公募公債		1.36	50,000	50,511	2021/2/25
平成24年度第6回福岡県公募公債		0.8	100,000	101,884	2022/10/25
平成22年度第12回千葉県公募公債		1.28	80,000	80,769	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債		1.33	80,000	80,880	2021/3/25
平成23年度第5回千葉県公募公債		1.06	80,000	81,248	2021/11/25
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	80,000	81,431	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	80,000	81,574	2022/4/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成27年度第3回千葉県公募公債		0.524	200,000	204,716	2025/6/25
平成28年度第1回岐阜県公募公債		0.06	100,000	99,871	2026/10/30
第96回共同発行市場公募地方債		1.29	20,000	20,213	2021/3/25
第104回共同発行市場公募地方債		1.03	600,000	609,096	2021/11/25
第108回共同発行市場公募地方債		1.01	70,000	71,264	2022/3/25
第116回共同発行市場公募地方債		0.8	300,000	305,850	2022/11/25
第125回共同発行市場公募地方債		0.82	100,000	102,583	2023/8/25
第130回共同発行市場公募地方債		0.76	100,000	102,687	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	102,420	2024/3/25
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	200,000	205,174	2024/4/25
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	200,000	204,286	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債		0.345	200,000	202,944	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債		0.47	200,000	204,258	2025/3/25
平成22年度第10回大阪市公募公債		1.31	20,000	20,211	2021/3/17
平成26年度第7回大阪市公募公債		0.535	100,000	102,282	2024/11/28
第1回名古屋市長公募公債（20年）		1.99	100,000	107,021	2023/12/20
第9回名古屋市長公募公債（20年）		2.07	100,000	116,721	2028/12/20
第9回名古屋市長公募公債（30年）		2.095	90,000	120,292	2042/9/19
第3回京都市公募公債（20年）		2.09	100,000	111,296	2025/12/19
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）		2.54	110,000	126,377	2026/6/19
平成23年度第5回神戸市公募公債		1.025	100,000	101,408	2021/10/19
第5回横浜市公募公債（20年）		2.17	100,000	110,696	2025/6/20
第7回横浜市公募公債（20年）		2.06	250,000	277,822	2025/12/19
第11回横浜市公募公債（20年）		2.2	200,000	227,756	2026/12/18
第27回横浜市公募公債（20年）		1.599	40,000	46,675	2033/5/20
第35回横浜市公募公債（20年）		0.443	200,000	201,640	2036/10/28
第7回川崎市公募公債（20年）		2.08	100,000	117,756	2029/7/17
平成23年度第6回福岡市公募公債		1.0	50,000	50,698	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債		0.8	70,000	71,327	2022/10/31
平成22年度第6回広島市公募公債		1.21	50,000	50,607	2021/5/31
平成23年度第1回三重県公募公債		1.021	162,550	165,012	2021/11/30
平成28年度第1回岡山県公募公債		0.18	140,000	140,931	2027/1/29
小	計		10,936,350	11,612,991	
特殊債券(除く金融債)					
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.2	100,000	134,668	2040/5/31
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	100,000	126,752	2040/8/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	100,000	118,343	2030/9/30
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	14,000	14,194	2021/6/30
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	200,000	202,748	2021/7/30
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	100,000	131,398	2042/2/28
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	100,000	101,881	2022/6/30
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.791	100,000	101,937	2022/10/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.815	30,000	30,679	2023/2/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.605	340,000	346,232	2023/5/31
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	208,000	213,162	2023/12/28
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	100,000	102,468	2024/3/29

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.669	100,000	102,619	2024/4/30
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	102,624	2024/6/28
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.495	100,000	102,219	2024/11/29
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.466	100,000	102,123	2024/12/27
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.45	200,000	204,328	2025/3/31
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.509	133,000	136,265	2025/5/30
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.484	101,000	103,392	2025/6/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	100,000	101,707	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.145	100,000	100,721	2026/2/27
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.12	108,000	108,683	2028/4/28
第12回政府保証日本政策投資銀行債券		2.1	100,000	102,380	2021/6/28
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)		0.576	110,000	110,928	2021/9/24
第21回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.2	11,000	11,101	2021/2/15
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	20,000	20,218	2021/3/12
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.0	124,500	126,347	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	200,000	203,610	2021/12/14
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.9	35,000	35,604	2022/3/14
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.819	100,000	101,912	2022/9/16
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.734	200,000	203,780	2022/12/16
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	38,000	38,850	2023/2/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.541	100,000	101,580	2023/4/21
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.835	100,000	102,694	2023/8/14
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	305,000	312,512	2023/12/18
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.645	100,000	102,444	2024/3/15
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	500,000	500,000	2026/3/13
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.02	102,000	102,000	2026/4/17
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.16	125,000	126,070	2027/7/16
第16回政府保証民間都市開発債券		0.699	90,000	92,136	2023/10/20
第211回政府保証預金保険機構債券		0.1	100,000	100,212	2021/10/19
第4回政府保証新関西国際空港債券		0.484	104,000	106,441	2025/6/13
第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債		0.001	200,000	200,202	2022/5/20
第19回政府保証日本政策投資銀行		0.668	100,000	101,883	2023/3/15
第13回政府保証中部国際空港債券		1.3	72,000	72,796	2021/3/15
第6回神奈川県住宅供給公社債券		0.215	100,000	99,347	2029/4/23
第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)		2.23	30,000	34,431	2027/5/28
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.99	100,000	156,156	2045/9/20
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.45	140,000	159,254	2026/3/19
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.75	100,000	153,007	2047/3/20
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.28	350,000	402,143	2027/4/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.67	110,000	166,426	2047/3/20
第28回道路債券(財投機関債)		2.83	100,000	133,294	2033/12/20
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.773	100,000	118,356	2032/9/17
第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		0.94	100,000	102,836	2023/6/20
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.133	200,000	222,264	2035/3/20
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	100,000	102,879	2023/3/22
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)		2.95	100,000	135,319	2034/3/24

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.22	100,000	119,726	2030/1/28
第7回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.2	100,000	108,340	2024/3/22
第8回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.25	100,000	108,532	2024/3/22
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.132	100,000	120,542	2031/1/28
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.29	100,000	117,049	2028/4/25
第27回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.034	100,000	101,301	2021/8/27
第44回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.791	200,000	204,174	2023/1/27
第47回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.576	200,000	203,266	2023/4/28
第104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.255	200,000	202,058	2028/1/28
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	70,000	80,315	2031/7/30
F151回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.348	100,000	109,083	2027/11/5
F197回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.052	100,000	106,955	2027/10/29
F203回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.063	100,000	107,266	2028/2/28
F438回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.123	200,000	200,500	2026/3/27
第1回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.1	100,000	104,335	2022/6/20
第29回福祉医療機構債券(財投機関債)		1.145	100,000	101,799	2021/12/20
第4回中部国際空港(財投機関債)		0.305	200,000	202,074	2027/2/22
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	25,890	26,694	2042/5/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	28,654	29,976	2042/6/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.82	22,730	23,140	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	35,592	36,258	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	12,279	12,658	2037/5/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	36,981	38,109	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	14,532	15,122	2042/12/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券		0.92	10,482	10,532	2038/6/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	15,251	15,961	2043/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	29,346	29,916	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.71	29,466	30,052	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.57	14,834	15,117	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	11,566	11,776	2039/6/10
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.95	27,450	29,553	2044/10/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	12,893	13,227	2040/6/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	28,216	30,306	2044/12/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	14,048	14,488	2040/7/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	57,400	60,884	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.71	57,902	61,281	2045/6/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	26,480	27,398	2041/2/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	32,933	34,512	2045/9/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	26,088	27,262	2041/5/10
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.3	26,282	27,370	2041/7/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	111,690	119,372	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	62,852	66,926	2046/2/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	59,490	63,333	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	29,589	31,417	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	30,400	32,205	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	32,824	34,786	2046/8/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.18	29,290	30,857	2042/3/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	35,499	37,534	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	37,087	39,216	2046/10/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	41,066	43,481	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	42,090	44,568	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	43,829	46,254	2047/5/10
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.26	84,906	89,286	2047/6/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	142,215	148,870	2047/11/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	50,368	52,572	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	98,886	103,069	2049/5/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.863	100,000	118,559	2031/11/18
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	112,790	116,832	2049/11/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	69,531	71,596	2050/5/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	200,000	238,660	2032/4/16
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	245,856	247,707	2051/6/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	171,806	174,245	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	172,020	174,588	2052/3/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	87,888	89,032	2052/7/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	89,957	90,848	2052/12/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	90,492	91,760	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	90,657	91,705	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	91,139	92,048	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	91,017	91,926	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	182,946	185,035	2053/6/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	93,640	95,023	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	94,239	95,836	2053/11/10
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	97,098	96,533	2054/8/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	97,948	97,327	2054/11/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	98,861	99,172	2055/1/10
第161回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.713	100,000	104,235	2027/6/18
第194回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.075	100,000	99,808	2026/10/20
第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		0.24	100,000	100,881	2027/3/19
第17回東京都住宅供給公社債券		1.17	100,000	101,406	2021/9/17
第18回韓国輸出入銀行		0.27	100,000	99,814	2021/6/28
小	計		13,677,761	14,517,823	
金融債券					
い第804号商工債券		0.06	300,000	299,817	2022/5/27
第321回信金中金債		0.03	200,000	199,948	2021/8/27
第333回信金中金債		0.09	100,000	100,076	2022/8/26
第337回信金中金債		0.11	100,000	100,143	2022/12/27
第338回信金中金債		0.11	200,000	200,294	2023/1/27
第341回信金中金債		0.11	100,000	100,161	2023/4/27
第230号商工債券(3年)		0.09	200,000	200,034	2022/3/25
第239号商工債券(3年)		0.02	200,000	199,662	2022/12/27
小	計		1,400,000	1,400,135	

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

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第1回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ		0.94	100,000	101,033	2024/6/26
第17回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ		0.535	100,000	98,218	2028/5/31
第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）		1.62	100,000	101,924	2021/10/29
第88回三菱東京ＵＦＪ銀行		2.34	100,000	114,446	2027/4/20
第12回住友信託銀行（劣後特約付）		1.373	100,000	100,525	2020/11/11
第15回住友信託銀行（劣後特約付）		1.62	100,000	102,429	2022/3/22
第23回三井住友銀行（劣後特約付）		1.61	100,000	100,795	2020/12/17
第18回みずほ銀行（劣後特約付）		2.14	100,000	108,698	2026/9/11
第20回東京センチュリーリース		0.19	100,000	99,780	2022/10/18
第53回ホンダファイナンス		0.05	200,000	199,630	2021/12/20
第77回トヨタファイナンス		0.145	100,000	99,503	2024/7/25
第30回リコーリース		0.16	100,000	99,914	2022/1/21
第35回リコーリース		0.04	100,000	99,634	2022/7/12
第37回リコーリース		0.02	100,000	99,484	2022/10/11
第7回イオンフィナンシャルサービス		0.19	100,000	99,350	2023/3/20
第79回アコム		0.29	100,000	98,122	2025/2/28
第70回日立キャピタル		0.2	100,000	99,841	2022/12/20
第82回日立キャピタル		0.09	200,000	198,896	2023/2/20
第194回オリックス		0.19	200,000	199,266	2023/11/8
第21回三井住友ファイナンス&リース		0.18	100,000	99,698	2023/11/27
第63回三菱ＵＦＪリース		0.19	100,000	99,825	2023/10/18
第66回三菱ＵＦＪリース		0.21	300,000	299,292	2024/4/11
第75回三菱ＵＦＪリース		0.22	100,000	99,580	2025/1/23
第24回野村ホールディングス		2.329	100,000	109,437	2025/6/24
第76回三井不動産		0.21	100,000	100,038	2023/4/28
第72回三菱地所		2.28	100,000	108,611	2024/9/20
第125回三菱地所		0.19	100,000	99,425	2025/3/14
第36回京王電鉄		0.325	100,000	99,815	2027/9/17
第32回東日本旅客鉄道		2.26	100,000	108,179	2024/3/19
第34回東日本旅客鉄道		2.53	100,000	109,819	2024/6/20
第100回東日本旅客鉄道		1.981	100,000	128,117	2044/1/29
第9回西日本旅客鉄道		2.28	100,000	104,084	2022/3/25
第6回東海旅客鉄道		2.39	21,000	21,851	2022/2/15
第42回東海旅客鉄道		2.312	100,000	117,547	2029/4/24
第53回東海旅客鉄道		1.797	100,000	114,737	2030/10/25
第50回阪急阪神ホールディングス		0.345	100,000	99,794	2028/9/13
第16回三菱倉庫		0.21	100,000	99,457	2024/12/6
第63回日本電信電話		0.69	200,000	202,788	2023/3/20
第21回ＫＤＤＩ		0.669	100,000	101,488	2024/9/20
第1回ソフトバンク		0.13	200,000	199,708	2023/3/17
第20回エス・ティ・ティ・ドコモ		0.73	100,000	101,582	2023/9/20
第8回電源開発		2.11	100,000	108,355	2024/12/20
第38回電源開発		0.978	100,000	102,801	2023/12/20
第50回電源開発		0.415	200,000	199,848	2027/7/20
第4回東京電力パワーグリッド		0.69	200,000	202,484	2024/6/20
第12回東京電力パワーグリッド		0.44	100,000	100,442	2023/4/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第15回東京電力パワーグリッド		0.89	100,000	98,168	2030/7/24
第28回東京電力パワーグリッド		1.01	100,000	100,333	2029/7/10
第30回東京電力パワーグリッド		0.58	100,000	100,685	2024/10/9
第31回東京電力パワーグリッド		0.98	100,000	99,955	2029/10/9
第23回東京ガス		1.01	100,000	102,818	2023/6/9
第13回広島ガス		0.405	100,000	99,995	2028/9/13
第6回ＳＣＳＫ		0.14	100,000	99,706	2022/7/21
第4回ファーストリテイリング		0.749	100,000	102,234	2025/12/18
第14回フランス相互信用連合銀行		0.563	100,000	99,903	2021/10/15
第26回フランス相互信用連合銀行		0.443	100,000	99,427	2023/10/12
第29回フランス相互信用連合銀行		0.25	100,000	98,187	2024/10/10
第8回新韓銀行		0.52	300,000	300,027	2022/11/2
第1回韓国石油公社債		0.24	100,000	99,437	2022/1/21
小	計		12,771,000	12,912,480	
合	計		222,489,111	241,122,801	

先物取引の銘柄別期末残高

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

○投資信託財産の構成 (2020年5月20日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月20日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2019年5月21日～2020年5月20日)

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

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

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

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

三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

《第20期》決算日2020年5月20日

[計算期間：2019年5月21日～2020年5月20日]

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

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

○最近5期の運用実績

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

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

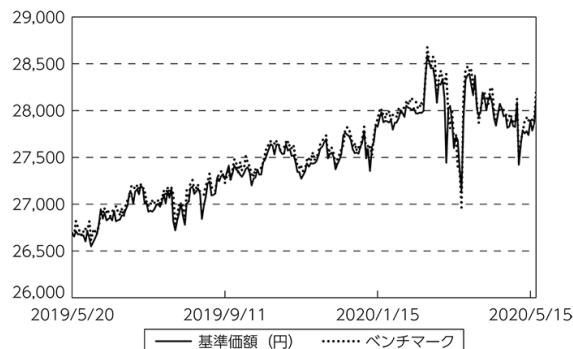
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ5.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因
(上昇要因)

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

●投資環境について

◎外国債券市況

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

◎為替市況

- ・米ドル、ユーロは対円で下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

主なマイナス要因：評価時価差異要因※によるものです。

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

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月21日～2020年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 7	% 0.025	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(7)	(0.025)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	7	0.025	
期中の平均基準価額は、27,486円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年5月21日～2020年5月20日)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月21日～2020年5月20日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2020年5月20日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

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

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	0.5 T-NOTE 230315	0.5	1,900	1,915	206,804	2023/ 3 /15
		1.125 T-NOTE 210930	1.125	1,100	1,114	120,336	2021/ 9 /30
		1.25 T-NOTE 211031	1.25	800	812	87,733	2021/10/31
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	1,700	1,755	189,546	2023/ 7 /31
		1.375 T-NOTE 221015	1.375	3,000	3,084	333,114	2022/10/15
		1.375 T-NOTE 230831	1.375	500	518	56,001	2023/ 8 /31
		1.375 T-NOTE 230930	1.375	950	986	106,515	2023/ 9 /30
		1.375 T-NOTE 250131	1.375	2,340	2,452	264,852	2025/ 1 /31
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	200	204	22,076	2022/ 1 /31
		1.5 T-NOTE 230331	1.5	1,700	1,762	190,349	2023/ 3 /31
		1.5 T-NOTE 241130	1.5	800	842	90,959	2024/11/30
		1.5 T-NOTE 260815	1.5	2,400	2,548	275,146	2026/ 8 /15
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	2,050	2,116	228,492	2022/ 8 /15
		1.625 T-NOTE 220831	1.625	1,500	1,548	167,259	2022/ 8 /31
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,050	2,134	230,524	2023/ 4 /30
		1.625 T-NOTE 230531	1.625	600	625	67,531	2023/ 5 /31
		1.625 T-NOTE 231031	1.625	1,050	1,099	118,746	2023/10/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	2,400	2,560	276,442	2026/ 2 /15
		1.625 T-NOTE 260515	1.625	2,400	2,563	276,826	2026/ 5 /15
		1.625 T-NOTE 260930	1.625	1,430	1,530	165,280	2026/ 9 /30
		1.625 T-NOTE 261130	1.625	1,210	1,296	139,995	2026/11/30
		1.625 T-NOTE 290815	1.625	2,820	3,061	330,529	2029/ 8 /15
		1.75 T-NOTE 211130	1.75	1,550	1,587	171,383	2021/11/30
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,100	2,158	233,100	2022/ 2 /28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	3,150	3,242	350,128	2022/ 3 /31
		1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,900	1,958	211,429	2022/ 4 /30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,250	2,319	250,490	2022/ 5 /15
		1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,600	1,650	178,247	2022/ 5 /31
		1.75 T-NOTE 230131	1.75	1,550	1,614	174,312	2023/ 1 /31
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,200	1,254	135,467	2023/ 5 /15
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	750	769	83,095	2021/11/30
		1.875 T-NOTE 220331	1.875	1,700	1,753	189,331	2022/ 3 /31
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	3,650	3,775	407,644	2022/ 5 /31
		1.875 T-NOTE 220731	1.875	2,350	2,437	263,149	2022/ 7 /31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	750	778	84,110	2022/ 8 /31
		1.875 T-NOTE 220930	1.875	950	987	106,628	2022/ 9 /30
		2 T-NOTE 210531	2.0	450	458	49,509	2021/ 5 /31
		2 T-NOTE 210831	2.0	1,100	1,125	121,557	2021/ 8 /31
		2 T-NOTE 211031	2.0	1,100	1,128	121,905	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	1,500	1,540	166,392	2021/11/15
2 T-NOTE 211231	2.0	450	463	50,010	2021/12/31		
2 T-NOTE 220215	2.0	1,200	1,237	133,630	2022/ 2 /15		
2 T-NOTE 230215	2.0	1,900	1,992	215,179	2023/ 2 /15		
2 T-NOTE 240531	2.0	1,950	2,083	224,987	2024/ 5 /31		

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

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

銘 柄			当 期 末					
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
	国債証券	5.25 T-BOND 281115	5.25	400	553	59,790	2028/11/15	
		5.25 T-BOND 290215	5.25	800	1,115	120,438	2029/2/15	
		5.5 T-BOND 280815	5.5	220	306	33,120	2028/8/15	
		6 T-BOND 260215	6.0	850	1,119	120,845	2026/2/15	
		6.125 T-BOND 271115	6.125	400	564	60,951	2027/11/15	
		6.25 T-BOND 230815	6.25	1,100	1,314	141,976	2023/8/15	
		8 T-BOND 211115	8.0	500	558	60,310	2021/11/15	
小 計						21,509,212		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	300	301	23,371	2022/3/1	
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	600	603	46,851	2021/9/1	
		1 CAN GOVT 220901	1.0	950	965	74,902	2022/9/1	
		1 CAN GOVT 270601	1.0	300	310	24,083	2027/6/1	
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	850	881	68,396	2023/6/1	
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	200	212	16,493	2026/6/1	
		2 CAN GOVT 280601	2.0	350	390	30,302	2028/6/1	
		2 CAN GOVT 511201	2.0	230	282	21,914	2051/12/1	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	750	818	63,514	2025/6/1	
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	160	184	14,280	2029/6/1	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,150	1,248	96,852	2024/6/1	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	250	262	20,369	2022/6/1	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	350	485	37,641	2048/12/1	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	160	249	19,325	2064/12/1	
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	750	773	60,012	2021/6/1	
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	360	545	42,303	2045/12/1	
		4 CAN GOVT 410601	4.0	320	495	38,433	2041/6/1	
		5 CAN GOVT 370601	5.0	320	523	40,615	2037/6/1	
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	270	394	30,581	2029/6/1	
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	510	825	64,053	2033/6/1	
			8 CAN GOVT 270601	8.0	150	227	17,688	2027/6/1
小 計						851,988		
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ			
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	7,650	9,107	41,622	2024/12/5	
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	1,400	1,871	8,553	2036/11/20	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	6,200	6,271	28,660	2026/3/5	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	7,000	7,103	32,462	2021/6/10	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	5,600	5,755	26,304	2022/6/9	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	2,500	2,607	11,916	2023/3/9	
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	3,450	3,561	16,274	2021/12/9	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	5,100	5,605	25,619	2027/6/3	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	4,100	4,578	20,921	2031/5/29	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	1,700	1,902	8,694	2034/11/23	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	5,650	6,100	27,879	2042/11/13	
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	6,700	7,321	33,458	2023/12/7	
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	1,800	1,999	9,139	2047/11/7	

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

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

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

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

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

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

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

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ポーランド			%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
	国債証券	2.75 POLAND 280425	2.75	700	776	20,137	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	600	675	17,533	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	990	1,103	28,624	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	1,600	1,779	46,161	2023/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	500	537	13,945	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	800	896	23,255	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	500	687	17,827	2029/4/25
小 計						255,579	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	550	559	39,611	2032/5/21
		2 AUST GOVT 211221	2.0	350	359	25,442	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 221121	2.25	150	157	11,142	2022/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	700	777	55,025	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	540	618	43,727	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,100	1,204	85,218	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	540	618	43,780	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	650	750	53,063	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	550	640	45,292	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	200	239	16,944	2035/6/21
		2.75 AUST GOVT 410521	2.75	180	214	15,193	2041/5/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	290	367	25,996	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	650	780	55,228	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	210	267	18,951	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	280	377	26,680	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,160	1,411	99,855	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	610	857	60,682	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	600	765	54,177	2027/4/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	650	749	52,997	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	750	790	55,923	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	750	838	59,301	2022/7/15	
小 計						944,239	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	2.125 SINGAPORG0V 260601	2.125	120	131	10,038	2026/6/1
		2.25 SINGAPORG0VT 210601	2.25	220	224	17,137	2021/6/1
		2.25 SINGAPORG0VT 360801	2.25	150	176	13,429	2036/8/1
		2.75 SINGAPORG0VT 230701	2.75	350	376	28,724	2023/7/1
		2.75 SINGAPORG0VT 420401	2.75	200	263	20,086	2042/4/1
		2.75 SINGAPORG0VT 460301	2.75	150	203	15,499	2046/3/1
		2.875 SINGAPORG0V 290701	2.875	200	238	18,165	2029/7/1
		2.875SINGAPORG0VT 300901	2.875	120	144	11,027	2030/9/1
		3 SINGAPORG0VT 240901	3.0	250	277	21,197	2024/9/1
		3.125SINGAPORG0VT 220901	3.125	230	245	18,695	2022/9/1
		3.375 SINGAPORG0V 330901	3.375	120	156	11,944	2033/9/1
		3.5 SINGAPORG0VT 270301	3.5	200	238	18,210	2027/3/1
小 計						204,158	

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

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

○投資信託財産の構成

(2020年5月20日現在)

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

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

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

1 アメリカドル=107.98円	1 カナダドル=77.58円	1 メキシコペソ=4.57円	1 ユーロ=118.10円
1 イギリスポンド=132.43円	1 スウェーデンクローネ=11.15円	1 ノルウェークローネ=10.83円	1 デンマーククローネ=15.84円
1 ポーランドズロチ=25.94円	1 オーストラリアドル=70.75円	1 シンガポールドル=76.26円	1 マレーシアリングット=24.81円
1 イスラエルシェケル=30.73円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月20日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2019年5月21日～2020年5月20日)

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

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

新興国債券インデックスマザーファンド

《第10期》決算日2020年1月27日

[計算期間：2019年1月29日～2020年1月27日]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月27日に第10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10期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主として対象インデックス（ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建の公社債に投資を行い、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。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。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	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	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		ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭ グローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	円	期 騰 落 中 率 %	期 騰 落 中 率 %	期 騰 落 中 率 %			
6期(2016年1月26日)	11,515	△18.9	26,826.64	△18.3	95.9	—	百万円 9,861
7期(2017年1月26日)	12,647	9.8	29,442.31	9.8	96.1	—	12,443
8期(2018年1月26日)	14,464	14.4	34,033.56	15.6	96.7	—	16,676
9期(2019年1月28日)	13,254	△8.4	31,268.09	△8.1	96.7	—	20,421
10期(2020年1月27日)	14,424	8.8	34,193.00	9.4	97.4	—	30,520

(注) ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイドとは、Ｊ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はＪ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、Ｊ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー バ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019年1月28日	円 13,254	% —	31,268.09	% —	% 96.7	% —
1月末	13,299	0.3	31,235.67	△0.1	96.5	—
2月末	13,591	2.5	32,082.90	2.6	96.4	—
3月末	13,363	0.8	31,500.96	0.7	95.5	—
4月末	13,413	1.2	31,730.84	1.5	95.9	—
5月末	13,078	△1.3	31,075.08	△0.6	96.4	—
6月末	13,669	3.1	32,298.63	3.3	95.5	—
7月末	13,911	5.0	32,890.36	5.2	97.0	—
8月末	13,249	△0.0	31,345.95	0.2	97.5	—
9月末	13,609	2.7	32,274.60	3.2	97.3	—
10月末	14,133	6.6	33,390.89	6.8	97.1	—
11月末	13,930	5.1	32,946.41	5.4	97.0	—
12月末	14,468	9.2	34,229.09	9.5	96.7	—
(期 末) 2020年1月27日	14,424	8.8	34,193.00	9.4	97.4	—

(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

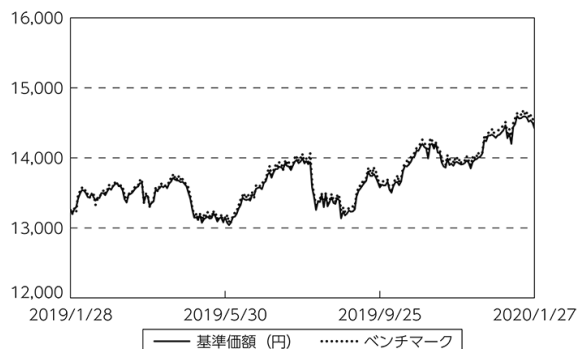
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ8.8%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
(9.4%)を0.6%下回りました。

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因
(上昇要因)

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

●投資環境について

◎債券市況

新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首に比べて上昇しました。

◎為替市況

世界景気の減速懸念が高まったことなどから、多くの新興国通貨は対円で売られました。特にデフォルト懸念が再燃したアルゼンチンペソなどが対円で大きく下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（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9.4%の上昇になったため、カイ離は△0.6%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ありません。

(主なマイナス要因)

- ・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

(2019 年 1 月 29 日～2020 年 1 月 27 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 13	% 0.095	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(12)	(0.090)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(1)	(0.005)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	13	0.095	
期中の平均基準価額は、13,689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。

公社債

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2019年 1 月29日～2020年 1 月27日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	14,430	3,894	27.0	6,509	1,538	23.6

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

(2020年1月27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
	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	%	%	%	%	%
メキシコ	493,200	524,481	3,036,748	9.9	—	5.1	3.6	1.2
	千ブラジルレアル	千ブラジルレアル						
ブラジル	110,170	112,940	2,944,361	9.6	9.6	2.3	5.2	2.2
	千チリペソ	千チリペソ						
チリ	4,960,000	5,784,730	811,019	2.7	—	2.2	—	0.4
	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
コロンビア	51,580,000	56,093,000	1,817,413	6.0	—	4.0	1.9	0.1
	千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル						
ペルー	27,000	31,946	1,047,844	3.4	—	3.3	0.2	—
	千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ						
ウルグアイ	15,200	14,368	42,099	0.1	—	0.1	0.1	—
	千ドミニカペソ	千ドミニカペソ						
ドミニカ	24,000	24,521	50,268	0.2	0.2	0.1	0.1	—
	千トルコリラ	千トルコリラ						
トルコ	62,500	63,367	1,162,157	3.8	3.8	1.4	1.8	0.6
	千チェココルナ	千チェココルナ						
チェコ	224,700	231,069	1,104,510	3.6	—	2.3	1.1	0.2
	千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント						
ハンガリー	2,667,000	3,063,090	1,095,361	3.6	—	2.0	1.6	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	90,100	93,290	2,637,316	8.6	—	3.3	3.9	1.5
	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル						
ロシア	1,397,900	1,510,464	2,643,313	8.7	—	4.5	3.2	1.0
	千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ						
ルーマニア	29,660	30,646	771,059	2.5	—	1.0	1.1	0.4
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	66,220	69,614	1,870,544	6.1	—	3.6	1.8	0.8
	千タイバーツ	千タイバーツ						
タイ	698,400	792,182	2,812,249	9.2	—	6.1	2.6	0.5
	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ						
フィリピン	20,000	24,460	52,591	0.2	—	0.2	—	—
	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア						
インドネシア	362,770,000	389,142,879	3,152,057	10.3	—	7.3	2.4	0.6
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	388,300	355,655	2,688,755	8.8	—	8.0	0.7	0.1
合 計	—	—	29,739,673	97.4	13.6	56.9	31.0	9.6

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	45,900	52,150	301,949	2024/12/ 5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	14,700	19,082	110,485	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	28,200	26,820	155,290	2026/ 3 / 5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	26,900	26,821	155,294	2021/ 6 /10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	54,200	53,968	312,474	2022/ 6 / 9
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	38,000	38,391	222,288	2021/12/ 9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	46,200	48,154	278,815	2027/ 6 / 3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	24,300	26,007	150,582	2031/ 5 /29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	15,400	16,594	96,082	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	31,900	34,279	198,479	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	57,300	59,767	346,052	2023/12/ 7
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	21,000	22,070	127,789	2024/ 9 / 5
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	23,300	25,888	149,893	2047/11/ 7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	40,200	44,901	259,981	2029/ 5 /31
8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	25,700	29,583	171,287	2038/11/18		
小 計						3,036,748	
ブラジル				千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	10.0	16,170	19,286	502,794	2027/ 1 / 1
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	13,100	15,224	396,894	2025/ 1 / 1
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	10.0	6,100	7,440	193,973	2029/ 1 / 1
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	20,100	22,575	588,546	2023/ 1 / 1
		BRAZIL-LTN 210701	—	9,800	9,189	239,570	2021/ 7 / 1
		BRAZIL-LTN 220101	—	17,800	16,209	422,570	2022/ 1 / 1
		BRAZIL-LTN 220701	—	11,500	10,154	264,719	2022/ 7 / 1
		BRAZIL-LTN 230701	—	15,600	12,861	335,292	2023/ 7 / 1
		小 計					
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券	4.5 BONOS TESORER 210301	4.5	870,000	910,585	127,664	2021/ 3 / 1
		4.5 BONOS TESORER 260301	4.5	1,200,000	1,329,932	186,456	2026/ 3 / 1
		4.7 BONOS TESORER 300901	4.7	1,000,000	1,140,850	159,947	2030/ 9 / 1
		5 BONOS TESORERIA 350301	5.0	1,000,000	1,193,185	167,284	2035/ 3 / 1
		6 BONOS TESORERIA 430101	6.0	890,000	1,210,177	169,666	2043/ 1 / 1
小 計						811,019	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	10.0	6,200,000	7,401,790	239,817	2024/ 7 /24
		4.375 COLOMBI (GL) 230321	4.375	1,680,000	1,646,884	53,359	2023/ 3 /21
		6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	7,280,000	7,414,307	240,223	2028/ 4 /28
		6.25 TITULOS DE T 251126	6.25	5,190,000	5,408,641	175,239	2025/11/26
		7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	8,010,000	8,396,023	272,031	2022/ 5 / 4
		7 TITULOS DE TESO 320630	7.0	6,000,000	6,484,364	210,093	2032/ 6 /30
		7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	2,300,000	2,520,991	81,680	2034/10/18
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	7,770,000	8,619,619	279,275	2026/ 8 /26
		7.75 COLOMBI (GL) 210414	7.75	1,000,000	1,030,514	33,388	2021/ 4 /14
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	4,860,000	5,536,317	179,376	2030/ 9 /18

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		
コロンビア			%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円		
	国債証券	9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,633,546	52,926	2027/6/28	
小計						1,817,413		
ペルー				千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル			
	国債証券	5.4 PERU 340812	5.4	2,600	2,780	91,188	2034/8/12	
		5.7 PERU 240812	5.7	1,300	1,459	47,856	2024/8/12	
		5.94 PERU 290212	5.94	3,700	4,212	138,180	2029/2/12	
		6.15 PERU 320812	6.15	2,800	3,222	105,714	2032/8/12	
		6.35 PERU 280812	6.35	3,900	4,558	149,531	2028/8/12	
		6.9 PERU 370812	6.9	3,800	4,664	152,992	2037/8/12	
		6.95 PERU 310812	6.95	5,700	6,966	228,495	2031/8/12	
		8.2 PERU 260812	8.2	3,200	4,081	133,884	2026/8/12	
小計						1,047,844		
ウルグアイ				千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ			
	国債証券	8.5 URUGUAY (GL) 280315	8.5	7,000	6,230	18,253	2028/3/15	
		9.875 URUGUAY (GL) 220620	9.875	8,200	8,138	23,845	2022/6/20	
小計						42,099		
ドミニカ				千ドミニカペソ	千ドミニカペソ			
	国債証券	8.9 DOMINICAN 230215	8.9	8,000	8,029	16,460	2023/2/15	
		9.75 DOMINICAN 260605	9.75	16,000	16,492	33,808	2026/6/5	
小計						50,268		
トルコ				千トルコリラ	千トルコリラ			
	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	2,400	2,428	44,544	2024/3/20	
		10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	5,900	6,026	110,532	2027/8/11	
		10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	6,200	6,336	116,209	2026/2/11	
		10.7 TURKEY GOVT 210217	10.7	3,300	3,339	61,248	2021/2/17	
		10.7 TURKEY GOVT 220817	10.7	3,800	3,879	71,155	2022/8/17	
		11 TURKEY GOVT 220302	11.0	4,400	4,494	82,430	2022/3/2	
		11 TURKEY GOVT 270224	11.0	3,300	3,438	63,063	2027/2/24	
		12.2 TURKEY GOVT 230118	12.2	4,600	4,885	89,594	2023/1/18	
		12.4 TURKEY GOVT 280308	12.4	3,100	3,489	63,989	2028/3/8	
		16.2 TURKEY GOVT 230614	16.2	2,800	3,295	60,441	2023/6/14	
		7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	4,900	4,534	83,170	2023/3/8	
		8 TURKEY GOVT 250312	8.0	4,000	3,668	67,274	2025/3/12	
		8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	4,200	4,086	74,948	2022/9/14	
		9 TURKEY GOVT 240724	9.0	3,100	2,997	54,977	2024/7/24	
		9.2 TURKEY GOVT 210922	9.2	4,200	4,176	76,604	2021/9/22	
		9.5 TURKEY GOVT 220112	9.5	2,300	2,288	41,971	2022/1/12	
小計						1,162,157		
チェコ				千チェココルナ	千チェココルナ			
	国債証券	0.25 CZECH REPUB. 270210	0.25	19,500	17,865	85,394	2027/2/10	
		0.45 CZECH REPUB. 231025	0.45	24,400	23,458	112,133	2023/10/25	
		0.95 CZECH REPUB. 300515	0.95	25,200	23,807	113,800	2030/5/15	
		1 CZECH REPUBLIC 260626	1.0	25,300	24,574	117,466	2026/6/26	
		2.4 CZECH REPUBLIC 250917	2.4	26,800	27,968	133,689	2025/9/17	
		2.5 CZECH REPUBLIC 280825	2.5	28,000	30,106	143,906	2028/8/25	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
チェコ			%	千チェココルナ	千チェココルナ	千円	
	国債証券	2.75 CZECH REPUBL 290723	2.75	23,000	25,408	121,452	2029/7/23
		3.85 CZECH REPUBL 210929	3.85	13,600	14,083	67,318	2021/9/29
		4.7 CZECH REPUBLI 220912	4.7	20,400	22,033	105,317	2022/9/12
		5.7 CZECH REPUBLI 240525	5.7	18,500	21,763	104,029	2024/5/25
小 計						1,104,510	
ハンガリー				千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
	国債証券	1.75 HUNGARY 221026	1.75	307,000	318,166	113,776	2022/10/26
		2.5 HUNGARY 211027	2.5	40,000	41,692	14,909	2021/10/27
		2.75 HUNGARY 261222	2.75	243,000	261,639	93,562	2026/12/22
		3 HUNGARY 240626	3.0	329,000	359,695	128,627	2024/6/26
		3 HUNGARY 271027	3.0	358,000	391,406	139,966	2027/10/27
		3 HUNGARY 300821	3.0	155,000	168,713	60,332	2030/8/21
		5.5 HUNGARY 250624	5.5	512,000	628,439	224,729	2025/6/24
		6 HUNGARY 231124	6.0	333,000	400,192	143,108	2023/11/24
		6.75 HUNGARY 281022	6.75	167,000	233,115	83,362	2028/10/22
		7 HUNGARY 220624	7.0	223,000	260,029	92,986	2022/6/24
小 計						1,095,361	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.75 POLAND 210725	1.75	8,300	8,330	235,498	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	3,800	3,828	108,227	2021/4/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	7,500	7,608	215,083	2022/4/25
		2.25 POLAND 241025	2.25	5,000	5,075	143,494	2024/10/25
		2.5 POLAND 230125	2.5	7,700	7,872	222,562	2023/1/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	7,800	8,007	226,368	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	8,600	8,791	248,525	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	8,000	8,158	230,642	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	6,900	7,157	202,348	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	4,400	4,592	129,842	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	6,700	7,123	201,392	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	6,400	6,907	195,286	2023/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	3,400	3,645	103,059	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	5,600	6,189	174,985	2022/9/23
小 計						2,637,316	
ロシア				千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
	国債証券	6.5 RUSSIA OFZ 240228	6.5	90,000	92,857	162,499	2024/2/28
		6.9 RUSSIA OFZ 290523	6.9	44,200	46,935	82,137	2029/5/23
		7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	36,500	38,014	66,525	2023/1/25
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	62,000	64,843	113,475	2023/8/16
		7 RUSSIA OFZ 211215	7.0	72,500	74,453	130,294	2021/12/15
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	106,700	113,844	199,228	2028/1/19
		7.1 RUSSIA OFZ 241016	7.1	122,400	129,258	226,201	2024/10/16
		7.25 RUSSIA OFZ 340510	7.25	56,300	61,651	107,889	2034/5/10
		7.4 RUSSIA OFZ 221207	7.4	76,700	80,548	140,960	2022/12/7
		7.4 RUSSIA OFZ 240717	7.4	90,000	95,860	167,756	2024/7/17
		7.5 RUSSIA OFZ 210818	7.5	61,900	63,757	111,574	2021/8/18

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	
ロシア			%	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル	千円	
	国債証券	7.6 RUSSIA GOVT 210414	7.6	30,400	31,190	54,583	2021/4/14
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	55,000	57,657	100,900	2022/7/20
		7.7 RUSSIA OFZ 330323	7.7	95,700	108,421	189,738	2033/3/23
		7.75 RUSSIA OFZ 260916	7.75	149,600	164,709	288,241	2026/9/16
		7.95 RUSSIA OFZ 261007	7.95	25,800	28,644	50,127	2026/10/7
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	111,000	124,929	218,627	2027/2/3
		8.5 RUSSIA OFZ 310917	8.5	111,200	132,886	232,550	2031/9/17
小 計						2,643,313	
ルーマニア				千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ		
	国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 210322	3.25	1,600	1,597	40,181	2021/3/22
		3.25 ROMANIA GOVE 240429	3.25	2,300	2,250	56,633	2024/4/29
		3.4 ROMANIA GOVER 220308	3.4	3,300	3,287	82,707	2022/3/8
		3.5 ROMANIA GOVER 221219	3.5	3,200	3,186	80,159	2022/12/19
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	6,300	6,541	164,594	2025/2/24
		5 ROMANIA GOVERN 290212	5.0	2,760	2,916	73,390	2029/2/12
		5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	2,600	2,888	72,669	2027/7/26
		5.85 ROMANIA GOVE 230426	5.85	4,000	4,258	107,151	2023/4/26
		5.95 ROMANIA 210611	5.95	3,600	3,718	93,569	2021/6/11
小 計						771,059	
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	3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	4,400	4,466	120,006	2021/11/30
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	5,900	6,138	164,952	2028/6/15
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	7,100	7,318	196,646	2023/8/17
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	3,300	3,495	93,933	2029/8/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	5,000	5,261	141,368	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	8,620	9,030	242,654	2026/11/30
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	8,800	9,213	247,569	2025/9/15
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	6,700	7,016	188,524	2024/9/30
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	4,000	4,075	109,500	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	5,500	5,779	155,301	2024/7/15
		4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	3,400	3,699	99,406	2028/10/31
4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	3,500	4,119	110,680	2037/4/7		
小 計						1,870,544	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	1.45 THAILAND 241217	1.45	44,000	44,517	158,035	2024/12/17
		1.875 THAILAND 220617	1.875	44,000	44,762	158,907	2022/6/17
		2 THAILAND 221217	2.0	39,100	40,040	142,144	2022/12/17
		2.125 THAILAND 261217	2.125	53,500	56,556	200,775	2026/12/17
		2.4 THAILAND 231217	2.4	48,100	50,311	178,605	2023/12/17
		2.875 THAILAND 281217	2.875	66,800	75,203	266,973	2028/12/17
		2.875 THAILAND 460617	2.875	42,200	50,113	177,903	2046/6/17
		3.3 THAILAND 380617	3.3	29,700	36,948	131,167	2038/6/17
		3.4 THAILAND 360617	3.4	43,300	54,067	191,940	2036/6/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	42,400	45,870	162,839	2023/6/16
		3.65 THAILAND 211217	3.65	43,700	45,767	162,476	2021/12/17

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	
タイ			%	千タイバーツ	千タイバーツ	千円	
	国債証券	3.65 THAILAND 310620	3.65	43,900	53,729	190,739	2031/ 6 /20
		3.775 THAILAND 320625	3.775	58,500	72,878	258,718	2032/ 6 /25
		3.85 THAILAND 251212	3.85	51,800	59,472	211,128	2025/12/12
		4.875 THAILAND 290622	4.875	47,400	61,941	219,893	2029/ 6 /22
小 計						2,812,249	
フィリピン				千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
	国債証券	6.25 PHILIPPI (GL) 360114	6.25	20,000	24,460	52,591	2036/ 1 /14
小 計						52,591	
インドネシア				千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	10.5	7,050,000	8,947,494	72,474	2030/ 8 /15
		11 INDONESIA 250915	11.0	8,850,000	10,793,991	87,431	2025/ 9 /15
		12.8 INDONESIA 210615	12.8	1,790,000	1,972,597	15,978	2021/ 6 /15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	28,400,000	28,343,200	229,579	2023/ 5 /15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	27,300,000	26,518,947	214,803	2028/ 5 /15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	16,900,000	16,159,273	130,890	2033/ 5 /15
		7 INDONESIA 220515	7.0	16,250,000	16,807,212	136,138	2022/ 5 /15
		7 INDONESIA 270515	7.0	18,450,000	19,011,249	153,991	2027/ 5 /15
		7.5 INDONESIA 320815	7.5	8,900,000	9,124,013	73,904	2032/ 8 /15
		7.5 INDONESIA 380515	7.5	11,100,000	11,183,139	90,583	2038/ 5 /15
		8.25 INDONESIA 210715	8.25	18,400,000	19,197,824	155,502	2021/ 7 /15
		8.25 INDONESIA 290515	8.25	19,500,000	21,704,475	175,806	2029/ 5 /15
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	15,000,000	16,241,850	131,558	2032/ 6 /15
		8.25 INDONESIA 360515	8.25	18,400,000	19,932,352	161,452	2036/ 5 /15
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	42,200,000	45,979,854	372,436	2024/ 3 /15
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	25,130,000	27,879,473	225,823	2026/ 9 /15
		8.375 INDONESIA 340315	8.375	31,300,000	34,718,586	281,220	2034/ 3 /15
		8.375 INDONESIA 390415	8.375	12,200,000	13,483,440	109,215	2039/ 4 /15
		8.75 INDONESIA 310515	8.75	15,100,000	17,268,813	139,877	2031/ 5 /15
		9 INDONESIA 290315	9.0	15,500,000	17,849,335	144,579	2029/ 3 /15
9.5 INDONESIA 310715	9.5	5,050,000	6,025,761	48,808	2031/ 7 /15		
小 計						3,152,057	
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	53,900	60,615	458,250	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	24,400	17,432	131,788	2036/ 3 /31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	20,300	14,110	106,677	2041/ 2 /28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	4,500	4,510	34,098	2021/ 3 /31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	21,500	18,245	137,938	2031/ 2 /28
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	25,900	26,544	200,679	2023/ 2 /28
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	45,700	42,674	322,620	2030/ 1 /31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	25,000	22,917	173,256	2032/ 3 /31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	26,300	23,180	175,245	2037/ 1 /31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	37,000	32,382	244,810	2044/ 1 /31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	52,100	45,425	343,420	2048/ 2 /28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	29,600	27,517	208,032	2035/ 2 /28

銘柄		当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
南アフリカ		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円
	国債証券 9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	22,100	20,097	151,936
小	計				2,688,755
合	計				29,739,673

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

○投資信託財産の構成

(2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 29,739,673	% 97.2
コール・ローン等、その他	850,478	2.8
投資信託財産総額	30,590,151	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（30,487,031千円）の投資信託財産総額（30,590,151千円）に対する比率は99.7%です。

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

1 アメリカドル＝109.06円	1 アルゼンチンペソ＝1.81円	1 メキシコペソ＝5.79円	1 ブラジルレアル＝26.07円
100チリペソ＝14.02円	100コロンビアペソ＝3.24円	1 ペルーヌエボソル＝32.80円	1 ウルグアイペソ＝2.93円
1 ドミニカペソ＝2.05円	1 トルコリラ＝18.34円	1 チェココルナ＝4.78円	100ハンガリーフォリント＝35.76円
1 ポーランドズロチ＝28.27円	1 ロシアルーブル＝1.75円	1 ルーマニアレイ＝25.16円	1 マレーシアリンギット＝26.87円
1 タイバーツ＝3.55円	1 フィリピンペソ＝2.15円	100インドネシアルピア＝0.81円	1 南アフリカランド＝7.56円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	30,619,487,366
コール・ローン等	381,147,959
公社債(評価額)	29,739,673,089
未収入金	29,335,894
未収利息	407,037,600
前払費用	62,292,824
(B) 負債	99,286,158
未払金	82,121,385
未払解約金	17,164,752
未払利息	21
(C) 純資産総額(A－B)	30,520,201,208
元本	21,159,314,350
次期繰越損益金	9,360,886,858
(D) 受益権総口数	21,159,314,350口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,424円

<注記事項>

- ①期首元本額 15,407,521,844円
 期中追加設定元本額 7,011,221,547円
 期中一部解約元本額 1,259,429,041円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,424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新興国債券インデックスファンド	7,247,804,820円
eMAXIS 新興国債券インデックス	4,127,296,896円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	3,887,604,316円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,784,891,430円
つみたて8資産均等バランス	1,503,550,049円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	579,123,955円
eMAXIS バランス(波乗り型)	360,275,489円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	200,503,821円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	169,425,523円
海外債券セレクション(ラップ向け)	158,727,367円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	45,830,320円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	39,070,562円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	18,945,835円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	14,049,651円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	9,769,125円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	7,863,232円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,871,095円
コアバランス	1,422,253円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,024,252円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	264,359円
合計	21,159,314,350円

○損益の状況 (2019年1月29日～2020年1月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,397,471,905
受取利息	1,397,481,057
その他収益金	60,968
支払利息	△ 70,120
(B) 有価証券売買損益	768,772,039
売買益	1,810,583,461
売買損	△1,041,811,422
(C) 保管費用等	△ 22,853,703
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,143,390,241
(E) 前期繰越損益金	5,013,583,488
(F) 追加信託差損益金	2,671,273,440
(G) 解約差損益金	△ 467,360,311
(H) 計(D+E+F+G)	9,360,886,858
次期繰越損益金(H)	9,360,886,858

- (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。

東証REIT指数マザーファンド

《第11期》決算日2020年1月27日

[計算期間：2019年1月29日～2020年1月27日]

「東証REIT指数マザーファンド」は、1月27日に第11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11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を主要投資対象とし、東証REIT指数（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。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。対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
主要運用対象	東証REIT指数（配当込み）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は行いません。

○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	不動産投信 指数比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
7期(2016年1月26日)	23,985	△10.1	2,998.39	△10.1	98.1	2.2	15,494
8期(2017年1月26日)	27,236	13.6	3,399.04	13.4	97.9	2.3	16,983
9期(2018年1月26日)	26,965	△1.0	3,362.92	△1.1	98.4	1.9	21,644
10期(2019年1月28日)	29,481	9.3	3,670.43	9.1	98.2	2.0	23,792
11期(2020年1月27日)	36,432	23.6	4,533.90	23.5	98.4	1.6	35,177

(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。

(注) 「不動産投信指数先物比率」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 R E I T 指 数		投 資 信 託 券 率 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 率 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配 当 込 み)	騰 落 率		
(期 首) 2019年1月28日	円	%		%	%	%
	29,481	—	3,670.43	—	98.2	2.0
1月末	29,791	1.1	3,709.11	1.1	98.1	1.9
2月末	29,943	1.6	3,728.00	1.6	97.7	2.4
3月末	30,934	4.9	3,851.10	4.9	98.5	1.4
4月末	30,708	4.2	3,822.76	4.2	98.6	1.4
5月末	31,243	6.0	3,889.57	6.0	98.6	1.3
6月末	31,713	7.6	3,947.76	7.6	98.8	1.3
7月末	33,102	12.3	4,120.33	12.3	98.6	1.4
8月末	34,357	16.5	4,275.94	16.5	98.2	1.7
9月末	35,980	22.0	4,477.77	22.0	98.5	1.5
10月末	37,170	26.1	4,625.77	26.0	98.7	1.3
11月末	36,834	24.9	4,584.30	24.9	98.9	1.1
12月末	35,758	21.3	4,450.34	21.2	98.6	1.5
(期 末) 2020年1月27日	36,432	23.6	4,533.90	23.5	98.4	1.6

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「不動産投信指数先物比率」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23.6%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(23.5%)を0.1%上回りました。

基準価額等の推移



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

●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REIT市況

- ・国内REIT市況は上昇しました。
- ・世界的な株式指数であるFTSEグローバル株式指数への組み入れについて検討開始との報道や、低金利環境が長期化するとの見方を背景に相対的にREIT指数利回りが好感されたこと等を受け、国内REIT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

- ・資産のほぼ全額を不動産投資信託証券(REIT)(先物を含む)に投資しました。
- ・ポートフォリオはベンチマークである東証REIT指数(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23.5%の上昇となったため、乖離は0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因※によるものです。

※留保金等が含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年1月29日～2020年1月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.003	(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
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(1)	(0.003)	
(b) そ の 他 費 用	0	0.000	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	1	0.003	
期中の平均基準価額は、33,243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。

(2019年1月29日～2020年1月27日)

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国		千口	千円	千口	千円
		エスコンジャパンリート投資法人	0.36	39,397	0.042
	サンケイリアルエステート投資法人	0.473 (0.026)	54,751 (3,087)	0.05	5,927
	日本アコモデーションファンド投資法人	0.311	202,798	0.144	92,427
	MCUBS MidCity投資法人	1	178,574	0.51	56,438
	森ヒルズリート投資法人	1	181,578	0.496	80,989
	産業ファンド投資法人	1	226,311	0.526	78,232
	アドバンス・レジデンス投資法人	0.948	324,126	0.539	180,847
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.652	130,981	0.264	51,951
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.474	250,615	0.285	144,752
	GLP投資法人	2	315,703	1	139,619
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.466 (0.008)	151,490 (2,344)	0.177	57,595
	日本プロロジスリート投資法人	1	429,014	0.609	163,323
	星野リゾート・リート投資法人	0.139	79,330	0.062	34,379
	Oneリート投資法人	0.168	52,954	0.064	19,824
	イオンリート投資法人	1	161,239	0.446	62,543
	ヒューリックリート投資法人	0.889	173,796	0.353	67,329
	日本リート投資法人	0.308	139,008	0.14	62,673
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6	136,817	2	45,416
	日本ヘルスケア投資法人	0.052	10,218	0.021	3,937
	積水ハウス・リート投資法人	3	314,617	1	106,478
	トーセイ・リート投資法人	0.249 (0.033)	33,097 (4,530)	0.107	13,327
	ケネディクス商業リート投資法人	0.408	112,820	0.163	44,021
	ヘルスケア&メディカル投資法人	0.288 (0.119)	36,940 (13,815)	0.09	11,442
	サムティ・レジデンシャル投資法人	0.19	21,918	0.089	10,005
	野村不動産マスターファンド投資法人	3 (0.067)	625,655 (10,064)	1	215,594
内	いちごホテルリート投資法人	0.158	20,565	0.098	12,380
	ラサールロジポート投資法人	1	187,764	0.363	51,706
	スターアジア不動産投資法人	0.363	41,952	0.141	16,032
	マリモ地方創生リート投資法人	0.119	14,974	0.037	4,484
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.381 (0.045)	151,019 (15,841)	0.107	44,129
	大江戸温泉リート投資法人	0.182	16,539	0.074	6,629
	さくら総合リート投資法人	0.201	19,097	0.092	8,600
	投資法人みらい	1 (2)	69,879 (-)	0.465	25,961
	森トラスト・ホテルリート投資法人	0.217	30,939	0.099	13,975
	三菱地所物流リート投資法人	0.401	133,131	0.066	21,189
	CREロジスティクスファンド投資法人	0.369	49,456	0.047	6,052
	ザイマックス・リート投資法人	0.264	34,481	0.054	7,106
	タカラレーベン不動産投資法人	0.456 (0.125)	54,933 (14,625)	0.091	10,420
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.143	16,122	0.066	7,111

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国	日本ビルファンド投資法人	0.905	715,353	0.419	323,988
	ジャパンリアルエステイト投資法人	0.935	655,488	0.433	296,525
	日本リートリアルファンド投資法人	1	407,310	0.816	184,117
	オリックス不動産投資法人	1	414,611	0.86	186,498
	日本プライムリアルティ投資法人	0.588	288,581	0.27	128,752
	プレミアム投資法人	0.854	130,109	0.523	77,142
	東急リアル・エステート投資法人	0.629	124,769	0.292	57,010
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.79	108,110	0.299	40,889
	ユナイテッド・アーバン投資法人	2	436,967	0.964	188,782
	森トラスト総合リート投資法人	0.666	125,061	0.307	56,274
	インヴィンシブル投資法人	6	384,553	1	97,492
	フロンティア不動産投資法人	0.365	170,663	0.148	68,728
	平和不動産リート投資法人	0.581	78,408	0.268	35,231
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.61	161,334	0.299	77,568
	福岡リート投資法人	0.485	87,725	0.225	40,333
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.29	235,825	0.134	105,548
	いちごオフィスリート投資法人	0.736	79,686	0.49	51,338
	大和証券オフィス投資法人	0.217	176,856	0.101	81,072
	阪急阪神リート投資法人	0.426	69,421	0.194	30,966
	スターツプロシード投資法人	0.144	28,022	0.071	13,224
	大和ハウスリート投資法人	1 (0.035)	412,185 (8,602)	0.581	159,938
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	3	258,213	1	121,016
	日本賃貸住宅投資法人	1	102,406	0.485	45,406
	ジャパンエクセレント投資法人	0.923	160,134	0.382	64,396
	エスコンジャパンリート投資法人（新）	0.014	1,736	—	—
	サンケイリアルエステート投資法人（新）	0.026 (△0.026)	3,087 (△ 3,087)	—	—
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）	0.009 (△0.008)	2,990 (△ 2,344)	—	—
	トーセイ・リート投資法人（新）	0.033 (△0.033)	4,530 (△ 4,530)	—	—
	ヘルスケア&メディカル投資法人（新）	— (△0.119)	— (△ 13,815)	—	—
	野村不動産マスターファンド投資法人（新）	0.067 (△0.067)	10,064 (△ 10,064)	—	—
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人（新）	0.03 (△0.045)	14,872 (△ 15,841)	—	—
	タカラレーベン不動産投資法人（新）	0.125 (△0.125)	14,625 (△ 14,625)	—	—
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人（新）	0.044	5,119	—	—
	大和ハウスリート投資法人（新）	0.035 (△0.035)	8,602 (△ 8,602)	—	—
合 計		63 (2)	11,102,052 (—)	24	4,521,897

(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 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 8,603	百万円 8,616	百万円 4	百万円 4

○利害関係人との取引状況等

(2019年1月29日～2020年1月27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 11,102	百万円 4,523	% 40.7	百万円 4,521	百万円 2,708	% 59.9
不動産投信指数先物取引	8,607	3,237	37.6	8,620	3,792	44.0

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 別	買 付 額
投資信託証券	百万円 697

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)	754千円
うち利害関係人への支払額 (B)	288千円
(B) / (A)	38.2%

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モルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2020年1月27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	—	0.318	44,806	0.1
サンケイリアルエステート投資法人	—	0.449	60,839	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	0.862	1	719,271	2.0
MCUBS MidCity投資法人	2	3	492,801	1.4
森ヒルズリート投資法人	2	3	655,224	1.9
産業ファンド投資法人	3	3	670,613	1.9
アドバンス・レジデンス投資法人	2	2	1,011,452	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	415,630	1.2
アクティブ・プロパティーズ投資法人	1	1	879,417	2.5
GLP投資法人	6	7	1,052,278	3.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.989	1	461,031	1.3
日本プロロジスリート投資法人	3	4	1,328,763	3.8
星野リゾート・リート投資法人	0.394	0.471	262,347	0.7
Oneリート投資法人	0.378	0.482	173,279	0.5
イオンリート投資法人	2	3	502,670	1.4
ヒューリックリート投資法人	2	2	518,240	1.5
日本リート投資法人	0.837	1	504,510	1.4
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	15	19	463,940	1.3
日本ヘルスケア投資法人	0.119	0.15	32,250	0.1
積水ハウス・リート投資法人	6	9	828,166	2.4
トーセイ・リート投資法人	0.499	0.674	91,327	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	0.95	1	323,725	0.9
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.343	0.66	93,720	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.519	0.62	74,028	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人	7	9	1,861,695	5.3
いちごホテルリート投資法人	0.453	0.513	67,818	0.2
ラサールレジポート投資法人	1	2	482,640	1.4
スターアジア不動産投資法人	0.805	1	118,926	0.3
マリモ地方創生リート投資法人	0.223	0.305	38,796	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.443	0.762	406,908	1.2
大江戸温泉リート投資法人	0.418	0.526	48,392	0.1
さくら総合リート投資法人	0.561	0.67	64,320	0.2
投資法人みらい	0.698	3	212,608	0.6
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.608	0.726	107,302	0.3
三菱地所物流リート投資法人	0.274	0.609	225,634	0.6
CREロジスティクスファンド投資法人	0.26	0.582	84,099	0.2
ザイマックス・リート投資法人	0.239	0.449	62,276	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	0.388	0.878	113,086	0.3
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.401	0.478	61,231	0.2
日本ビルファンド投資法人	2	2	2,571,426	7.3
ジャパンリアルエステイト投資法人	2	3	2,423,385	6.9
日本リテールファンド投資法人	4	5	1,344,330	3.8
オリックス不動産投資法人	5	6	1,431,977	4.1
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	952,074	2.7
プレミアム投資法人	2	2	436,735	1.2
東急リアル・エステート投資法人	1	2	442,390	1.3

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	%
グローバル・ワン不動産投資法人	1	2	308,381	0.9
ユナイテッド・アーバン投資法人	5	6	1,355,250	3.9
森トラスト総合リート投資法人	1	2	433,330	1.2
インヴィンシブル投資法人	9	13	737,285	2.1
フロンティア不動産投資法人	0.882	1	493,451	1.4
平和不動産リート投資法人	1	1	267,799	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	1	2	588,402	1.7
福岡リート投資法人	1	1	297,625	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	0.802	0.958	820,048	2.3
いちごオフィスリート投資法人	2	2	278,771	0.8
大和証券オフィス投資法人	0.598	0.714	612,612	1.7
阪急阪神リート投資法人	1	1	237,380	0.7
スタートアップブロード投資法人	0.409	0.482	98,906	0.3
大和ハウスリート投資法人	3	4	1,180,541	3.4
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8	9	720,903	2.0
日本賃貸住宅投資法人	2	3	368,395	1.0
ジャパンエクセレント投資法人	2	2	556,280	1.6
エスコンジャパンリート投資法人(新)	—	0.014	1,920	0.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)	0.008	0.009	3,180	0.0
ヘルスケア&メディカル投資法人(新)	0.119	—	—	—
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人(新)	0.045	0.03	15,823	0.0
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人(新)	—	0.044	5,532	0.0
合 計	口 数 ・ 金 額	139	180	34,600,208
銘 柄 数<比 率>		64	67	<98.4%>

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容

当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

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	不動産投信指数先物取引	東証REIT指数	百万円 576	百万円 —

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2020年1月27日現在)

区 分	当 期	末
	数	量
貸付有価証券<投資証券>総口数		口 48,131

○投資信託財産の構成

(2020年1月27日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 34,600,208	% 77.3
コール・ローン等、その他	10,155,506	22.7
投資信託財産総額	44,755,714	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	44,737,286,351
コール・ローン等	9,898,671,199
投資証券(評価額)	34,600,208,736
未収入金	16,368,320
未収配当金	229,289,329
その他未収収益	235,267
差入委託証拠金	△ 7,486,500
(B) 負債	9,559,745,280
未払解約金	68,698,342
未払利息	△ 262,666
受入担保金	9,491,309,604
(C) 純資産総額(A－B)	35,177,541,071
元本	9,655,654,154
次期繰越損益金	25,521,886,917
(D) 受益権総口数	9,655,654,154口
1万口当たり基準価額(C/D)	36,432円

<注記事項>

- ①期首元本額 8,070,576,759円
 期中追加設定元本額 4,019,694,773円
 期中一部解約元本額 2,434,617,378円
 また、1口当たり純資産額は、期末3,6432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 国内リートインデックス	4,496,639,368円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	1,566,185,865円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,116,834,542円
J-REITインデックスファンド(ラップ向け)	986,741,786円
つみたて8資産均等バランス	607,770,669円
eMAXIS Slim 国内リートインデックス	176,752,849円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	175,691,467円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	163,771,919円
eMAXIS バランス(波乗り型)	144,963,384円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	60,495,444円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	45,520,639円
三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド	40,523,857円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	19,037,293円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	18,532,347円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	15,607,869円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	9,514,615円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	5,747,733円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	4,403,577円
eMAXIS マイマネージャ 1980s	504,067円
eMAXIS マイマネージャ 1970s	307,954円
eMAXIS マイマネージャ 1990s	106,910円
合計	9,655,654,154円

○損益の状況 (2019年1月29日～2020年1月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,039,737,998
受取配当金	1,038,281,609
受取利息	37,983
その他収益金	1,621,379
支払利息	△ 202,973
(B) 有価証券売買損益	4,644,888,135
売買益	4,774,466,342
売買損	△ 129,578,207
(C) 先物取引等取引損益	116,356,450
取引益	162,933,560
取引損	△ 46,577,110
(D) 保管費用等	△ 600
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	5,800,981,983
(F) 前期繰越損益金	15,722,317,042
(G) 追加信託差損益金	9,709,767,637
(H) 解約差損益金	△ 5,711,179,745
(I) 計(E+F+G+H)	25,521,886,917
次期繰越損益金(I)	25,521,886,917

(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】

より適正な水準となるように信託財産留保額を引き下げるため、信託財産留保額を変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2019年10月26日)

MUAM G-REITマザーファンド

《第14期》決算日2020年1月6日

[計算期間：2019年1月8日～2020年1月6日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月6日に第14期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		S & P 先 進 国 R E I T イ ン デ ッ ク ス (除く日本、配当込み、円換算ベース)		投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率		
	円	%		%	%	百万円
10期(2016年1月5日)	15,105	△ 1.8	39,610.16	△ 2.5	98.7	16,191
11期(2017年1月5日)	16,039	6.2	41,801.16	5.5	98.8	18,949
12期(2018年1月5日)	16,420	2.4	42,522.26	1.7	98.0	18,551
13期(2019年1月7日)	15,011	△ 8.6	38,602.62	△ 9.2	98.8	19,712
14期(2020年1月6日)	18,377	22.4	47,161.24	22.2	99.0	30,217

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

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P R E I T イ (除く日本、配当込 み、円換算ベース)	先 進 国 ス ン デ ッ ク ス イ (除く日本、配当込 み、円換算ベース)	投 資 信 託 組 入 比 率
	円	騰 落 率			
(期 首) 2019年1月7日	15,011	% —	38,602.62	% —	% 98.8
1月末	16,718	11.4	42,993.79	11.4	98.7
2月末	17,116	14.0	44,060.75	14.1	98.8
3月末	17,744	18.2	45,609.74	18.2	99.2
4月末	17,691	17.9	45,466.50	17.8	99.2
5月末	17,198	14.6	44,158.46	14.4	99.1
6月末	17,246	14.9	44,255.14	14.6	98.9
7月末	17,674	17.7	45,346.95	17.5	99.2
8月末	17,534	16.8	45,002.08	16.6	98.8
9月末	18,234	21.5	46,866.47	21.4	99.0
10月末	18,854	25.6	48,408.12	25.4	99.4
11月末	18,794	25.2	48,267.58	25.0	99.0
12月末	18,596	23.9	47,729.52	23.6	99.4
(期 末) 2020年1月6日	18,377	22.4	47,161.24	22.2	99.0

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

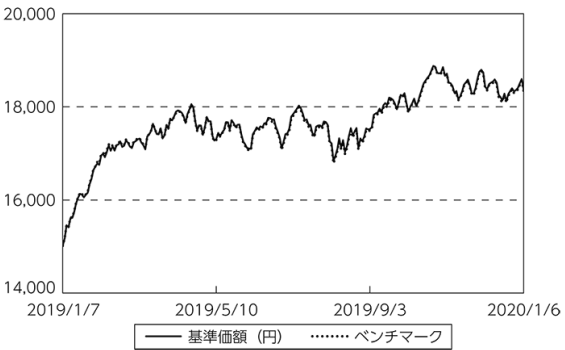
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ22.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(22.2%)を0.2%上回りました。

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

●投資環境について

◎外国REIT市況（現地通貨ベース）

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは22.2%の上昇になったため、カイ離は0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・その他の要因によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年1月8日～2020年1月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 3	% 0.016	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(3)	(0.016)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.012	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(2)	(0.012)	
(c) そ の 他 費 用	5	0.030	(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)	(5)	(0.027)	
(そ の 他)	(1)	(0.003)	
合 計	10	0.058	
期中の平均基準価額は、17,648円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年1月8日～2020年1月6日)

株式

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

(注) 金額は受渡代金。
(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分です。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	SITE CENTERS CORP	5	78	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23	791	2	75
	MACERICH CO/THE	4	130	—	—
	ACADIA REALTY TRUST	4	128	—	—
	AGREE REALTY CORP	3	213	—	—
	ALEXANDER'S INC	0.141	48	0.344	117
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6	914	0.631	96
	PROLOGIS INC	28	2,262	5	469
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	6	295	1	75
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	—	(—)	(0.84625)
	BRANDYWINE REALTY TRUST	5	85	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	4	506	0.683	74
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7	418	—	—
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3	106	—	—
	COUSINS PROPERTIES INC	10 (△ 50)	188 (200)	—	—
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	6	64	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9	1,105	1	197
	EASTGROUP PROPERTIES INC	1	203	—	—
	EPR PROPERTIES	3	241	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5 (17)	529 (—)	0.816	102
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	893	0.692	216
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6	666	0.642	74
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	409	1	191
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5	227	1	75
	GETTY REALTY CORP	1	49	—	—
	WELLTOWER INC	22	1,816	2	255
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	5	230	1	75
	SERVICE PROPERTIES TRUST	6	152	—	—
	EQUITY COMMONWEALTH	5	168	0.9	29
	KILROY REALTY CORP	5	408	2	182
	KITE REALTY GROUP TRUST	2	49	—	—
	LEXINGTON REALTY TRUST	17	175	2	24
	LTC PROPERTIES INC	1	66	—	—
	MAC-KALI REALTY CORP	3	77	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	6	856	3	423
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	44	860	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4	588	0.939	120
	NATL HEALTH INVESTORS INC	1	127	—	—
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11 (1)	447 (46)	1	74
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.797	23	—	—

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

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

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

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8	226	3	100
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2	140	—	—
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2	32	—	—
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	2	44	—	—
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5	68	—	—
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	2	30	19	318
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1	108	—	—
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	4	70	—	—
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4	48	—	—
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1	33	—	—
	CHOICE PROPERTIES REIT	8	112	—	—
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5	73	—	—
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4	79	—	—
	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	—	—	—	—
				(2)	(29)
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	10	131	6	79
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	3	24	—	—
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2	55	—	—
	小計	96	2,046	31 (2)	599 (29)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ				
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	6 (—)	89 (△ 15)	—	—
	HAMBORNER REIT AG	2	19	—	—
	小計	8 (—)	109 (△ 15)	—	—
	イタリア				
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	— (—)	— (△0.11263)	—	—
	小計	— (—)	— (△0.11263)	—	—
	フランス				
	COVIVIO	—	—	— (1)	— (123)
	GECINA SA	2	323	0.481	67
	KLEPIERRE	7	235	—	—
	COVIVIO	3 (1)	284 (123)	4	434
	MERCIALYS	3	45	7	92
	ICADE	1	136	3	301
	ALTAREA	0.21 (—)	40 (△ 7)	—	—
	小計	18 (1)	1,065 (115)	16 (1)	896 (123)

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

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
	INTU PROPERTIES PLC	40	14	—	—
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	114	153	—	—
	SEGRO PLC	68	518	11	90
	WORKSPACE GROUP PLC	5	50	—	—
	SHAFESBURY PLC	4	38	—	—
	BIG YELLOW GROUP PLC	4	45	—	—
	DERWENT LONDON PLC	4	148	2	74
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	60	124	—	—
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	13	14	—	—
	RDI REIT PLC	16 (△ 180)	20 (—)	—	—
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	6	41	—	—
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	131	194	41	61
	ASSURA PLC	85	51	44	25
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	44	43	—	—
	REGIONAL REIT LTD	26	28	—	—
	NEWRIVER REIT PLC	11	25	—	—
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	102	104	—	—
	UNITE GROUP PLC/THE	30	347	—	—
	LXI REIT PLC	34	43	—	—
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	68	60	—	—
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	117	103	—	—
	AEW UK REIT PLC	65	62	—	—
	小計	1,164 (△ 180)	2,901 (—)	121	396
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	VICINITY CENTRES	152	392	42	109
	ABACUS PROPERTY GROUP	25	99	—	—
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	8	38	—	—
	CHARTER HALL GROUP	13	149	—	—
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	12	45	—	—
	CROMWELL PROPERTY GROUP	90	111	—	—
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	43	114	—	—
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	7	34	—	—
	NATIONAL STORAGE REIT	35	65	—	—
	GDI PROPERTY GROUP	29	40	—	—
	APN INDUSTRIA REIT	11	32	—	—
	SCENTRE GROUP	227	893	40	160
	ARENA REIT	23	66	—	—
	VIVA ENERGY REIT	23	63	—	—
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	53	282	—	—
	PROPERTYLINK GROUP	—	—	87	101
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	79	236	—	—
	GPT GROUP	106	654	18	110
	MIRVAC GROUP	223	679	35	110
	STOCKLAND	111	493	24	108

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	DEXUS	64	803	12	153
	BWP TRUST	15	60	—	—
	CHARTER HALL RETAIL REIT	21	95	—	—
	GOODMAN GROUP	70	984	16	218
	小計	1,450	6,439	278	1,073
	ニュージーランド		千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	29	77	—	—
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	73	115	—	—
	GOODMAN PROPERTY TRUST	45	90	—	—
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	64	107	—	—
	ARGOSY PROPERTY LTD	33	40	—	—
	STRIDE PROPERTY GROUP	—	—	69	158
	小計	246	430	69	158
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	90	8,067	24	2,090
	CHAMPION REIT	79	467	—	—
	PROSPERITY REIT	134	424	73	233
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	74	393	—	—
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	35	203	—	—
	FORTUNE REIT	56	564	—	—
	小計	468	10,120	97	2,324
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	92 (—)	173 (△ 4)	—	—
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	107	216	—	—
	KEPPEL REIT	88 (—)	107 (△ 1)	—	—
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	22 (—)	32 (△ 2)	—	—
	ASCOTT TRUST	24 (121)	31 (112)	—	—
	ESR-REIT	111 (—)	58 (△0.79694)	— (—)	— (0.7467)
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	46 (—)	74 (△ 1)	—	—
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	54	143	—	—
	STARHILL GLOBAL REIT	40 (—)	31 (△ 1)	—	—
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	284 (—)	457 (△ 5)	— (—)	— (4)
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	58 (—)	90 (△ 7)	—	—
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	25 (—)	25 (△ 3)	—	—
	AIMS APAC REIT	76 (—)	109 (△0.24471)	104	147

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	163 (-)	35 (△ 2)	—	—
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	10 (-)	30 (△ 1)	—	—
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	91 (-)	206 (△0.56505)	—	—
	CACHE LOGISTICS TRUST	52 (-)	38 (△0.29194)	—	—
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	144	328	48	109
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46	30	—	—
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	— (-)	— (△ 0.1596)	—	—
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	31 (-)	33 (△ 1)	— (152)	— (125)
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	74 (-)	97 (△ 7)	—	—
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	48 (-)	29 (△0.14437)	—	—
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	198 (306)	106 (144)	—	—
	QUE HOSPITALITY TRUST	48	34	72 (225)	51 (153)
	SPH REIT	61	67	—	—
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	— (-)	— (△ 4)	—	—
	KEPPEL DC REIT	77	143	—	—
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	26 (-)	31 (△ 6)	—	—
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	130	103	—	—
	CAPITALAND MALL TRUST	93	233	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	211 (-)	627 (△ 10)	33	105
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	— (81)	— (-)	81	22
	小 計	2,543 (509)	3,732 (191)	340 (378)	435 (284)
	韓国		千韓国ウォン		千韓国ウォン
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5	28,311	—	—
	小 計	5	28,311	—	—
	イスラエル		千イスラエルシェケル		千イスラエルシェケル
	REIT 1 LTD	5	99	—	—
	小 計	5	99	—	—

(注) 金額は受渡代金。

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

○株式売買比率

(2019年1月8日～2020年1月6日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	132千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	127千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.03

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年1月8日～2020年1月6日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	6,960	1,216	17.5	1,294	89	6.9

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

○組入資産の明細

(2020年1月6日現在)

外国株式

銘柄		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	ヘルスケア機器・サービス
FIVE STAR SENIOR LIVING INC		—	32	11	1,276	
合 計	株 数 ・ 金 額	—	32	11	1,276	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.0%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
SITE CENTERS CORP	23	29	405	43,794	0.1	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82	103	3,559	384,862	1.3	
MACERICH CO/THE	18	22	587	63,561	0.2	
ACADIA REALTY TRUST	13	18	466	50,484	0.2	
AGREE REALTY CORP	5	8	614	66,475	0.2	
ALEXANDER'S INC	0.654	0.451	150	16,217	0.1	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18	24	3,859	417,289	1.4	
PROLOGIS INC	108	130	11,662	1,260,865	4.2	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23	28	1,309	141,555	0.5	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15	15	40	4,373	0.0	
BRANDYWINE REALTY TRUST	31	36	579	62,636	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	15	19	2,114	228,644	0.8	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	31	31	31	3,437	0.0	
CEDAR REALTY TRUST INC	17	17	52	5,686	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	27	35	1,874	202,629	0.7	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	18	22	665	71,916	0.2	
COUSINS PROPERTIES INC	70	30	1,231	133,182	0.4	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	35	41	448	48,511	0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC	35	43	5,170	558,943	1.8	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6	7	1,044	112,896	0.4	
EPR PROPERTIES	12	16	1,137	123,021	0.4	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15	37	2,636	284,994	0.9	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11	13	4,105	443,830	1.5	
EXTRA SPACE STORAGE INC	21	27	2,924	316,179	1.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12	14	1,813	196,045	0.6	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22	25	1,082	117,026	0.4	
GETTY REALTY CORP	5	7	240	26,042	0.1	
WELLTOWER INC	64	83	6,828	738,221	2.4	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	18	21	1,043	112,829	0.4	
SERVICE PROPERTIES TRUST	27	33	810	87,569	0.3	
EQUITY COMMONWEALTH	20	25	819	88,596	0.3	
KILROY REALTY CORP	17	20	1,689	182,691	0.6	
KITE REALTY GROUP TRUST	14	17	332	35,979	0.1	
LEXINGTON REALTY TRUST	34	49	533	57,704	0.2	
LTC PROPERTIES INC	6	8	364	39,427	0.1	
MACK-CALI REALTY CORP	14	18	422	45,654	0.2	
BOSTON PROPERTIES INC	26	29	4,067	439,722	1.5	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	63	107	2,259	244,242	0.8	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19	23	3,086	333,688	1.1	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7	8	719	77,810	0.3	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	34	45	1,895	204,888	0.7	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2	3	83	9,055	0.0	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12	12	62	6,743	0.0	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
RPT REALTY	13	15	229	24,858	0.1
REALTY INCOME CORP	50	67	4,961	536,378	1.8
REGENCY CENTERS CORP	29	34	2,142	231,609	0.8
SAUL CENTERS INC	2	2	134	14,495	0.0
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	39	48	391	42,272	0.1
SL GREEN REALTY CORP	14	17	1,520	164,376	0.5
LIFE STORAGE INC	8	9	1,035	111,919	0.4
SUN COMMUNITIES INC	14	19	2,879	311,323	1.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38	45	633	68,534	0.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16	18	261	28,296	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	10	12	394	42,612	0.1
CUBESMART	32	39	1,248	134,958	0.4
UDR INC	47	60	2,808	303,627	1.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2	2	305	32,990	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4	6	146	15,828	0.1
VENTAS INC	61	77	4,398	475,515	1.6
WASHINGTON REIT	13	16	477	51,595	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20	24	752	81,381	0.3
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5	7	103	11,182	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3	4	679	73,458	0.2
UMH PROPERTIES INC	6	7	122	13,201	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4	5	125	13,607	0.0
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	15	20	299	32,350	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	21	29	985	106,554	0.4
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	19	22	189	20,444	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2	2	157	16,977	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	27	34	1,501	162,289	0.5
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22	26	702	75,923	0.3
CHESAPEAKE LODGING TRUST	10	—	—	—	—
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21	25	575	62,270	0.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26	32	1,195	129,221	0.4
CORESITE REALTY CORP	6	7	870	94,103	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6	9	450	48,732	0.2
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	18	21	263	28,506	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7	9	304	32,953	0.1
RLJ LODGING TRUST	29	35	613	66,281	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	20	23	398	43,049	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	19	29	927	100,293	0.3
SABRA HEALTH CARE REIT INC	30	40	847	91,581	0.3
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	37	43	572	61,896	0.2
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	36	42	1,287	139,175	0.5
WP CAREY INC	27	35	2,845	307,620	1.0
WHITESTONE REIT	7	8	118	12,837	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9	11	1,004	108,568	0.4
CHATHAM LODGING TRUST	7	9	164	17,736	0.1

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
TERRENO REALTY CORP	10	14	759	82,072	0.3
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14	20	1,009	109,140	0.4
CORECIVIC INC	19	25	406	43,974	0.1
GEO GROUP INC/THE	20	25	411	44,489	0.1
VEREIT INC	167	219	2,016	217,982	0.7
DUKE REALTY CORP	62	76	2,693	291,216	1.0
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	15	22	1,049	113,407	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST	31	37	705	76,250	0.3
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	43	52	1,368	148,001	0.5
CYRUSONE INC	18	23	1,536	166,099	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4	6	55	5,970	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	23	30	424	45,857	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	8	11	623	67,370	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	51	60	1,257	135,897	0.4
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	20	24	501	54,189	0.2
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29	39	136	14,793	0.0
CARETRUST REIT INC	15	19	408	44,157	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6	9	119	12,910	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34	42	1,820	196,766	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	17	18	261	28,264	0.1
IRON MOUNTAIN INC	49	58	1,804	195,039	0.6
STORE CAPITAL CORP	32	43	1,614	174,535	0.6
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	11	16	127	13,793	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	20	23	435	47,028	0.2
EQUINIX INC	—	17	10,312	1,114,910	3.7
PARAMOUNT GROUP INC	34	42	585	63,244	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	10	15	367	39,720	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	20	23	492	53,294	0.2
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9	12	412	44,619	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	3	4	195	21,132	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	37	42	683	73,842	0.2
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3	3	42	4,578	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	13	18	382	41,309	0.1
CITY OFFICE REIT INC	6	11	159	17,278	0.1
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	8	—	—	—	—
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4	6	273	29,561	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11	13	378	40,870	0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2	3	162	17,558	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	4	4	28	3,096	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	214	292	290	31,423	0.1
TIER REIT INC	9	—	—	—	—
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	5	—	—	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC	34	49	1,259	136,175	0.5
EQUITY RESIDENTIAL	63	72	5,886	636,383	2.1
COLONY CAPITAL INC	81	100	476	51,484	0.2

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
INVITATION HOMES INC	50	110	3,328	359,821	1.2	
JBG SMITH PROPERTIES	18	24	955	103,288	0.3	
CLIPPER REALTY INC	2	2	30	3,300	0.0	
GLADSTONE LAND CORP	2	4	51	5,615	0.0	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	3	7	102	11,128	0.0	
INFRAREIT INC	6	—	—	—	—	
VICI PROPERTIES INC	62	94	2,395	259,010	0.9	
AMERICOLD REALTY TRUST	9	39	1,384	149,686	0.5	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10	12	287	31,076	0.1	
SPIRIT MTA REIT	6	—	—	—	—	
RETAIL VALUE INC	2	3	113	12,316	0.0	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	14	262	28,363	0.1	
BRT APARTMENTS CORP	2	2	37	4,107	0.0	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	8	10	137	14,875	0.0	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1	2	178	19,325	0.1	
SAFEHOLD INC	1	2	108	11,753	0.0	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	9	21	277	29,984	0.1	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	5	16	418	45,281	0.1	
ARA US HOSPITALITY TRUST	—	97	83	9,070	0.0	
COREPOINT LODGING INC	—	7	74	8,092	0.0	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	—	4	74	8,088	0.0	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	—	202	111	12,011	0.0	
PRIME US REIT	—	111	108	11,700	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	128	149	2,696	291,506	1.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	25	32	1,965	212,461	0.7	
PUBLIC STORAGE	25	31	6,629	716,750	2.4	
SIMON PROPERTY GROUP INC	53	63	9,211	995,829	3.3	
VORNADO REALTY TRUST	29	32	2,157	233,265	0.8	
KIMCO REALTY CORP	73	87	1,737	187,825	0.6	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	23	28	6,026	651,542	2.2	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	26	30	1,560	168,679	0.6	
小 計	口 数 ・ 金 額	3,858	5,292	203,300	21,978,777	
	銘 柄 数 < 比 率 >	157	158	—	< 72.7% >	
(カナダ)			千カナダドル			
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3	4	211	17,575	0.1	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10	14	445	37,099	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11	16	893	74,405	0.2	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	14	18	264	22,019	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5	6	191	15,943	0.1	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23	29	612	51,035	0.2	
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4	6	195	16,294	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26	30	826	68,821	0.2	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9	12	623	51,914	0.2	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12	14	175	14,591	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6	9	152	12,684	0.0	

銘 柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		8	13	164	13,737	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV		16	—	—	—	—
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		3	5	365	30,418	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		8	12	195	16,315	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		8	12	162	13,504	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		2	4	80	6,722	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		21	30	423	35,271	0.1
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		8	13	214	17,882	0.1
SLATE RETAIL REIT - U		5	5	66	5,558	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		6	10	199	16,583	0.1
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA		2	—	—	—	—
SLATE OFFICE REIT		5	5	32	2,722	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		10	14	174	14,540	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		6	9	69	5,810	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		1	3	88	7,384	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	243	306	6,832	568,838	
	銘 柄 数 < 比 率 >	26	24	—	<1.9%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		25	32	540	65,218	0.2
HAMBORNER REIT AG		13	15	151	18,231	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	39	47	691	83,449	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		8	8	53	6,504	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	8	8	53	6,504	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)						
COVIVIO		1	—	—	—	—
GECINA SA		9	11	1,837	221,754	0.7
KLEPIERRE		35	43	1,496	180,597	0.6
COVIVIO		9	9	941	113,591	0.4
MERCIALYS		9	5	70	8,504	0.0
ICADEA		7	5	550	66,454	0.2
ALTAREA		0.575	0.785	159	19,232	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	73	75	5,055	610,135	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	6	—	<2.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV		7	8	217	26,302	0.1
NSI NV		3	3	163	19,729	0.1
VASTNED RETAIL NV		2	4	109	13,179	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		23	28	4,030	486,424	1.6
WERELDHAVE NV		6	7	161	19,507	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	43	52	4,682	565,142	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<1.9%>	

銘 柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		14	14	105	12,684	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		62	74	959	115,757	0.4
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		48	50	578	69,804	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	125	139	1,642	198,246	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.7%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		4	4	257	31,134	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		3	4	112	13,579	0.0
RETAIL ESTATES		1	2	182	22,061	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2	26	629	76,025	0.3
AEDIFICA		3	4	567	68,452	0.2
MONTEA		1	2	195	23,649	0.1
COFINIMMO		3	5	679	82,003	0.3
小 計	口 数 ・ 金 額	19	49	2,625	316,907	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<1.0%>	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		115	—	—	—	—
HIBERNIA REIT PLC		109	149	210	25,428	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		67	84	132	16,048	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	291	233	343	41,476	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	2	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	601	607	15,095	1,821,862	
	銘 柄 数 < 比 率 >	28	26	—	<6.0%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		167	195	1,229	173,876	0.6
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		47	55	472	66,830	0.2
HAMMERSON PLC		136	159	492	69,648	0.2
LAND SECURITIES GROUP PLC		128	154	1,530	216,465	0.7
INTU PROPERTIES PLC		160	201	66	9,386	0.0
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		130	244	390	55,209	0.2
SEGRO PLC		174	231	2,070	292,804	1.0
WORKSPACE GROUP PLC		21	26	318	44,981	0.1
SHAFTESBURY PLC		39	44	416	58,958	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC		26	30	368	52,155	0.2
DERWENT LONDON PLC		19	21	852	120,527	0.4
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		112	172	407	57,675	0.2
HANSTEEN HOLDINGS PLC		76	90	105	14,991	0.0
RDI REIT PLC		225	61	80	11,317	0.0
SAFESTORE HOLDINGS PLC		37	43	353	50,058	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC		261	351	520	73,662	0.2
ASSURA PLC		438	479	370	52,433	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		99	99	56	7,951	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		86	131	127	18,020	0.1
REGIONAL REIT LTD		51	78	88	12,508	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC		75	75	19	2,730	0.0

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		千口	千口	千イギリスポンド	千円	%
NEWRIVER REIT PLC		47	59	119	16,965	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		28	130	120	17,062	0.1
UNITE GROUP PLC/THE		43	74	939	132,848	0.4
LXI REIT PLC		65	99	139	19,748	0.1
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		107	176	156	22,081	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		68	68	63	8,914	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD		—	117	114	16,232	0.1
AEW UK REIT PLC		—	65	65	9,250	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	2,876	3,739	12,055	1,705,297	
	銘 柄 数 < 比 率 >	27	29	—	< 5.6% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		547	657	1,650	124,067	0.4
ABACUS PROPERTY GROUP		50	76	277	20,885	0.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP		38	47	234	17,596	0.1
CHARTER HALL GROUP		82	95	1,069	80,418	0.3
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		39	52	170	12,783	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP		294	384	453	34,127	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		153	196	535	40,239	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		48	55	235	17,723	0.1
NATIONAL STORAGE REIT		119	155	294	22,165	0.1
GDI PROPERTY GROUP		75	104	154	11,596	0.0
APN INDUSTRIA REIT		11	23	68	5,114	0.0
SCENTRE GROUP		912	1,099	4,264	320,597	1.1
ARENA REIT		45	68	198	14,916	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		24	24	77	5,793	0.0
VIVA ENERGY REIT		73	97	260	19,551	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		33	86	472	35,548	0.1
PROPERTYLINK GROUP		87	—	—	—	—
CENTURIA METROPOLITAN REIT		—	79	232	17,472	0.1
RURAL FUNDS GROUP		57	57	111	8,392	0.0
GPT GROUP		311	400	2,294	172,464	0.6
MIRVAC GROUP		631	819	2,629	197,693	0.7
STOCKLAND		415	502	2,346	176,433	0.6
DEXUS		173	225	2,683	201,709	0.7
BWP TRUST		85	100	397	29,891	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT		55	77	333	25,073	0.1
GOODMAN GROUP		276	330	4,465	335,712	1.1
小 計	口 数 ・ 金 額	4,646	5,818	25,910	1,947,973	
	銘 柄 数 < 比 率 >	25	25	—	< 6.4% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		49	78	223	16,086	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD		247	320	499	35,954	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		180	225	503	36,245	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		164	228	418	30,162	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		126	160	219	15,822	0.1

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)		千口	千口	千ニュージーランドドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP		69	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	836	1,014	1,863	134,270	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	5	—	<0.4%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		366	433	35,397	491,674	1.6
CHAMPION REIT		328	407	2,067	28,718	0.1
PROSPERITY REIT		178	239	731	10,158	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		231	305	1,613	22,410	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		163	198	1,011	14,053	0.0
FORTUNE REIT		239	295	2,666	37,041	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	1,505	1,877	43,488	604,057	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	<2.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		379	471	872	69,880	0.2
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		476	584	1,168	93,591	0.3
KEPPEL REIT		298	386	475	38,132	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		106	128	212	16,989	0.1
ASCOTT TRUST		214	359	478	38,331	0.1
ESR-REIT		346	458	249	20,005	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		128	174	284	22,817	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		96	150	424	33,977	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		232	272	197	15,836	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		391	676	1,169	93,710	0.3
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		97	156	248	19,888	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		94	119	119	9,591	0.0
AIMS APAC REIT		120	92	132	10,610	0.0
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		281	444	100	8,015	0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		66	76	253	20,332	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		212	303	792	63,473	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST		169	221	159	12,756	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		340	436	1,043	83,613	0.3
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		143	189	142	11,388	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		133	133	61	4,955	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		121	—	—	—	—
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC		361	436	501	40,177	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		105	153	81	6,523	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		—	504	282	22,639	0.1
QUE HOSPITALITY TRUST		249	—	—	—	—
SPH REIT		105	167	179	14,361	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		139	139	100	8,054	0.0
KEPPEL DC REIT		171	248	524	42,031	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI		279	306	376	30,208	0.1
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		—	130	115	9,271	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		484	578	1,417	113,609	0.4

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		442	619	1,846	147,976	0.5
小 計	口 数 ・ 金 額	6,786	9,120	14,011	1,122,753	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	30	—	<3.7%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		—	5	39,300	3,643	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	—	5	39,300	3,643	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.0%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD		28	34	710	22,074	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	28	34	710	22,074	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	21,385	27,814	—	29,909,549	
	銘 柄 数 < 比 率 >	306	305	—	<99.0%>	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2020年 1 月 6 日現在)

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

(注) 期末における外貨建純資産（29,993,436千円）の投資信託財産総額（30,416,007千円）に対する比率は98.6%です。

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

1 アメリカドル=108.11円	1 カナダドル=83.26円	1 ユーロ=120.69円	1 イギリスポンド=141.45円
1 オーストラリアドル=75.18円	1 ニュージーランドドル=72.04円	1 香港ドル=13.89円	1 シンガポールドル=80.13円
100韓国ウォン=9.27円	1 イスラエルシェケル=31.05円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月6日現在)

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

<注記事項>

- ①期首元本額 13,131,720,547円
 期中追加設定元本額 4,475,915,257円
 期中一部解約元本額 1,164,873,706円
 また、1口当たり純資産額は、期末18,377円です。

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

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

○損益の状況 (2019年1月8日~2020年1月6日)

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

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

eMAXIS マイマネージャー 1990s
合計

404,395円
16,442,762,098円

【お 知 ら せ】

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