

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	2060年1月26日まで(2017年10月2日設定)
運用方針	各マザーファンド受益証券への投資を通じて、マイライフサイクル指數1970sに連動する投資成果をめざして運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 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を行いません。
主要運用対象	<p>ベビーファンド</p> <p>TOPIXマザーファンド 東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。</p> <p>外国株式インデックスマザーファンド 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を主要投資対象とします。</p> <p>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。</p> <p>日本債券インデックスマザーファンド NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。</p> <p>外国債券インデックスマザーファンド FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に採用されている国債を主要投資対象とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な組入制限	<p>ベビーファンド 株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。</p> <p>TOPIXマザーファンド 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は行いません。</p> <p>外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。</p> <p>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。</p> <p>日本債券インデックスマザーファンド 外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>外国債券インデックスマザーファンド 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
分配方針	<p>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。</p> <p>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。)</p>

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

※公募株式投資信託は税法上、「NISA(少額投資非課税制度)」および「ジュニアNISA(未成年者少額投資非課税制度)」の適用対象です。

ファンドは「つみたてNISA(非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度)」の適用対象です。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書(全体版)

eMAXIS
イーマクシス

e MAXIS
マイマネージャー 1970s



第4期(決算日:2021年1月26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「eMAXISマイマネージャー1970s」は、去る1月26日に第4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。

MUFG

三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル
0120-151034
(受付時間:営業日の9:00~17:00、
土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客様のお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決算期 (分配落)	基準価額			マイライフサイクル指標 1970s 期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額 百万円
	税込み 分配金	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率							
(設定日) 2017年10月2日	円 10,000	円 —	% —	100.00	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 10
1期(2018年1月26日)	10,555	0	5.6	105.50	5.5	43.4	1.2	37.7	0.1	16.1
2期(2019年1月28日)	9,950	0	△ 5.7	99.50	△ 5.7	42.8	1.5	38.4	0.0	15.7
3期(2020年1月27日)	11,076	0	11.3	110.90	11.5	42.6	1.7	38.5	0.0	15.5
4期(2021年1月26日)	11,503	0	3.9	115.70	4.3	43.6	1.3	38.4	0.0	15.3

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) マイライフサイクル指數は、特定の年代の人に合わせイボットソン・アソシエイツ・ジャパンがe MAX I Sシリーズのファンドを参考して算出する指數であり、3つの想定生まれ年別指數の総称です。各指數は想定生まれ年における特定の年齢の統計データを基に、人的資本と金融資産を推計した上で、金融資産部分の目標リスク水準を決定しております。そのため個人の資産構成によっては、想定生まれ年に示されている指數とは違う指數が適合する場合があります。指數の目標リスク水準および資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。

*マイライフサイクル指標 1970sを算出するために参照したファンド

e MAX I S TOPIXインデックス、e MAX I S 先進国株式インデックス、e MAX I S 新興国株式インデックス、
e MAX I S 国内債券インデックス、e MAX I S 先進国債券インデックス、e MAX I S 新興国債券インデックス、
e MAX I S 国内リートインデックス、e MAX I S 先進国リートインデックス

(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、不動産投信指數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。

(注) 設定日の純資産額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基 準 価 額	マイライフサイクル指数 1970s		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 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%	%
2020年1月27日	11,076	—	110.90	—	42.6	1.7	38.5	0.0
1月末	11,007	△ 0.6	110.20	△ 0.6	42.4	1.2	38.3	0.0
2月末	10,511	△ 5.1	105.10	△ 5.2	42.0	1.0	40.9	0.2
3月末	9,443	△14.7	94.60	△14.7	42.6	1.8	38.4	0.0
4月末	9,826	△11.3	98.50	△11.2	43.8	1.4	37.7	0.0
5月末	10,130	△ 8.5	101.70	△ 8.3	42.2	2.5	38.1	0.0
6月末	10,243	△ 7.5	102.80	△ 7.3	43.1	1.2	38.7	0.0
7月末	10,323	△ 6.8	103.70	△ 6.5	42.8	1.3	38.8	0.0
8月末	10,705	△ 3.3	107.50	△ 3.1	43.7	1.7	38.1	0.0
9月末	10,544	△ 4.8	106.00	△ 4.4	42.8	1.6	38.5	0.1
10月末	10,384	△ 6.2	104.40	△ 5.9	42.8	1.0	39.3	0.0
11月末	11,070	△ 0.1	111.30	0.4	43.6	1.5	38.3	0.0
12月末	11,286	1.9	113.60	2.4	43.2	1.6	38.2	0.0
(期 末)								
2021年1月26日	11,503	3.9	115.70	4.3	43.6	1.3	38.4	0.0
								15.3

(注) 謄落率は期首比。

(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、不動産投信指數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4期：2020年1月28日～2021年1月26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4期首	11,076円
第4期末	11,503円
既払分配金	0円
騰落率	3.9%

※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3.9%の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（4.3%）を0.4%下回りました。

基準価額の主な変動要因**上昇要因**

主に先進国株式市況が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

組入ファンド	騰落率	組入比率（対純資産総額）
MUAM G-R EITマザーファンド	-13.9%	9.1%
新興国株式インデックススマザーファンド	22.3%	8.1%
東証REIT指数マザーファンド	-14.8%	6.0%
新興国債券インデックススマザーファンド	-4.2%	6.9%
TOPIXマザーファンド	11.2%	16.9%
外国株式インデックススマザーファンド	11.5%	20.1%
日本債券インデックススマザーファンド	-1.1%	24.9%
外国債券インデックススマザーファンド	4.3%	7.0%

第4期：2020年1月28日～2021年1月26日

▶ 投資環境について

▶ 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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

▶ 外国株式市況

外国株式市況は上昇しました。

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外国株式市況は下落する局面もありましたが、感染拡大後の潤沢な政府支援などが好感され外国株式市況は上昇しました。

▶ 新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

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新興国株式市況は下落する局面もありましたが、感染拡大後の潤沢な政府支援などが好感され新興国株式市況は上昇しました。

▶ 国内債券市況

国内債券市況は下落しました。

国内債券市況は、期の序盤に新型コロナ

ウイルスによる景気後退懸念などから上昇しましたが、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。その後はもみ合いで推移し、期を通して見ると国内債券市況は下落しました。

▶ 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、新型コロナウイルスの感染拡大ととともに影響が警戒されるなど、市場参加者のリスク回避姿勢が強まり下落しましたが、その後は各国での金融および財政支援策等を受け、経済回復期待や投資家心理の改善等を背景に上昇し、期を通じてみると上昇しました。

▶ 国内R E I T市況

国内R E I T市況は下落しました。

新型コロナウイルスの世界的流行を受け、国内R E I T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、新型コロナウィ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、香港ドルは円に対して下落、ユーロは円に対して上昇しました。

為替市況は、期首に比べて4.9%の円高・米ドル安、4.6%の円高・香港ドル安、4.7%の円安・ユーロ高となりました。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。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS マイマネージャー 1970s

日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券市場の値動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

資産配分方針は、マイライフサイクル指
数 1970sの資産クラス別比率を維持しま
した。

資産クラス別比率は以下の通りです。原
則年1回、目標リスク水準および資産ク
ラス別比率の変更を行います。

(ご参考)

■ ベンチマークの資産クラス別比率

マザーファンド	アセット	期首	期末
TOPIXマザーファンド	国内株式	17.0%	17.0%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	20.0%	20.0%
新興国株式インデックスマザーファンド	新興国株式	8.0%	8.0%
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	25.0%	26.0%
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	7.0%	7.0%
新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	8.0%	7.0%
東証REIT指数マザーファンド	国内REIT	6.0%	6.0%
MUAM G-REITマザーファンド	先進国REIT	9.0%	9.0%

► TOPIXマザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

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

► 外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等（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

► 日本債券インデックスマザーファンド

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（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。

► 外国債券インデックスマザーファンド

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、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。

▶ 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 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）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ポートフォリオを構築しました。

▶ 東証 R E I T 指数マザーファンド

資産のほぼ全額を不動産投資信託証券（R E I T）（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 R E I T 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。

▶ MUAM G – R E I T マザーファンド

ベンチマークである 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）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

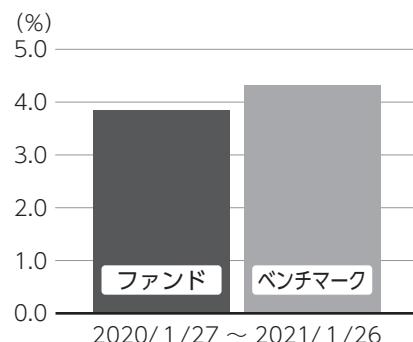
► eMAXIS マイマネージャー 1970s

基準価額の騰落率は3.9%の上昇となり、ベンチマークの騰落率（4.3%）を0.4%下回りました。
差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

資産配分要因	△0.5%程度
その他	0.1%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）



► TOP1X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：組入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。

► 外国株式インデックススマザーファンド

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：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：組入要因によるものです。

► 新興国株式インデックススマザーファンド

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：取引要因によるものです。

▶ 日本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：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：ありません。

▶ 外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：ポートフォリオ要因によるものです。

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した。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4期 2020年1月28日～2021年1月26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	1,944

(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。)

▶ eMAXIS マイマネージャー 1970s

資産配分方針は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが算出するマイライフサイクル指数 1970sの資産クラス別比率を維持します。

また、原則年1回、目標リスク水準および資産クラス別比率の変更を行い、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。

▶ TOPIXマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 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。

▶ 日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶ 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。

2020年1月28日～2021年1月26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	57	0.545	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（期中の日数÷年間日数）
(投信会社)	(25)	(0.239)	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)	(25)	(0.241)	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)	(0.066)	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	0.008	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株式)	(0)	(0.005)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.003)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c)有価証券取引税	1	0.010	(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)	(0.007)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.002)	
(d)その他費用	3	0.033	(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)	(2)	(0.021)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監査費用)	(0)	(0.003)	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
(その他の)	(1)	(0.008)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	62	0.596	

期中の平均基準価額は、10,496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。

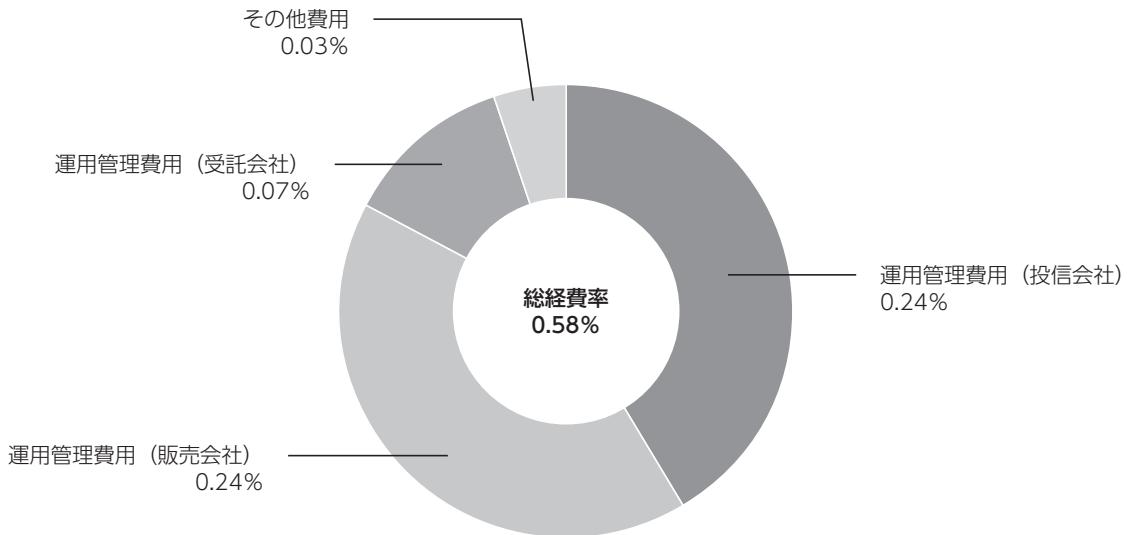
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.58%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2020年1月28日～2021年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定期		解約	
	口数	金額	口数	金額
MUAM G-R E I Tマザーファンド	千口 948	千円 1,333	千口 938	千円 1,426
新興国株式インデックススマザーファンド	361	812	504	1,279
東証R E I T指數マザーファンド	275	750	267	778
新興国債券インデックススマザーファンド	546	703	750	1,012
TOP I Xマザーファンド	1,169	1,941	1,495	2,659
外国株式インデックススマザーファンド	767	2,101	1,010	3,065
日本債券インデックススマザーファンド	2,813	3,797	3,100	4,187
外国債券インデックススマザーファンド	365	797	459	1,015

○株式売買比率

(2020年1月28日～2021年1月26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		
	新興国株式 インデックス マザーファンド	TOP I X マザーファンド	外国株式 インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	65,183,873千円	564,091,408千円	635,291,979千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	123,157,670千円	327,925,976千円	523,370,020千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.52	1.72	1.21

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年1月28日～2021年1月26日)

利害関係人との取引状況

<e MAXIS マイマネージャー 1970s>

該当事項はございません。

<MUAM G-R E I T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 17,212	百万円 778	% 4.5	百万円 3,611	百万円 21	% 0.6

平均保有割合 0.0%

※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		$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円			%	百万円	
為替直物取引	85,927	2,713	3.2	45,084	1,205	2.7		

平均保有割合 0.0%

※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ペーパ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		$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円			%	百万円	
投資信託証券	19,708	7,595	38.5	7,821	3,853	49.3		
不動産投信指数先物取引	14,004	11,154	79.6	13,572	10,223	75.3		

平均保有割合 0.0%

※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ペーパ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		$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円			%	百万円	
為替先物取引	1,194	268	22.4	1,188	291	24.5		
為替直物取引	20,352	4,411	21.7	12,151	2,733	22.5		

平均保有割合 0.0%

※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ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<TOPIX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		$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円			%	百万円	
株式	340,894	27,112	8.0	223,196	7,861	3.5		
貸付有価証券(株式)	563,098	246,699	43.8	539,549	242,116	44.9		

平均保有割合 0.0%

※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ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<外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		$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円			%	百万円	
為替直物取引	482,630	439,205	91.0	363,666	333,455	91.7		

平均保有割合 0.0%

※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ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<日本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		$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円			%	百万円	
公社債	364,188	128,992	35.4	659,555	143,082	21.7		

平均保有割合 0.0%

※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ペーパ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。

<外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		$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円			%	百万円	
為替直物取引	49,019	26,037	53.1	25,077	15,758	62.8		

平均保有割合 0.0%

※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ペーパ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

<TOPIXマザーファンド>

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	5,134	3,607	6,883

<日本債券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
公社債	2,718	3,331	1,847

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

<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 732

<TOPIXマザーファンド>

種類	買付額
株式	百万円 266

<日本債券インデックスマザーファンド>

種類	買付額
公社債	百万円 11,300

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)	1千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.043千円
(B) / (A)	2.7%

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2020年1月28日～2021年1月26日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 10	百万円 —	百万円 10	百万円 —	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2021年1月26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 價 額
MUAM G-R E I T マザーファンド	千口 894	千口 904	千円 1,485
新興国株式インデックスマザーファンド	556	414	1,331
東証R E I T 指数マザーファンド	307	316	981
新興国債券インデックスマザーファンド	1,024	820	1,133
TOPIXマザーファンド	1,656	1,330	2,773
外国株式インデックスマザーファンド	1,180	937	3,290
日本債券インデックスマザーファンド	3,325	3,038	4,089
外国債券インデックスマザーファンド	607	513	1,144

○有価証券の貸付及び借入の状況

TOPIXマザーファンドにおいて、2021年1月26日現在における貸付株数の総株数は27,445,800株です。
 うち利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券に対する貸付は、9,555,100株です。

○投資信託財産の構成

(2021年1月26日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
MUAM G-REITマザーファンド	千円 1,485	% 8.8
新興国株式インデックスマザーファンド	1,331	7.9
東証REIT指数マザーファンド	981	5.8
新興国債券インデックスマザーファンド	1,133	6.7
TOPIXマザーファンド	2,773	16.5
外国株式インデックスマザーファンド	3,290	19.6
日本債券インデックスマザーファンド	4,089	24.3
外国債券インデックスマザーファンド	1,144	6.8
コール・ローン等、その他	590	3.6
投資信託財産総額	16,816	100.0

(注) MUAM G-REITマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(42,873,765千円)の投資信託財産総額(42,956,640千円)に対する比率は99.8%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(196,611,579千円)の投資信託財産総額(197,189,115千円)に対する比率は99.7%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(37,764,052千円)の投資信託財産総額(37,807,817千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 外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(807,295,099千円)の投資信託財産総額(809,447,745千円)に対する比率は99.7%です。

(注) 外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(176,879,184千円)の投資信託財産総額(177,090,000千円)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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1アメリカドル=103.77円	1カナダドル=81.40円	1アルゼンチンペソ=1.19円	1メキシコペソ=5.16円
1ブラジルレアル=18.98円	100チリペソ=14.16円	100コロンビアペソ=2.89円	1ペルーヌエボソル=28.47円
1ウルグアイペソ=2.47円	1ドミニカペソ=1.79円	1ユーロ=125.90円	1イギリスポンド=141.88円
1イスラブラン=116.81円	1スウェーデンクローネ=12.52円	1ノルウェークローネ=12.14円	1デンマーククローネ=16.93円
1トルコリラ=14.00円	1チェコクロナ=4.81円	100ハンガリーフォリント=35.20円	1ポーランドズロチ=27.73円
1ロシアルーブル=1.38円	1ルーマニアレイ=25.83円	1オーストラリアドル=79.98円	1ニュージーランドドル=74.60円
1香港ドル=13.39円	1シンガポールドル=78.18円	1マレーシアリンギット=25.66円	1タイバーツ=3.46円
1フィリピンペソ=2.16円	100インドネシアルピア=0.74円	100韓国ウォン=9.43円	1ニュー台湾ドル=3.71円
1インドルピー=1.43円	1中国元=16.01円	1オフショア元=16.00円	1アラブディルハム=28.30円
1クウェートディナール=343.38円	1サウジアラビアリヤル=27.71円	1イスラエルシェケル=31.68円	1カタールリアル=28.46円
1南アフリカランド=6.80円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月26日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コレ・ローン等	16,816,830
MU AM G-R E I Tマザーファンド(評価額)	463,365
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,485,695
東証R E I T指数マザーファンド(評価額)	1,331,636
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	981,918
T O P I Xマザーファンド(評価額)	1,133,388
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	2,773,236
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	3,290,586
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	4,089,756
未収入金	1,144,449
未収入金	122,801
(B) 負債	423,007
未払解約金	374,734
未払信託報酬	48,000
その他未払費用	273
(C) 純資産総額(A-B)	16,393,823
元本	14,251,435
次期繰越損益金	2,142,388
(D) 受益権総口数	14,251,435口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,503円

<注記事項>

- ①期首元本額 16,794,259円
 期中追加設定元本額 9,268,775円
 期中一部解約元本額 11,811,599円
 また、1口当たり純資産額は、期末1,1503円です。

○損益の状況 (2020年1月28日～2021年1月26日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 10
支払利息	△ 10
(B) 有価証券売買損益	1,151,643
売買益	1,558,349
売買損	△ 406,706
(C) 信託報酬等	△ 103,257
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,048,376
(E) 前期繰越損益金	782,401
(F) 追加信託差損益金	311,611
(配当等相当額)	(931,928)
(売買損益相当額)	(△ 620,317)
(G) 計(D+E+F)	2,142,388
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	2,142,388
追加信託差損益金	311,611
(配当等相当額)	(940,746)
(売買損益相当額)	(△ 629,135)
分配準備積立金	1,830,777

- (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。

②分配金の計算過程

項目	2020年1月28日～ 2021年1月26日
費用控除後の配当等収益額	286,853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	761,523円
収益調整金額	940,746円
分配準備積立金額	782,401円
当ファンドの分配対象収益額	2,771,523円
1万口当たり収益分配対象額	1,944円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金額	－円

* 三菱U F J 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くださいか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

TOPIXマザーファンド

《第19期》決算日2020年3月25日

[計算期間：2019年3月26日～2020年3月25日]

「TOPIXマザーファンド」は、3月25日に第19期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指數先物取引等の買建額を加算し、または株価指數先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は、原則として高位を維持します。
主要運用対象	東京証券取引所第一部に上場されている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	東証株価指數 (TOPIX) (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		期騰落率	中騰落率			
15期(2016年3月25日)	円 13,743	% △12.5	% 1,905.92	% △12.5	% 98.2	% 1.9 220,801
16期(2017年3月27日)	15,678	14.1	2,174.27	14.1	98.8	1.0 296,391
17期(2018年3月26日)	17,551	11.9	2,433.96	11.9	98.1	1.1 275,958
18期(2019年3月25日)	16,939	△ 3.5	2,348.27	△ 3.5	99.3	1.4 245,020
19期(2020年3月25日)	15,695	△ 7.3	2,174.58	△ 7.4	95.4	4.2 244,088

(注) 東証株価指數（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數です。東証株価指數（TOPIX）（配当込み）（TOPIXといいます）の指數値およびTOPIXの商標は、東京証券取引所の知的財産権であり、株価指數の算出、指數値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	東 証 株 価 指 数		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率	(T O P I X) (配当込み)		
(期 首) 2019年3月25日	円 16,939	% —	2,348.27	% —	% 99.3
3月末	17,277	2.0	2,395.21	2.0	98.2
4月末	17,564	3.7	2,434.82	3.7	98.4
5月末	16,424	△ 3.0	2,275.96	△ 3.1	98.2
6月末	16,872	△ 0.4	2,338.89	△ 0.4	97.0
7月末	17,025	0.5	2,360.18	0.5	99.4
8月末	16,451	△ 2.9	2,280.58	△ 2.9	99.4
9月末	17,444	3.0	2,418.29	3.0	98.2
10月末	18,316	8.1	2,539.02	8.1	98.8
11月末	18,674	10.2	2,588.40	10.2	98.9
12月末	18,945	11.8	2,625.91	11.8	97.0
2020年1月末	18,539	9.4	2,569.77	9.4	99.5
2月末	16,635	△ 1.8	2,305.76	△ 1.8	98.4
(期 末) 2020年3月25日	15,695	△ 7.3	2,174.58	△ 7.4	95.4
					4.2

(注) 謄落率は期首比。

(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

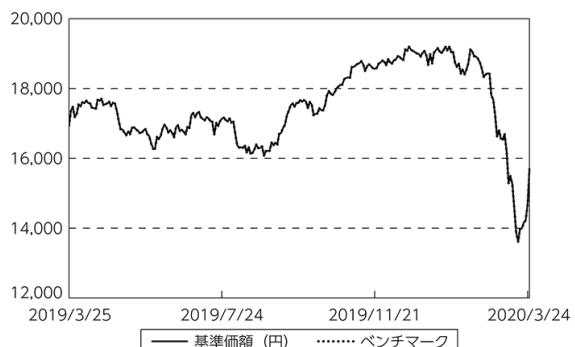
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ7.3%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率（-7.4%）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
(下落要因)

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

●投資環境について
◎国内株式市況

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。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは7.4%の下落になったため、カイ離は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)

- ・組入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3月26日～2020年3月25日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 （株式） (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.002 (0.001) (0.002)	(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) その他の費用 （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	0.002	
期中の平均基準価額は、17,480円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(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おります。

○売買及び取引の状況

(2019年3月26日～2020年3月25日)

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株 184,176 (3,018)	千円 357,845,063 (-)	千株 174,898	千円 331,603,466

(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 — (176,300)	千円 — (—)	証券 176,300	千円 705

(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 71,009	百万円 64,308	百万円 —	百万円 —

○株式売買比率

(2019年3月26日～2020年3月25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	689,448,530千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	285,158,518千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.41

(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3月26日～2020年3月25日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株式	百万円 357,845	百万円 36,155	% 10.1	百万円 331,603	百万円 45,912	% 13.8
新株予約権証券	—	—	—	0.7052	0.7052	100.0
貸付有価証券(株式)	486,941	309,245	63.5	486,281	322,181	66.3

利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 6,260	百万円 5,730	百万円 3,861

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 30

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)	6,392千円
うち利害関係人への支払額 (B)	119千円
(B) / (A)	1.9%

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MUF G証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

(2020年3月25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	4.7	5.5	14,646	
日本水産	146	157.6	77,696	
マルハニチロ	21.1	22.8	51,596	
カネコ種苗	4.4	4.8	5,716	
サカタのタネ	17.8	18.8	57,340	
ホクト	12.2	12	22,416	
ホクリヨウ	2	2.4	1,500	
鉱業 (0.2%)				
住石ホールディングス	31.4	31.8	3,943	
日鉄鉱業	3.3	3.6	15,516	
三井松島ホールディングス	6.1	6.1	5,746	
国際石油開発帝石	585.6	632.2	397,148	
石油資源開発	21	20.6	37,347	
K&Oエナジーグループ	7.1	7.7	11,342	
建設業 (2.7%)				
ヒノキヤグループ	3.1	3.9	5,534	
ショーボンドホールディングス	10.4	24.5	98,122	
ミライト・ホールディングス	41.1	46.8	62,010	
タマホーム	7	8.5	9,877	
サンヨーホームズ	2.1	1.4	957	
日本アクリア	3.5	6.3	3,817	
ファーストコーポレーション	4.5	4.8	2,208	
ベステラ	2.8	2.7	2,419	
TATERU	17.8	32.5	3,802	
キャンディル	—	1.4	610	
スペースバリューホールディングス	17.8	19.2	8,064	
ダイセキ環境ソリューション	2.8	3	2,583	
第一カッター興業	1.8	1.9	3,030	
明豊ファシリティワークス	—	3.8	1,926	
安藤・間	93.4	93.8	65,191	
東急建設	42.8	46.2	26,657	
コムシスホールディングス	51.8	55.9	149,420	
ミサワホーム	11.5	—	—	

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	11.9	17.2	8,531	
高松コンストラクショングループ	9.1	9.8	23,637	
東建コーポレーション	4.5	4.9	38,808	
ソネック	1.5	1.6	1,073	
ヤマウラ	5.6	6.8	6,167	
大成建設	119.9	121.4	404,262	
大林組	361.2	363.9	341,338	
清水建設	368.4	369.3	320,183	
飛島建設	10.3	10.4	10,868	
長谷工コーポレーション	150.6	140.9	172,602	
松井建設	13.3	14.3	9,266	
錢高組	1.5	1.6	4,952	
鹿島建設	282.3	285.7	326,269	
不動テトラ	8.3	9.5	12,160	
大末建設	4.3	4.2	3,397	
鉄建建設	7.3	7.9	17,585	
西松建設	26	28	61,208	
三井住友建設	86.9	87.9	43,510	
大豊建設	8.1	8.2	18,802	
前田建設工業	85.9	91.2	72,321	
佐田建設	7.8	7.8	2,480	
ナカノフード一建設	9.2	9.9	3,672	
奥村組	19.8	19.7	47,398	
東鉄工業	14.5	15.6	44,709	
イチケン	2.2	2.6	3,694	
富士ビー・エス	3.7	5.4	2,592	
淺沼組	4.3	4.1	17,609	
戸田建設	140	151.1	95,041	
熊谷組	17.2	16.9	43,872	
青木あすなろ建設	5.9	—	—	
北野建設	2.5	2.2	5,482	
植木組	1.5	1.6	3,843	
矢作建設工業	16.4	16.1	13,105	
ビーエス三菱	12.7	12	6,624	

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
日本ハウスホールディングス	23	24.8	7,291	太平電業	8.1	8.8	20,169
大東建託	42.9	43.6	454,312	高砂熱学工業	30.4	31.6	50,718
新日本建設	14.3	15.5	12,725	三晃金属工業	1.5	1.6	3,360
NIPPO	31.9	30.1	65,226	朝日工業社	2.5	2.4	7,560
東亜道路工業	2.3	2.3	7,003	明星工業	21.8	23.5	17,484
前田道路	37.7	38.5	88,781	大氣社	16.4	17.7	55,047
日本道路	3.3	3.5	22,890	ダイダン	8.1	8.7	24,499
東亜建設工業	10.5	11.3	16,385	日比谷総合設備	11.5	11.7	21,481
日本国土開発	—	26.6	13,805	東芝プラントシステム	26.1	—	—
若築建設	6.1	6.5	8,333	フィル・カンパニー	—	1.6	4,395
東洋建設	44.1	40.8	17,707	O S J B ホールディングス	53.2	57.4	13,833
五洋建設	143.2	144.3	77,922	東洋エンジニアリング	14.2	15.3	5,263
世紀東急工業	17.5	17.5	14,560	千代田化工建設	86.9	—	—
福田組	3.9	4.2	16,464	レイズネクスト	21.6	19.5	23,088
住友林業	85.4	92.2	126,129	食料品(4.1%)			
日本基礎技術	12.4	12.2	4,623	日本製粉	35.8	34.1	55,037
巴コーポレーション	15	16.2	5,378	日清製粉グループ本社	121.9	131.6	231,089
大和ハウス工業	333.5	360.1	974,970	日東富士製粉	0.8	0.8	4,584
ライト工業	23.1	20.8	25,979	昭和産業	9.9	10.7	33,651
積水ハウス	368.8	398.2	735,873	鳥越製粉	9.6	10.3	8,106
日特建設	10.3	9.5	6,973	中部飼料	13.2	14.2	18,332
北陸電気工事	5.8	6.3	6,224	フィード・ワン	72.5	78.2	12,042
ユアテック	19.3	20.8	12,188	東洋精糖	1.6	2	2,200
日本リーテック	—	6.8	10,744	日本甜菜製糖	6.1	6.1	10,888
四電工	1.8	2	4,630	三井製糖	8.5	10.2	20,665
中電工	15.5	14.7	32,251	塩水港精糖	11.7	12.6	2,658
関電工	54.8	51.8	44,030	日新製糖	5.1	5.5	11,088
きんでん	80.1	86.5	134,075	森永製菓	27.1	27.3	115,069
東京エネシス	12.4	12.1	8,978	中村屋	2.8	3	11,865
トーエネット	3.4	3.7	11,858	江崎グリコ	32.4	34.5	149,040
住友電設	8.3	10.3	21,630	名糖産業	5.2	5.6	7,784
日本電設工業	20.5	20	41,700	井村屋グループ	4.6	5	9,100
協和エクシオ	47.2	55.2	124,089	不二家	6	6.5	12,668
新日本空調	10.1	9.6	19,104	山崎製パン	88.2	87.3	172,766
九電工	23.8	25.5	71,247	第一屋製パン	1.9	2	1,800
三機工業	27.2	26.2	31,544	モロゾフ	1.8	2	10,160
日揮ホールディングス	103.7	112	100,688	亀田製菓	6.7	6.6	30,393
中外炉工業	3.4	3.9	5,814	寿スピリツ	11.4	11.2	55,440
ヤマト	10.8	11.6	6,786	カルビー	49.2	53.1	146,821

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円	
森永乳業	21.6	21.5	78,367		ニチレイ	56	55.5	143,911	
六甲バター	7.9	7.7	9,748		東洋水産	55.5	59.9	283,027	
ヤクルト本社	79.9	80.1	496,620		イートアンド	3.7	4	7,172	
明治ホールディングス	76.4	77	549,780		大冷	1.2	1.5	2,787	
雪印メグミルク	26	28	63,280		ヨシムラ・フード・ホールディングス	2.9	6.4	5,977	
プリマハム	15.2	18.2	41,459		日清食品ホールディングス	45.9	49.5	412,335	
日本ハム	46.6	44.5	167,765		永谷園ホールディングス	5.7	5.7	12,540	
林兼産業	3.6	3.9	2,074		一正蒲鉾	4.2	4.5	4,153	
丸大食品	11.5	12.4	23,684		フジッコ	11.7	12.6	24,544	
S Foods	9.7	9.3	20,311		ロック・フィールド	11.6	12.5	17,375	
柿安本店	—	4	8,924		日本たばこ産業	623	672.5	1,387,367	
伊藤ハム米久ホールディングス	69.5	75	47,325		ケンコーマヨネーズ	6	6.5	13,325	
サッポロホールディングス	39.4	39.7	78,447		わらべや日洋ホールディングス	7.1	7.6	12,129	
アサヒグループホールディングス	225.9	243.9	890,235		なとり	6	6.5	11,485	
キリンホールディングス	488	494	1,123,109		イフジ産業	1.9	2	1,552	
宝ホールディングス	80.8	86.3	69,298		ピックルスコーポレーション	2.6	2.5	5,440	
オエノンホールディングス	30.6	30.7	11,635		北の達人コーポレーション	42.4	40.7	22,995	
養命酒製造	3.3	3.6	6,976		ユーグレナ	46	49.7	35,038	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	82.6	81.7	179,740		ミヨシ油脂	4.1	4.5	4,405	
サントリー食品インターナショナル	72.2	77.9	318,611		理研ビタミン	5.1	5.5	23,045	
ダイドーグループホールディングス	6.1	6	21,000		繊維製品（0.5%）				
伊藤園	32.8	35.4	177,000		片倉工業	12.9	16.5	15,196	
キーコーヒー	10.6	11.4	26,790		グンゼ	7.1	8.3	30,502	
ユニカフェ	3	3	2,682		東洋紡	44.6	44.9	52,712	
ジャパンフーズ	1.5	1.7	2,080		ユニチカ	30.8	33.3	8,957	
日清オイリオグループ	13.9	15	49,950		富士紡ホールディングス	5.5	5.5	15,114	
不二製油グループ本社	26.3	28.4	72,618		倉敷紡績	10	11.3	26,069	
かどや製油	1.2	1.3	5,174		シキボウ	5.5	6	6,090	
J-オイルミルズ	5.6	6	25,740		日本毛織	34.6	37.4	32,425	
キッコーマン	71.2	83.8	387,994		ダイトイボウ	17	18.4	2,042	
味の素	238.3	257.2	480,835		トーア紡コーポレーション	4.5	4.5	1,912	
キューピー	60.1	64.9	135,705		ダイドーリミテッド	12.6	14.9	3,203	
ハウス食品グループ本社	41.2	43.6	145,188		帝国繊維	11.8	12.7	24,701	
カゴメ	43.2	44.2	119,251		帝人	85.9	92.7	162,595	
焼津水産化学工業	5.2	5.6	5,342		東レ	816.7	822.9	404,043	
アリアケジャパン	9.9	10.6	69,430		サカイオーベックス	2.6	3	5,262	
ピエトロ	1.4	1.5	2,472		住江織物	3.1	2.5	4,377	
エバラ食品工業	2.6	2.8	6,300		日本フエルト	6	6.4	2,848	
やまみ	—	0.7	1,169		イチカワ	1.5	1.6	2,110	

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
日東製綱	1,2	1,3	1,623	共和レザー	6.5	6.2	4,265
アツギ	8.7	9.4	5,931	昭和電工	69.9	80.9	180,487
ダイニック	4.3	4.4	3,000	住友化学	828.7	835	274,715
セーレン	25.9	27.9	34,763	住友精化	5.1	5	13,370
ソニー	4.2	4.5	4,275	日産化学	64.6	63.6	230,232
東海染工	1.4	1.6	1,822	ラサ工業	3.7	4	5,120
小松マテーレ	17.3	18.7	12,884	クレハ	9.7	9.7	44,911
ワコールホールディングス	30.7	29.7	71,131	多木化学	3.1	3.3	12,078
ホギメディカル	13.1	13	40,690	ティカ	8.6	8.3	11,777
レナウン	30.4	29.2	2,277	石原産業	20.2	20.4	11,424
クラウディアホールディングス	2.6	2.8	1,041	片倉コーブアグリ	3.1	2.9	3,335
T S I ホールディングス	38.8	38.1	15,316	日東エフシー	6.6	—	—
マツオカコーポレーション	3.3	3.3	5,520	日本曹達	16.6	16.8	43,663
ワールド	10.3	16.1	27,031	東ソー	162.7	175.7	222,611
三陽商会	6.3	5.9	8,602	トクヤマ	30.3	32.8	71,012
ナイガイ	3.8	4.1	1,693	セントラル硝子	22.9	23.2	45,773
オンワードホールディングス	63.2	68.3	32,032	東亞合成	66.1	71.3	65,382
ルックホールディングス	3.8	3.9	3,088	大阪ソーダ	11.3	11.6	29,000
キムラタン	51.9	59.3	1,304	関東電化工業	25	27	21,762
ゴールドワイン	9.5	20.6	132,252	デンカ	41.4	41.5	96,902
デサント	23.3	22.2	28,438	信越化学工業	185.5	195.2	2,119,872
キング	5.6	5.4	2,797	日本カーバイド工業	3.6	3.8	3,845
ヤマトイントナショナル	6.9	6.9	1,849	堺化学工業	7	7.3	12,745
パルプ・紙 (0.2%)				第一稀元素化学工業	8.6	12.3	9,655
特種東海製紙	6.7	7.2	25,380	エア・ウォーター	86.2	105.7	145,654
王子ホールディングス	473.9	475.1	254,653	大陽日酸	86.7	109.2	168,604
日本製紙	50.4	50.3	77,763	日本化学工業	3.6	3.5	8,141
三菱製紙	17.1	12.9	4,515	東邦アセチレン	1.6	1.7	2,176
北越コーポレーション	69.8	75.4	30,310	日本パーカライジング	57.5	57.3	60,967
中越バルブ工業	4.5	4.8	6,220	高圧ガス工業	16.7	18	12,420
巴川製紙所	3.5	3.4	2,278	チタン工業	1.3	1.4	2,398
大王製紙	51.3	49.8	72,210	四国化成工業	17.7	17.5	17,587
阿波製紙	2.7	2.9	1,284	戸田工業	2.2	2.6	3,393
レンゴー	108.6	107.4	83,879	ステラ ケミファ	6.2	6.2	15,376
トーモク	6.5	7	10,227	保土谷化学工業	3.7	4.2	12,339
ザ・パック	8	8.6	29,369	日本触媒	17.7	17.6	91,520
化学 (7.3%)				大日精化工業	8.7	10.1	21,199
クラレ	177.6	179	194,752	カネカ	28	29.4	79,497
旭化成	749	753.3	567,762	三菱瓦斯化学	108.3	105.7	133,287

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
三井化学	95.6	103.2	224,150	日華化学	3.5	3.8	2,751
J S R	105.7	105.9	194,008	ニイタカ	1.6	1.8	4,300
東京応化工業	18.1	19.5	75,952	三洋化成工業	7.1	6.8	27,132
大阪有機化学工業	9.7	10.5	15,267	有機合成薬品工業	8.1	8.7	2,053
三菱ケミカルホールディングス	703.8	759.8	516,360	大日本塗料	11.9	12.8	10,496
KHネオケム	16	20	31,340	日本ペイントホールディングス	86.9	93.8	483,070
ダイセル	163.5	155.5	123,622	関西ペイント	118.3	127.7	261,529
住友ベークライト	18.2	17.9	44,087	神東塗料	8.3	8.9	1,370
積水化学工業	230.1	244.4	344,604	中国塗料	34.6	32.4	27,313
日本ゼオン	94.9	102.5	84,460	日本特殊塗料	7.9	8.5	6,647
アイカ工業	31.6	34.1	99,640	藤倉化成	14.2	15.3	7,344
宇部興産	53.2	57.4	100,564	太陽ホールディングス	8.7	8.3	33,366
積水樹脂	17.4	20.5	41,451	D I C	47.6	48	111,840
タキロンシーアイ	22.8	24.6	14,784	サカタインクス	23	24.8	21,204
旭有機材	7.3	6.4	8,742	東洋インキS Cホールディングス	22.3	24	47,136
日立化成	48.7	48.9	224,206	T & K T O K A	8.2	8.8	6,476
ニチバン	5.5	6	9,282	富士フィルムホールディングス	223.3	222.5	1,092,030
リケンテクノス	28.7	28.6	10,839	資生堂	213.6	230.6	1,497,285
大倉工業	5.4	5.4	8,375	ライオン	149.7	150.9	307,081
積水化成品工業	15.7	15.2	8,542	高砂香料工業	7.4	7.3	13,519
群栄化学工業	2.7	2.6	6,237	マンダム	24.2	26.1	52,539
タイガースボリマー	5.5	6	2,706	ミルボン	13.3	15.5	82,150
ミライアル	3	4	3,664	ファンケル	47.9	47	117,970
ダイキアクシス	3.7	4	3,112	コーセー	18.2	21.8	296,698
ダイキヨーニシカワ	22.2	24	12,504	コタ	5.1	6.1	8,826
竹本容器	3.8	4.1	2,722	シーズ・ホールディングス	2.9	—	—
森六ホールディングス	5.7	6.1	9,363	シーポン	1.3	1.5	3,480
日本化薬	67	70.3	72,479	ボーラ・オルビスホールディングス	45.9	49.5	102,217
カーリットホールディングス	11.2	12.1	5,687	ノエビアホールディングス	6.8	11.1	59,052
日本精化	8.5	9.1	12,476	アジュバンコンスマジヤパン	2.4	2.6	2,407
扶桑化学工業	10.7	11.5	34,419	エステー	7.7	7.5	11,580
トリケミカル研究所	2.3	2.5	19,950	アグロ カネショウ	4.4	3.6	5,032
A D E K A	51.9	52.3	67,467	コニシ	19	19.1	25,574
日油	40.6	42.8	150,014	長谷川香料	12.8	15.4	29,044
新日本理化	19	18.8	2,970	星光P M C	7.2	6.6	4,224
ハリマ化成グループ	8.7	9.4	9,691	小林製薬	30.1	32.5	293,800
花王	261	277.9	2,382,158	荒川化学工業	9.6	10.4	12,168
第一工業製薬	3.9	4.2	15,834	メック	7.4	8	11,336
石原ケミカル	2.7	3.1	5,707	日本高純度化学	3	3.2	7,792

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
タカラバイオ	千株	千株	千円	ビオフェルミン製薬	千株	千株	千円
J C U	28.1	30.4	62,897	1.8	2	4,558	
新田ゼラチン	13.9	14.1	33,219	中外製薬	112.1	121	1,395,130
O A Tアグリオ	6.7	7.3	4,066	科研製薬	19.4	19.9	97,410
デクセリアルズ	1.5	2	1,990	エーザイ	128.7	138.9	1,054,667
アース製薬	27.7	29.9	21,258	ロート製薬	55.1	59.6	183,270
北興化学工業	8.1	8.7	45,849	小野薬品工業	253.9	266.5	609,219
大成ラミック	11	11.9	6,283	久光製薬	31.8	30.7	152,732
クミアイ化学生業	3.5	3.8	9,450	持田製薬	8.1	16.1	66,895
日本農薬	44.4	48	36,240	参天製薬	203.8	216.2	394,565
アキレス	25.7	20.7	8,217	扶桑薬品工業	3.8	4.1	7,974
有沢製作所	7.8	8	11,456	日本ケミファ	1.4	1.5	3,487
日東電工	16.9	18.3	14,969	ツムラ	406.107	33.3	36
レック	81.2	80.1	33.106	日医工	27.6	32.9	93,996
三光合成	11.5	12.4	2,679	キッセイ薬品工業	19	20.5	42,770
きもと	9.2	13.3	3,551	生化学工業	20.9	22.5	50,922
藤森工業	18.3	19.7	2,679	榮研化学	20.9	22.5	24,030
前澤化成工業	9.6	10.4	27,934	日水製薬	18.9	20.4	37,332
未来工業	7.4	7.4	7,274	鳥居薬品	4.5	4.9	6,125
ウェーブロックホールディングス	5.8	6.2	11,891	J C R フィアーマ	5.8	7.3	18,257
J S P	2.2	4	2,132	東和薬品	7.6	8.2	71,750
エフピコ	6.3	6.8	9,649	富士製薬工業	5.2	14.8	32,412
天馬	8.9	12.8	87,040	沢井製薬	7.3	7.9	9,061
信越ポリマー	7.4	7.7	13,598	ゼリア新薬工業	22.1	23.8	135,660
東リ	19.3	20.8	16,868	第一三共	21.3	21.1	41,166
ニフコ	26.8	28.9	7,571	キョーリン製薬ホールディングス	307.6	332.1	2,399,090
バルカー	43.1	42.6	86,307	大幸薬品	23.7	25.6	39,792
ユニ・チャーム	8.7	9.4	16,299	ダイト	4.8	4.7	20,492
ショーエイコーポレーション	227.9	223.7	821,426	大塚ホールディングス	6.3	6.9	19,389
医薬品(6.39%)	0.6	1.3	967	大正製薬ホールディングス	204.8	221.1	873,345
協和キリン	134.7	116.7	273,078	ペプチドリーム	24.1	24.5	155,330
武田薬品工業	938.4	965.5	3,229,597	石油・石炭製品(0.5%)	53.6	58.7	238,028
アステラス製薬	991.1	1,020.8	1,691,465	日本コーカス工業	13.7	13.7	6,076
大日本住友製薬	79.7	86	122,464	昭和シェル石油	—	—	—
塩野義製薬	140.6	148.4	747,490	ニチレイ	51.5	13.7	18,851
田辺三菱製薬	112.4	—	—	ユシロ化学工業	3.8	6.5	7,559
わかもと製薬	12.8	13.8	3,312	ビーピー・カストロール	26.1	4.1	4,879
あすか製薬	13.3	13.2	14,190	富士石油	103.9	31	6,231
日本新薬	28.1	30.4	228,000	M O R E S C O	3.9	4.2	3,603
				出光興産	130.5	130.5	346,347

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
	千株	千株	千円
J X T G ホールディングス	1,808	1,745.8	674,577
コスマエネルギーホールディングス	31.1	33.6	54,028
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	62.2	67.2	98,582
TOYO TIRE	55.2	66.6	80,785
ブリヂストン	330.4	334.3	1,139,963
住友ゴム工業	96.6	104.2	108,889
藤倉コンポジット	9.4	10.1	3,747
オカモト	7.5	7.1	26,412
フコク	4.7	5.1	3,411
ニッタ	12.1	13.1	26,750
住友理工	20.8	22.5	13,207
三ツ星ベルト	14.1	15.3	19,721
パンドー化学	20.5	20.4	12,852
ガラス・土石製品 (0.8%)			
日東紡績	16	17.3	79,493
AGC	106.3	114.7	320,013
日本板硝子	51.4	55.5	21,201
石塚硝子	1.8	2.1	4,269
日本山村硝子	4.5	4.8	4,243
日本電気硝子	46.5	46.6	70,645
オハラ	4.2	4.6	4,107
住友大阪セメント	21.7	22	77,000
太平洋セメント	67.9	73.3	155,615
日本ヒューム	10.8	11.6	7,180
日本コンクリート工業	23.1	25	6,600
三谷セキサン	5	5.4	22,032
アジアパイルホールディングス	15.2	16.5	6,864
東海カーボン	97.6	121.6	109,804
日本カーボン	5.1	6	19,230
東洋炭素	6.3	6.8	10,710
ノリタケカンパニーリミテド	6.4	6.4	21,696
TOTO	82.7	82.9	314,191
日本碍子	131.2	141.6	215,940
日本特殊陶業	90.6	90.3	141,951
ダントーホールディングス	9	8.6	645
MARUWA	3.7	4.5	29,115
品川リフラクトリーズ	2.8	3.1	7,281
黒崎播磨	2.1	2.3	10,304

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
	千株	千株	千円
ヨータイ	9.4	9.2	5,796
イソライト工業	5.5	6	2,844
東京窯業	13.7	14.7	3,704
ニッカトー	4.9	5.2	2,875
フジミインコーポレーデッド	9.6	10.3	26,769
クニミネ工業	3.6	4.7	4,615
エーアンドエーマテリアル	2.1	2	2,284
ニチアス	29.4	31.8	67,066
ニチハ	14.9	16.1	33,294
鉄鋼 (0.6%)			
日本製鉄	493.9	513.6	557,256
神戸製鋼所	194.6	210	82,110
中山製鋼所	14.7	15.9	6,264
合同製鐵	5.1	6.2	13,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	287.1	309.9	262,175
東京製鐵	56.9	55.9	37,117
共英製鋼	12	12.9	17,634
大和工業	22.6	24.4	47,799
東京鐵鋼	4.4	4.7	5,405
大阪製鐵	7.1	6.1	7,448
淀川製鋼所	14.4	15.5	28,070
丸一鋼管	37.6	37.3	102,761
モリ工業	3.2	3.4	7,480
大同特殊鋼	17.4	18.8	67,210
日本高周波鋼業	3.9	4.2	1,570
日本冶金工業	87.9	9.5	15,941
山陽特殊製鋼	13.4	7.9	8,097
愛知製鋼	6	6.4	19,648
日立金属	114.5	123.6	146,589
日本金属	2.5	2.7	1,809
太平洋金属	7.2	7.8	13,423
新日本電工	63.7	73.9	10,863
栗本鑄工所	5.4	5.7	10,562
虹技	1.6	1.7	1,723
日本鋳鉄管	1.1	1.2	1,634
三菱製鋼	7.9	8.5	6,587
日亜鋼業	15.5	16.8	4,737
日本精線	1.5	1.9	6,346
エンピプロ・ホールディングス	3	4.9	2,636

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
シンニッタン	16.5	17.8	4,165	横河ブリッジホールディングス	19.8	21.3	38,318
新家工業	2.4	2.6	3,049	駒井ハルティック	2	2.1	3,103
非鉄金属 (0.79%)				高田機工	1	1	2,360
大紀アルミニウム工業所	17.5	18.9	10,962	三和ホールディングス	109.8	110.1	93,034
日本軽金属ホールディングス	289.6	290.4	51,400	文化シヤッター	31.3	33.8	26,735
三井金属鉱業	28.7	31	59,055	三協立山	14.7	14.8	15,332
東邦亜鉛	5.9	5.9	7,864	アルインコ	8.4	8.3	7,669
三菱マテリアル	70.2	75.8	170,777	東洋シヤッター	2.6	2.8	1,708
住友金属鉱山	145.6	146.7	350,759	LIXILグループ	156.8	169.3	224,999
DOWAホールディングス	24.8	29	86,072	日本フィルコン	8.1	8.8	3,986
古河機械金属	17.5	20.4	22,970	ノーリツ	23.7	23.8	26,037
エス・サイエンス	47	50.7	1,723	長府製作所	10.8	11.7	26,617
大阪チタニウムテクノロジーズ	12.3	11.9	11,888	リンナイ	18.9	22.3	163,013
東邦チタニウム	19	20.5	13,940	ダイニチ工業	5.7	6.2	3,862
UACJ	16.1	17.4	28,918	日東精工	14.7	15.8	7,236
CKサンエツ	2	2.4	6,624	三洋工業	1.4	1.5	2,550
古河電気工業	30.7	35.6	71,627	岡部	21.5	23.3	16,426
住友電気工業	397.4	429.1	502,261	ジークット	11.7	14.2	16,159
フジクラ	128.4	138.6	43,104	中国工業	1.6	—	—
昭和電線ホールディングス	12.3	13.3	14,191	東プレ	19.8	21.4	26,578
東京特殊電線	1.4	1.7	4,309	高周波熱練	20.5	22.1	14,563
タツタ電線	21.1	22.7	10,669	東京製綱	6.5	8.2	4,920
カナレ電気	1.8	1.9	2,831	サンコール	6	6.4	2,822
平河ヒューテック	4.4	4.3	3,870	モリテック スチール	8.3	8.9	2,429
リヨービ	13.1	14.1	18,033	パイオラックス	17	17	25,483
アーレスティ	13.1	15	5,535	エイチワン	10.4	11.3	5,898
アサヒホールディングス	20	20.1	47,817	日本発條	105.9	123.1	89,863
金属製品 (0.59%)				中央発條	1.3	1.4	3,547
稻葉製作所	6	6.5	7,865	アドバネクス	1.4	1.6	2,188
宮地エンジニアリンググループ	3.2	3.5	5,943	立川ブラインド工業	4.7	5	5,155
トーカロ	27.4	31.9	30,655	三益半導体工業	9.5	9	15,426
アルファCo	3.7	4	3,884	機械 (5.09%)			
SUMCO	117.5	137.4	194,970	日本ドライケミカル	2.9	2.8	3,987
川田テクロロジーズ	2.4	2.3	12,604	日本製鋼所	32.2	34.8	43,813
R S T e c h n o l o g i e s	2.1	3.2	6,896	三浦工業	46	49.7	174,695
信和	4.3	4.9	3,934	タクマ	38.8	38.9	44,501
東洋製罐グループホールディングス	67.7	73.1	95,687	ツガミ	23.9	23.8	18,183
ホッカンホールディングス	5.4	6.3	10,508	オークマ	13.5	13.4	50,451
コロナ	5.9	6.3	6,111	東芝機械	12	13	29,055

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
アマダホールディングス	164	145.9	132,623	ユニオンツール	4.6	4.3	10,805
アイダエンジニアリング	29.5	30	21,210	オイレス工業	14.9	14.8	19,654
滝澤鉄工所	3.3	3.6	3,938	日精エー・エス・ビー機械	3.1	3.9	12,577
F U J I	31.8	49.3	81,838	サトーホールディングス	12.8	16.4	34,702
牧野フライス製作所	12.5	13.5	41,580	技研製作所	7.4	10.1	36,713
オーエスジー	52.4	53	79,341	日本エアーテック	3.3	3.6	2,829
ダイジェット工業	1.2	1.3	1,560	カワタ	2.2	3.4	2,482
旭ダイヤモンド工業	27.9	30.1	14,508	日精樹脂工業	8.9	9.6	9,254
DMG森精機	67.3	72.6	74,560	オカダアイヨン	3.6	3.6	3,279
ソディック	23.2	27	17,820	ワイエイシイホールディングス	4.2	4.9	2,077
ディスコ	14.4	15.5	345,340	小松製作所	486.7	525.6	1,000,479
日東工器	5.8	6.3	10,514	住友重機械工業	61.5	66.4	138,975
日進工具	3.1	3.4	8,330	日立建機	43.1	46.5	114,111
パンチ工業	7.4	10.4	4,409	日工	2.9	15.9	9,810
富士ダイス	4.7	5	3,100	巴工業	4.6	4.9	9,172
豊和工業	5.9	6.3	3,937	井関農機	10.7	11.6	13,061
O K K	4.4	4.7	2,185	TOWA	9.2	11.7	8,927
石川製作所	2.6	2.8	3,455	丸山製作所	2.3	2.5	2,697
東洋機械金属	7.6	8.2	3,304	北川鉄工所	4.8	5.2	8,320
津田駒工業	2.3	2.2	1,782	ローツェ	4.7	5.1	16,243
エンシュウ	2.8	2.9	2,734	タカキタ	3.7	4	1,872
島精機製作所	14.7	18.5	28,786	クボタ	575.9	615.7	809,953
オプトラン	10.4	12.8	33,510	荏原実業	3.1	2.9	6,107
N C ホールディングス	3.4	3.5	1,897	三菱化工機	3.7	4	6,560
イワキポンプ	3.5	5.5	4,647	月島機械	21.3	21.4	27,220
フリュー	8.5	11.2	9,968	帝国電機製作所	7.5	9.6	12,163
ヤマシンフィルタ	18.5	24.9	18,550	東京機械製作所	4.2	4.7	1,132
日阪製作所	13.1	14.2	10,706	新東工業	25.5	27.5	20,295
やまびこ	20.6	22.2	17,271	瀧谷工業	9.4	10.1	23,745
平田機工	5	5.4	25,191	アイチ コーポレーション	18.6	20	12,980
ベガサスミシン製造	9.9	11.6	4,152	小森コーポレーション	29.1	29.4	22,285
マルマエ	2.9	4.4	3,058	鶴見製作所	8.4	9	17,604
タツモ	3.3	5.4	5,842	住友精密工業	1.8	1.7	3,665
ナブテスコ	58.5	67.6	172,650	日本ギア工業	—	3.5	850
三井海洋開発	11.3	12.2	16,775	酒井重工業	2	2.2	5,381
レオン自動機	10.4	11.3	13,119	荏原製作所	47.6	48	100,512
SMC	31.5	36.4	1,668,576	石井鐵工所	1.6	1.5	3,399
ヤマハモーターロボティクスホールディング	8	9.3	6,909	西島製作所	11	11.7	9,231
ホソカワミクロン	3.7	4	18,480	北越工業	11.1	12	12,336

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
ダイキン工業	146.7	147.8	2,075,112	大豊工業	8.8	9.5	5,101
オルガノ	3.9	4.2	22,848	日本精工	220.8	218.5	162,564
トヨーカネツ	4	5	10,165	N T N	231	268.6	56,674
栗田工業	58.2	62.8	158,130	ジェイテクト	103.1	111.3	91,377
椿本チエイン	14.1	16.6	41,599	不二越	10	10.8	31,568
大同工業	5.1	5.5	3,668	日本トムソン	31.9	34.4	13,209
木村化工機	8.9	9.6	4,406	T H K	67	67.5	155,452
アネスト岩田	16.7	18	16,092	ユーシン精機	8.3	9	6,075
ダイフク	59.2	59.3	380,113	前澤給装工業	4.2	4.2	8,295
サムコ	3	3.2	5,344	イーグル工業	13.3	14.3	10,796
加藤製作所	5.5	6.3	7,534	前澤工業	7.2	7.7	2,340
油研工業	1.8	2	3,092	日本ピラー工業	10.9	11.7	14,274
タダノ	51.9	56	43,512	キッツ	43.6	47	28,764
フジテック	39.1	42.2	60,303	マキタ	130.8	151.3	500,046
C K D	29.9	32.3	47,739	日立造船	85.2	92	32,752
キトー	8.1	8.8	8,984	三菱重工業	180.1	194.5	576,011
平和	30	32.4	66,128	I H I	82.6	83.6	127,322
理想科学工業	9.5	10.2	16,258	スター精密	18.3	17.9	19,922
S ANK YO	26.9	25.8	81,915	電気機器 (14.2%)			
日本金錢機械	11.9	12.8	7,296	日清紡ホールディングス	59.7	77.3	55,192
マースグループホールディングス	6.8	7.4	12,535	イビデン	65.8	71.1	162,108
フクシマガリレイ	6.6	7.2	24,264	コニカミノルタ	234.9	253.5	121,680
オーイズミ	4.5	4.9	1,857	プラザー工業	140	141.7	236,213
ダイコク電機	4.9	5.3	6,312	ミネベアミツミ	199.5	215.4	354,763
竹内製作所	18	19.4	26,675	日立製作所	483.9	557.6	1,788,223
アマノ	30.7	30.4	76,334	三菱電機	1,074.9	1,160.4	1,544,492
J U K I	15	16.1	9,257	富士電機	69.8	69.9	172,583
サンデンホールディングス	13.1	15.2	5,988	東洋電機製造	4.2	4.2	4,872
蛇の目ミシン工業	9.8	10.6	3,243	安川電機	124.6	124.9	384,067
マックス	16.5	17.7	28,408	シンフォニアテクノロジー	14.9	15	14,325
グローリー	29.8	29.8	72,563	明電舎	21.3	21.3	34,506
新晃工業	10	10.8	15,087	オリジン	2.9	3.1	4,333
大和冷機工業	15.5	16.8	15,405	山洋電気	5.2	5.6	23,016
セガサミーホールディングス	106.6	115.1	150,090	デンヨー	9.9	9.9	18,582
日本ピストリング	3.9	4.2	5,329	東芝テック	13.5	14.5	50,387
リケン	5	5.4	14,558	芝浦メカトロニクス	1.9	2.1	5,420
T P R	14.5	15.6	19,921	マブチモーター	29.7	32.1	103,522
ツバキ・ナカシマ	16.3	23.7	16,590	日本電産	129.3	139.6	1,563,520
ホシザキ	31.4	33.9	308,829	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5.8	7	1,694

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
トレックス・セミコンダクター	千株	千株	千円	能美防災	千株	千株	千円
東光高岳	3.6	6.6	6,652	ホーチキ	14.2	15.3	28,978
ダブル・スコープ	5.4	6.5	6,233	星和電機	6.8	8.4	10,458
宮越ホールディングス	15.7	18.3	8,967	エレコム	4.3	5.7	3,117
ダイヘン	4	4.3	2,377	バナソニック	10	12.8	47,744
田淵電機	11.8	12.7	36,156	シャープ	1,228	1,325.9	1,117,601
ヤーマン	14.9	—	—	アンリツ	106.6	134.3	155,922
J V C ケンウッド	15.6	18.9	11,793	富士通ゼネラル	69.2	74.7	149,400
ミマキエンジニアリング	82.1	94.5	18,994	ソニー	32.8	31.5	59,346
第一精工	9.6	10.4	4,232	T D K	721	733.9	4,770,350
日新電機	4.5	4.7	8,638	帝国通信工業	56.2	56	501,200
大崎電気工業	25.2	27.2	23,963	タムラ製作所	4.7	5.1	5,865
オムロン	21.4	23.1	12,104	アルプスアルパイン	29.4	38.8	15,636
日東工業	114.2	104	612,560	池上通信機	111.9	102.7	114,715
I D E C	17.2	17	29,427	日本電波工業	3.4	3.7	3,189
正興電機製作所	14.4	16.8	22,646	鈴木	9.7	10.5	3,612
不二電機工業	1.9	2.7	2,546	日本トリム	5.8	5.7	3,534
ジース・ユアサ コーポレーション	38.6	38.7	60,642	ローランド ディー. ジー.	2	1.6	4,681
サクサホールディングス	2.7	2.7	3,960	フォスター電機	5.5	6.4	7,692
メルコホールディングス	4.5	4	8,404	SMK	12.6	12.2	13,432
テクノメディカ	2.4	2.6	4,737	ヨコオ	3	3	6,876
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	—	1.9	921	ティアック	7.7	7.5	17,992
日本電気	139.1	140.8	558,272	ホシデン	7.7	8.3	1,369
富士通	103.6	111.9	1,066,183	ヒロセ電機	31.6	31.7	23,870
沖電気工業	46.6	47.1	50,302	日本航空電子工業	15.4	18	199,980
岩崎通信機	5	5.1	4,131	T O A	24.6	26.6	34,260
電気興業	5.6	5.6	14,134	マクセルホールディングス	11.5	12.4	9,647
サンケン電気	12.6	12.7	27,635	古野電気	23.1	25	29,675
ナカヨ	2.1	2.2	3,229	ユニデンホールディングス	13.8	14.9	12,083
アイホン	6.1	6.6	9,893	スミダコーポレーション	3.2	3.2	5,884
ルネサスエレクトロニクス	111.4	554.6	240,141	アイコム	9.2	8.9	6,141
セイコーエプソン	133.4	144	181,440	リオン	5.9	6.4	16,083
ワコム	77.8	78	24,024	本多通信工業	4.9	4.9	11,000
アルパック	21.4	21.3	59,448	船井電機	9.2	9.9	3,920
アクセル	4.5	4.8	2,812	横河電機	10.9	11.7	5,370
E I Z O	9.9	9	27,810	新電元工業	107.6	106.5	141,112
ジャパンディスプレイ	254.2	335.4	16,434	アズビル	3.8	4.1	10,389
日本信号	27.4	29.5	32,922	東亜ディーケーケー	69.4	73.2	198,079
京三製作所	23.1	27.2	12,403	日本光電工業	5.3	5.7	5,158

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
チノー	3.7	4	4,880	ローム	52	51.5	336,810
共和電業	11.2	12.1	4,598	浜松ホトニクス	77.1	83.2	348,192
日本電子材料	4.2	4.6	4,025	三井ハイテック	11.9	12.8	14,681
堀場製作所	21.3	23	125,350	新光電気工業	36.1	39	40,404
アドバンテスト	73.3	86.3	394,391	京セラ	163.8	163.3	1,050,508
小野測器	5	4.8	2,328	太陽誘電	47.8	51.6	150,052
エスペック	9.5	10.3	17,314	村田製作所	112.8	340.9	1,878,359
キーエンス	52.8	105.2	3,634,660	ユーシン	15	—	—
日置電機	5.6	6.1	18,208	双葉電子工業	17.6	18.3	18,318
システムズ	83.8	82.9	597,957	北陸電気工業	4	4.7	4,230
日本マイクロニクス	17.4	20.2	15,816	ニチコン	33.8	39.3	26,291
メガチップス	8.5	10.8	17,031	日本ケミコン	7.6	8.8	11,325
OBARA GROUP	6.3	6	14,160	KOA	16.2	17.5	15,697
澤藤電機	1.3	1.4	1,960	市光工業	16.1	17.3	8,131
原田工業	3.3	5.5	4,999	小糸製作所	64.4	69.5	243,597
コーセル	13.7	15.4	14,322	ミツバ	19.8	21.3	9,734
イリゾ電子工業	9.8	9.7	31,185	S C R E N ホールディングス	18.6	20.1	85,123
オブテックスグループ	18.9	19	19,570	キヤノン電子	9.9	12.2	19,032
千代田インテグレ	4.5	5.4	8,969	キヤノン	578.7	624.7	1,548,631
アイ・オー・データ機器	4	3.7	3,034	リコー	323.2	295.2	260,956
レーザーテック	22	51	270,300	象印マホービン	20	34	52,258
スタンレー電気	76	81.6	178,622	MUTOH ホールディングス	1.5	1.6	2,638
岩崎電気	4.2	4.5	5,566	東京エレクトロン	71.7	77.4	1,638,558
ウシオ電機	65.2	67.4	75,151	輸送用機器 (7.6%)			
岡谷電機産業	7.6	9.1	2,857	トヨタ紡織	37.6	33.8	44,379
ヘリオス テクノ ホールディング	9.9	10.7	2,931	芦森工業	2.2	2.4	2,311
エノモト	2.2	3.5	2,926	ユニプレス	20.8	22.5	22,725
日本セラミック	10.9	11.8	22,384	豊田自動織機	87	93.9	487,341
遠藤照明	5.4	5.9	3,315	モリタホールディングス	18.8	20.3	33,312
古河電池	7.7	8.3	4,681	三櫻工業	13.6	14.7	10,907
双信電機	5.2	5.6	1,993	デンソー	236.7	255.5	928,231
山一電機	7.8	8.4	12,339	東海理化電機製作所	28.3	30.6	42,962
図研	7	7.5	15,727	三井E & S ホールディングス	38.8	41.9	24,218
日本電子	21.2	22.9	59,173	川崎重工業	83.6	90.3	156,489
カシオ計算機	95.1	102.7	153,331	名村造船所	32.3	37.3	7,609
ファナック	102.1	110.3	1,694,759	サノヤスホールディングス	14.1	14.1	2,115
日本シエムケイ	27.4	27.3	12,312	日本車輌製造	3.9	4.2	10,697
エンプラス	4.9	5.9	13,457	三菱ロジスネクスト	12.8	15.4	13,952
大真空	3.9	4.2	6,274	近畿車輛	1.6	1.7	1,973

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
日産自動車	1,267.7	1,368.6	548,945	愛三工業	16.8	18.2	8,845
いすゞ自動車	339.8	336.2	258,874	盟和産業	1.6	1.8	1,580
トヨタ自動車	1,197.9	1,294.8	8,958,721	日本プラスチ	8.4	9.1	4,322
日野自動車	134.2	144.9	91,576	ヨロズ	10	10.8	11,804
三菱自動車工業	397.9	429.5	143,023	エフ・シー・シー	19.3	19	30,875
エフテック	7.5	8.1	3,912	シマノ	43.3	43.4	636,678
レシップホールディングス	3.8	4.5	1,930	ティ・エス・テック	25	26.9	69,402
GMB	2.1	2.1	1,266	ジャムコ	5.4	5.8	4,239
ファルテック	1.9	2	1,392	精密機器 (2.5%)			
武蔵精密工業	26.1	25.8	20,923	デルモ	152.1	328.4	1,168,447
日産車体	21	22.7	19,136	クリエートメディック	3.5	3.8	4,149
新明和工業	48.3	31.3	37,528	日機装	34.7	34.8	28,640
極東開発工業	21.4	21.6	25,488	日本エム・ディ・エム	—	6.7	10,733
日信工業	19.7	21.9	47,544	島津製作所	138.3	138.7	383,228
トピー工業	8.8	9.5	12,549	J M S	9.9	9.8	7,193
ティラド	3.9	4.2	5,724	クボテック	2.3	3	807
曙ブレーキ工業	59	63.7	10,255	長野計器	8.4	8.4	6,526
タチエス	18.2	19	19,076	ブイ・テクノロジー	2.5	5.4	18,603
NOK	57.8	62.4	72,696	東京計器	6.8	7.4	5,298
フタバ産業	29.9	32.3	14,954	愛知時計電機	1.4	1.5	6,067
K Y B	11.2	13	29,341	インターラクション	5	6.2	13,534
大同メタル工業	17.4	22.3	12,599	オーバル	10.5	10.4	2,444
プレス工業	53.3	57.5	14,202	東京精密	19.4	21	63,840
ミクニ	13.6	14.7	3,998	マニー	13.1	46.2	118,595
太平洋工業	22.5	24.3	23,498	ニコン	187.3	187.8	193,997
ケーヒン	24.7	28.1	71,205	トプコン	57.7	58.4	48,238
河西工業	13.2	15.7	8,964	オリンパス	160.1	642.1	1,028,323
アイシン精機	88.5	95.6	272,460	理研計器	9.5	10.2	22,083
マツダ	337.4	341.4	223,617	タムロン	9.5	9.3	17,279
今仙電機製作所	10	10.8	7,214	H O Y A	216.4	231.7	2,080,434
本田技研工業	906.8	913.7	2,370,137	シード	4.6	4.9	3,959
スズキ	196.7	230	669,645	ノーリツ鋼機	8.5	7.8	7,269
S U B A R U	333.7	360.3	811,215	エー・アンド・ディ	9.8	10.6	7,049
安永	5.2	5.6	5,320	朝日インテック	45.6	98.5	262,207
ヤマハ発動機	151.8	151.3	213,786	シチズン時計	117.6	135.9	50,826
ショーワ	25.4	25.5	56,763	リズム時計工業	3.6	3.6	2,404
T B K	12.8	13.8	6,872	大研医器	8.5	8	4,408
エクセディ	14.6	15.8	26,164	メニコン	14.7	16.4	66,174
豊田合成	34.7	37.5	73,875	シンシア	1.6	1.2	384

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
松風	千株	千株	千円		ツツミ	千株	千株	千円	
セイコーホールディングス	5.2	5.2	9,266		3.4	3.6	6,552		
ニプロ	16.6	16.4	29,831		小松ウォール工業	3.3	3.5	6,737	
その他製品 (2.4%)	74.4	80.3	88,410		ヤマハ	63.9	69	313,605	
中本パックス	3	2.9	3,529		河合楽器製作所	3.3	3.6	8,740	
スノーピーク	4.1	5.8	4,344		クリナップ	10	10.8	5,886	
パラマウントベッドホールディングス	12.4	12.2	51,728		ビジョン	65	70.1	266,029	
トランザクション	5.8	7.4	5,809		オリバー	—	2.5	8,000	
粧美堂	3.1	3.4	1,132		兼松サステック	0.7	0.7	1,038	
ニホンフラッシュ	4.6	5.4	11,691		キングジム	8.9	9.6	7,728	
前田工織	11.8	12.8	24,755		リンテック	25.6	27.6	59,698	
永大産業	14.1	15.2	4,408		イトーキ	19.8	24.7	8,027	
アートネイチャー	11.5	12.4	8,084		任天堂	66.2	71.2	2,822,368	
バンダイナムコホールディングス	111.1	120	644,280		三菱鉛筆	17.7	19.1	25,059	
アイフィスジャパン	2.4	3	1,848		タカラスタンダード	22.2	24	37,944	
共立印刷	17.9	19.4	2,968		コクヨ	51.6	55.7	80,319	
S H O E I	5.2	5.6	22,904		ナカバヤシ	10.6	11.4	6,042	
フランズベッドホールディングス	15.2	16.4	13,956		グローブライド	5.2	5.2	9,765	
パイロットコーポレーション	18.7	18.9	65,394		オカムラ	37.5	40.5	34,911	
萩原工業	6	6.4	8,128		美津濃	10.6	10.5	19,729	
トッパン・フォームズ	23	24.9	22,758		電気・ガス業 (1.7%)				
フジシールインターナショナル	24.1	26	49,634		東京電力ホールディングス	858.1	926.4	353,884	
タカラトミー	45	52	42,796		中部電力	328.9	355	501,437	
廣済堂	9.1	8.1	5,864		関西電力	438.6	439.7	492,683	
エステールホールディングス	2.9	3.1	1,925		中国電力	148.6	167.4	244,236	
アーク	41	44.3	3,233		北陸電力	105.3	106.1	76,392	
タカノ	4.2	4.5	3,213		東北電力	251.7	289.9	285,551	
プロネクサス	9.2	10	10,350		四国電力	96.8	104.5	86,839	
ホクシン	6.6	7.2	892		九州電力	221.5	239.2	205,951	
ウッドワン	3.6	3.9	4,430		北海道電力	100.6	108.6	48,652	
大建工業	8.1	7.8	12,667		沖縄電力	19.9	21.5	39,044	
凸版印刷	151.7	163.8	276,166		電源開発	85.5	92.3	199,275	
大日本印刷	151.5	151.9	341,167		エフオン	5.1	6.2	3,050	
図書印刷	10.1	—	—		イーレックス	18.7	16.5	19,981	
共同印刷	3.3	3.6	9,694		レノバ	13.2	19.3	17,099	
N I S S H A	22.1	23.8	17,659		東京瓦斯	210.9	223.2	537,800	
光村印刷	0.9	1	1,265		大阪瓦斯	208.6	225.2	428,780	
TAKARA & COMPANY	5.2	5.6	9,251		東邦瓦斯	53.2	57.1	263,802	
アシックス	106.7	95.8	96,566		北海道瓦斯	5.8	6.2	9,672	
					広島ガス	22.1	23.9	8,580	

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
	千株	千株	千円
西部瓦斯	12.1	13.1	32,854
静岡ガス	33.1	32.9	27,504
メタウォーター	5.2	5.6	20,608
陸運業 (4.5%)			
SBSホールディングス	10.6	10	16,810
東武鉄道	113.4	122.4	454,104
相鉄ホールディングス	36.8	37.1	105,141
東急	292	292.7	500,809
京浜急行電鉄	147.2	149	276,991
小田急電鉄	172.2	172.6	418,555
京王電鉄	60.1	60.2	379,260
京成電鉄	80.6	80.8	260,984
富士急行	14.7	15.8	45,804
新京成電鉄	2.8	3	6,891
東日本旅客鉄道	191.1	204.2	1,715,280
西日本旅客鉄道	96.4	103.4	770,226
東海旅客鉄道	96.2	96.5	1,751,475
西武ホールディングス	137	155.7	204,122
鴻池運輸	17.1	18.5	21,275
西日本鉄道	29.8	32.2	84,686
ハマキヨウレックス	8.2	8.9	23,362
サカイ引越センター	5.6	6.1	34,587
近鉄グループホールディングス	101.8	109.9	571,480
阪急阪神ホールディングス	135.8	146.6	542,420
南海電気鉄道	45.4	52.1	124,206
京阪ホールディングス	45.3	48.9	236,431
神戸電鉄	2.6	2.6	10,114
名古屋鉄道	81.5	90.4	281,596
山陽電気鉄道	7.8	7.8	16,536
日本通運	40	38.8	204,476
ヤマトホールディングス	178.5	192.7	319,689
山九	28.3	30.5	124,592
丸運	5.8	6.3	1,493
丸全昭和運輸	8.2	8.9	18,716
センコーグループホールディングス	56.1	60.6	49,449
トナミホールディングス	2.4	2.6	10,595
ニッコンホールディングス	38.7	39.3	82,923
日本石油輸送	1.2	1.2	3,274
福山通運	13	14.1	54,778

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
	千株	千株	千円
セイノーホールディングス	76.2	82.3	97,525
エスライン	3.1	3.3	2,755
神奈川中央交通	2.5	2.7	11,205
日立物流	22.4	20.1	48,883
丸和運輸機関	5.4	11.6	28,675
C&Fロジホールディングス	10.3	11.1	14,541
九州旅客鉄道	85.4	98	308,210
S Gホールディングス	96.2	115.4	281,576
海運業 (0.1%)			
日本郵船	85.1	91.9	132,427
商船三井	60.4	69.5	136,081
川崎汽船	31.4	33.8	31,231
N S ニナイテッド海運	5.6	6	9,090
明治海運	10.8	11.7	3,919
飯野海運	48.2	52	16,120
共栄タンカー	0.9	1.9	1,727
乾汽船	9.1	6.3	8,001
空運業 (0.4%)			
日本航空	186.4	197.8	427,841
ANAホールディングス	186.1	200.9	585,723
バスコ	2	2.1	3,019
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	2.8	3.1	20,491
日新	8.8	9.5	14,896
三菱倉庫	35.2	34.9	79,676
三井倉庫ホールディングス	12.5	12.6	18,207
住友倉庫	38.3	40.5	49,126
濱澤倉庫	5.6	6	11,748
東陽倉庫	18.4	19.8	6,633
日本トランシスティ	22.4	24.2	10,188
ケイヒン	2	2.1	2,402
中央倉庫	6.2	6.5	7,988
川西倉庫	2.1	2	1,832
安田倉庫	8.4	9	7,893
ファイズホールディングス	1.4	2.3	2,139
東洋埠頭	3.1	3.3	4,365
宇徳	8.7	9.4	4,916
上組	62.8	62.9	120,013
サンリツ	2.4	2.6	1,406

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
キムラユニティー	千株	千株	千円		コロプラ	千株	千株	千円	
キユーソー流通システム	2.7	2.9	2,766		オルトプラス	30.2	37.3	31,182	
近鉄エクスプレス	2.5	2.7	4,449		ブロードリーフ	6.5	8.4	8,500	
東海運	19.2	23.3	37,163		クロス・マークティンググループ	52.3	56.4	26,169	
エーアイティー	5.8	6.3	1,656		デジタルハーツホールディングス	2.9	5	1,345	
内外トランスライン	6.6	7.8	5,467		システム情報	4.8	6	4,392	
日本コンセプト	3.2	3.9	4,208		メディアドウホールディングス	2.1	5.8	3,636	
情報・通信業 (9.5%)	2.8	3.5	4,637		じげん	3.2	3.6	10,281	
N E C ネッツエスアイ	11.6	10.8	40,068		ブイキューブ	11.2	28.2	8,093	
クロスキャット	2.1	3	2,391		エンカレッジ・テクノロジ	5.6	7	5,390	
システナ	37.6	40.6	58,545		サイバーリンクス	1	1.9	1,187	
デジタルアーツ	5.7	5.6	26,404		ディー・エル・イー	1.6	1.7	1,558	
日鉄ソリューションズ	15.8	17.1	47,349		フィックスターズ	7.4	9.2	1,085	
キューブシステム	5.6	6.1	3,531		C A R T A H O L D I N G S	10.1	12.1	12,644	
エイジア	2.1	2.1	2,589		オプティム	5.6	5.5	4,680	
コア	4.5	4.8	5,644		セレス	2.3	3	11,100	
シリトンシステムズ	5.9	5	4,700		S H I F T	3.4	3.7	2,719	
ソフトクリエイトホールディングス	4.6	5	8,210		ペリサーブ	—	3	20,670	
T I S	35.2	38	200,260		ティーガイア	0.9	—	—	
ネオス	3.8	4.6	2,364		セック	10.6	10.1	20,351	
電算システム	4	4.3	8,754		日本アジアグループ	1.7	1.7	4,681	
グリー	72.8	69.8	28,269		豆蔵ホールディングス	11.1	12	3,108	
コーエーテクモホールディングス	21.6	23.3	59,018		テクマトリックス	7.2	7.2	13,572	
三菱総合研究所	4.1	4.9	15,925		プロシップ	7.4	8	17,192	
ボルテージ	1.9	2.7	837		ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3	3.3	3,623	
電算	1.2	1.3	2,823		G M O ベイメントゲートウェイ	254.2	27.4	42,497	
A G S	6	6.4	4,736		ザッパラス	17.4	18.7	140,063	
ファインデックス	8.9	9.6	6,614		システムリサーチ	5.5	4.9	1,582	
ブレインパッド	2	2.9	12,963		インターネットイニシアティブ	1.4	3	4,410	
K L a b	18.9	22	14,322		さくらインターネット	17.2	16.8	52,080	
ポートワイン・ピットクルーホールディ	14	13.7	10,165		ヴィンクス	12.6	12.2	5,416	
イーブックイニシアティブジャパン	1.7	1.6	1,896		G M O クラウド	3.5	3.2	2,304	
ネクソン	268.7	324.4	545,640		S R A ホールディングス	2.3	2.1	3,666	
アイスタイル	27	31.9	7,145		M i n o r i ソリューションズ	5.6	6	12,672	
エムアップ	3.6	3.3	6,996		システムインテグレータ	2.1	—	—	
エイチーム	6.6	7.8	4,992		朝日ネット	3	3.6	2,217	
エニグモ	—	8.1	6,642		e B A S E	8.5	8.1	5,151	
テクノスジャパン	8.9	8.8	3,176		アバント	3.1	6.8	10,234	
e n i s h	3.7	5.1	2,045		アドソル日進	3.8	8.1	6,698	

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円	
フリービット	6.3	5.9	3,622	サインポスト	—	1.8	2,626		
コムチュア	5.9	12.8	26,112	ソルクシーズ	4.5	4.8	2,764		
サイバーコム	1.9	2	3,038	フェイス	4.2	4	2,344		
アステリア	5.3	6.9	2,249	プロトコーゴレーション	3.3	10.2	9,241		
アイル	—	4.1	6,092	ハイマックス	1.3	1.3	2,471		
マークライズ	3.6	5.7	8,943	野村総合研究所	67.1	161.4	374,932		
メディカル・データ・ビジョン	9.4	8.7	5,550	サイバネットシステム	8.7	8.1	4,584		
g u m i	13.5	14.6	8,701	C E ホールディングス	2.8	6.5	2,697		
ショーケース	2.3	2.7	1,204	日本システム技術	1.7	1.8	1,737		
モバイルファクトリー	2.9	2.5	2,782	インテージホールディングス	13.5	14.2	10,990		
テラスカイ	0.6	4.1	10,606	東邦システムサイエンス	3.1	3	2,595		
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4.7	4.5	5,166	ソースネクスト	40.9	54	15,822		
P C I ホールディングス	1.8	2.3	4,103	インフォコム	8.7	12.5	28,362		
パイプドHD	1.6	1.5	1,866	HERO Z	—	1.1	3,498		
アイビーシー	1.7	2.1	1,696	ラクスル	—	6.1	14,017		
ネオジャパン	2	2.1	1,890	F I G	9.3	12.3	2,829		
P R T I M E S	0.7	1	1,860	システムサポート	—	1	2,124		
ランドコンピュータ	1.2	1.7	1,723	イーソル	—	4.1	4,182		
ダブルスタンダード	0.7	1.5	5,257	アルテリア・ネットワークス	8.8	12.6	22,604		
オープンドア	5.2	5.6	4,732	東海ソフト	—	0.7	781		
マイネット	3.4	3.7	2,475	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	2.4	2.6	1,963		
アカツキ	3.7	4	14,940	フォーカスシステムズ	7.1	7	5,096		
ベネフィットジャパン	0.6	0.8	1,114	クレスコ	3.2	6.9	9,549		
U b i c o m ホールディングス	1.9	2.5	3,465	フジ・メディア・ホールディングス	109.4	109.7	120,560		
L I N E	32.1	24.2	122,694	オーピック	36.6	39.5	505,995		
カナミックネットワーク	1.6	6.9	3,450	ジャストシステム	15	18.5	91,852		
ノムラシステムコーポレーション	0.9	2.5	847	T D C ソフト	9.2	10	7,490		
チエンジ	1.4	2.3	7,084	Z ホールディングス	687.7	1,563.7	537,912		
シンクロ・フード	4.5	4.8	1,084	トレンドマイクロ	56.2	50.6	267,168		
オークリネット	5.5	7	7,560	I D ホールディングス	3	4.3	5,869		
セグエグループ	—	1.9	1,130	日本オラクル	21.4	23.1	210,210		
エイトレッド	0.8	1.4	1,769	アルファシステムズ	3.3	3.5	9,765		
A O I T Y O H o l d i n g s	11.5	11.5	5,175	フューチャー	14.3	13.7	18,741		
マクロミル	18.7	21.7	14,604	C A C H o l d i n g s	7.5	7.4	6,948		
ビーグリー	2	2.2	2,521	S B テクノロジー	4.5	4.1	8,200		
オロ	1	3	8,682	トーセ	2.8	3.1	2,256		
ユーザーローカル	—	0.8	1,902	オーピックビジネスコンサルタント	10.8	11.6	51,214		
テモナ	—	1.5	835	伊藤忠テクノソリューションズ	48.1	51.9	152,222		
ニーズウェル	—	1.4	735	アイティフォー	12.8	13.8	7,935		

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
	千株	千株	千円
東計電算	1.6	1.7	6,443
エックスネット	1.9	1.8	1,693
大塚商会	57.1	61.6	264,572
サイボウズ	12.3	13.3	20,894
ソフトブレーン	8.3	6.7	2,633
電通国際情報サービス	6.5	7	26,145
ACCESS	—	10.6	9,805
デジタルガレージ	20.5	20.5	67,650
EMシステムズ	8.6	16	14,448
ウェザーニューズ	3.6	3.8	12,882
C I J	8.2	7.8	6,068
ビジネスエンジニアリング	1.1	1.3	3,250
日本エンタープライズ	10.8	11.6	2,343
WOWOW	5.1	5.5	13,145
スカラ	7.4	7.6	3,435
インテリジェント ウェイブ	—	5	2,505
I M A G I C A G R O U P	8.9	9.7	3,453
ネットワンシステムズ	37.3	43.4	96,131
システムソフト	25	27	1,863
アルゴグラフィックス	4.5	9.7	33,319
マーベラス	16.1	17.4	9,831
エイベックス	18.1	19.6	18,639
日本ユニシス	32.9	35.6	98,825
兼松エレクトロニクス	5.7	6.2	20,770
東京放送ホールディングス	70	69.2	104,838
日本テレビホールディングス	96.8	95.1	123,630
朝日放送グループホールディングス	10.5	11.3	7,774
テレビ朝日ホールディングス	29	31.3	49,266
スカパーJ SATホールディングス	80.5	74.9	29,136
テレビ東京ホールディングス	8.6	9.3	20,525
日本BS放送	3.6	3.8	3,750
ビジョン	3.3	9.9	7,524
スマートバリュー	2.3	3	2,523
U S E N - N E X T H O L D I N G S	4	4.3	5,878
ワイヤレスゲート	4.6	5.4	2,160
コネクシオ	7.5	6.4	8,448
日本通信	91	88.8	14,918
クロップス	1.9	2.1	1,134
日本電信電話	721.4	1,522.2	3,810,066

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
	千株	千株	千円
KDDI	929.5	848.6	2,751,161
ソフトバンク	838.7	1,034.9	1,468,523
光通信	12.4	11.7	218,790
NTTドコモ	757.4	841.2	2,676,698
エムティーアイ	12.2	11	5,643
GMOインターネット	38.4	44.9	77,632
ファイバーゲート	—	2.7	2,789
アイドマーマーケティングコミュニケーション	2.3	3.4	1,315
KADOKAWA	30.8	30.7	38,989
学研ホールディングス	3.5	3.8	27,550
ゼンリン	21	22.7	23,176
昭文社	4.9	5.2	2,012
インプレスホールディングス	8.7	9.4	1,269
アイネット	6	5.9	7,835
松竹	7	7.5	91,200
東宝	69.4	67.2	230,832
東映	4.4	4.3	58,222
エヌ・ティ・ティ・データ	280.8	303.2	331,397
ビー・シー・エー	1.3	1.5	4,447
ビジネスブレイン太田昭和	1.8	1.9	4,628
DTS	11.8	25.4	48,285
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49.1	48.6	222,102
シーイーシー	11.3	12.2	16,006
カプコン	45.2	53.7	167,544
アイ・エス・ピー	2	2.2	3,293
ジャステック	6.1	7.2	7,142
SCK	27.8	26.3	120,848
日本システムウエア	3.5	3.8	6,703
アイネス	13.4	11.2	14,772
TKC	8.9	9.6	43,536
富士ソフト	15.7	14.6	50,662
NSD	17.3	36.6	53,582
コナミホールディングス	43.1	41.4	140,139
福井コンピュータホールディングス	3.5	4.5	10,989
JBCCホールディングス	8.3	7.7	12,304
ミロック情報サービス	10.5	10	24,200
ソフトバンクグループ	440.8	903.5	3,767,595
卸売業 (5.1%)			
ホウスイ	0.8	0.9	637

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
高千穂交易		千株	千株	千円	デリカフーズホールディングス		千株	千株	千円
カワニシホールディングス	4.1	4.4	4,408		1.9	4	2,608		
伊藤忠食品	—	1	1,038		スター・ティアホールディングス	2.1	2.6	1,287	
エレマテック	2.6	2.8	12,012		コメダホールディングス	24.5	24.9	42,255	
JALUX	4.9	10.7	7,960		ビーパンドットコム	—	0.9	757	
あらた	3	3.2	5,321		アセンティック	—	0.9	2,473	
トーメンデバイス	5.9	9.1	40,677		富士興産	4.1	3.5	1,379	
東京エレクトロン デバイス	1.6	1.7	5,822		協栄産業	1.3	1.3	1,401	
フィールズ	3.8	4.1	9,364		小野建	9.5	10.2	11,505	
双日	9.3	8.8	2,772		南陽	2.2	2.5	3,360	
アルフレッサ ホールディングス	584.7	631.3	175,501		佐鳥電機	7.8	7.8	6,536	
横浜冷凍	117.6	127	247,142		エコートレーディング	2.4	2.6	1,214	
神栄	27.7	32	28,512		伯東	7.2	7	7,343	
ラサ商事	1.5	1.6	713		コンドーテック	8.2	8.8	8,104	
ラクーンホールディングス	5.6	6	5,262		中山福	6.1	6.6	3,399	
アルコニックス	5	4.6	2,267		ナガイレーベン	15.3	16.5	38,824	
神戸物産	11.2	12.1	12,426		三菱食品	11.6	12.6	33,894	
ハイパー	16	39.4	154,251		松田産業	7.7	8.3	10,366	
あい ホールディングス	—	1.2	486		第一興商	15.8	17	56,525	
ディープイエックス	15.1	16.3	21,108		メディバルホールディングス	144.2	123.3	237,599	
ダイワボウホールディングス	4.1	4.1	3,763		SPK	2.3	2.4	6,220	
マクニカ・富士エレホールディングス	9.6	9.7	52,089		萩原電気ホールディングス	3.9	4.2	9,219	
ラクト・ジャパン	29.3	27.3	38,356		アズワン	7.6	7.5	69,150	
バイタルケースケー・ホールディングス	2.3	4.3	12,943		スズデン	3.7	4	4,936	
八洲電機	19.9	21.5	23,499		尾家産業	3.4	3.3	4,167	
メディアホールディングス	8.2	8.8	7,198		シモジマ	6.5	7	8,743	
レスター・ホールディングス	6	6.5	4,933		ドウシシャ	10	10.8	13,197	
ジュー・テックホールディングス	6.8	11.9	18,766		小津産業	2.3	2.5	3,987	
大光	2.4	2.6	2,810		高速	6.3	6.8	8,799	
OCHIホールディングス	3.4	4.8	2,784		たけびし	3.7	4	5,320	
TOKAIホールディングス	3.1	3.3	4,867		リックス	2.4	2.6	4,160	
黒谷	55.9	60.4	55,386		丸文	9.4	10.1	5,080	
Cominix	1.8	2	1,454		ハピネット	8.8	9.5	10,925	
三洋貿易	5.3	11.5	9,947		橋本総業ホールディングス	1.9	2.3	4,413	
ピューティガレージ	1.7	1.8	2,442		日本ライフライン	33.2	33.9	43,798	
ワイン・パートナーズ	6.9	8.2	7,806		タカショ一	5.1	5.6	2,324	
ミタチ産業	3.2	3.4	1,676		エクセル	3.9	—	—	
シップヘルスケアホールディングス	22.1	18.3	76,768		マルカ	3.4	4	7,524	
明治電機工業	3.3	3.6	4,899		IDOM	35.7	30.8	13,090	
					日本エム・ディ・エム	6.2	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
進和	千株 6.3	千株 6.8	千円 11,777	カナデン	千株 10.1	千株 9.3	千円 11,160
エスケイジャパン	2.6	2.4	722	菱電商事	8.4	8.2	10,627
ダイトロン	4.8	4.8	6,835	フルサト工業	5.8	6.3	9,273
シークス	13.5	14.5	12,078	岩谷産業	23.5	25.4	92,710
田中商事	3.5	3.5	2,369	すてきナイスグループ	4.5	4.9	4,601
オーハシテクニカ	6	6.4	8,582	昭光通商	3.8	3.7	2,168
白銅	3.4	4.1	4,944	ニチモウ	1.6	1.8	2,973
伊藤忠商事	740.5	799.4	1,839,019	極東貿易	3.3	3.3	4,669
丸紅	1,044	1,189.7	741,896	イワキ	12.7	15	6,285
高島	1.7	1.8	2,799	三愛石油	28.4	28.1	27,566
長瀬産業	59.5	64.3	82,561	稲畑産業	25.4	25.2	29,358
蝶理	6.8	7.3	11,636	G S I クレオス	2.8	2.8	2,895
豊田通商	118.2	127.6	348,092	明和産業	9.8	10.5	6,121
三共生興	18	17.3	8,494	クワザワ	2.9	4.1	2,316
兼松	42.3	42.6	47,158	ヤマエ久野	—	6.1	7,472
ツカモトコーポレーション	1.9	2.1	2,389	ワキタ	22.6	24.4	22,936
三井物産	872.2	1,004.6	1,658,594	東邦ホールディングス	31.3	36.7	81,290
日本紙パルプ商事	6	6.5	22,230	サンゲツ	32	31.1	48,453
日立ハイテク	32.2	36.9	292,986	ミヅウロコグループホールディングス	15.3	16.8	17,572
カメイ	13.8	14.9	13,857	シナネンホールディングス	4.4	4.7	12,220
東都水産	1.5	1.5	3,972	伊藤忠エネクス	23.4	25.3	21,353
O U G ホールディングス	1.7	1.8	4,626	サンリオ	32.7	32.1	51,263
スター・ゼン	3.9	4.2	18,837	サンワテクノス	6.4	8.1	7,047
山善	41.3	44.6	40,095	リヨーサン	11.7	12.6	30,265
椿本興業	2.4	2.1	7,423	新光商事	10	17.9	14,534
住友商事	626.1	721.1	971,321	トーホー	4.8	5.2	7,982
内田洋行	4.9	4.9	16,831	三信電気	8.8	6.1	8,289
三菱商事	742.9	802	1,976,128	東陽テクニカ	12.2	13.2	12,144
第一実業	4.8	5.6	19,040	モスクードサービス	13.9	15	39,540
キヤノンマーケティングジャパン	30.3	32.7	68,016	加賀電子	10.5	11.4	19,551
西華産業	6	6.5	6,701	ソーダニッカ	10.9	11.8	7,445
佐藤商事	9.5	9.4	8,290	立花エレック	7.8	8.4	12,247
菱洋エレクトロ	10.7	11.6	23,640	フォーパル	4.6	5	5,835
東京産業	10.5	10.3	5,098	P A L T A C	19.1	18.3	93,513
ユアサ商事	10.8	10.8	30,834	三谷産業	12.4	15	4,800
神鋼商事	2.4	2.9	5,678	太平洋興発	4.2	4.5	3,141
小林産業	6.3	6.8	1,761	西本W i s m e t t a c ホールディングス	2.4	2.1	4,491
阪和興業	18.4	21.4	38,605	ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	1	1,479
正栄食品工業	5.6	7.4	24,827	国際紙パルプ商事	18.5	27	6,210

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
ヤマタネ	5.3	5.7	6,093	
丸紅建材リース	1	1.1	1,772	
日鉄物産	7.5	8.1	29,970	
泉州電業	3.5	3.5	8,519	
ト拉斯コ中山	22	23.8	55,763	
オートパックスセブン	42.1	42.4	54,229	
モリト	7.7	8.3	5,038	
加藤産業	16.6	17.9	60,144	
北恵	2	2.2	1,447	
イノテック	6.3	6.8	5,861	
イエローハット	10	21.6	33,674	
J Kホールディングス	9.6	10.3	7,220	
日伝	8.8	10.3	20,085	
北沢産業	7.9	8.6	2,476	
杉本商事	5.7	6.2	11,277	
因幡電機産業	15	32.5	76,635	
パイティックホールディングス	4.8	—	—	
東テク	3.5	3.8	7,326	
ミスミグループ本社	132.5	143.2	314,180	
アルテック	7.8	9.1	1,628	
タキヒヨー	3.2	3.5	4,973	
蔵王産業	1.7	2.2	3,179	
スズケン	48.3	48.4	183,920	
ジェコス	7.3	7.9	6,288	
グローセル	9.7	11.4	4,753	
小売業 (4.8%)				
ローソン	26.8	28.9	167,042	
サンエー	8	9.5	41,990	
カワチ薬品	8.2	8.9	20,345	
エービーシー・マート	16.5	17.8	97,366	
ハードオフコーポレーション	4.2	4.5	3,289	
アスクル	11.1	11.9	37,544	
ゲオホールディングス	16.1	20.6	27,027	
アダストリア	14.7	15.8	23,305	
ジーフット	6.4	6.9	2,898	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	1.4	1.6	659	
くら寿司	6.2	6	25,920	
キャンドゥ	5	5.4	8,964	
バルグループホールディングス	5.4	11.7	15,022	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
エディオン	44.9	52.5	48,720	
サーラコーポレーション	21.5	23.2	12,203	
ワッツ	3.5	5	2,675	
ハローズ	4	4.3	10,625	
フジオフードシステム	4.4	9.6	13,267	
あみやき亭	2.3	2.5	7,925	
ひらまつ	21.1	21	3,717	
大黒天物産	2.5	2.7	7,719	
ハニーズホールディングス	9.3	10.1	11,958	
ファーマライズホールディングス	2.5	2.8	1,741	
アルペン	8.1	8.8	14,291	
ハブ	3.4	3.2	2,300	
クオールホールディングス	15.6	16.8	21,218	
ジンズホールディングス	7.2	6	37,320	
ピックカメラ	56.5	67.8	64,071	
D C Mホールディングス	57.1	61.8	60,069	
ベッバーフードサービス	8.3	9.5	5,472	
Mon o t a R O	66.9	81.3	243,818	
東京一番フーズ	2.7	2.9	1,537	
DDホールディングス	2.3	4.5	4,081	
きちりホールディングス	2.8	3	1,785	
アークランドサービスホールディングス	7.7	8.3	12,690	
J. フロント リテイリング	135.4	136.5	131,313	
ドトール・日レスホールディングス	18.6	18.2	31,304	
マツモトキヨシホールディングス	43.8	47.2	180,540	
プロンコビリー	5.5	6	13,440	
Z O Z O	114.4	78.6	118,843	
トレジャーファクトリー	3.1	3.3	2,128	
物語コーポレーション	2.6	3	20,640	
ココカラファイン	11.9	11.9	61,642	
三越伊勢丹ホールディングス	198	199.7	139,590	
H a m e e	3.2	4.1	3,808	
ウエルシアホールディングス	28	34	229,500	
クリエイト S Dホールディングス	15.6	19.3	50,160	
丸善CHIホールディングス	12.4	13.3	4,894	
ミサワ	1.9	2.3	956	
ティーライフ	1.4	1.5	1,422	
エー・ビーカンパニー	2	2.1	1,014	
チムニー	3.2	3.5	6,573	

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
ショッピング	千株	千株	千円	ノジマ	千株	千株	千円
ネクステージ	7.2	7.8	5,265	カッパ・クリエイト	18.8	20.3	37,839
ジョイフル本田	16.3	16.3	11,703	ライトオン	14.8	16	23,008
鳥貴族	31	33.5	38,424	ジーンズメイト	8.9	8.5	4,522
キリン堂ホールディングス	3.5	3.8	7,068	良品計画	3.2	3.5	826
ホットランド	4.2	4.5	7,488	三城ホールディングス	15	151.7	186,287
すかいらーくホールディングス	5.5	7.6	7,584	アドヴァン	13.1	12.1	3,025
S F P ホールディングス	98.7	128.1	229,811	アルビス	16.2	17.4	17,904
綿半ホールディングス	3.2	4.9	7,580	コナカ	4	4.3	8,544
ヨシックス	3.9	4.3	6,222	ハウス オブ ローゼ	13.5	13.5	4,171
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	1.7	1.9	4,111	G-7 ホールディングス	1.3	1.4	2,349
ゴルフダイジェスト・オンライン	30.8	33.2	31,174	イオン北海道	3.1	6.7	13,252
B E E N O S	4.3	5.3	2,554	コジマ	10.6	15.1	9,784
あさひ	2.5	4.3	3,650	ヒマラヤ	15.6	19.6	7,487
日本調剤	8.8	8.5	9,826	コーナン商事	3.3	4	2,880
コスモス薬品	3.7	3.5	11,620	エコス	13.9	16.2	33,922
トーエル	4.7	5	114,500	ワタミ	3.9	4.2	6,984
オンリー	5.1	5.5	4,086	マルシェ	1.8	13.9	14,107
セブン&アイ・ホールディングス	443.7	447.1	1,609,560	パン・パシフィック・インターナショナルホ	—	251.2	467,232
薬王堂	443.7	447.1	1,609,560	西松屋チーン	—	23.2	19,301
クリエイト・レストランツ・ホールディング	4.6	—	—	ゼンショーホールディングス	28.5	49.9	121,930
ツルハホールディングス	28.5	61.4	47,646	幸楽苑ホールディングス	24.8	6.7	11,293
サンマルクホールディングス	23	24.8	322,400	ハーカスレイ	8.4	2.2	2,937
フェリシモ	2.3	2.5	2,415	サイゼリヤ	13.1	17.4	40,664
トリドールホールディングス	9.5	14.1	35,687	V T ホールディングス	10.3	35.9	15,088
TOKYO BASE	9.5	10.3	2,904	魚力	2.9	2.9	4,956
ウイルプラスホールディングス	1.2	1.4	726	ボブ	1.6	2.8	1,326
J M ホールディングス	4	5.8	11,484	フジ・コーポレーション	0.7	2.1	5,397
サツドラホールディングス	1.6	1.7	3,148	ユナイテッドアローズ	—	12.1	22,440
デファクトスタンダード	5.7	5.7	3,961	ハイディ日高	1.6	15.3	26,119
アレンザホールディングス	—	1.8	2,514	京都きもの友禅	5.7	6.7	1,846
串かつ田中ホールディングス	10.5	10.2	82,314	コロワイド	8.6	35.2	36,500
パロックジャパンリミテッド	3	5.2	5,269	ビーシーデボコーポレーション	11.6	14	5,821
クスリのアオキホールディングス	11.6	12.5	3,686	壱番屋	5.7	7.5	37,138
力の源ホールディングス	9	11.3	90,750	トップカルチャー	11.2	3.8	1,184
スリーゴローバルホールディングス	9	11	4,620	P L A N T	11.2	2.4	1,174
L I X I L ビバ	5	5.3	4,409	スギホールディングス	—	23.2	22,8
メディカルシステムネットワーク	—	—	—	薬王堂ホールディングス	—	—	123,804
はるやまホールディングス	—	—	—	ヴィア・ホールディングス	—	13	5
	—	—	—		—	14	11,625
	—	—	—		—	—	7,700

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
スクロール		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
	16.3	17.6	5,420		ケーズホールディングス	110	110.3	122,984	
ヨンドシーホールディングス	11.7	11.6	22,167		O l y m p i c グループ	6.2	5.9	3,404	
ファミリーマート	118.4	91.3	182,508		日産東京販売ホールディングス	15.6	16.8	3,813	
木曽路	13	14.9	38,039		シルバーライフ	—	1.1	2,072	
S R S ホールディングス	12.5	13.5	13,770		一家ダイニングプロジェクト	—	0.8	548	
千趣会	19.2	20.6	7,374		G e n k y D r u g S t o r e s	5.2	5	9,585	
タカキュー	8.2	8.8	1,258		ナルミヤ・インターナショナル	—	1.9	1,121	
ケーヨー	19.6	23.5	11,327		総合メディカルホールディングス	9.2	9.3	23,715	
上新電機	12.5	13.4	25,888		ブックオフグループホールディングス	5.5	6.7	6,097	
日本瓦斯	17.2	18.1	59,458		AINホールディングス	14.2	14	83,720	
ロイヤルホールディングス	18.5	20	37,980		元気寿司	3	2.9	7,183	
東天紅	0.8	0.8	668		ヤマダ電機	322.5	348.2	164,698	
いなげや	11.8	14.2	20,661		アークランドサカモト	18	17.9	17,040	
島忠	24	21.5	57,598		ニトリホールディングス	45.8	49.5	721,710	
チヨダ	11.1	12	13,704		グルメ杵屋	7.5	8.1	8,829	
ライフコーポレーション	8	8.7	22,019		愛眼	8.4	9.1	1,965	
リンガーハット	13	14.1	30,202		ケーユーホールディングス	5.5	6	4,776	
M r M a x H D	14.5	15.7	5,228		吉野家ホールディングス	37	37.5	83,287	
テンアライド	9.8	10.5	4,389		松屋フーズホールディングス	5.1	5.5	23,375	
A O K I ホールディングス	21.2	22.9	18,640		サガミホールディングス	14.2	15.3	19,890	
オークワ	15.1	17.9	27,476		関西スーパーマーケット	8	9.5	9,671	
コメリ	16.3	17.6	33,334		王将フードサービス	7.8	8.4	49,980	
青山商事	18.5	23.6	24,803		ブレナス	11.9	12.8	23,833	
しまむら	12.3	13.3	96,558		ミニストップ	7.8	8.5	12,554	
はせがわ	5.6	6	2,394		アークス	19.9	23.4	41,886	
高島屋	83.1	83.3	84,382		パローホールディングス	22.8	25.3	43,490	
松屋	21.3	23	15,686		藤久	0.8	0.9	539	
エイチ・ツー・オー リテイリング	54.3	54.1	47,283		ベルク	5.2	5.6	29,736	
近鉄百貨店	4	4.4	11,440		大庄	5.7	6.1	7,698	
バルコ	10.2	—	—		ファーストリテイリング	14.2	15.3	771,732	
丸井グループ	89.6	104.8	219,765		サンドラッグ	39.8	43	144,050	
アクシアル リテイリング	8.8	9.5	34,342		サックスパー ホールディングス	9	9.7	6,586	
井筒屋	5.4	6.2	1,035		ヤマザワ	2.2	2.7	4,266	
イオン	407.4	439.8	1,022,095		やまや	1.8	2.3	5,032	
イズミ	21.5	23.2	63,985		ベルーナ	26	24.5	12,054	
平和堂	21.5	23.2	41,249		銀行業 (5.5%)				
フジ	12.8	13.8	24,370		島根銀行	2.2	2.3	1,051	
ヤオコー	12	13	80,340		じもとホールディングス	71.6	77.3	7,498	
ゼビオホールディングス	12.8	13.8	12,571		めぶきフィナンシャルグループ	550.9	594.7	127,265	

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
東京きらぼしフィナンシャルグループ	千株	千株	千円		滋賀銀行	千株	千株	千円	
九州フィナンシャルグループ	14.3	15.5	18,290		南都銀行	21.3	23	57,086	
ゆうちょ銀行	174	187.8	77,373		百五銀行	12.4	19	38,798	
富山第一銀行	300.4	324.3	331,110		京都銀行	95.4	103	29,664	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	25.3	27.3	7,261		紀陽銀行	38	41	144,320	
西日本フィナンシャルホールディングス	675.3	673.2	224,175		ほくほくフィナンシャルグループ	37.5	40.5	63,099	
関西みらいフィナンシャルグループ	67.9	78	46,800		広島銀行	70.6	76.2	73,609	
三十三フィナンシャルグループ	49.8	67.2	28,560		山陰合同銀行	156.5	169	77,571	
第四北越フィナンシャルグループ	9.2	10.6	14,850		中国銀行	62.9	67.9	36,733	
新生銀行	18.4	19.9	44,993		鳥取銀行	68.4	98.5	91,506	
あおぞら銀行	77.8	84	118,692		伊予銀行	3.6	3.9	4,816	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	59.2	68.2	162,111		百十四銀行	140.5	163.3	85,079	
りそなホールディングス	7,298.2	7,829.5	3,513,096		四国銀行	11.3	12.2	22,570	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,163.4	1,256	448,266		阿波銀行	15.2	17.4	14,041	
三井住友フィナンシャルグループ	208.4	216.3	721,576		大分銀行	721.576	721.576	40,579	
千葉銀行	747.2	791.6	2,335,615		宮崎銀行	6.5	6.6	13,160	
群馬銀行	375.5	393.7	197,637		佐賀銀行	7.1	7.6	17,069	
武蔵野銀行	212.1	224.9	74,217		十八銀行	6.4	6.9	8,093	
千葉興業銀行	15.8	17.1	23,187		沖縄銀行	6.5	—	—	
筑波銀行	29.1	6.8	1,516		琉球銀行	9.7	10.5	32,287	
七十七銀行	44.1	47.6	8,044		セブン銀行	358.2	382.3	108,573	
青森銀行	33.3	38.7	51,935		みずほフィナンシャルグループ	14,406.2	15,552.7	2,096,503	
秋田銀行	8.2	8.9	21,564		高知銀行	3.8	4.2	2,595	
山形銀行	6.8	7.3	11,519		山口フィナンシャルグループ	132.3	142.9	84,168	
岩手銀行	11.9	12.9	15,170		長野銀行	3.5	3.8	4,446	
東邦銀行	7.4	7.5	18,427		名古屋銀行	8.6	9.3	22,422	
東北銀行	94.8	102.3	24,961		北洋銀行	194,979	172.5	34,845	
みちのく銀行	5.4	5.5	5,104		愛知銀行	159.8	172.5	12,025	
ふくおかフィナンシャルグループ	6.8	7.4	8,465		中京銀行	3.8	4.1	4,378	
静岡銀行	86.1	96.4	152,504		大光銀行	4.4	4.7	9,865	
十六銀行	266.9	283.4	194,979		愛媛銀行	3.6	4.4	4,917	
スルガ銀行	14.2	14.3	26,841		トマト銀行	14.8	16	17,744	
八十二銀行	108.5	117.1	46,840		京葉銀行	4.1	4.4	4,378	
山梨中央銀行	191.9	276.2	102,746		栃木銀行	46.8	48.8	25,473	
大垣共立銀行	13.1	13.3	9,788		北日本銀行	54.9	55.3	8,682	
福井銀行	16.8	22.6	46,217		東和銀行	3.3	3.6	6,944	
北國銀行	9.1	9.8	14,112		福島銀行	18.6	20.1	12,984	
清水銀行	11.3	11.8	36,226		大東銀行	9.2	10.8	1,695	
富山銀行	4.4	4.7	8,474		トモニホールディングス	5.1	5.9	3,451	
	2	2.2	3,443			82	88.5	30,798	

銘柄	期首(前期末)	当期末			銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円	
フィデアホールディングス	102.9	111.1	11,776	ジェイリース	2.2	3.2	841		
池田泉州ホールディングス	112.5	131.6	21,319	イントラスト	3	4	2,052		
証券、商品先物取引業 (0.8%)				日本モーゲージサービス	1.4	2.3	4,459		
F P G	33.3	35.3	20,368	C a s a	3.6	4	4,092		
マーキュリアインベストメント	4.1	5.1	2,937	アルヒ	9.6	18.2	20,893		
S B I ホールディングス	126.3	127.8	218,410	ブレミアグループ	2.3	6.2	9,436		
日本アジア投資	9	9.7	1,872	クレディセゾン	74.3	80.2	104,099		
ジャフコ	17.4	17.6	54,032	芙蓉総合リース	12.1	12	67,080		
大和証券グループ本社	850.7	918.4	416,310	みずほリース	19.9	17.7	39,878		
野村ホールディングス	1,865.5	2,013.9	986,811	東京センチュリー	21.4	23	84,295		
岡三証券グループ	90.3	97.5	34,125	日本証券金融	46.7	50.4	24,897		
丸三証券	31.5	34	15,300	アイフル	161.7	174.6	40,507		
東洋証券	37.9	40.9	5,603	リコリース	8.3	9	26,946		
東海東京ファイナンシャル・ホールディングス	126.4	131.4	34,952	イオンファイナンシャルサービス	67.7	70	81,900		
光世証券	2.5	2.7	1,417	アコム	213.1	230.1	99,403		
水戸証券	30.7	33.1	6,156	ジャックス	11.7	12.6	23,070		
いちよし証券	22.2	21.4	10,999	オリエントコーポレーション	286.7	309.6	38,390		
松井証券	51.9	65.4	54,870	日立キャピタル	25	27	55,593		
だいこう証券ビジネス	4.3	5.5	3,025	アプラスファイナンシャル	50.9	54.9	3,403		
マネックスグループ	99	86.4	15,811	オリックス	707.3	715.9	1,000,470		
カブドットコム証券	72.2	—	—	三菱UFJリース	239.2	290.5	160,356		
極東証券	14.2	15.4	10,040	九州リースサービス	5.2	5.6	2,710		
岩井コスモホールディングス	10.9	10.8	11,631	日本取引所グループ	286.4	328.5	592,285		
藍澤證券	19.8	20.5	15,580	イー・ギャランティ	9.9	12.3	16,629		
マネーパートナーズグループ	12.4	12.2	2,257	アサックス	4.4	5.9	3,746		
スパークス・グループ	25	39.6	7,603	N E C キャピタルソリューション	4.3	4.7	9,038		
小林洋行	3	3.3	801	不動産業 (2.2%)					
保険業 (2.2%)				いちご	134.8	145.7	37,736		
かんぽ生命保険	40	40.5	56,416	日本駐車場開発	127.9	125.5	16,691		
S O M P O ホールディングス	186.9	215.2	697,893	スター・マイカ・ホールディングス	—	5.9	7,422		
アニコム ホールディングス	8.7	9.5	33,250	ヒューリック	221.3	244.4	259,552		
M S & A D インシュアラנסグループホール	277.2	299.3	900,893	三栄建築設計	4.2	4.6	5,566		
ソニーフィナンシャルホールディングス	87.1	94.1	172,579	スター・マイカ	4.9	—	—		
第一生命ホールディングス	599.8	647.7	882,167	野村不動産ホールディングス	70.6	69.5	135,108		
東京海上ホールディングス	384.3	409.3	2,055,504	三重交通グループホールディングス	21.5	23.2	12,180		
T & D ホールディングス	327.9	342.1	309,600	サムティ	14.6	16.2	19,488		
アドバンスクリエイト	2.5	2.7	4,147	ディア・ライフ	13.6	14.7	6,159		
その他金融業 (1.1%)				コーチェアールイー	3.1	3.4	1,451		
全国保証	29.9	32.3	115,957	エー・ディー・ワクス	163.4	212.3	4,458		

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
日本商業開発	6.6	7.2	10,857	空港施設	12.4	11.5	4,611
プレサンスコーポレーション	16.8	18.8	19,533	明和地所	5.8	6.3	3,546
ユニゾホールディングス	16	17.3	103,108	ゴールドクレスト	8.4	9	14,922
THEグローバル社	5.4	5.4	1,684	エスリード	4.1	4.5	7,096
ハウスコム	—	1.5	1,813	日神グループホールディングス	15.7	16.9	7,267
日本管理センター	7	7.5	8,355	日本エスコン	19.1	20.7	12,958
サンセイランディック	2.8	3.4	2,301	タカラレーベン	49.7	52.3	19,612
エストラスト	1.4	1.6	848	AVANTIA	6	6.4	3,948
フージャースホールディングス	23	22.8	14,728	イオンモール	53.1	57.4	83,976
オープンハウス	17.3	33.2	74,832	毎日コムネット	2.3	2.9	2,114
東急不動産ホールディングス	285.2	311.2	188,587	ファースト住建	3.9	4.9	4,405
飯田グループホールディングス	88.4	95.5	142,868	ランド	432.8	623	4,984
イーグランド	1.5	1.8	1,164	カチタス	11.8	14.2	47,002
ムゲンエステート	7.3	7.9	3,476	トーセイ	14.6	15.8	15,104
ビーロット	1.6	2.7	3,385	穴吹興産	1.2	2.5	3,342
ファーストブラザーズ	2.9	2.6	1,804	サンフロンティア不動産	14.6	15.8	14,378
ハウスドウ	5.8	5.6	3,936	エフ・ジー・ネクスト	9.3	10	8,840
シーアールイー	3.5	2.8	2,912	インテリックス	3	3.2	1,612
プロパティエージェント	1.1	1.8	1,537	ランドビジネス	5.4	4.8	1,876
ケイアイスター不動産	2.8	3.6	4,536	日本社宅サービス	—	2.6	2,337
アグレ都市デザイン	1.3	1.8	871	グランディハウス	9.3	8.9	3,649
グッドコムアセット	1.8	2.6	3,159	日本空港ビルディング	33.8	36.5	157,862
ジェイ・エス・ピー	0.4	1.2	4,932	サービス業(5.0%)			
テンポイノベーション	0.9	2.6	1,866	日本工営	6.9	7.5	21,810
グローバル・リンク・マネジメント	0.8	1.9	1,054	LIFULL	39.8	38.7	12,267
パーク24	62	61.4	111,318	ジェイエイシーシルートメント	8.3	7.4	7,969
バラカ	2.7	2.9	4,872	日本M&Aセンター	76.6	83.8	248,634
三井不動産	562.5	564.5	1,092,307	メンバーズ	3.4	3.3	4,507
三菱地所	742.8	802	1,359,390	中広	1.1	1.1	447
平和不動産	20.1	21	55,440	UTグループ	—	13.1	18,222
東京建物	115.9	120.6	149,182	アイティメディア	—	3.3	2,475
ダイビル	31.2	29.5	27,228	タケエイ	10.7	10.6	8,511
京阪神ビルディング	18.9	18.6	21,966	E・Jホールディングス	1.3	2	2,598
住友不動産	238.3	257.3	780,648	ビーネックスグループ	5.7	13.8	7,245
テーオーシー	24.3	22.5	13,050	コシダカホールディングス	27.5	26.7	11,053
東京楽天地	1.5	1.9	7,714	アルトナー	1.9	2.7	1,717
レオパレス21	130.8	150	42,750	パソナグループ	12.5	12	11,256
スターツコーポレーション	14.4	15.6	30,591	CDS	2.5	2.7	3,083
フジ住宅	13.5	13.3	7,328	リンクアンドモチベーション	18.9	24.4	8,027

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
G C A	10.4	13.4	7,852	エスプール	—	19.9	10,765
エス・エム・エス	37.7	34.5	74,071	W D B ホールディングス	4.7	5.1	10,710
サニーサイドアップグループ	1.1	2.9	1,827	手間いらす	—	0.5	2,087
パーソルホールディングス	102.7	110.9	121,546	ティア	5.2	6.5	3,380
リニカル	5.8	5.3	4,293	C D G	0.9	1.2	1,674
クックパッド	32.3	38.7	10,410	バリューコマース	6.9	6.2	10,409
エスクリ	2.8	3.5	1,519	インフォマート	56.3	121.5	82,377
アイ・ケイ・ケイ	5	5.4	3,245	J P ホールディングス	29.3	34.8	9,152
学情	4.2	3.9	5,467	エコナックホールディングス	18.5	20	1,800
スタジオアリス	5.2	5.6	8,965	E P S ホールディングス	15.5	16.7	17,835
シミックホールディングス	5.7	6.1	8,668	レッグス	2.5	2.7	2,273
エプロ	—	1.8	1,413	プレステージ・インターナショナル	19.2	41.5	32,494
N J S	2.3	2.4	4,051	アミューズ	6.2	6	13,494
総合警備保障	40.9	44.1	226,674	ドリームインキュベータ	3.1	3.4	3,046
カカクコム	76.9	83	182,849	クイック	6.4	6.9	7,307
アイロムグループ	3.9	3.9	5,011	T A C	5.6	6.7	1,132
セントケア・ホールディング	5.6	7.2	2,865	ケネディクス	90.2	103.3	44,212
サイネックス	1.7	1.9	1,176	電通グループ	125.1	114.3	281,178
ルネサンス	5.7	6.2	7,285	テイクアンドギヴ・ニーズ	3.9	4.2	2,583
ディップ	16.6	15.6	30,669	ぴあ	2.9	3.2	9,280
オプトホールディング	6.3	6	8,016	イオンファンタジー	3.3	4.3	7,335
新日本科学	13.9	12	6,372	シーティーエス	11.6	12.5	6,562
ツクイ	24.2	26.1	10,283	ネクシィーズグループ	3	3.9	4,122
キャリアデザインセンター	2.6	2.8	2,178	みらかホールディングス	28.7	31	69,874
ベネフィット・ワン	28.5	30.3	44,389	アルプラス技研	9	9.8	15,356
エムスリー	216.2	244.5	733,500	サニックス	18	19.4	5,567
ツカダ・グローバルホールディング	6.5	7.1	2,477	ダイオーズ	2.4	2.2	2,404
プラス	0.8	1.2	513	日本空調サービス	11.6	11.6	7,725
アウトソーシング	54.1	63.5	32,829	オリエンタルランド	121.4	117.9	1,749,046
ウェルネット	9.7	11.2	5,140	ダスキン	27.6	28.5	80,541
ワールドホールディングス	2.8	3.7	4,665	明光ネットワークジャパン	13	13	9,477
ディー・エヌ・エー	55.4	54.3	68,200	ファルコホールディングス	5.6	6.1	10,766
博報堂D Y ホールディングス	142.8	154.2	179,334	秀英予備校	2.2	2.4	957
ぐるなび	14.6	19.3	11,425	田谷	1.9	2	1,170
タカミヤ	10.6	11.7	5,218	ラウンドワン	31.9	31	20,801
ジャパンベストレスキューシステム	8.1	7.5	4,980	リゾートトラスト	43.5	50.8	59,588
ファンコミュニケーションズ	28.2	30.5	11,864	ビー・エム・エル	13.2	14.3	38,009
ライク	4	3.7	5,198	ワタベウェディング	1.7	1.8	680
ビジネス・ブレークスルー	4.3	4.6	1,619	りらいあコミュニケーションズ	18.6	20	20,000

銘柄	期首(前期末)	当期末		銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
リゾー教育	52.1	50.7	14,956	ウイルグループ	6.7	7.2	4,564
早稲田アカデミー	1.5	3.6	3,124	エスクリー・エージェント・ジャパン	14.1	15.3	2,356
ユー・エス・エス	125.4	124.1	192,230	日本ビューホテル	3.2	—	—
東京個別指導学院	3.6	3.9	1,833	リクルートホールディングス	735.8	794.3	2,467,890
サイバーエージェント	63.3	63.8	244,354	エラン	7.1	6.6	8,659
楽天	478.8	516.9	429,027	土木管理総合試験所	4.5	4.8	1,636
クリーク・アンド・リバー社	6	5.7	4,178	ネットマーケティング	—	3.2	1,980
マー・オー・ダブリュー	9	8.8	5,218	日本郵政	841.9	908.9	793,469
山田コンサルティンググループ	2.9	5.4	4,995	ペルシステム24ホールディングス	17.2	18.6	20,850
セントラルスポーツ	3.8	4.1	9,909	鎌倉新書	7.5	8.3	9,918
フルキャストホールディングス	10.3	11.1	14,763	SMN	1	1.8	1,162
エン・ジャパン	11.2	19.7	44,029	一蔵	1.1	1.2	621
リソルホールディングス	1.1	1.2	4,560	LITALICO	2.3	3.8	7,942
テクノプロ・ホールディングス	20.6	22.1	119,561	グローバルキッズCOMPANY	1.2	1.7	901
アトラ	2	2.5	537	エアトリ	3	4.6	3,928
インターワークス	2	2.1	974	アトラエ	2	2.9	7,023
アイ・アールジャパンホールディングス	3.1	4.5	25,470	ストライク	2.6	4.2	13,650
Keeper技研	3.8	4.1	5,592	ソラスト	25	30.5	30,103
ファーストロジック	2	2.6	1,534	セラク	2.3	3.5	2,457
三機サービス	2.1	2.1	1,927	インソース	3.4	5.4	11,799
Gunosy	7.1	6.9	6,499	ペイカレント・コンサルティング	5.4	6.7	37,386
デザインワン・ジャパン	2	2.2	404	Orchestra Holdings	1.3	2.3	1,796
イー・ガーディアン	4.9	5.6	8,237	アイモバイル	2.4	3.5	1,963
リブセンス	5.6	7.1	1,696	キャリアインデックス	3.5	4.5	1,314
ジャパンマテリアル	28.1	34.1	45,591	MS-Japan	4.1	3.6	2,721
ベクトル	12.5	13.8	9,936	船場	1.6	1.8	1,591
ウチヤマホールディングス	5.1	5.5	1,919	グレイステクノロジー	2.8	5	12,740
チャーム・ケア・コーポレーション	2.5	9.4	7,416	ジャパンエレベーターサービスホールディン	6.1	11.7	27,612
ライクキッズ	2.4	1.9	957	フルテック	1.1	1.5	1,849
キャリアリンク	3.8	3.6	1,382	グリーンズ	2.9	2.8	1,282
IBJ	6.9	7.6	4,324	ツナググループ・ホールディングス	0.9	1.3	470
アサンテ	4.1	4.4	6,820	Game With	—	2.5	1,167
N・フィールド	6.6	7.6	2,880	ソウルドアウト	0.8	1.7	3,527
バリューHR	2.2	2.2	5,854	MS Consulting	1.1	1.5	796
M&Aキャピタルパートナーズ	2.6	7.4	19,447	ミダック	—	1.1	1,096
ライドオンエクスプレスホールディングス	4.2	4.2	5,199	日総工産	2.5	7.3	3,825
ERIホールディングス	2.9	3.1	1,847	キューピーネットホールディングス	4.7	4.6	8,169
アピスト	1.6	1.7	3,468	RPAホールディングス	—	6.3	5,657
シグマクシス	4.9	7.6	9,750	スプリックス	2.9	3.7	2,556

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
マネジメントソリューションズ and factory	千株	千株	千円
カーブスホールディングス	—	1.2	3,302
アドバンテッジリスクマネジメント	—	1.1	1,116
リログループ	—	27.5	15,895
東祥	4	5.6	3,589
エイチ・アイ・エス	56.1	60.6	135,319
ラックランド	6.4	6.9	7,093
共立メンテナンス	18.3	17.3	26,901
イチネンホールディングス	2.1	2.6	3,996
建設技術研究所	15.7	18.4	47,159
スペース	10.7	12.4	14,830
長大	7.1	7.7	12,474
燐ホールディングス	6.7	7.2	7,243
スバル興業	4.1	4.1	3,403
東京テアトル	2.2	4.8	5,812
タナベ経営	0.7	0.7	5,712
ナガワ	4	4.3	5,246
よみうりランド	2	2.1	2,671
東京都競馬	2.9	3.5	24,045
常磐興産	2.2	2.4	8,904
カナモト	6.7	7.3	20,659
カナモト	4.1	4.4	6,428
東京ドーム	15.4	18.1	36,797
西尾レントオール	38.4	44.9	33,989
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	10.4	11.3	24,961
トランス・コスマス	56.4	71	1,562
	11.4	10.5	19,582

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
乃村工藝社	千株	千株	千円
藤田観光	—	24	47.5
KNT-CTホールディングス	—	4.1	4.8
日本管財	—	5.5	6.9
トーカイ	—	11	5,547
白洋舎	—	9.9	10.7
セコム	—	1.2	28,141
セントラル警備保障	—	109	3,208
丹青社	—	4.9	1,040,468
メイティック	—	19.4	21,703
応用地質	—	13	14,713
船井総研ホールディングス	—	11	60,828
進学会ホールディングス	—	21.2	14,149
オオバ	—	4.7	51,273
いであ	—	8.1	4,3
学究社	—	2.1	2,038
ベネッセホールディングス	—	3.4	4,176
イオンディライト	—	37.6	3,884
ナック	—	12.7	98,855
ニチイ学館	—	6.5	43,292
ダイセキ	—	14.6	4,800
ステップ	—	17.2	16,969
合計	—	3.8	4,161
銘柄数<比率>	—	125,044	5,740
	—	2,137	232,815,716
		<95.4%>	

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当期末	
		買建額	売建額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円
		10,339	—

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2020年3月25日現在)

区分	当期末
貸付有価証券<株式>総株数 (モルガン・スタンレーMUFG証券)	株 11,620,100 (4,974,400)

(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3月25日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 232,815,716	% 83.1
コール・ローン等、その他	47,464,184	16.9
投資信託財産総額	280,279,900	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年3月25日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	279,963,283,626
株式(評価額)	45,312,244,104
未収入金	232,815,716,820
未取配当金	772,205,210
その他未収收益	432,658,283
差入委託証拠金	57,404,409
△	573,054,800
(B) 負債	35,874,581,890
未払金	15,212,019,027
未払解約金	1,130,526,409
未払利息	△ 2,203,424
受入担保金	19,534,239,878
(C) 純資産総額(A-B)	244,088,701,736
元本	155,521,677,140
次期繰越損益金	88,567,024,596
(D) 受益権総口数	155,521,677,140口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,695円

○損益の状況 (2019年3月26日～2020年3月25日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取配当金	6,454,834,347
受取利息	6,177,370,821
その他収益金	153,254
支払利息	281,245,364
△	△ 3,935,092
(B) 有価証券売買損益	△ 36,779,317,626
売買益	17,703,040,746
売買損	△ 54,482,358,372
(C) 先物取引等取引損益	△ 199,999,790
取引益	1,489,653,530
取引損	△ 1,289,653,740
(D) 保管費用等	△ 121,129
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 30,124,604,618
(F) 前期繰越損益金	100,372,443,154
(G) 追加信託差損益金	187,375,621,352
(H) 解約差損益金	△ 169,056,435,292
(I) 計(E+F+G+H)	88,567,024,596
次期繰越損益金(I)	88,567,024,596

(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。

<注記事項>

①期首元本額 144,648,237,224円

期中追加設定元本額 243,091,402,690円

期中一部解約元本額 232,217,962,774円

また、1口当たり純資産額は、期末1,5695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国内株式インデックスファンド

50,790,692,412円

MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）

31,979,987,647円

eMAXIS TOPIXインデックス

10,654,280,427円

三菱UFJ バランスマネジメント40VA（適格機関投資家限定）

9,924,809,163円

eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）

8,988,945,317円

三菱UFJ TOPIX・ファンド

7,724,777,644円

つみたて日本株式（TOPIX）

3,566,921,468円

eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）

3,404,533,401円

MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）

3,193,400,465円

三菱UFJ バランスマネジメントVA 40型（適格機関投資家限定）

2,885,466,020円

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）

2,291,088,282円

eMAXIS バランス（8資産均等型）

2,187,156,516円

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）

1,915,137,116円

三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド

1,704,856,116円

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）

1,533,370,129円

国内株式セレクション（ラップ向け）

1,418,965,813円

つみたて8資産均等バランス

1,339,622,487円

三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1

1,278,905,086円

三菱UFJ バランスマネジメント20VA（適格機関投資家限定）

968,589,616円

国内株式インデックス・オーブン（ラップ向け）

882,732,804円

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）

624,564,692円

eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）

537,084,578円

三菱UFJ バランスマネジメント50VA（適格機関投資家限定）

446,401,997円

三菱UFJ バランスマネジメントVA 50型（適格機関投資家限定）

443,083,780円

つみたて4資産均等バランス

397,776,772円

eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）

380,713,319円

eMAXIS バランス（4資産均等型）

339,997,505円

eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）

280,568,775円

三菱UFJ バランスマネジメントVA 20型（適格機関投資家限定）

267,655,808円

eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）

261,441,477円

三菱UFJ バランスマネジメントVA 60D（適格機関投資家限定）

245,849,929円

三菱UFJ TOPIX・ファンドVA

230,875,003円

三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）

200,062,658円

ファンド・マネジャー（国内株式）

199,069,822円

MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）

199,009,336円

MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）

195,305,481円

MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2019-04（適格機関投資家限定）

158,613,947円

三菱UFJ バランスマネジメントVA 60G（適格機関投資家限定）

147,450,253円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）

142,731,821円

MUAMトピックスリスクコントロール（10%）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）

136,741,102円

MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2019-11（適格機関投資家限定）

120,109,106円

eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）

115,644,940円

eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）

111,059,861円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）

99,593,659円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）

97,539,899円

eMAXIS バランス（波乗り型）

96,621,074円

世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）

66,522,945円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）

46,177,528円

三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	41,629,367円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	37,554,127円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	31,970,541円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	31,378,773円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	25,671,793円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	23,742,169円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	22,985,649円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	18,216,295円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	15,735,143円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	15,354,118円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	8,726,654円
三菱UFJ バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	5,624,448円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	5,551,065円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	5,015,892円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,881,881円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,717,502円
MUAMトピックスリスクコントロール(5%) インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家限定)	2,067,782円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,883,966円
コアバランス	464,979円
合計	155,521,677,140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)

外国株式インデックスマザーファンド

《第19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]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月12日に第19期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。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。
主要運用対象	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コクサイ・インデックス		株組入比率	株式先物比率	投資信託組入比率	純資産額
		期騰落率	中率				
15期(2016年5月12日)	円 19,726	% △14.5	550,129.14	% △14.8	% 94.4	% 2.8	% 2.7 百万円 270,065
16期(2017年5月12日)	24,302	23.2	675,952.24	22.9	92.9	1.9	2.4 332,985
17期(2018年5月14日)	26,785	10.2	742,711.39	9.9	94.4	3.4	2.2 337,226
18期(2019年5月13日)	27,724	3.5	767,126.93	3.3	93.8	3.8	2.5 437,368
19期(2020年5月12日)	26,834	△ 3.2	740,810.97	△ 3.4	93.7	4.0	2.4 449,841

(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、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) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)		株 式 組 入 比 率	株 物 先 比 率	投 資 信 託 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2019年5月13日	円 27,724	% —	% 767,126.93	% —	% 93.8	% 3.8
5月末	26,891	△ 3.0	743,484.51	△ 3.1	92.8	4.7
6月末	27,859	0.5	770,156.42	0.4	93.8	3.7
7月末	28,618	3.2	790,836.41	3.1	95.2	2.6
8月末	27,204	△ 1.9	751,785.28	△ 2.0	88.9	8.6
9月末	28,077	1.3	775,713.31	1.1	95.5	1.8
10月末	29,192	5.3	805,459.07	5.0	92.6	4.8
11月末	30,277	9.2	835,911.03	9.0	91.8	5.6
12月末	31,190	12.5	860,793.53	12.2	93.3	4.6
2020年1月末	31,228	12.6	861,985.05	12.4	94.5	3.2
2月末	28,777	3.8	794,123.11	3.5	95.5	2.2
3月末	24,454	△11.8	675,468.96	△11.9	92.7	5.0
4月末	26,849	△ 3.2	740,391.09	△ 3.5	94.6	2.8
(期 末) 2020年5月12日	26,834	△ 3.2	740,810.97	△ 3.4	93.7	4.0
						2.4

(注) 謄落率は期首比。

(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

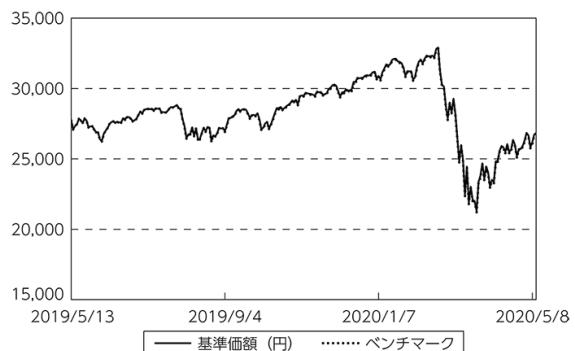
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.2%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率（-3.4%）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

外国株式市況は下落しました。

- ・外国株式市況は、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。

◎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2.0%の円高・米ドル安、5.9%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

- ・M S C I 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（R E I T）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3.4%の下落になったため、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)

- ・組入要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(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 （株式） （投資信託証券） （先物・オプション）	円 2 (1) (0) (1)	% 0.008 (0.005) (0.000) (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
(b) 有価証券取引税 （株式） （投資信託証券）	10 (10) (0)	0.036 (0.035) (0.001)	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他の費用 （保管費用） （その他）	7 (7) (0)	0.025 (0.024) (0.001)	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	19	0.069	
期中の平均基準価額は、28,248円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(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おります。

○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 256,772 (7,911)	千アメリカドル 2,217,907 (22,620)	百株 233,941 (4,933)	千アメリカドル 1,940,865 (39,278)
	カナダ	33,713 (△ 915)	千カナダドル 160,566 (—)	33,831 (256)	千カナダドル 139,077 (553)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	20,030 (66)	90,669 (△ 245)	17,811	77,873
	イタリア	43,865	20,470	40,432	17,517
	フランス	21,728 (44)	106,711 (△ 15)	19,818	92,384
	オランダ	17,811	54,596	14,823	42,858
	スペイン	43,954 (18,346)	31,539 (379)	56,983	27,330
	ベルギー	1,582	10,955	1,439	8,742
	オーストリア	775 (—)	2,332 (△ 44)	726	2,096
	ルクセンブルク	2,360	2,852	1,873	2,418
	フィンランド	7,431 (47)	10,141 (—)	6,564	8,838
	アイルランド	2,120 (1)	5,828 (10)	1,837 (—)	5,143 (10)
	ポルトガル	2,924	1,778	2,503	1,495
	イギリス	250,154 (79,759)	千イギリスポンド 148,712 (△ 136)	225,597 (203,336)	千イギリスポンド 126,735 (627)
	スイス	14,455 (—)	千スイスフラン 108,330 (△ 271)	12,997	千スイスフラン 94,941
	スウェーデン	20,745 (787)	千スウェーデンクローネ 295,948 (1,238)	18,497 (517)	千スウェーデンクローネ 256,504 (1,358)
	ノルウェー	4,352	千ノルウェークローネ 64,787	4,302	千ノルウェークローネ 60,598
	デンマーク	3,524	千デンマーククローネ 153,739	3,237	千デンマーククローネ 134,802
	オーストラリア	64,754 (△ 7)	千オーストラリアドル 112,459 (△ 72)	56,170 (32)	千オーストラリアドル 95,600 (4)

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	ニュージーランド	百株 3,846	千ニュージーランドドル 3,259	百株 3,268	千ニュージーランドドル 2,781
	香港	74,550 (1,107)	千香港ドル 291,698 (—)	68,258	千香港ドル 258,400
	シンガポール	27,989	千シンガポールドル 17,273	31,699	千シンガポールドル 15,199
	イスラエル	4,568 (68)	千イスラエルシェケル 13,124 (—)	4,767	千イスラエルシェケル 9,623

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40	1,346	31	1,081
MACERICH CO/THE	1	46	13	364
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8	1,415	7	1,127
PROLOGIS INC	54 (13)	4,816 (1,046)	50	4,333
CAMDEN PROPERTY TRUST	8	917	7	798
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11	664	10	570
DIGITAL REALTY TRUST INC	23	2,967	15	1,890
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22 (8)	2,109 (-)	10	874
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	1,608	4	1,492
EXTRA SPACE STORAGE INC	9	967	7	859
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5	699	4	617
WELLTOWER INC	33	2,755	26	2,187
BOSTON PROPERTIES INC	12	1,694	11	1,481
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	76	1,544	19	405
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9	1,244	7	1,026
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	33	1,431	11	471
REALTY INCOME CORP	24	1,809	20	1,522
REGENCY CENTERS CORP	16	1,060	13	848
SL GREEN REALTY CORP	5	513	5	413
SUN COMMUNITIES INC	18	2,475	7	1,087
UDR INC	22	1,051	15	733
VENTAS INC	34	1,918	27	1,673
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	74	685	30 (186)	270 (1,760)
WEYERHAEUSER CO	61	1,714	54	1,440
AMERICAN TOWER CORP	36	8,175	32	7,423
AGNC INVESTMENT CORP	29	482	18 (67)	292 (1,159)
WP CAREY INC	13	1,056	9	832
VEREIT INC	88	856	69	651
DUKE REALTY CORP	29	1,020	27	907
IRON MOUNTAIN INC	19	616	16	533
EQUINIX INC	7	4,015	5	3,327
CROWN CASTLE INTL CORP	34	4,897	30	4,509
EQUITY RESIDENTIAL	29	2,394	25	2,067
INVITATION HOMES INC	48	1,455	27	804
VICI PROPERTIES INC	71	1,806	18	474
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	—	12	245
SBA COMMUNICATIONS CORP	2 (14)	834 (3,282)	5	1,407
HOST HOTELS & RESORTS INC	65	1,093	59	911

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
LIBERTY PROPERTY TRUST	9 (△ 20)	505 (△ 1,046)	3	191
PUBLIC STORAGE	12	2,843	11	2,630
SIMON PROPERTY GROUP INC	24	3,510	23	3,195
VORNADO REALTY TRUST	13	862	13	798
KIMCO REALTY CORP	38	677	30	521
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11	2,433	10	2,176
小計	1,202 (16)	76,996 (3,282)	863 (253)	61,474 (2,920)
	千カナダドル		千カナダドル	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	4	142	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12	653	3	208
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12	262	9	201
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8	234	6	142
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	2 (25)	43 (553)	12	273
小計	39 (25)	1,335 (553)	32	824
ヨーロッパ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	5	748	4	690
KLEPIERRE	18	592	19	555
COVIVIO	2	257	2	244
ICADE	1	137	1	120
小計	27	1,735	27	1,611
オランダ				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12	1,527	10	1,272
小計	12	1,527	10	1,272
ユーロ計	40	3,263	38	2,883
	千イギリスポンド		千イギリスポンド	
イギリス				
BRITISH LAND CO PLC	93	491	81	417
HAMMERSOHN PLC	—	—	75	209
LAND SECURITIES GROUP PLC	50	433	44	378
SEGRO PLC	95	813	81	667
小計	239	1,738	283	1,673
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	271	691	287	694
SCENTRE GROUP	526	1,890	470	1,725
GPT GROUP	175	947	142	859
MIRVAC GROUP	289	937	278	881
STOCKLAND	273	1,134	243	1,147
DEXUS	86	1,090	74	951
GOODMAN GROUP	143	2,063	131	1,945
小計	1,767	8,755	1,629	8,206

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
LINK REIT	181	14,948	161	13,243
小計	181	14,948	161	13,243
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	269 (-)	494 (△ 1)	324	588
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	245	446	160	326
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	400 (-)	963 (△ 0.06294)	184	422
CAPITALAND MALL TRUST	122	308	104	242
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	245 (-)	752 (△ 4)	204	635
ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	— (40)	— (-)	40	10
小計	1,283 (40)	2,964 (△ 5)	1,018	2,225

(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 371,227	百万円 371,693	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	651,373,227千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	436,549,910千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.49

(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 427,884	百万円 378,738	88.5	百万円 389,771	百万円 362,161	92.9

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MUF G証券です。

○組入資産の明細

(2020年5月12日現在)

外国株式

銘 柏	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
AMERICAN EXPRESS CO	753	783	6,685	718,854		各種金融
ABBOTT LABORATORIES	1,822	1,994	19,158	2,059,877		ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	330	348	2,835	304,856		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	55	—	—	—		各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	454	487	7,042	757,241		ソフトウェア・サービス
AES CORP	683	763	946	101,766		公益事業
AFLAC INC	790	819	2,903	312,132		保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	917	991	2,732	293,841		保険
APACHE CORP	388	403	484	52,138		エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	983	1,194	6,655	715,619		半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	49	43	185	19,926		ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	662	715	13,431	1,444,169		ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	227	250	5,832	627,068		素材
ANTHEM INC	268	285	7,785	837,147		ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	522	—	—	—		エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,436	1,554	5,871	631,291		ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	525	542	4,827	519,011		ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	559	602	7,770	835,518		資本財
BECTON DICKINSON AND CO	278	305	7,992	859,356		ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	259	275	2,149	231,167		小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,693	2,644	16,567	1,781,323		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	122	130	6,436	692,006		各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,287	4,661	26,289	2,826,678		電気通信サービス
BALL CORP	337	350	2,223	239,080		素材
ALLSTATE CORP	357	363	3,702	398,125		保険
avery DENNISON CORP	88	92	1,004	108,030		素材
CHUBB LTD	477	512	5,215	560,817		保険
ANALOG DEVICES INC	382	412	4,477	481,377		半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	26	26	2,837	305,039		小売
CVS HEALTH CORP	1,342	1,468	9,372	1,007,728		ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	831	839	1,788	192,264		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	3,450	3,534	31,799	3,419,066		銀行
CATERPILLAR INC	612	622	6,764	727,301		資本財
COCA-COLA CO/THE	4,196	4,589	20,899	2,247,098		食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	490	526	3,129	336,511		各種金融
CAMPBELL SOUP CO	186	182	948	101,991		食品・飲料・タバコ
CSX CORP	832	823	5,427	583,514		運輸
CHEVRON CORP	1,981	2,130	19,890	2,138,578		エネルギー
TAPESTRY INC	300	336	468	50,372		耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	1,192	1,221	5,162	555,074		エネルギー
CME GROUP INC	371	403	7,433	799,207		各種金融
CARDINAL HEALTH INC	317	335	1,787	192,149		ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	855	918	6,373	685,326		家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	783	926	7,341	789,384		公益事業
DEVON ENERGY CORP	496	446	556	59,849		エネルギー
DEERE & CO	317	334	4,512	485,137		資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円		
DANAHER CORP	654	705	11,408	1,226,604		ヘルスケア機器・サービス	
WALT DISNEY CO/THE	1,865	2,031	21,889	2,353,592		メディア・娯楽	
DARDEN RESTAURANTS INC	131	144	1,068	114,854		消費者サービス	
DUKE ENERGY CORP	740	823	6,726	723,276		公益事業	
DR HORTON INC	377	412	2,002	215,302		耐久消費財・アパレル	
TARGET CORP	513	573	6,894	741,321		小売	
DAVITA INC	132	101	826	88,818		ヘルスケア機器・サービス	
DOVER CORP	147	171	1,559	167,626		資本財	
DTE ENERGY COMPANY	192	217	2,143	230,450		公益事業	
EXXON MOBIL CORP	4,390	4,763	21,789	2,342,785		エネルギー	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	216	232	5,238	563,290		ヘルスケア機器・サービス	
EOG RESOURCES INC	600	658	3,280	352,673		エネルギー	
EMERSON ELECTRIC CO	648	683	3,829	411,738		資本財	
EXELON CORP	1,005	1,088	4,058	436,332		公益事業	
ECOLAB INC	269	295	5,794	623,051		素材	
EQUIFAX INC	123	136	2,018	217,076		商業・専門サービス	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	228	250	4,255	457,538		家庭用品・パーソナル用品	
EATON CORP PLC	449	464	3,769	405,260		資本財	
EDISON INTERNATIONAL	338	406	2,308	248,214		公益事業	
ENTERGY CORP	190	227	2,186	235,072		公益事業	
EVEREST RE GROUP LTD	42	46	824	88,623		保険	
NEXTERA ENERGY INC	496	550	12,506	1,344,707		公益事業	
MACY'S INC	305	—	—	—		小売	
FEDEX CORP	259	279	3,280	352,733		運輸	
FORD MOTOR CO	3,848	4,380	2,242	241,137		自動車・自動車部品	
FRANKLIN RESOURCES INC	321	339	663	71,379		各種金融	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	42	1,207	129,819		各種金融	
FIRSTENERGY CORP	531	609	2,465	265,042		公益事業	
FLUOR CORP	143	—	—	—		資本財	
FREEPORT-MCMORAN INC	1,434	1,651	1,483	159,494		素材	
GENERAL MILLS INC	619	682	4,148	445,996		食品・飲料・タバコ	
GENERAL DYNAMICS CORP	261	277	3,710	398,944		資本財	
WW GRAINGER INC	48	50	1,449	155,888		資本財	
GENERAL ELECTRIC CO	9,024	9,845	6,094	655,242		資本財	
GLOBAL PAYMENTS INC	166	338	5,838	627,771		ソフトウェア・サービス	
GENUINE PARTS CO	153	162	1,235	132,867		小売	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	246	—	—	—		自動車・自動車部品	
GAP INC/THE	232	220	168	18,161		小売	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	347	358	6,565	705,869		各種金融	
HALLIBURTON CO	900	902	954	102,617		エネルギー	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	767	805	10,815	1,162,905		資本財	
HARLEY-DAVIDSON INC	166	169	340	36,581		自動車・自動車部品	
HP INC	1,642	1,675	2,582	277,708		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	372	410	1,434	154,196		保険	
HERSHEY CO/THE	149	167	2,228	239,623		食品・飲料・タバコ	
HOME DEPOT INC	1,171	1,230	29,100	3,128,852		小売	
HASBRO INC	122	142	974	104,789		耐久消費財・アパレル	
TRANX TECHNOLOGIES PLC	254	271	2,196	236,202		資本財	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	943	997	12,231	1,315,108		ソフトウェア・サービス	
INTERNATIONAL PAPER CO	401	412	1,364	146,725		素材	
ILLINOIS TOOL WORKS	309	364	5,893	633,715		資本財	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	403	397	663	71,378		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		
IDEX CORP	81	92	1,413	151,981		資本財	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	89	111	1,474	158,518		素材	
JOHNSON & JOHNSON	2,783	2,968	44,256	4,758,420		医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KANSAS CITY SOUTHERN	103	115	1,545	166,180		運輸	
KELLOGG CO	274	297	1,882	202,412		食品・飲料・タバコ	
KIMBERLY-CLARK CORP	359	390	5,408	581,509		家庭用品・パーソナル用品	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,508	1,621	8,237	885,649		食品・飲料・タバコ	
KROGER CO	827	907	3,061	329,129		食品・生活必需品小売	
KOHLS CORP	177	149	263	28,280		小売	
ELI LILLY & CO	927	974	15,456	1,661,889		医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	102	108	1,835	197,347		ヘルスケア機器・サービス	
SOUTHWEST AIRLINES CO	143	146	381	41,028		運輸	
LENNAR CORP-A	309	333	1,766	189,978		耐久消費財・アパレル	
LOWE'S COS INC	836	865	9,815	1,055,361		小売	
LEGGETT & PLATT INC	135	137	392	42,169		耐久消費財・アパレル	
L BRANDS INC	247	—	—	—		小売	
LAS VEGAS SANDS CORP	407	383	1,859	199,890		消費者サービス	
LOCKHEED MARTIN CORP	265	286	10,789	1,160,135		資本財	
LINCOLN NATIONAL CORP	220	217	767	82,542		保険	
LENNOX INTERNATIONAL INC	37	41	777	83,588		資本財	
L3 TECHNOLOGIES INC	81	—	—	—		資本財	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	300	318	2,621	281,818		消費者サービス	
MCDONALD'S CORP	800	848	15,347	1,650,181		消費者サービス	
S&P GLOBAL INC	260	274	8,265	888,759		各種金融	
MEDTRONIC PLC	1,394	1,510	14,915	1,603,711		ヘルスケア機器・サービス	
MERCK & CO. INC.	2,698	2,871	22,371	2,405,422		医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MICRON TECHNOLOGY INC	1,174	1,252	6,039	649,316		半導体・半導体製造装置	
MATTEL INC	368	—	—	—		耐久消費財・アパレル	
3M CO	604	648	9,443	1,015,406		資本財	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	169	192	2,509	269,820		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	508	579	849	91,309		消費者サービス	
MASCO CORP	311	315	1,309	140,744		資本財	
M & T BANK CORP	140	145	1,449	155,847		銀行	
MARSH & MCLENNAN COS	522	562	5,858	629,950		保険	
MOHAWK INDUSTRIES INC	63	73	594	63,880		耐久消費財・アパレル	
MORGAN STANLEY	1,339	1,379	5,494	590,726		各種金融	
MCKESSON CORP	204	182	2,557	274,982		ヘルスケア機器・サービス	
METLIFE INC	869	883	3,001	322,774		保険	
MANPOWERGROUP INC	66	63	443	47,689		商業・専門サービス	
MOODY'S CORP	178	189	4,804	516,617		各種金融	
NORFOLK SOUTHERN CORP	282	293	5,106	549,002		運輸	
BANK OF AMERICA CORP	9,673	9,627	21,739	2,337,441		銀行	
NISOURCE INC	386	413	971	104,470		公益事業	
NORTHROP GRUMMAN CORP	171	181	5,927	637,363		資本財	
NEWMONT CORP	850	934	5,884	632,735		素材	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	126	139	2,291	246,426		食品・飲料・タバコ	
MARKEL CORP	14	15	1,354	145,595		保険	
NUCOR CORP	327	343	1,397	150,229		素材	
NEWELL BRANDS INC	474	440	529	56,983		耐久消費財・アパレル	
NOBLE ENERGY INC	483	588	564	60,745		エネルギー	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	782	953	1,433	154,088		エネルギー	
OMNICOM GROUP	235	242	1,298	139,570		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		
PEPSICO INC	1,464	1,572	21,126	2,271,555		食品・飲料・タバコ	
PACKAGING CORP OF AMERICA	95	111	1,087	116,950		素材	
ALTRIA GROUP INC	1,949	2,106	7,672	824,942		食品・飲料・タバコ	
PINNACLE WEST CAPITAL	114	127	941	101,187		公益事業	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,585	2,811	32,424	3,486,304		家庭用品・パーソナル用品	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	478	491	5,014	539,203		銀行	
PFIZER INC	5,998	6,241	23,778	2,556,678		医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	428	449	2,561	275,460		保険	
PULTEGROUP INC	266	260	767	82,547		耐久消費財・アパレル	
PARKER HANNIFIN CORP	137	146	2,315	249,015		資本財	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	176	198	1,676	180,227		エネルギー	
CITIGROUP INC	2,533	2,454	10,818	1,163,198		銀行	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	299	336	1,231	132,362		保険	
PPG INDUSTRIES INC	248	267	2,414	259,586		素材	
PENTAIR PLC	174	173	600	64,529		資本財	
PPL CORP	758	825	2,084	224,162		公益事業	
PROGRESSIVE CORP	604	665	4,865	523,171		保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	525	567	2,735	294,078		公益事業	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	173	182	696	74,874		消費者サービス	
RAYTHEON COMPANY	295	—	—	—		資本財	
REPUBLIC SERVICES INC	236	247	2,029	218,256		商業・専門サービス	
REGIONS FINANCIAL CORP	1,094	1,026	1,007	108,308		銀行	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	42	51	833	89,620		保険	
ROPER TECHNOLOGIES INC	107	117	4,267	458,879		資本財	
CENTERPOINT ENERGY INC	532	578	1,050	113,000		公益事業	
ROBERT HALF INTL INC	127	157	730	78,536		商業・専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	125	130	2,525	271,497		資本財	
SCHLUMBERGER LTD	1,422	1,520	2,638	283,726		エネルギー	
STRYKER CORP	349	379	7,356	790,958		ヘルスケア機器・サービス	
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,261	1,287	4,614	496,113		各種金融	
SEMPRA ENERGY	284	316	3,950	424,735		公益事業	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	87	93	5,227	562,108		素材	
STANLEY BLACK & DECKER INC	159	170	1,934	207,996		資本財	
SUNTRUST BANKS INC	464	—	—	—		銀行	
TRAVELERS COS INC/THE	274	289	2,764	297,191		保険	
SOUTHERN CO/THE	1,068	1,179	6,584	707,925		公益事業	
AT&T INC	7,550	8,235	24,197	2,601,697		電気通信サービス	
WESTERN DIGITAL CORP	306	338	1,434	154,225		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STATE STREET CORP	394	408	2,398	257,908		各種金融	
SYSCO CORP	512	553	2,862	307,784		食品・生活必需品小売り	
SEALED AIR CORP	158	165	486	52,258		素材	
TEXAS INSTRUMENTS INC	995	1,051	12,084	1,299,333		半導体・半導体製造装置	
TIFFANY & CO	113	119	1,539	165,498		小売	
TERADYNE INC	—	187	1,182	127,168		半導体・半導体製造装置	
GLOBE LIFE INC	106	115	863	92,872		保険	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	958	875	2,499	268,710		資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	417	452	15,392	1,654,958		医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TEXTRON INC	253	248	642	69,107		資本財	
UNION PACIFIC CORP	764	781	12,265	1,318,771		運輸	
UNUM GROUP	223	244	362	39,021		保険	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	850	1,706	9,789	1,052,537		資本財	
UNITEDHEALTH GROUP INC	998	1,068	30,842	3,316,215		ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円		
US Bancorp	1,592	1,676	5,592	601,326		銀行	
Marathon Oil Corp	855	944	542	58,382		エネルギー	
United Parcel Service-CL B	721	790	7,420	797,880		運輸	
Valero Energy Corp	442	471	3,091	332,432		エネルギー	
Varian Medical Systems Inc	93	102	1,239	133,304		ヘルスケア機器・サービス	
ViacomCBS Inc - CLASS B	350	649	1,171	125,969		メディア・娯楽	
VF Corp	349	383	2,196	236,122		耐久消費財・アパレル	
Vulcan Materials Co	138	149	1,448	155,783		素材	
Williams Cos Inc	1,278	1,363	2,662	286,224		エネルギー	
Walgreens Boots Alliance Inc	836	857	3,578	384,756		食品・生活必需品小売り	
WEC Energy Group Inc	329	358	3,062	329,286		公益事業	
Walmart Inc	1,507	1,605	19,857	2,135,085		食品・生活必需品小売り	
Wellcare Health Plans Inc	50	—	—	—		ヘルスケア機器・サービス	
Wells Fargo & Co	4,639	4,528	11,222	1,206,599		銀行	
Waste Management Inc	442	474	4,766	512,473		商業・専門サービス	
Waters Corp	78	73	1,398	150,400		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Whirlpool Corp	64	75	825	88,776		耐久消費財・アパレル	
Xerox Corp	219	—	—	—		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
Xcel Energy Inc	534	587	3,534	380,049		公益事業	
KeyCorp	1,080	1,112	1,189	127,939		銀行	
CarMax Inc	185	188	1,435	154,352		小売	
Zimmer Biomet Holdings Inc	211	231	2,728	293,370		ヘルスケア機器・サービス	
Yum! Brands Inc	324	339	2,931	315,174		消費者サービス	
T.J.X. Companies Inc	1,282	1,365	6,601	709,742		小売	
Clorox Company	132	141	2,913	313,298		家庭用品・パーソナル用品	
Celanese Corp	142	140	1,124	120,919		素材	
Cadence Design Sys Inc	292	313	2,604	280,022		ソフトウェア・サービス	
Carnival Corp	440	523	725	78,013		消費者サービス	
Fidelity National Info Serv	339	691	8,872	953,920		ソフトウェア・サービス	
Conagra Brands Inc	512	532	1,779	191,312		食品・飲料・タバコ	
Consolidated Edison Inc	323	378	2,751	295,875		公益事業	
Fifth Third Bancorp	805	835	1,435	154,395		銀行	
Intel Corp	4,734	4,902	29,476	3,169,314		半導体・半導体製造装置	
Cisco Systems Inc	4,664	4,778	20,699	2,225,573		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
Cintas Corp	93	100	2,155	231,792		商業・専門サービス	
SBA Communications Corp	118	—	—	—		不動産	
Costco Wholesale Corp	454	498	15,467	1,663,062		食品・生活必需品小売り	
Applied Materials Inc	1,019	1,052	5,684	611,232		半導体・半導体製造装置	
Electronic Arts Inc	313	328	3,856	414,680		メディア・娯楽	
Tyson Foods Inc-CL A	306	333	2,026	217,853		食品・飲料・タバコ	
NortonLifeLock Inc	647	701	1,508	162,143		ソフトウェア・サービス	
Ross Stores Inc	386	407	3,698	397,683		小売	
Microchip Technology Inc	248	269	2,380	255,920		半導体・半導体製造装置	
Nike Inc -CL B	1,320	1,403	12,764	1,372,388		耐久消費財・アパレル	
Exact Sciences Corp	—	166	1,394	149,963		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Amgen Inc	661	670	16,277	1,750,199		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Comerica Inc	162	152	490	52,757		銀行	
Northern Trust Corp	218	231	1,731	186,181		各種金融	
Microsoft Corp	7,566	8,170	152,573	16,404,661		ソフトウェア・サービス	
Ansys Inc	88	96	2,555	274,808		ソフトウェア・サービス	
Centene Corp	428	658	4,448	478,305		ヘルスケア機器・サービス	
Starbucks Corp	1,287	1,329	10,090	1,084,912		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		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円		
ORACLE CORP	2,751	2,589	13,860	1,490,294	ソフトウェア・サービス		
NETFLIX INC	452	493	21,759	2,339,579	メディア・娯楽		
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	83	85	3,396	365,206	小売		
ACTIVISION BLIZZARD INC	751	873	6,590	708,572	メディア・娯楽		
SKYWORKS SOLUTIONS INC	187	195	2,158	232,036	半導体・半導体製造装置		
HENRY SCHEIN INC	159	157	873	93,941	ヘルスケア機器・サービス		
TRACTOR SUPPLY COMPANY	129	132	1,446	155,505	小売		
LAM RESEARCH CORP	160	162	4,270	459,183	半導体・半導体製造装置		
COPART INC	212	235	1,953	210,049	商業・専門サービス		
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	100	1,137	122,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
WYNN RESORTS LTD	99	108	894	96,139	消費者サービス		
COMCAST CORP-CLASS A	4,710	5,117	18,503	1,989,477	メディア・娯楽		
XILINX INC	262	275	2,378	255,764	半導体・半導体製造装置		
PACCAR INC	362	397	2,735	294,085	資本財		
DENTSPLY SIRONA INC	238	256	1,035	111,300	ヘルスケア機器・サービス		
ALIGN TECHNOLOGY INC	78	83	1,783	191,728	ヘルスケア機器・サービス		
GILEAD SCIENCES INC	1,342	1,428	11,540	1,240,800	医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス		
CITRIX SYSTEMS INC	139	149	2,305	247,939	ソフトウェア・サービス		
INTUITIVE SURGICAL INC	118	129	7,007	753,416	ヘルスケア機器・サービス		
INTUIT INC	255	292	8,427	906,173	ソフトウェア・サービス		
SVB FINANCIAL GROUP	54	57	1,022	109,978	銀行		
PAYCHEX INC	334	365	2,421	260,324	ソフトウェア・サービス		
ON SEMICONDUCTOR CORP	451	534	837	90,022	半導体・半導体製造装置		
SIGNATURE BANK	56	67	684	73,639	銀行		
CHECK POINT SOFTWARE TECH	126	134	1,447	155,646	ソフトウェア・サービス		
OLD DOMINION FREIGHT LINE	64	105	1,645	176,890	運輸		
AUTODESK INC	226	246	4,552	489,481	ソフトウェア・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	181	139	300	32,261	メディア・娯楽		
SALESFORCE.COM INC	793	938	17,136	1,842,511	ソフトウェア・サービス		
NORDSTROM INC	119	100	172	18,525	小売		
ALPHABET INC-CL A	309	485	68,089	7,320,988	メディア・娯楽		
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	61	1,454	156,399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
EAST WEST BANCORP INC	154	163	553	59,511	銀行		
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	41	2,112	227,095	各種金融		
UNITED THERAPEUTICS CORP	41	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス		
GARMIN LTD	115	146	1,187	127,685	耐久消費財・アパレル		
TRIMBLE INC	257	277	1,030	110,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
QUALCOMM INC	1,257	1,286	10,351	1,113,010	半導体・半導体製造装置		
HOLOGIC INC	293	304	1,610	173,148	ヘルスケア機器・サービス		
SYNOPSYS INC	155	165	2,676	287,767	ソフトウェア・サービス		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	292	317	1,732	186,226	半導体・半導体製造装置		
AMAZON.COM INC	431	475	114,458	12,306,612	小売		
T ROWE PRICE GROUP INC	249	262	2,954	317,696	各種金融		
QUEST DIAGNOSTICS INC	139	152	1,690	181,806	ヘルスケア機器・サービス		
KLA CORP	169	177	2,992	321,804	半導体・半導体製造装置		
STEEL DYNAMICS INC	231	231	561	60,401	素材		
E*TRADE FINANCIAL CORP	267	331	1,359	146,126	各種金融		
CERNER CORP	307	354	2,426	260,938	ヘルスケア機器・サービス		
ALKERMES PLC	158	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス		
VERISIGN INC	112	118	2,516	270,576	ソフトウェア・サービス		
WASTE CONNECTIONS INC	273	298	2,792	300,251	商業・専門サービス		
EBAY INC	948	870	3,666	394,216	小売		

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円		
IAC/INTERACTIVECORP	81	91	2,204	237,058	メディア・娯楽		
NVIDIA CORP	600	654	21,131	2,272,036	半導体・半導体製造装置		
DOLLAR TREE INC	246	266	2,076	223,302	小売		
BOOKING HOLDINGS INC	48	47	6,648	714,860	小売		
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,343	1,481	25,865	2,781,086	各種金融		
TRUIST FINANCIAL CORP	798	1,505	5,180	557,050	銀行		
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,026	931	3,207	344,885	各種金融		
BORGWARNER INC	218	222	650	69,992	自動車・自動車部品		
H&R BLOCK INC	213	—	—	—	消費者サービス		
JM SMUCKER CO/THE	116	135	1,583	170,248	食品・飲料・タバコ		
AMERISOURCEBERGEN CORP	161	168	1,528	164,291	ヘルスケア機器・サービス		
ASSURANT INC	64	71	699	75,212	保険		
AMEREN CORPORATION	255	271	1,920	206,520	公益事業		
AMERICAN ELECTRIC POWER	512	552	4,370	469,890	公益事業		
AON PLC	249	—	—	—	保険		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	583	612	2,168	233,205	食品・飲料・タバコ		
HESS CORP	277	316	1,492	160,434	エネルギー		
JUNIPER NETWORKS INC	344	423	1,007	108,295	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
TD AMERITRADE HOLDING CORP	285	299	1,104	118,768	各種金融		
RED HAT INC	183	—	—	—	ソフトウェア・サービス		
F5 NETWORKS INC	62	67	1,005	108,072	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
DISH NETWORK CORP-A	232	263	682	73,354	メディア・娯楽		
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	167	182	1,862	200,261	ソフトウェア・サービス		
NETAPP INC	261	263	1,159	124,649	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
INCYTE CORP	190	201	2,001	215,147	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	646	700	1,845	198,460	半導体・半導体製造装置		
BIOGEN INC	209	203	6,679	718,190	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ILLUMINA INC	152	164	5,261	565,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ADOBE INC	506	545	20,243	2,176,581	ソフトウェア・サービス		
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	265	290	8,293	891,703	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	970	1,239	1,419	152,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CELGENE CORP	725	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	600	615	3,417	367,490	ソフトウェア・サービス		
EXPEDITORS INTL WASH INC	183	185	1,394	149,940	運輸		
FASTENAL CO	297	646	2,567	276,030	資本財		
FISERV INC	413	652	6,634	713,322	ソフトウェア・サービス		
FLEX LTD	536	558	552	59,369	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
NEKTAR THERAPEUTICS	176	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,779	1,726	977	105,090	メディア・娯楽		
APPLE INC	4,923	5,009	157,809	16,967,689	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
CINCINNATI FINANCIAL CORP	160	175	946	101,793	保険		
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,119	1,174	965	103,858	銀行		
ZIONS BANCORP NA	205	207	606	65,262	銀行		
COSTAR GROUP INC	38	41	2,732	293,837	商業・専門サービス		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	231	250	2,534	272,478	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	146	160	1,195	128,583	運輸		
CENTURYLINK INC	1,018	1,078	1,042	112,098	電気通信サービス		
FLIR SYSTEMS INC	145	157	768	82,580	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
MYLAN NV	520	552	937	100,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ONEOK INC	428	485	1,524	163,884	エネルギー		
SEAGATE TECHNOLOGY	275	259	1,296	139,368	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
BUNGE LTD	140	171	593	63,777	食品・飲料・タバコ		

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		
ADVANCE AUTO PARTS INC	77	76	967	104,049		小売	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	389	545	702	75,509		エネルギー	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	172	188	3,077	330,863		食品・飲料・タバコ	
NVR INC	3	4	1,289	138,653		耐久消費財・アパレル	
COOPER COS INC/THE	49	55	1,720	185,011		ヘルスケア機器・サービス	
AMPHENOL CORP-CL A	312	333	2,905	312,416		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WR BERKLEY CORP	153	160	817	87,871		保険	
DISCOVERY INC - A	161	202	411	44,288		メディア・娯楽	
MONSTER BEVERAGE CORP	434	454	3,016	324,318		食品・飲料・タバコ	
EXPEDIA GROUP INC	129	162	1,095	117,782		小売	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	242	223	613	65,964		素材	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	540	504	1,062	114,246		メディア・娯楽	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	144	145	1,799	193,464		各種金融	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	290	323	820	88,247		保険	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	591	632	5,947	639,495		各種金融	
NASDAQ INC	117	128	1,401	150,671		各種金融	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	175	142	128	13,832		耐久消費財・アパレル	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	150	160	652	70,159		メディア・娯楽	
VIACOM INC-CLASS B	361	—	—	—		メディア・娯楽	
AUTOLIV INC	89	87	530	57,022		自動車・自動車部品	
CBRE GROUP INC - A	337	375	1,532	164,801		不動産	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	25	29	2,751	295,825		消費者サービス	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	272	348	2,324	249,943		食品・飲料・タバコ	
QURATE RETAIL INC-SERIES A	419	—	—	—		小売	
ARROW ELECTRONICS INC	90	87	560	60,222		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BROWN & BROWN INC	—	264	1,004	107,962		保険	
CUMMINS INC	157	168	2,721	292,665		資本財	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	133	146	1,154	124,098		資本財	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	311	276	382	41,137		各種金融	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	63	74	1,264	136,011		素材	
CIMAREX ENERGY CO	109	—	—	—		エネルギー	
RALPH LAUREN CORP	57	52	365	39,314		耐久消費財・アパレル	
ALLIANT ENERGY CORP	247	281	1,326	142,602		公益事業	
HANESBRANDS INC	372	388	348	37,431		耐久消費財・アパレル	
MASTERCARD INC - A	953	1,011	28,444	3,058,316		ソフトウェア・サービス	
WESTERN UNION CO	479	460	889	95,624		ソフトウェア・サービス	
LEIDOS HOLDINGS INC	151	155	1,591	171,071		ソフトウェア・サービス	
AERCAP HOLDINGS NV	134	135	387	41,666		資本財	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	106	110	210	22,579		資本財	
IPG PHOTONICS CORP	37	39	610	65,620		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOSAIC CO/THE	374	425	477	51,374		素材	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	253	222	362	39,010		消費者サービス	
HEICO CORP	—	45	408	43,914		資本財	
TRANSDIGM GROUP INC	49	55	1,926	207,111		資本財	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	121	125	1,492	160,464		ソフトウェア・サービス	
INSULET CORP	—	69	1,562	168,029		ヘルスケア機器・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	135	142	2,841	305,550		保険	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	388	501	580	62,378		銀行	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	741	3,941	423,766		各種金融	
TE CONNECTIVITY LTD	356	379	2,827	304,044		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	348	331	1,342	144,311		各種金融	
LULULEMON ATHLETICA INC	103	124	3,053	328,264		耐久消費財・アパレル	

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		
WABCO HOLDINGS INC	54	60	822	88,397		資本財	
MERCADOLIBRE INC	44	50	3,935	423,116		小売	
VMWARE INC-CLASS A	87	91	1,286	138,334		ソフトウェア・サービス	
LOEWS CORP	272	300	902	97,080		保険	
SEATTLE GENETICS INC	116	131	2,108	226,748		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ULTA BEAUTY INC	58	63	1,462	157,204		小売	
LKQ CORP	323	331	840	90,368		小売	
HORMEL FOODS CORP	307	342	1,638	176,184		食品・飲料・タバコ	
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	237	955	102,746		公益事業	
EASTMAN CHEMICAL CO	148	142	879	94,513		素材	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	122	247	4,437	477,096		資本財	
HUMANA INC	142	147	5,623	604,633		ヘルスケア機器・サービス	
NRG ENERGY INC	303	267	868	93,391		公益事業	
INVESCO LTD	426	428	335	36,051		各種金融	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	185	199	1,925	206,982		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEI INVESTMENTS COMPANY	136	150	779	83,854		各種金融	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	172	—	—	—		ソフトウェア・サービス	
CONCHO RESOURCES INC	210	246	1,388	149,248		エネルギー	
MSCI INC	91	95	3,305	355,441		各種金融	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	90	130	182	19,591		エネルギー	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	201	205	791	85,147		食品・飲料・タバコ	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,613	1,754	12,504	1,344,477		食品・飲料・タバコ	
VISA INC-CLASS A SHARES	1,825	1,929	35,418	3,808,192		ソフトウェア・サービス	
CABOT OIL & GAS CORP	455	451	873	93,876		エネルギー	
FLOWSERVE CORP	139	145	363	39,064		資本財	
HELMERICH & PAYNE	116	—	—	—		エネルギー	
T-MOBILE US INC	352	482	4,670	502,152		電気通信サービス	
DISCOVERY INC-C	306	397	735	79,061		メディア・娯楽	
RESMED INC	151	162	2,747	295,401		ヘルスケア機器・サービス	
GARTNER INC	96	101	1,204	129,551		ソフトウェア・サービス	
AMETEK INC	240	251	2,092	224,939		資本財	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	410	468	1,183	127,280		保険	
CHURCH & DWIGHT CO INC	256	279	2,065	222,114		家庭用品・パーソナル用品	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	91	98	1,011	108,763		運輸	
PERRIGO CO PLC	136	145	777	83,637		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FMC CORP	135	155	1,421	152,873		素材	
WABTEC CORP	142	205	1,125	121,003		資本財	
EVERSOURCE ENERGY	329	362	2,791	300,151		公益事業	
INGREDION INC	73	71	586	63,017		食品・飲料・タバコ	
ALLERGAN PLC	350	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CROWN HOLDINGS INC	138	147	898	96,587		素材	
EATON VANCE CORP	126	121	457	49,185		各種金融	
DELTA AIR LINES INC	182	218	481	51,781		運輸	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	188	203	2,430	261,358		公益事業	
VERISK ANALYTICS INC	164	175	2,818	303,031		商業・専門サービス	
DOLLAR GENERAL CORP	274	288	5,279	567,682		小売	
FORTINET INC	146	168	2,368	254,699		ソフトウェア・サービス	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	71	62	150	16,226		運輸	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	26	27	1,991	214,140		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CIT GROUP INC	108	—	—	—		銀行	
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	20	—	—	—		運輸	
GENERAL MOTORS CO	1,317	1,440	3,283	353,026		自動車・自動車部品	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円		
NXP SEMICONDUCTORS NV	356	315	3,237	348,119		半導体・半導体製造装置	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	338	297	1,667	179,338		素材	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	44	48	867	93,319		資本財	
HCA HEALTHCARE INC	286	305	3,180	341,971		ヘルスケア機器・サービス	
HOLLYFRONTIER CORP	173	161	488	52,526		エネルギー	
MARATHON PETROLEUM CORP	720	714	2,336	251,172		エネルギー	
ATMOS ENERGY CORP	124	131	1,269	136,544		公益事業	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	142	146	793	85,304		資本財	
DEXCOM INC	91	103	4,342	466,909		ヘルスケア機器・サービス	
MIDDLEBY CORP	60	60	371	39,896		資本財	
XYLEM INC	190	199	1,249	134,303		資本財	
ABIOMED INC	44	53	1,048	112,741		ヘルスケア機器・サービス	
TRIPADVISOR INC	114	99	165	17,821		メディア・娯楽	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	63	61	706	75,913		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	172	187	1,930	207,521		銀行	
ALLEGHANY CORP	15	16	831	89,407		保険	
REGENERON PHARMACEUTICALS	82	90	5,207	559,875		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILLIPS 66	456	498	3,823	411,122		エネルギー	
FACEBOOK INC-CLASS A	2,492	2,710	57,792	6,213,890		メディア・娯楽	
CMS ENERGY CORP	300	322	1,790	192,479		公益事業	
ALBEMARLE CORP	110	110	711	76,539		素材	
PVH CORP	78	77	337	36,263		耐久消費財・アパレル	
KINDER MORGAN INC	2,097	2,293	3,522	378,703		エネルギー	
NIELSEN HOLDINGS PLC	372	409	570	61,341		商業・専門サービス	
APTVI PLC	274	299	1,995	214,541		自動車・自動車部品	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	163	160	577	62,089		資本財	
SPLUNK INC	151	174	2,768	297,673		ソフトウェア・サービス	
HEICO CORP-CLASS A	—	94	689	74,093		資本財	
OGE ENERGY CORP	204	205	626	67,329		公益事業	
POLARIS INC	62	62	460	49,497		耐久消費財・アパレル	
ABBVIE INC	1,561	1,988	17,481	1,879,644		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	41	1,403	150,870		資本財	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	86	1,178	126,751		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TESLA INC	133	152	12,355	1,328,511		自動車・自動車部品	
CHENIERE ENERGY INC	234	287	1,275	137,183		エネルギー	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	129	137	916	98,562		各種金融	
ZOETIS INC	498	536	6,786	729,658		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	82	1,737	186,839		ヘルスケア機器・サービス	
NEWS CORP - CLASS A	417	413	442	47,559		メディア・娯楽	
SPRINT CORP	850	—	—	—		電気通信サービス	
SNAP-ON INC	59	66	826	88,912		資本財	
PERKINELMER INC	—	119	1,120	120,465		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAPRI HOLDINGS LTD	156	151	217	23,368		耐久消費財・アパレル	
TWITTER INC	712	839	2,491	267,917		メディア・娯楽	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	79	83	1,561	167,843		ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY INC-CLASS A	312	—	—	—		ソフトウェア・サービス	
WORKDAY INC-CLASS A	154	184	3,076	330,756		ソフトウェア・サービス	
SERVICENOW INC	185	212	8,168	878,254		ソフトウェア・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	86	99	981	105,504		ヘルスケア機器・サービス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	92	98	2,328	250,410		ソフトウェア・サービス	
ALLEGION PLC	97	107	1,096	117,908		資本財	
ALPHABET INC-CL C	326	201	28,333	3,046,388		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	千円	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル		
UNITED RENTALS INC	85	87	1,021	109,872		資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	119	89	90	9,743		運輸
VOYA FINANCIAL INC	164	140	601	64,720		各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	40	54	231	24,917		素材
IQVIA HOLDINGS INC	166	188	2,606	280,293		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	429	426	645	69,425		各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	292	303	2,069	222,533		消費者サービス
CDK GLOBAL INC	128	136	555	59,702		ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	163	169	697	74,947		エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	194	210	2,131	229,218		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	109	119	1,498	161,114		メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	121	123	1,640	176,404		メディア・娯楽
OWENS CORNING	117	117	495	53,245		資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	228	214	251	27,083		消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	98	109	2,396	257,671		ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	670	683	1,212	130,368		各種金融
QORVO INC	130	134	1,368	147,175		半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	151	852	91,694		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	193	209	1,817	195,431		保険
ACUITY BRANDS INC	40	40	330	35,580		資本財
JONES LANG LASALLE INC	46	61	617	66,410		不動産
ARAMARK	266	260	634	68,193		消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	491	461	973	104,690		銀行
LEAR CORP	64	69	719	77,387		自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	93	126	1,802	193,799		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	223	232	456	49,080		素材
TARGA RESOURCES CORP	253	236	316	34,065		エネルギー
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	38	439	47,287		ソフトウェア・サービス
GRUBHUB INC	94	95	445	47,868		小売
CHEMOURS CO/THE	176	—	—	—		素材
WESTROCK CO	264	273	709	76,327		素材
KRAFT HEINZ CO/THE	632	758	2,224	239,219		食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	1,161	1,255	18,077	1,943,645		ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	—	63	1,443	155,246		ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	56	1,542	165,861		ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	73	—	—	—		ソフトウェア・サービス
ZILLLOW GROUP INC - C	118	157	875	94,174		メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,529	1,530	1,488	160,073		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	9	9	274	29,528		運輸
CDW CORP/DE	155	158	1,663	178,877		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SABRE CORP	277	270	180	19,428		ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	547	—	—	—		ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	55	59	1,326	142,635		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	172	191	1,116	120,082		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	187	223	1,740	187,139		商業・専門サービス
GODADDY INC - CLASS A	179	196	1,485	159,710		ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	—	53	430	46,319		メディア・娯楽
WAYFAIR INC- CLASS A	63	76	1,454	156,359		小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	211	286	229	24,633		耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	171	183	597	64,189		メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	98	93	305	32,889		メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	217	264	790	84,965		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		
VAIL RESORTS INC	41	48	856	92,060	92,060	消費者サービス	
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	25	1,182	127,138	127,138	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DOMINO'S PIZZA INC	39	42	1,616	173,796	173,796	消費者サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	166	169	8,643	929,377	929,377	メディア・娯楽	
IDEXX LABORATORIES INC	89	96	2,891	310,860	310,860	ヘルスケア機器・サービス	
SMITH (A.O.) CORP	146	142	627	67,445	67,445	資本財	
UGI CORP	176	275	835	89,886	89,886	公益事業	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	224	261	1,001	107,666	107,666	食品・飲料・タバコ	
FORTIVE CORP	311	342	2,012	216,424	216,424	資本財	
IHS MARKIT LTD	413	428	2,895	311,361	311,361	商業・専門サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	238	258	1,484	159,601	159,601	ソフトウェア・サービス	
COTY INC-CL A	503	280	134	14,427	14,427	家庭用品・パーソナル用品	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	98	957	103,000	103,000	ソフトウェア・サービス	
HOWMET AEROSPACE INC	467	397	467	50,305	50,305	資本財	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	153	169	1,010	108,676	108,676	食品・飲料・タバコ	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	256	—	—	—	—	エネルギー	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	66	63	586	63,067	63,067	保険	
TELEFLEX INC	46	54	1,888	203,077	203,077	ヘルスケア機器・サービス	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	206	—	—	—	—	電気通信サービス	
BEIGENE LTD-ADR	33	41	680	73,146	73,146	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TECHNIPFMC PLC	441	465	349	37,543	37,543	エネルギー	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	130	148	2,928	314,896	314,896	ヘルスケア機器・サービス	
TWILIO INC - A	—	134	2,504	269,263	269,263	ソフトウェア・サービス	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	93	125	1,250	134,421	134,421	各種金融	
SNAP INC - A	—	799	1,445	155,459	155,459	メディア・娯楽	
DXC TECHNOLOGY CO	291	362	605	65,052	65,052	ソフトウェア・サービス	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	162	170	460	49,550	49,550	保険	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	77	86	551	59,266	59,266	保険	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	209	—	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	180	195	571	61,426	61,426	資本財	
ROLLINS INC	152	155	659	70,955	70,955	商業・専門サービス	
XPO LOGISTICS INC	127	109	744	80,026	80,026	運輸	
BAKER HUGHES CO	528	708	1,036	111,392	111,392	エネルギー	
OKTA INC	—	118	2,066	222,153	222,153	ソフトウェア・サービス	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	110	—	—	—	—	保険	
DUPONT DE NEMOURS INC	2,380	835	3,860	415,112	415,112	素材	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	125	131	505	54,333	54,333	運輸	
BLACK KNIGHT INC	—	163	1,205	129,651	129,651	ソフトウェア・サービス	
SQUARE INC - A	323	397	2,979	320,358	320,358	ソフトウェア・サービス	
VISTRA ENERGY CORP	349	438	804	86,466	86,466	公益事業	
INGERSOLL-RAND INC	—	395	1,149	123,621	123,621	資本財	
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	44	1,492	160,469	160,469	ソフトウェア・サービス	
PTC INC	117	129	932	100,224	100,224	ソフトウェア・サービス	
BROADCOM INC	428	446	12,297	1,322,249	1,322,249	半導体・半導体製造装置	
EVERGY INC	267	253	1,414	152,077	152,077	公益事業	
ALTICE USA INC- A	323	131	313	33,656	33,656	メディア・娯楽	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	25	436	46,905	46,905	保険	
DOCUSIGN INC	—	120	1,449	155,849	155,849	ソフトウェア・サービス	
LINDE PLC	571	605	11,311	1,216,220	1,216,220	素材	
WIX.COM LTD	40	54	895	96,282	96,282	ソフトウェア・サービス	
EQUITABLE HOLDINGS INC	278	453	778	83,688	83,688	各種金融	
BURLINGTON STORES INC	67	79	1,402	150,821	150,821	小売	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)							
KKR & CO INC -A	百株	百株	千アメリカドル	千円		各種金融	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	483	581	1,536	165,193		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CIGNA CORP	286	453	941	101,203		ヘルスケア機器・サービス	
DELL TECHNOLOGIES -C	394	421	7,961	856,029		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MONGODB INC	158	186	809	87,014		ソフトウェア・サービス	
FOX CORP - CLASS A	—	55	1,042	112,114		メディア・娯楽	
FOX CORP - CLASS B	369	378	970	104,384		メディア・娯楽	
DOW INC	148	203	518	55,723		素材	
DROPBOX INC-CLASS A	793	834	2,829	304,249		ソフトウェア・サービス	
STERIS PLC	—	264	606	65,192		ヘルスケア機器・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	—	94	1,446	155,579		運輸	
CORTEVA INC	—	485	1,536	165,153		素材	
AMCOR PLC	—	825	2,012	216,425		素材	
XEROX HOLDINGS CORP	—	1,901	1,679	180,551		素材	
ROKU INC	—	239	420	45,202		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	105	1,388	149,311		メディア・娯楽	
PINTEREST INC- CLASS A	—	152	1,106	119,012		ソフトウェア・サービス	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	341	634	68,254		メディア・娯楽	
RPM INTERNATIONAL INC	—	85	2,353	253,100		ソフトウェア・サービス	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	—	154	1,068	114,918		素材	
AGNC INVESTMENT CORP	—	1,639	988	106,285		各種金融	
AON PLC	—	590	726	78,106		各種金融	
OTIS WORLDWIDE CORP	—	263	5,060	544,138		保険	
CARRIER GLOBAL CORP	—	468	2,425	260,788		資本財	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	884	1,622	174,471		資本財	
JARDINE STRATEGIC HLDS LTD	1,204	1,241	515	55,374		不動産	
JARDINE MATHESON HLDS LTD	232	296	632	68,011		資本財	
DAIRY FARM INTL HLDS LTD	227	252	1,110	119,380		資本財	
	410	459	223	23,984		食品・生活必需品小売り	
小計	株数	金額	314,557	340,366	2,818,845	303,082,252	
	銘柄数	<比率>	598	609	—	<67.4%>	
(カナダ)							
ROYAL BANK OF CANADA	1,491	1,614	千カナダドル				
IMPERIAL OIL LTD	298	283	13,977	1,068,839		銀行	
THOMSON REUTERS CORP	212	217	594	45,446		エネルギー	
TC ENERGY CORP	955	1,051	2,080	159,071		商業・専門サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	377	423	6,920	529,236		エネルギー	
SUN LIFE FINANCIAL INC	621	664	2,455	187,740		電気通信サービス	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	520	537	3,202	244,893		保険	
BARRICK GOLD CORP	1,812	1,994	664	50,796		素材	
BCE INC	162	177	7,276	556,403		素材	
BOMBARDIER INC-B	2,265	—	1,011	77,326		電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	662	718	—	—		資本財	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	875	1,500	4,933	377,255		銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	1,271	1,381	7,088	542,047		各種金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	329	376	7,375	564,036		銀行	
CAE INC	280	270	889	68,028		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAMECO CORP	412	394	593	45,381		資本財	
CI FINANCIAL CORP	261	210	589	45,073		エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	458	500	304	23,285		各種金融	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,246	1,357	4,176	319,376		銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	755	806	3,108	237,736		エネルギー	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	62	56	9,376	716,997		運輸	
			604	46,210		小売	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円			
ENBRIDGE INC	2,103	2,281	10,540	806,032		エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	29	30	1,056	80,791		保険	
CGI INC	260	275	2,467	188,716		ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	347	328	132	10,107		エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	78	88	259	19,865		各種金融	
LOBLAW COMPANIES LTD	190	215	1,541	117,865		食品・生活必需品小売り	
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,054	2,203	3,773	288,577		保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	328	335	1,828	139,845		自動車・自動車部品	
NATIONAL BANK OF CANADA	354	388	2,181	166,836		銀行	
ONEX CORPORATION	90	94	621	47,528		各種金融	
POWER CORP OF CANADA	358	640	1,349	103,167		保険	
POWER FINANCIAL CORP	274	—	—	—		保険	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	475	547	1,271	97,252		メディア・娯楽	
SUNCOR ENERGY INC	1,658	1,756	4,177	319,455		エネルギー	
WESTON (GEORGE) LTD	81	83	850	65,028		食品・生活必需品小売り	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	148	155	4,994	381,958		運輸	
ENCANA CORP	1,584	—	—	—		エネルギー	
AGNICO EAGLE MINES LTD	252	268	2,424	185,429		素材	
FINNING INTERNATIONAL INC	162	—	—	—		資本財	
KINROSS GOLD CORP	1,314	1,415	1,368	104,634		素材	
SNC-LAVALIN GROUP INC	165	—	—	—		資本財	
GREAT-WEST LIFECO INC	285	385	820	62,768		保険	
METHANEX CORP	68	92	196	15,013		素材	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	1,058	—	—	—		素材	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	204	222	436	33,358		耐久消費財・アパレル	
SAPUTO INC	246	276	998	76,360		食品・飲料・タバコ	
BLACKBERRY LTD	563	522	336	25,706		ソフトウェア・サービス	
TELUS CORP	116	232	537	41,123		電気通信サービス	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	700	756	650	49,775		素材	
FORTIS INC	430	508	2,756	210,821		公益事業	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	453	981	4,051	309,820		食品・生活必需品小売り	
LUNDIN MINING CORP	688	908	558	42,702		素材	
TORONTO-DOMINION BANK	1,897	2,041	11,811	903,207		銀行	
FRANCO-NEVADA CORP	189	209	4,139	316,528		素材	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	466	499	2,982	228,073		素材	
EMPIRE CO LTD 'A'	187	174	550	42,112		食品・生活必需品小売り	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	149	134	437	33,487		公益事業	
METRO INC/CN	250	278	1,654	126,552		食品・生活必需品小売り	
OPEN TEXT CORP	273	306	1,705	130,430		ソフトウェア・サービス	
INTACT FINANCIAL CORP	140	159	2,225	170,185		保険	
CENOVUS ENERGY INC	1,105	1,042	535	40,956		エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	401	—	—	—		エネルギー	
TOURALMINE OIL CORP	277	—	—	—		エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	524	586	1,954	149,438		エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	159	—	—	—		エネルギー	
DOLLARAMA INC	303	347	1,533	117,285		小売	
KEYERA CORP	219	236	481	36,815		エネルギー	
ALTAGAS LTD	303	288	476	36,404		公益事業	
ATCO LTD -CLASS I	76	104	396	30,348		公益事業	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	207	—	—	—		不動産	
INTER PIPELINE LTD	423	472	547	41,832		エネルギー	
PRARIESKY ROYALTY LTD	210	302	286	21,910		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		外貨建替額 邦貨換算額		
			外貨建替額	邦貨換算額			
(カナダ)							
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	百株	百株	千カナダドル	千円			
CONSTITUTION SOFTWARE INC	228	—	—	—		エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	21	23	3,411	260,864		ソフトウェア・サービス	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	250	337	2,485	190,061		消費者サービス	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	49	78	310	23,709		素材	
HYDRO ONE LTD	149	188	823	62,968		素材	
EMERA INC	351	369	954	72,998		公益事業	
SHOPIFY INC - CLASS A	54	265	1,473	112,711		公益事業	
NUTRIEN LTD	94	116	12,180	931,422		ソフトウェア・サービス	
WSP GLOBAL INC	638	665	3,226	246,751		素材	
AUROORA CANNABIS INC	102	119	1,062	81,235		資本財	
CANOPY GROWTH CORP	741	59	61	4,721		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
STARS GROUP INC/THE	219	230	482	36,864		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IA FINANCIAL CORP INC	199	265	993	75,971		消費者サービス	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	121	117	482	36,870		保険	
CRONOS GROUP INC	—	323	1,858	142,122		素材	
QUEBECOR INC -CL B	199	256	188	14,447		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AIR CANADA	—	185	551	42,200		メディア・娯楽	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	124	202	15,456		運輸	
PARKLAND FUEL CORP	—	552	1,070	81,847		公益事業	
OVINTIV INC	—	158	537	41,079		エネルギー	
	—	205	167	12,788		エネルギー	
小計	株数	・金額	43,615	42,325	193,649	14,808,391	
	銘柄数	<比率>	88	83	—	<3.3%>	
(ヨーロッパ)							
COMMERZBANK AG	1,024	1,071	343	39,814		銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	2,072	2,245	1,429	165,799		各種金融	
SIEMENS AG-REG	794	860	7,582	879,776		資本財	
RWE AG	537	665	1,798	208,645		公益事業	
BASF SE	952	1,046	4,735	549,386		素材	
VOLKSWAGEN AG	33	47	652	75,725		自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	943	1,022	3,164	367,132		自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	187	202	1,565	181,585		家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE	2,290	2,544	2,315	268,593		公益事業	
BAIERISCHE MOTOREN WERKE AG	347	362	1,860	215,869		自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG	967	1,107	6,392	741,695		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALLIANZ SE-REG	440	467	7,311	848,268		保険	
CONTINENTAL AG	113	125	980	113,711		自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,179	1,411	2,514	291,691		半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	154	165	762	88,427		自動車・自動車部品	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	234	226	173	20,089		運輸	
HUGO BOSS AG -ORD	67	—	—	—		耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG	1,027	1,111	2,974	345,114		運輸	
SAP SE	1,019	1,106	11,803	1,369,460		ソフトウェア・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	256	—	—	—		メディア・娯楽	
DEUTSCHE BOERSE AG	197	213	3,186	369,736		各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	226	240	1,755	203,707		ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	40	38	143	16,644		運輸	
ADIDAS AG	187	202	4,170	483,851		耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,459	3,715	5,020	582,517		電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	155	161	3,056	354,647		保険	
THYSSENKRUPP AG	425	411	199	23,154		素材	
BEIERSDORF AG	101	112	1,060	123,029		家庭用品・パーソナル用品	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等		
		株数	株数	評価額	外貨建金額			
				邦貨換算金額				
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円			
HEIDELBERGCEMENT AG	156	157	661	76,762		素材		
MERCK KGAA	130	152	1,618	187,768		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
VOLKSWAGEN AG-PREF	192	198	2,527	293,274		自動車・自動車部品		
PUMA SE	8	101	592	68,738		耐久消費財・アパレル		
LANXESS AG	90	86	399	46,294		素材		
FRESENIUS SE & CO KGAA	435	473	1,920	222,804		ヘルスケア機器・サービス		
HOCHTIEF AG	25	24	170	19,750		資本財		
DEUTSCHE WOHNEN SE	374	421	1,620	188,043		不動産		
GEA GROUP AG	171	157	346	40,175		資本財		
SYMRISE AG	127	144	1,369	158,915		素材		
HENKEL AG & CO KGAA	104	116	825	95,725		家庭用品・パーソナル用品		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	125	126	405	47,005		電気通信サービス		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	53	82	348	40,490		自動車・自動車部品		
HANNOVER RUECK SE	61	68	943	109,451		保険		
BRENNTAG AG	167	187	808	93,778		資本財		
AXEL SPRINGER SE	49	—	—	—		メディア・娯楽		
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	41	383	44,487		ヘルスケア機器・サービス		
FUCHS PETROLUB SE-PREF	67	92	323	37,506		素材		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	679	1,280	342	39,679		電気通信サービス		
OSRAM LICHT AG	104	—	—	—		資本財		
VONOVA SE	511	581	2,846	330,265		不動産		
EVONIK INDUSTRIES AG	180	227	496	57,637		素材		
ZALANDO SE	122	153	838	97,253		小売		
COVESTRO AG	194	202	609	70,711		素材		
UNIPER SE	197	218	538	62,454		公益事業		
INNOGY SE	145	—	—	—		公益事業		
METRO AG	183	142	112	13,105		食品・生活必需品小売り		
KION GROUP AG	68	61	279	32,389		資本財		
1&1 DRILLISCH AG	59	—	—	—		電気通信サービス		
MTU AERO ENGINES AG	55	63	782	90,780		資本財		
WIRECARD AG	118	137	1,257	145,938		ソフトウェア・サービス		
DELIVERT HERO SE	101	133	1,171	135,891		小売		
SARTORIUS AG-VORZUG	36	41	1,157	134,281		ヘルスケア機器・サービス		
SIEMENS HEALTHINEERS AG	153	163	683	79,324		ヘルスケア機器・サービス		
KNORR-BREMSE AG	—	52	423	49,133		資本財		
小計	株数	・	金額	24,693	26,978	103,757	12,037,899	
銘柄	株数	<	比率	61	57	<2.7%>		
(ユーロ…イタリア)								
ASSICURAZIONI GENERALI	1,232	1,242	1,598	185,409		保険		
INTESA SANPAOLO	15,379	16,811	2,369	274,906		銀行		
TELECOM ITALIA SPA	12,095	9,493	330	38,351		電気通信サービス		
ENI SPA	2,626	2,872	2,479	287,652		エネルギー		
UNICREDIT SPA	2,074	2,321	1,535	178,174		銀行		
ENEL SPA	8,434	9,189	5,587	648,247		公益事業		
RECORDATI SPA	114	110	484	56,255		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ATLANTIA SPA	504	552	773	89,737		運輸		
MEDIOBANCA SPA	623	662	355	41,278		銀行		
SNAM SPA	2,394	2,234	899	104,406		公益事業		
TELECOM ITALIA-RSP	6,267	8,748	310	36,074		電気通信サービス		
LEONARDO SPA	423	416	246	28,562		資本財		
TERNA SPA	1,430	1,705	965	111,984		公益事業		
PRYSMIAN SPA	247	259	467	54,289		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		
			千ユーロ	千円			
(ユーロ…イタリア)							
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	百株 595	百株 631	455	52,803	食品・飲料・タバコ		
POSTE ITALIANE SPA	573	579	440	51,082	保険		
FINECOBANK SPA	—	666	665	77,259	銀行		
MONCLER SPA	181	208	674	78,267	耐久消費財・アパレル		
PIRELLI & C SPA	430	351	126	14,723	自動車・自動車部品		
小計	55,628	59,061	20,767	2,409,468			
	株数・金額 銘柄数 <比率>	18	19	<0.5%>			
(ユーロ…フランス)							
MICHELIN (CGDE)	176	194	1,690	196,169	自動車・自動車部品		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	288	313	10,939	1,269,149	耐久消費財・アパレル		
PEUGEOT SA	618	680	893	103,692	自動車・自動車部品		
AXA SA	2,006	2,174	3,503	406,493	保険		
DANONE	639	692	4,435	514,583	食品・飲料・タバコ		
CARREFOUR SA	625	661	877	101,765	食品・生活必需品小売		
VIVENDI	1,081	935	1,875	217,616	メディア・娯楽		
INGENICO GROUP	67	72	872	101,268	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
SOCIETE GENERALE SA	801	937	1,210	140,386	銀行		
AIR LIQUIDE SA	444	534	6,241	724,143	素材		
TOTAL SA	2,501	2,701	8,749	1,015,111	エネルギー		
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	515	589	1,479	171,671	資本財		
VINCI SA	526	580	4,363	506,301	資本財		
SANOFI	1,168	1,272	11,318	1,313,145	医薬・バイオケンタロジー・ライフサイエンス		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	565	648	1,245	144,507	公益事業		
L'OREAL	261	283	7,260	842,380	家庭用品・パーソナル用品		
ACCOR SA	199	188	425	49,353	消費者サービス		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	569	628	5,045	585,337	資本財		
BNP PARIBAS	1,164	1,258	3,535	410,160	銀行		
ESSILORLUXOTTICA	298	321	3,648	423,286	耐久消費財・アパレル		
CAPGEMINI SE	166	187	1,614	187,337	ソフトウェア・サービス		
CASINO GUICHARD PERRACHON	52	68	242	28,189	食品・生活必需品小売		
VALEO SA	245	278	561	65,180	自動車・自動車部品		
HERMES INTERNATIONAL	32	35	2,375	275,557	耐久消費財・アパレル		
SODEXO SA	91	90	583	67,653	消費者サービス		
KERING	78	85	3,752	435,315	耐久消費財・アパレル		
DASSAULT SYSTEMES SA	135	144	1,990	230,955	ソフトウェア・サービス		
ATOS SE	97	113	712	82,657	ソフトウェア・サービス		
ORANGE	2,066	2,246	2,389	277,179	電気通信サービス		
CNP ASSURANCES	177	307	274	31,800	保険		
IMERYS SA	32	—	—	—	素材		
SAFRAN SA	345	370	2,909	337,535	資本財		
RENAULT SA	199	214	377	43,851	自動車・自動車部品		
PUBLICIS GROUPE	226	260	682	79,153	メディア・娯楽		
JCDECAUX SA	67	121	236	27,392	メディア・娯楽		
SOCIETE BIC SA	29	—	—	—	商業・専門サービス		
BOUYGUES SA	229	232	626	72,650	資本財		
THALES SA	107	117	818	95,002	資本財		
PERNOD RICARD SA	220	239	3,236	375,513	食品・飲料・タバコ		
CREDIT AGRICOLE SA	1,207	1,414	993	115,280	銀行		
ENGIE	1,893	2,089	2,039	236,655	公益事業		
ALSTOM	161	201	728	84,502	資本財		
ARKEMA	73	74	561	65,094	素材		
LEGRAND SA	276	295	1,739	201,767	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		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…フランス)							
SCOR SE	百株	百株	千ユーロ	千円			
ADP	176	172	404	46,874		保険	
EDF	32	31	245	28,469		運輸	
NATIXIS	648	627	445	51,714		公益事業	
WENDEL	932	937	198	23,087		各種金融	
BUREAU VERITAS SA	26	27	202	23,502		各種金融	
EURAZEO SE	276	301	556	64,607		商業・専門サービス	
EURAZEO SE-NEW	44	41	182	21,216		各種金融	
SUEZ	2	—	—	—		公益事業	
EIFFAGE	415	365	381	44,263		資本財	
ILIAD SA	81	80	608	70,614		電気通信サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	24	13	183	21,311		メディア・娯楽	
BIOMERIEUX	169	147	132	15,371		ヘルスケア機器・サービス	
GETLINK SE	40	51	630	73,208		運輸	
EDENRED	498	586	668	77,552		ソフトウェア・サービス	
REMY COINTREAU	243	296	1,153	133,771		食品・飲料・タバコ	
REXEL SA	20	20	210	24,459		資本財	
BOLLORE	292	—	—	—		メディア・娯楽	
DASSAULT AVIATION SA	846	837	210	24,448		資本財	
SEB SA	2	2	186	21,597		耐久消費財・アパレル	
IPSEN	21	21	237	27,580		各種金融	
AMUNDI SA	40	52	355	41,253		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FAURECIA	62	63	374	43,407		自動車・自動車部品	
TELEPERFORMANCE	83	69	228	26,565		商業・専門サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	59	65	1,446	167,848		メディア・娯楽	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	89	97	704	81,793		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WORLDLINE SA	30	30	708	82,162		ソフトウェア・サービス	
	85	138	925	107,345			
小計	株数・金額	27,984	29,938	120,641	13,996,780		
銘柄	比 率	71	67	—	<3.1%>		
(ユーロ…オランダ)							
QIAGEN N.V.	236	262	1,038	120,502		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CNH INDUSTRIAL NV	1,030	1,062	547	63,545		資本財	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,129	1,273	972	112,776		自動車・自動車部品	
FERRARI NV	128	139	2,056	238,574		自動車・自動車部品	
EXOR NV	112	129	614	71,341		各種金融	
AIRBUS SE	604	653	3,561	413,175		資本財	
STMICROELECTRONICS NV	694	771	1,760	204,239		半導体・半導体製造装置	
WOLTERS KLUWER	290	306	2,057	238,673		商業・専門サービス	
UNILEVER NV	—	1,654	7,522	872,809		家庭用品・パーソナル用品	
KONINKLIJKE KPN NV	3,377	3,846	814	94,475		電気通信サービス	
AKZO NOBEL N.V.	233	229	1,601	185,808		素材	
HEINEKEN NV	269	293	2,220	257,609		食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	961	1,020	4,015	465,829		ヘルスケア機器・サービス	
AEGON NV	1,879	2,035	446	51,760		保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	1,228	1,248	2,902	336,735		食品・生活必需品小売	
RANDSTAD NV	117	135	485	56,314		商業・専門サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	122	128	903	104,848		食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	185	207	2,363	274,226		素材	
ING GROEP NV	4,034	4,421	2,180	252,928		銀行	
ASML HOLDING NV	425	479	13,385	1,553,033		半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV-CVA	1,603	—	—	—		家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	83	74	371	43,064		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		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…オランダ)							
NN GROUP NV	百株	百株	千ユーロ	千円			
ALTICE EUROPE NV	316	341	866	100,543		保険	
ABN AMRO BANK NV-CVA	—	632	233	27,138		メディア・娯楽	
ADYEN NV	428	455	302	35,103		銀行	
JUST EAT TAKEAWAY	11	12	1,223	141,966		ソフトウェア・サービス	
PROSUS NV	—	126	1,266	146,989		小売	
	—	550	4,254	493,662		小売	
小計	株数・金額	19,505	22,494	59,969	6,957,678		
	銘柄数<比率>	24	27	—	<1.5%>		
(ユーロ…スペイン)							
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	269	236	322	37,414		資本財	
ENDESA SA	318	381	772	89,609		公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	273	297	704	81,715		資本財	
IBERDROLA SA	6,433	6,917	5,981	694,020		公益事業	
TELEFONICA SA	4,838	5,265	2,208	256,278		電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	16,803	18,394	3,571	414,372		銀行	
BANKINTER SA	662	676	235	27,331		銀行	
REPSOL SA	1,454	1,673	1,423	165,124		エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	6,895	7,566	2,002	232,370		銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	372	331	548	63,665		公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	1,128	1,232	2,848	330,500		小売	
MAPFRE SA	1,250	1,522	240	27,936		保険	
FERROVIAL SA	516	582	1,332	154,559		資本財	
ENAGAS SA	240	271	561	65,169		公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	435	511	793	92,097		公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	5,932	6,443	198	23,085		銀行	
CAIXABANK SA	3,668	3,845	636	73,844		銀行	
GRIFOLS SA	308	326	959	111,378		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	454	487	1,907	221,297		ソフトウェア・サービス	
BANKIA SA	1,302	1,629	141	16,466		銀行	
AENA SME SA	69	76	805	93,470		運輸	
CELLNEX TELECOM SA	—	276	1,380	160,220		電気通信サービス	
小計	株数・金額	53,629	58,947	29,580	3,431,932		
	銘柄数<比率>	21	22	—	<0.8%>		
(ユーロ…ベルギー)							
GALAPAGOS NV	—	52	1,101	127,752		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AGEAS	198	181	584	67,791		保険	
UCB SA	128	144	1,221	141,739		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	87	90	649	75,389		各種金融	
UMICORE	217	208	779	90,487		素材	
COLRUYT SA	63	58	342	39,785		食品・生活必需品小売り	
KBC GROUP NV	262	296	1,413	163,984		銀行	
SOLVAY SA	76	86	635	73,701		素材	
PROXIMUS	168	154	287	33,378		電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	59	64	225	26,195		メディア・娯楽	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	790	856	3,401	394,626		食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額	2,052	2,194	10,643	1,234,832		
	銘柄数<比率>	10	11	—	<0.3%>		
(ユーロ…オーストリア)							
ERSTE GROUP BANK AG	320	331	652	75,681		銀行	
VERBUND AG	71	66	296	34,441		公益事業	
OMV AG	157	155	481	55,807		エネルギー	
VOESTALPINE AG	123	109	202	23,500		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		
			千ユーロ	千円			
(ユーロ…オーストリア) ANDRITZ AG RAIFFEISEN BANK INTERNATIONALA	百株 73 145	百株 66 210	204 334	23,756 38,774		資本財 銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	890	939	2,171	251,961		
		6	6	—	<0.1%>		
(ユーロ…ルクセンブルク) RTL GROUP AROUNDOWN SA TENARIS SA SES EUROFINS SCIENTIFIC ARCELORMITTAL	42 818 497 369 12 707	— 1,363 486 375 12 697	— 683 297 221 691 602	— 79,318 34,540 25,693 80,186 69,850		メディア・娯楽 不動産 エネルギー メディア・娯楽 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,448	2,935	2,496	289,589		
		6	5	—	<0.1%>		
(ユーロ…フィンランド) NOKIA OYJ STORA ENSO OYJ-R SHS NOKIAN RENKAAT OYJ UPM-KYMMENE OYJ FORTUM OYJ KONE OYJ-B METSO OYJ SAMPO OYJ-A SHS WARTSILA OYJ ABP ELISA OYJ NESTE OYJ ORION OYJ-CLASS B	5,834 552 112 566 455 353 108 465 472 150 407 99	6,385 689 121 580 486 391 101 513 469 166 480 107	2,117 716 223 1,443 749 2,215 260 1,514 311 918 1,534 510	245,702 83,170 25,918 167,501 86,974 257,019 30,227 175,672 36,132 106,560 178,054 59,201		テクノロジー・ハードウェアおよび機器 素材 自動車・自動車部品 素材 公益事業 資本財 資本財 保険 資本財 電気通信サービス エネルギー 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,578	10,493	12,516	1,452,135		
		12	12	—	<0.3%>		
(ユーロ…アイルランド) KERRY GROUP PLC-A KINGSPAN GROUP PLC FLUTTER ENTERTAINMENT PLC FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW BANK OF IRELAND GROUP PLC AIB GROUP PLC SMURFIT KAPPA GROUP PLC IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD CRH PLC	168 160 80 — 1,020 897 228 472 851	184 166 92 1 926 1,193 259 472 866	1,919 828 1,033 15 129 110 744 — 2,301	222,715 96,122 119,884 1,741 15,031 12,799 86,417 — 267,054		食品・飲料・タバコ 資本財 消費者サービス 消費者サービス 銀行 銀行 素材 銀行 素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,879	4,163	7,082	821,766		
		8	9	—	<0.2%>		
(ユーロ…ポルトガル) EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA JERONIMO MARTINS GALP ENERGIA SGPS SA	2,590 243 525	2,863 268 647	1,175 422 656	136,357 48,992 76,166		公益事業 食品・生活必需品小売り エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,359	3,779	2,254	261,515		
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	203,649	221,926	371,880	43,145,558		
		240	238	—	<9.6%>		
(イギリス) BARCLAYS PLC BP PLC LLOYDS BANKING GROUP PLC	17,749 20,780 73,795	18,737 22,852 78,426	1,922 7,172 2,385	254,249 948,546 315,461		銀行 エネルギー 銀行	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円		
ASTRAZENECA PLC	1,314	1,479	12,878	1,703,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SMITHS GROUP PLC	419	396	499	65,994	資本財		
NEXT PLC	149	152	730	96,555	小売		
DIAGEO PLC	2,518	2,637	7,467	987,614	食品・飲料・タバコ		
BAE SYSTEMS PLC	3,251	3,681	1,851	244,900	資本財		
UNILEVER PLC	1,152	1,248	5,209	688,899	家庭用品・パーソナル用品		
TESCO PLC	10,156	11,036	2,627	347,520	食品・生活必需品小売		
RELX PLC	2,042	2,166	4,030	533,072	商業・専門サービス		
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,677	1,950	170	22,584	小売		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	697	799	5,474	724,026	家庭用品・パーソナル用品		
HALMA PLC	—	412	919	121,618	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
PRUDENTIAL PLC	2,683	2,908	3,259	431,127	保険		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	6,250	6,888	1,403	185,572	保険		
SAGE GROUP PLC/THE	1,100	1,184	761	100,699	ソフトウェア・サービス		
HSBC HOLDINGS PLC	20,786	22,893	9,409	1,244,395	銀行		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,380	2,585	7,887	1,043,118	食品・飲料・タバコ		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	706	809	735	97,311	公益事業		
SCHRODERS PLC	119	132	368	48,733	各種金融		
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	5,062	5,778	638	84,413	銀行		
BHP GROUP PLC	2,189	2,361	3,190	421,894	素材		
IMPERIAL BRANDS PLC	990	1,093	1,766	233,659	食品・飲料・タバコ		
WPP PLC	1,336	1,439	849	112,307	メディア・娯楽		
CENTRICA PLC	5,907	6,723	244	32,358	公益事業		
BT GROUP PLC	8,750	9,872	1,053	139,377	電気通信サービス		
SSE PLC	1,039	1,182	1,467	194,087	公益事業		
STANDARD CHARTERED PLC	2,919	2,986	1,208	159,874	銀行		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,767	2,093	591	78,244	資本財		
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT	125,524	—	—	—	資本財		
COMPASS GROUP PLC	1,645	1,805	2,293	303,314	消費者サービス		
KINGFISHER PLC	2,231	2,310	375	49,633	小売		
PEARSON PLC	815	869	395	52,330	メディア・娯楽		
SEVERN TRENT PLC	255	269	656	86,864	公益事業		
RIO TINTO PLC	1,198	1,273	4,678	618,713	素材		
GLAXOSMITHKLINE PLC	5,148	5,622	9,433	1,247,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
3I GROUP PLC	1,004	1,127	829	109,642	各種金融		
VODAFONE GROUP PLC	27,677	30,090	3,400	449,676	電気通信サービス		
WM MORRISON SUPERMARKETS	2,401	2,632	496	65,719	食品・生活必需品小売		
SAINSBURY (J) PLC	1,772	1,850	353	46,696	食品・生活必需品小売		
AVIVA PLC	3,963	4,467	1,081	143,087	保険		
JOHNSON MATTHEY PLC	201	237	465	61,584	素材		
RENTOKIL INITIAL PLC	—	2,155	1,030	136,232	商業・専門サービス		
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,102	1,161	444	58,802	保険		
WHITBREAD PLC	194	178	505	66,894	消費者サービス		
NATIONAL GRID PLC	3,526	3,890	3,600	476,218	公益事業		
BUNZL PLC	343	398	695	91,937	資本財		
ANGLO AMERICAN PLC	1,092	1,127	1,609	212,836	素材		
INTERTEK GROUP PLC	172	182	868	114,812	商業・専門サービス		
BURBERRY GROUP PLC	425	431	592	78,336	耐久消費財・アパレル		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	172	188	663	87,716	消費者サービス		
CARNIVAL PLC	174	163	156	20,733	消費者サービス		
PERSIMMON PLC	321	396	879	116,308	耐久消費財・アパレル		
MEGGITT PLC	810	868	213	28,195	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		
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円		
ITV PLC	3,763	3,850	285	37,737	37,737	メディア・娯楽	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	324	353	2,809	371,514	371,514	各種金融	
GAS PLC	1,704	1,363	125	16,625	16,625	商業・専門サービス	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	122	138	578	76,508	76,508	耐久消費財・アパレル	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,064	1,119	570	75,481	75,481	耐久消費財・アパレル	
SMITH & NEPHEW PLC	907	992	1,594	210,842	210,842	ヘルスケア機器・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	3,313	3,430	516	68,355	68,355	耐久消費財・アパレル	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,669	4,747	6,236	824,808	824,808	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,884	4,177	5,272	697,272	697,272	エネルギー	
INVESTEC PLC	745	—	—	—	—	各種金融	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2,689	2,521	541	71,601	71,601	各種金融	
EXPERIAN PLC	942	1,019	2,607	344,784	344,784	商業・専門サービス	
MONDI PLC	384	527	719	95,201	95,201	素材	
WEIR GROUP PLC/THE	247	272	254	33,612	33,612	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	377	403	696	92,087	92,087	食品・飲料・タバコ	
ANTOFAGASTA PLC	408	392	313	41,431	41,431	素材	
ADMIRAL GROUP PLC	209	207	501	66,365	66,365	保険	
FRESNILLO PLC	211	—	—	—	—	素材	
BABCOCK INTL GROUP PLC	227	—	—	—	—	商業・専門サービス	
ST JAMES'S PLACE PLC	543	602	510	67,492	67,492	各種金融	
GLENCORE PLC	11,709	12,104	1,793	237,238	237,238	素材	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	86	799	105,698	105,698	資本財	
EVRAZ PLC	—	968	245	32,454	32,454	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	302	377	598	79,128	79,128	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	132	146	730	96,627	96,627	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	5,084	5,654	530	70,097	70,097	資本財	
COCA-COLA HBC AG-DI	209	222	410	54,319	54,319	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	192	218	109	14,447	14,447	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,489	1,521	416	55,125	55,125	保険	
ROYAL MAIL PLC	980	—	—	—	—	運輸	
AVEVA GROUP PLC	—	63	251	33,202	33,202	ソフトウェア・サービス	
ASHTead GROUP PLC	508	484	1,099	145,373	145,373	資本財	
MERLIN ENTERTAINMENT	681	—	—	—	—	消費者サービス	
TUI AG-DI	469	418	111	14,740	14,740	消費者サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	368	312	139	18,458	18,458	ソフトウェア・サービス	
NMC HEALTH PLC	116	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
OCADO GROUP PLC	—	502	962	127,345	127,345	小売	
AUTO TRADER GROUP PLC	959	1,014	503	66,643	66,643	メディア・娯楽	
DCC PLC	104	112	662	87,591	87,591	資本財	
GVC HOLDINGS PLC	618	629	490	64,903	64,903	消費者サービス	
CONVATEC GROUP PLC	1,236	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
JOHN WOOD GROUP PLC	695	—	—	—	—	エネルギー	
INFORMA PLC	1,275	1,567	675	89,334	89,334	メディア・娯楽	
FERGUSON PLC	242	256	1,498	198,223	198,223	資本財	
M&G PLC	—	3,120	402	53,215	53,215	各種金融	
JD SPORTS FASHION PLC	—	457	246	32,588	32,588	小売	
小計	株数	・	金額	435,994	336,973	160,708	21,253,670
	銘柄数	<	比率	93	92	—	<4.7%>
(スイス)					千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	3,177	3,354	35,419	3,907,438	3,907,438	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	540	586	3,265	360,302	360,302	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	2,648	2,916	2,320	255,962	255,962	各種金融	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)							
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	百株	百株	千スイスフラン	千円			
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	503	561	2,193	242,010		素材	
GIVAUDAN-REG	729	792	27,318	3,013,796		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SONOVA HOLDING AG-REG	9	10	3,449	380,500		素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	55	62	1,199	132,294		ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	156	165	4,823	532,128		保険	
LONZA GROUP AG-REG	11	11	837	92,362		ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	77	83	3,762	415,055		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	62	110	392	43,354		耐久消費財・アパレル	
GEBERIT AG-REG	40	45	972	107,276		資本財	
SWISS RE AG	38	42	1,849	204,059		資本財	
PARGEZA HOLDING SA-BR	315	323	2,135	235,605		保険	
NOVARTIS AG-REG	2,249	2,422	20,262	2,235,363		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	165	182	751	82,897		商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	27	28	1,408	155,424		電気通信サービス	
ABB LTD-REG	1,907	2,066	3,671	405,025		資本財	
CLARIANT AG-REG	191	200	354	39,137		素材	
SGS SA-REG	5	7	1,531	168,944		商業・専門サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	22	26	563	62,154		資本財	
TEMENOS AG - REG	60	70	928	102,410		ソフトウェア・サービス	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	56	61	839	92,654		運輸	
BALOISE HOLDING AG - REG	49	56	775	85,540		保険	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	35	40	1,328	146,532		保険	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.09	0.11	907	100,115		食品・飲料・タバコ	
JULIUS BAER GROUP LTD	237	242	892	98,451		各種金融	
SIKA AG-REG	133	144	2,394	264,185		素材	
SWISS PRIME SITE-REG	82	80	748	82,569		不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	1	1,032	113,953		食品・飲料・タバコ	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	18	20	1,591	175,553		各種金融	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	3	618	68,248		食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	8	8	570	62,897		素材	
UBS GROUP AG-REG	3,997	4,313	4,090	451,228		各種金融	
DUFRY AG-REG	36	41	112	12,360		小売	
VIFOR PHARMA AG	45	58	897	99,028		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALCON INC	449	469	2,462	271,638		ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	18,221	19,679	139,403	15,379,009		
		39	39	—	<3.4%>		
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ				
ELECTROLUX AB-SER B	261	237	3,272	35,537		耐久消費財・アパレル	
ERICSSON LM-B SHS	3,187	3,442	28,820	312,985		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ATLAS COPCO AB-B SHS	389	406	12,742	138,387		資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,671	1,957	14,553	158,047		銀行	
INVESTOR AB-B SHS	459	520	24,779	269,104		各種金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,586	1,777	15,763	171,191		銀行	
ATLAS COPCO AB-A SHS	708	782	27,055	293,817		資本財	
SKF AB-B SHARES	403	445	6,912	75,071		資本財	
ASSA ABLOY AB-B	1,046	1,132	20,983	227,882		資本財	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	928	920	12,036	130,715		小売	
SANDVIK AB	1,169	1,296	19,174	208,239		資本財	
SEWBANK AB - A SHARES	958	1,011	10,751	116,761		銀行	
SECURITAS AB-B SHS	333	323	3,737	40,585		商業・専門サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	外貨建金額	
				邦貨換算金額		
(スウェーデン)						
SKANSKA AB-B SHS	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		資本財
SWEDISH MATCH AB	363	395	7,224	78,455		食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	173	186	11,595	125,931		電気通信サービス
TELIA CO AB	518	572	7,292	79,200		電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS	2,919	3,299	10,765	116,912		資本財
ALFA LAVAL AB	1,625	1,606	19,949	216,654		資本財
LUNDIN ENERGY AB	302	412	7,671	83,312		資本財
BOLIDEN AB	201	211	4,753	51,624		エネルギー
HUSQVARNA AB-B SHS	283	308	6,063	65,850		素材
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	470	406	2,352	25,542		耐久消費財・アパレル
HEXAGON AB-B SHS	73	103	2,379	25,839		電気通信サービス
KINNEVIK AB - B	262	294	14,023	152,294		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	262	253	5,593	60,745		各種金融
ICA GRUPPEN AB	150	159	3,165	34,375		各種金融
LUNDBERGS AB-B SHS	72	96	4,042	43,899		食品・生活必需品小売り
ESSITY AKTIEBOLAG-B	636	684	21,552	234,063		家庭用品・パーソナル用品
EPIROC AB-B	440	417	4,265	46,320		資本財
EPIROC AB-A	643	793	8,144	88,449		資本財
NORDEA BANK ABP	3,152	3,709	21,892	237,748		銀行
小計	株数	金額	25,723	28,240	366,414	3,979,260
銘柄	数	<比率>	32	32	—	<0.9%>
(ノルウェー)						
DNB ASA	1,002	1,105	12,883	133,856		銀行
NORSK HYDRO ASA	1,415	1,281	2,993	31,104		素材
ORKLA ASA	802	812	6,850	71,179		食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA	1,200	1,134	16,023	166,487		エネルギー
TELENOR ASA	777	872	13,169	136,833		電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	182	195	6,485	67,385		素材
MOWI ASA	430	461	8,312	86,364		食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	193	221	3,905	40,573		保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	109	97	2,006	20,847		メディア・娯楽
AKER BP ASA	117	102	1,765	18,340		エネルギー
小計	株数	金額	6,233	6,284	74,395	772,973
銘柄	数	<比率>	10	10	—	<0.2%>
(デンマーク)						
NOVO NORDISK A/S-B	1,884	1,993	87,531	1,361,987		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	226	235	8,268	128,660		素材
DANSKE BANK A/S	742	710	5,390	83,869		銀行
DEMAN T A/S	104	118	2,056	31,992		ヘルスケア機器・サービス
H LUNDBECK A/S	62	63	1,573	24,481		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	202	218	13,265	206,408		資本財
CARLSBERG AS-B	108	127	10,740	167,129		食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	123	135	14,098	219,367		ヘルスケア機器・サービス
DSV PANALPINA A/S	189	239	17,000	264,531		運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	7	7	4,844	75,380		運輸
TRYG A/S	121	147	2,710	42,180		保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	3	3	2,235	34,780		運輸
PANDORA A/S	122	105	2,939	45,744		耐久消費財・アパレル
ISS A/S	183	213	2,061	32,074		商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	99	117	7,372	114,715		素材
GENMAB A/S	62	75	14,362	223,474		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) ORSTED A/S		百株 193	百株 211	千デンマーククローネ 14,796	千円 230,230	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	4,439	4,725	211,247	3,287,010		
(オーストラリア)		17	17	<0.7%>			
BHP GROUP LTD		3,059	3,338	10,531	728,884	素材	
CSL LTD		470	511	15,464	1,070,314	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALUMINA LTD		2,703	3,240	499	34,539	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD		976	1,072	2,400	166,117	エネルギー	
AUST AND NZ BANKING GROUP		2,979	3,240	5,123	354,623	銀行	
RIO TINTO LTD		386	411	3,456	239,214	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD		1,364	1,622	1,239	85,788	保険	
LENDLEASE GROUP		627	628	710	49,203	不動産	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,838	1,993	11,988	829,739	銀行	
WESTPAC BANKING CORP		3,570	4,039	6,314	437,016	銀行	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		2,846	3,589	5,736	397,035	銀行	
BRAMBLES LTD		1,640	1,900	2,062	142,747	商業・専門サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD		—	767	270	18,744	運輸	
BORAL LTD		1,267	1,130	313	21,675	素材	
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,372	1,437	4,992	345,561	食品・生活必需品小売	
TELSTRA CORP LTD		4,389	4,567	1,402	97,041	電気通信サービス	
AMP LTD		3,147	4,324	616	42,652	各種金融	
TABCORP HOLDINGS LTD		2,062	2,078	675	46,752	消費者サービス	
AMCOR LIMITED		1,197	—	—	—	素材	
COMPUTERSHARE LTD		462	505	597	41,332	ソフトウェア・サービス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD		599	677	1,722	119,209	消費者サービス	
MACQUARIE GROUP LTD		336	384	4,286	296,675	各種金融	
CIMIC GROUP LTD		94	146	340	23,533	資本財	
ASX LTD		198	210	1,748	121,006	各種金融	
COCA-COLA AMATIL LTD		584	519	450	31,195	食品・飲料・タバコ	
COCHLEAR LTD		63	71	1,370	94,833	ヘルスケア機器・サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		441	456	1,012	70,093	素材	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		552	790	238	16,523	小売	
NEWCREST MINING LTD		789	858	2,387	165,263	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		2,355	2,523	1,377	95,364	保険	
ORIGIN ENERGY LTD		1,780	1,802	1,005	69,600	エネルギー	
ORICA LTD		399	424	682	47,244	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD		476	477	1,263	87,470	ヘルスケア機器・サービス	
SANTOS LTD		1,881	1,832	905	62,647	エネルギー	
SUNCORP GROUP LTD		1,343	1,377	1,278	88,487	保険	
TRANSURBAN GROUP		2,794	3,115	4,299	297,593	運輸	
WESFARMERS LTD		1,179	1,278	4,837	334,829	小売	
BLUESCOPE STEEL LTD		583	520	542	37,571	素材	
CHALLENGER LTD		610	590	271	18,789	各種金融	
SYDNEY AIRPORT		1,232	1,266	715	49,516	運輸	
CALTEX AUSTRALIA LTD		291	289	728	50,392	エネルギー	
OIL SEARCH LTD		1,406	2,206	644	44,582	エネルギー	
WORLEY LTD		363	303	267	18,485	エネルギー	
AGL ENERGY LTD		667	853	1,422	98,416	公益事業	
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,590	1,643	1,990	137,771	素材	
AUSNET SERVICES		1,869	1,900	372	25,774	公益事業	
CROWN RESORTS LTD		379	382	356	24,688	消費者サービス	
INCITEC PIVOT LTD		1,623	1,491	326	22,601	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		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(オーストラリア)							
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	百株 545	百株 707	千オーストラリアドル 424	千円 29,380		銀行	
AURIZON HOLDINGS LTD	2,121	2,213	1,022	70,790		運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	773	796	823	57,019		食品・飲料・タバコ	
APA GROUP	—	1,300	1,508	104,368		公益事業	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	150	191	1,177	81,519		ヘルスケア機器・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	51	222	249	17,277		消費者サービス	
SEEK LTD	372	359	625	43,260		メディア・娯楽	
BANK OF QUEENSLAND LTD	376	—	—	—		銀行	
REA GROUP LTD	50	51	476	33,008		メディア・娯楽	
TPG TELECOM LTD	341	315	229	15,849		電気通信サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	3,016	2,895	810	56,116		保険	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	63	—	—	—		消費者サービス	
SOUTH32 LTD	5,138	5,838	1,123	77,792		素材	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	137	748	51,823		各種金融	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	135	174	316	21,935		エネルギー	
COLES GROUP LTD	1,184	1,509	2,279	157,761		食品・生活必需品小売	
WISETECH GLOBAL LTD	—	213	424	29,377		ソフトウェア・サービス	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	77,180 61	85,725 62	123,485 <1.9%>	8,546,427	
(ニュージーランド)							
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,923	1,790	千ニュージーランドドル 831	54,172		電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	993	965	577	37,583		運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	576	634	1,869	121,757		ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	862	805	274	17,844		素材	
RYMAN HEALTHCARE LTD	360	382	470	30,613		ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,237	1,208	575	37,455		公益事業	
MERCURY NZ LTD	—	676	334	21,768		公益事業	
A2 MILK CO LTD	738	806	1,550	100,938		食品・飲料・タバコ	
小計	株数 銘柄数	金額 <比率>	6,693 7	7,271 8	6,482 —	422,133 <0.1%>	
(香港)							
WHARF HOLDINGS LTD	1,170	—	千香港ドル —	—		不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	510	520	2,633	36,530		不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,808	3,068	17,552	243,458		資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,660	1,805	18,447	255,861		不動産	
MTR CORP	1,635	1,785	7,639	105,964		運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	9,704	11,855	16,360	226,917		公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	6,570	6,440	5,905	81,909		不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,435	1,640	8,290	114,985		公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,239	1,346	33,650	466,725		各種金融	
HANG LUNG GROUP LTD	880	—	—	—		不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,180	2,110	3,587	49,751		不動産	
CLP HOLDINGS LTD	1,725	1,915	15,348	212,886		公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,369	1,626	5,090	70,607		不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	1,366	1,294	2,119	29,403		銀行	
HANG SENG BANK LTD	795	848	11,660	161,724		銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	710	—	—	—		不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,220	—	—	—		消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	334	305	2,470	34,265		半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	3,334	3,194	3,538	49,085		不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	765	610	803	11,151		耐久消費財・アパレル	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	710	700	3,241	44,952		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)						
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	百株	百株	千香港ドル	千円		
	3,870	4,085	9,967	138,247		銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	1,385	1,560	10,381	143,995		資本財
PCCW LTD	4,060	4,460	2,127	29,507		電気通信サービス
KERRY PROPERTIES LTD	605	925	2,021	28,033		不動産
MINTH GROUP LTD	840	—	—	—		自動車・自動車部品
NWS HOLDINGS LTD	1,785	2,145	1,662	23,057		資本財
SANDS CHINA LTD	2,464	2,732	8,783	121,825		消費者サービス
WHEELOCK & CO LTD	840	960	5,553	77,028		不動産
WYNN MACAU LTD	1,508	2,056	2,960	41,064		消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	2,400	2,100	1,734	24,058		消費者サービス
AIA GROUP LTD	12,538	13,620	96,293	1,335,589		保険
SWIRE PROPERTIES LTD	1,230	1,126	2,471	34,280		不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2,490	2,420	13,128	182,092		消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	884	—	—	—		消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	3,950	4,040	5,195	72,060		電気通信サービス
WH GROUP LTD	8,910	10,395	7,494	103,952		食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,683	2,923	14,589	202,351		不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	3,000	2,394	33,204		公益事業
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,260	1,350	4,542	63,007		不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	900	2,565	35,576		食品・飲料・タバコ
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	1,363	3,168	43,953		食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	95,823	103,223	355,376	4,929,068	
銘柄	数<比率>	39	36	—	<1.1%>	
(シンガポール)						
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,311	3,773	3,373	255,441		銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,528	1,479	229	17,366		メディア・娯楽
SEMCORP INDUSTRIES LTD	926	1,280	207	15,703		資本財
CAPITALAND LTD	2,614	3,022	891	67,512		不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	378	429	344	26,055		不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	109	135	276	20,948		小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,862	2,046	4,092	309,887		銀行
KEPPEL CORP LTD	1,476	1,671	1,014	76,812		資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,392	1,443	2,896	219,321		銀行
VENTURE CORP LTD	300	284	447	33,874		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,748	1,693	565	42,822		資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	8,473	9,344	2,569	194,608		電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	583	510	225	17,045		運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	812	871	864	65,433		各種金融
UOL GROUP LTD	443	440	308	23,324		不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	2,383	2,682	429	32,497		運輸
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,395	—	—	—		食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,112	2,018	714	54,099		食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE LTD	6,480	5,772	444	33,657		消費者サービス
SATS LTD	650	905	272	20,629		運輸
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	2,745	3,213	327	24,818		資本財
小計	株数・金額	46,722	43,011	20,492	1,551,860	
銘柄	数<比率>	21	20	—	<0.3%>	
(イスラエル)						
ICL LTD	710	969	1,207	37,009		素材
BANK HAPOALIM BM	1,078	1,215	2,725	83,518		銀行
NICE LTD	62	67	4,269	130,814		ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,504	1,587	3,065	93,926		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		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(イスラエル) ELBIT SYSTEMS LTD ISRAEL DISCOUNT BANK-A BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD AZRIELI GROUP LTD	百株 22 — 1,865 159 37	百株 32 1,244 — 140 52	千イスラエルシェケル 1,555 1,427 — 987 1,014	千円 47,670 43,747 — 30,269 31,089	資本財 銀行 電気通信サービス 銀行 不動産		
小計	株数 ・ 銘柄 数 <比率>	5,441 8	5,311 8	16,254 —	498,046 <0.1%>		
合計	株数 ・ 銘柄 数 <比率>	1,284,294 1,253	1,245,065 1,254	— —	421,655,664 <93.7%>		

(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	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47	55	1,327	142,732	0.0	
MACERICH CO/THE	11	—	—	—	—	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11	12	1,971	211,935	0.0	
PROLOGIS INC	65	83	7,387	794,345	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	9	10	939	101,010	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16	17	554	59,570	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	21	29	4,278	460,044	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	20	1,229	132,230	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6	7	1,769	190,222	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12	14	1,312	141,090	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7	7	591	63,602	0.0	
WELLTOWER INC	39	45	1,919	206,388	0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	16	17	1,479	159,026	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	57	1,013	108,948	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11	13	1,537	165,299	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	22	598	64,358	0.0	
REALTY INCOME CORP	30	35	1,916	206,064	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	15	18	735	79,134	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	8	9	412	44,352	0.0	
SUN COMMUNITIES INC	—	10	1,515	162,987	0.0	
UDR INC	27	34	1,294	139,151	0.0	
VENTAS INC	37	44	1,285	138,255	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	141	—	—	—	—	
WEYERHAEUSER CO	77	85	1,647	177,099	0.0	
AMERICAN TOWER CORP	45	49	11,897	1,279,187	0.3	
AGNC INVESTMENT CORP	56	—	—	—	—	
WP CAREY INC	17	21	1,306	140,451	0.0	
VEREIT INC	95	114	607	65,340	0.0	
DUKE REALTY CORP	38	41	1,393	149,871	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	27	30	725	77,988	0.0	
EQUINIX INC	8	9	6,523	701,429	0.2	
CROWN CASTLE INTL CORP	43	46	7,493	805,650	0.2	
EQUITY RESIDENTIAL	38	41	2,664	286,445	0.1	
INVITATION HOMES INC	36	58	1,476	158,743	0.0	
VICI PROPERTIES INC	—	53	885	95,201	0.0	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12	—	—	—	—	
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	12	3,763	404,698	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	75	82	837	90,087	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	15	—	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	16	17	3,317	356,711	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	32	33	1,858	199,791	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	18	18	675	72,578	0.0	
KIMCO REALTY CORP	42	50	506	54,491	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		14	15	2,484	267,172	0.1
小計	口数・金額	1,250	1,351	85,134	9,153,694	
銘柄数<比率>		38	39	—	<2.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		5	10	196	15,060	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		—	8	409	31,320	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		12	14	133	10,193	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		13	16	238	18,247	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		—	15	187	14,338	0.0
小計	口数・金額	31	64	1,165	89,160	
銘柄数<比率>		3	5	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		4	5	610	70,844	0.0
KLEPIERRE		21	21	350	40,695	0.0
COVIVIO		4	4	255	29,691	0.0
ICADE		3	3	199	23,153	0.0
小計	口数・金額	34	34	1,416	164,384	
銘柄数<比率>		4	4	—	<0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		14	16	796	92,403	0.0
小計	口数・金額	14	16	796	92,403	
銘柄数<比率>		1	1	—	<0.0%>	
ユ一口計	口数・金額	48	51	2,213	256,787	
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		94	106	408	53,978	0.0
HAMMERSOHN PLC		75	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		75	81	515	68,152	0.0
SEGRO PLC		112	125	1,055	139,600	0.0
小計	口数・金額	357	313	1,979	261,730	
銘柄数<比率>		4	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		364	348	521	36,094	0.0
SCENTRE GROUP		564	620	1,414	97,879	0.0
GPT GROUP		199	232	969	67,101	0.0
MIRVAC GROUP		389	400	896	62,071	0.0
STOCKLAND		264	294	818	56,621	0.0
DEXUS		104	116	1,075	74,418	0.0
GOODMAN GROUP		174	186	2,715	187,937	0.0
小計	口数・金額	2,061	2,198	8,410	582,125	
銘柄数<比率>		7	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		220	240	16,554	229,616	0.1
小計	口数・金額	220	240	16,554	229,616	
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	
(シンガポール)		千口	千口	千円	%
SUNTEC REIT	249	194	270	20,452	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	278	363	581	44,020	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	216	419	31,777	0.0
CAPITALAND MALL TRUST	244	262	486	36,818	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	278	318	955	72,382	0.0
小計	1,050	1,355	2,712	205,452	
銘柄数 <比率>	4	5	—	<0.0%>	
合計	5,021	5,574	—	10,778,567	
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	当期末	
		買建額	売建額
外 国	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	SP EMINI SP/TSE60 SWISS IX EURO ST SPI 200 FTSE100	12,837 572 629 2,215 710 908	— — — — — —

(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 421,655,664	% 93.7
投資証券	10,778,567	2.4
コール・ローン等、その他	17,484,321	3.9
投資信託財産総額	449,918,552	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（449,768,670千円）の投資信託財産総額（449,918,552千円）に対する比率は100.0%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カナダドル=76.47円	1ユーロ=116.02円	1イギリスポンド=132.25円
1スイスフラン=110.32円	1スウェーデンクローネ=10.86円	1ノルウェークローネ=10.39円	1デンマーククローネ=15.56円
1オーストラリアドル=69.21円	1ニュージーランドドル=65.12円	1香港ドル=13.87円	1シンガポールドル=75.73円
1イスラエルシェケル=30.64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
(A) 資産	円
コール・ローン等	451,053,773,434
株式(評価額)	11,358,349,528
投資証券(評価額)	421,655,664,074
未収入金	10,778,567,605
未収配当金	2,073,819,005
差入委託証拠金	462,895,406
(B) 負債	4,724,477,816
未払金	1,212,025,293
未払解約金	1,138,716,670
未払利息	73,308,537
(C) 純資産総額(A-B)	86
元本	449,841,748,141
次期繰越損益金	167,638,526,747
(D) 受益権総口数	282,203,221,394
1万口当たり基準価額(C/D)	167,638,526,747円
1万口当たり基準価額(C/D)	26,834円

<注記事項>

- ①期首元本額 157,760,668,644円
 期中追加設定元本額 195,344,613,367円
 期中一部解約元本額 185,466,755,264円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.6834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）

MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)
 e MAX I S S l i m 先進国株式インデックス
 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド
 e MAX I S 先進国株式インデックス
 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)
 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)
 e MAX I S S l i m 全世界株式 (オール・カントリー)
 e MAX I S S l i m 全世界株式 (除く日本)
 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド
 つみたて先進国株式
 MAX I S 海外株式 (MSCIコクサイ) 上場投信
 e MAX I S 全世界株式インデックス
 MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)
 e MAX I S S l i m バランス (8資産均等型)
 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド
 三菱UFJ バランスファンドVA40型 (適格機関投資家限定)
 e MAX I S バランス (8資産均等型)
 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)
 海外株式セレクション (ラップ向け)
 つみたて8資産均等バランス
 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)

○損益の状況 (2019年5月14日～2020年5月12日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取配当金	9,259,068,815
受取利息	9,181,447,298
その他収益金	93,941,685
支払利息	6,007,495
(B) 有価証券売買損益	△ 22,327,663
売買益	△ 36,289,747,956
売買損	50,932,431,638
(C) 先物取引等取引損益	△ 87,222,179,594
取引益	1,930,981,192
取引損	7,522,400,504
(D) 保管費用等	△ 5,591,419,312
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 113,419,041
(F) 前期繰越損益金	△ 25,213,116,990
(G) 追加信託差損益金	279,608,222,514
(H) 解約差損益金	369,765,625,097
(I) 計(E+F+G+H)	△341,957,509,227
次期繰越損益金(I)	282,203,221,394
次期繰越損益金(I)	282,203,221,394

(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算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。

三義UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	640,683,877円
三義UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	572,018,703円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	523,136,449円
e MAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	416,237,464円
e MAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	281,651,425円
つみたて4資産均等バランス	261,109,962円
e MAXIS バランス（4資産均等型）	207,463,984円
e MAXIS S1im 全世界株式（3地域均等型）	194,631,119円
e MAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	194,017,940円
e MAXIS バランス（波乗り型）	186,327,117円
三義UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	179,818,866円
三義UFJ バランスマネジメントVA 20型（適格機関投資家限定）	144,646,587円
アドバンスト・バランスII（FOF用）（適格機関投資家限定）	141,041,330円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	118,101,293円
先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）	112,092,621円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	111,316,072円
三義UFJ バランスマネジメントVA 60G（適格機関投資家限定）	78,389,839円
e MAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	74,244,882円
三義UFJ バランスマネジメントVA 60D（適格機関投資家限定）	71,008,672円
e MAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	64,812,602円
ファンド・マネジャー（海外株式）	56,051,354円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	52,831,155円
三義UFJ 外国株式インデックスファンドVA	50,807,151円
三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	44,614,545円
三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	32,787,427円
三義UFJ バランスマネジメント45VA（適格機関投資家限定）	31,499,083円
三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	30,616,359円
アドバンスト・バランスI（FOF用）（適格機関投資家限定）	23,715,417円
三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	16,272,327円
三義UFJ バランスマネジメントVA 30G（適格機関投資家限定）	13,703,853円
三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	13,545,612円
三義UFJ バランスマネジメントVA 30D（適格機関投資家限定）	9,839,465円
三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	9,084,811円
三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	8,178,083円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	5,635,268円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	5,372,429円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	3,841,353円
三義UFJ バランスマネジメントVA 30型（適格機関投資家限定）	3,140,185円
e MAXIS マイマネージャー 1990s	2,164,662円
e MAXIS マイマネージャー 1980s	2,093,999円
e MAXIS マイマネージャー 1970s	1,588,448円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,486,010円
つみたて全世界株式	752,488円
コアバランス	322,511円
合計	167,638,526,747円

[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外国株式の貸付に関する指図権限を三義UFJアセット・マネジメント（UK）に委託するため、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（D R（預託証書）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	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
		期騰落率	中騰落率				
7期(2016年5月12日)	円 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知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

(注) 外国の指標は、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 券 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
5月末	23,052	△ 3.9	50,540.40	△ 3.9	92.3	6.1
6月末	24,283	1.2	53,098.32	1.0	93.8	4.7
7月末	24,281	1.2	53,171.46	1.1	93.2	5.4
8月末	22,206	△ 7.4	48,562.79	△ 7.6	93.2	4.0
9月末	23,227	△ 3.2	50,932.52	△ 3.1	93.4	3.9
10月末	24,483	2.1	53,500.15	1.8	92.5	5.0
11月末	24,824	3.5	54,320.61	3.3	91.4	5.9
12月末	26,440	10.2	58,006.54	10.3	96.7	6.3
2020年1月末	25,249	5.2	55,392.34	5.4	94.5	5.3
2月末	24,333	1.4	53,436.53	1.6	95.2	4.5
3月末	19,575	△18.4	43,007.66	△18.2	97.3	2.9
4月末	21,321	△11.1	46,748.89	△11.1	95.7	4.1
(期 末) 2020年5月12日	21,268	△11.3	46,859.15	△10.9	94.8	5.4
						0.1

(注) 謄落率は期首比。

(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

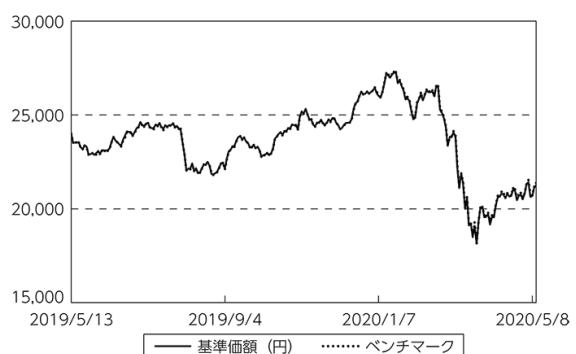
◎基準価額の動き

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

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率（-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。

◎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

- 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）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、カイ離は△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
（ 保 管 費 用 ）	(24)	(0.100)	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 ）	(2)	(0.007)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
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おります。

(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おります。

○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 (—)	百株 41,801	千アメリカドル 11,936
	メキシコ	44,173 (—)	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)	千ブラジルレアル 107,846 (△ 151)	10,791 (2)	千ブラジルレアル 32,779 (0.71204)
	チリ	394,611 (14,066)	千チリペソ 2,351,967 (—)	153,414 (0.01)	千チリペソ 706,259 (—)
	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	— (670)	— (4,648)	670	4,535
	ベルギー	— (77)	— (141)	—	—
	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 (—)	3,777	千トルコリラ 2,173
	チェコ	337	千チェコクロナ 7,834	50	千チェコクロナ 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
	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	72,586	3,413	4.7	41,348	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MUF G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	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	
(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
ROSNFT 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		
HYUA 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 TELEVISAS 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 PENOLE 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	
ATACADAQ 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		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ブラジル)							
SUZANO SA	798	963	4,584	84,683	千円	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)							
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)							
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)							
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	—	77	千ユーロ	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)	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…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%>	
ユ一口計	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)				千チェコクロナ		
CEZ AS		242	304	14,247	59,983	公益事業
KOMERCFNI 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	期首(前期末)	当期末				業種等		
		株数	株数	評価額	外貨建替額			
				邦貨換算額				
(ポーランド)								
PKO BANK POLSKI SA		百株	百株	千ポーランドズロチ	千円			
BANK PEKAO SA	1,276	1,648	3,403	86,510		銀行		
KGHM POLSKA MIEDZ SA	235	300	1,456	37,029		銀行		
SANTANDER BANK POLSKA SA	184	220	1,662	42,257		素材		
MBANK SA	54	65	949	24,136		銀行		
POLSKIE GORNICZTWO NAFTOWE I	23	23	425	10,810		銀行		
GRUPA LOTOS SA	2,723	3,788	1,391	35,363		エネルギー		
AMREST HOLDINGS SE	124	158	964	24,524		エネルギー		
BANK MILLENNIUM SA	—	106	265	6,758		消費者サービス		
CYFROWY POLSAT SA	760	1,215	287	7,318		銀行		
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	371	480	1,162	29,556		メディア・娯楽		
PGE SA	56	—	—	—		銀行		
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	1,118	1,483	567	14,425		公益事業		
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	854	1,140	3,345	85,032		保険		
ALIOR BANK SA	68	—	—	—		素材		
LPP SA	155	—	—	—		銀行		
CCC SA	1	2	1,625	41,307		耐久消費財・アパレル		
CD PROJEKT SA	45	45	184	4,693		耐久消費財・アパレル		
DINO POLSKA SA	98	118	4,300	109,317		メディア・娯楽		
	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	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		
ANGANG STEEL CO LTD-H	1,080	—	—	—	—	素材	
CHINA MOBILE LTD	8,920	10,985	64,976	901,220	901,220	電気通信サービス	
HUANENG POWER INTL INC-H	6,520	6,780	1,878	26,048	26,048	公益事業	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	2,860	2,860	703	9,758	9,758	公益事業	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,790	2,170	13,139	182,242	182,242	素材	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	6,640	8,180	12,908	179,034	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	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	55,237	保険	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	580	760	3,811	52,864	52,864	食品・飲料・タバコ	
SINOTRANS LIMITED-H	3,580	3,580	630	8,739	8,739	運輸	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	5,660	8,580	1,389	19,278	19,278	素材	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2,430	2,470	1,111	15,416	15,416	素材	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2,850	4,060	1,270	17,625	17,625	資本財	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	9,780	12,620	9,099	126,203	126,203	保険	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	10,850	13,450	21,466	297,736	297,736	保険	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	1,045	1,080	2,084	28,910	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	125,002	半導体・半導体製造装置	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	2,600	3,160	2,837	39,358	39,358	公益事業	
LI NING CO LTD	—	3,675	9,518	132,018	132,018	耐久消費財・アパレル	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	4,090	5,010	14,203	197,000	197,000	食品・飲料・タバコ	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	7,550	9,950	78,804	1,093,011	1,093,011	保険	
AIR CHINA LTD-H	2,800	2,800	1,464	20,311	20,311	運輸	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	9,720	12,170	14,384	199,519	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	25,140	エネルギー	
TENCENT HOLDINGS LTD	8,286	10,252	445,962	6,185,492	6,185,492	メディア・娯楽	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	12,119	15,589	7,607	105,515	105,515	銀行	
ZTE CORP-H	1,119	1,449	3,463	48,043	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	48,019	素材	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	139,255	171,545	106,701	1,479,947	1,479,947	銀行	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	1,464	2,112	2,059	28,561	28,561	不動産	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	1,077	1,333	12,463	172,869	172,869	耐久消費財・アパレル	
CHINA POWER INTERNATIONAL	7,050	7,050	1,135	15,743	15,743	公益事業	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	4,020	4,400	2,384	33,077	33,077	自動車・自動車部品	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	4,280	4,280	992	13,772	13,772	資本財	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	4,820	6,250	8,487	117,721	117,721	エネルギー	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2,480	3,150	2,290	31,762	31,762	素材	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	2,480	2,920	2,601	36,085	36,085	不動産	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,490	2,570	1,909	26,484	26,484	素材	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	5,260	5,420	1,344	18,643	18,643	不動産	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	2,680	3,440	4,114	57,064	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	577,806	銀行	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	5,131	7,491	3,535	49,041	49,041	商業・専門サービス	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,555	2,030	6,404	88,832	88,832	不動産	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	990	1,240	4,929	68,365	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	357,623	銀行	
IND & COMM BK OF CHINA-H	100,473	115,993	59,968	831,765	831,765	銀行	
MAANSHAN IRON & STEEL-H	2,320	2,320	542	7,529	7,529	素材	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	1,138	1,413	12,738	176,678	176,678	公益事業	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	1,835	1,835	1,396	19,368	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	30,819	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		
(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	60,054	資本財	
CHINA COAL ENERGY CO-H	3,170	3,170	646	8,969	8,969	エネルギー	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	1,305	1,895	2,861	39,688	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	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	82,162	銀行	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,590	1,910	12,892	178,818	178,818	耐久消費財・アパレル	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	5,620	7,410	3,408	47,277	47,277	資本財	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	18,980	15,720	1,399	19,405	19,405	小売	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	1,080	1,250	8,056	111,740	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	249,343	不動産	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	2,685	3,390	2,756	38,226	38,226	資本財	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	4,440	5,140	8,121	112,641	112,641	公益事業	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	3,650	4,570	4,579	63,512	63,512	資本財	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	4,975	4,975	1,004	13,938	13,938	不動産	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	5,200	6,780	6,732	93,380	93,380	素材	
SHUI ON LAND LTD	3,745	7,170	975	13,524	13,524	不動産	
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,858	3,428	5,162	71,604	71,604	資本財	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	4,405	4,405	951	13,197	13,197	運輸	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	7,380	8,920	5,004	69,407	69,407	食品・飲料・タバコ	
KUNLUN ENERGY CO LTD	4,740	7,080	3,610	50,081	50,081	公益事業	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	11,162	13,952	14,287	198,163	198,163	不動産	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1,240	1,580	6,944	96,314	96,314	公益事業	
SOHO CHINA LTD	3,175	3,175	977	13,563	13,563	不動産	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	8,120	8,120	2,395	33,224	33,224	公益事業	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	7,270	8,860	11,588	160,737	160,737	自動車・自動車部品	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	4,240	5,620	2,124	29,464	29,464	公益事業	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	9,048	12,258	6,864	95,211	95,211	銀行	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	3,900	4,688	11,626	161,255	161,255	保険	
CRRC CORP LTD - H	5,545	8,165	3,339	46,321	46,321	資本財	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	839	1,059	2,705	37,528	37,528	資本財	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	41,760	52,830	17,011	235,946	235,946	銀行	
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,810	3,190	4,823	66,898	66,898	不動産	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	3,929	5,289	3,887	53,923	53,923	自動車・自動車部品	
SINOPHARM GROUP CO-H	1,760	2,584	5,374	74,547	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	177,854	公益事業	
XINJIANG GOLDWIND SCI+TEC-H	1,172	1,172	882	12,240	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	163,520	不動産	
SUNNY OPTICAL TECH	1,050	1,286	15,509	215,112	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	63,713	素材	
SSY GROUP LTD	2,240	3,280	1,830	25,385	25,385	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY - H	—	2,194	1,423	19,749	19,749	資本財	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	4,860	6,190	3,342	46,361	46,361	自動車・自動車部品	
BBMG CORP-H	4,160	4,160	815	11,309	11,309	素材	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	7,220	9,620	5,377	74,587	74,587	不動産	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1,555	2,360	2,171	30,114	30,114	素材	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3,060	4,140	2,537	35,199	35,199	資本財	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	3,340	4,290	5,036	69,855	69,855	ソフトウェア・サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(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	
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 HUISHAN 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)		当期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)						
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	百株 2,370	百株 2,370	千香港ドル 884	千円 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	—	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	
HENTEN 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 APPTEC 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 銘柄数 <比率>	1,355,005 206	金額 207	1,620,933 1,749,150	24,260,716 <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	千円	千マレーシアリング		
TELEKOM MALAYSIA BHD		1,355	2,148	22,557	912	電気通信サービス	
TENAGA NASIONAL BHD		4,430	5,508	167,950	6,796	公益事業	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD		593	827	42,096	1,703	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BHD		5,556	6,921	126,724	5,128	銀行	
IOI CORP BHD		2,419	3,161	30,306	1,226	食品・飲料・タバコ	
AMMB HOLDINGS BHD		2,319	2,715	19,522	790	銀行	
YTL CORP BHD		6,372	3,487	6,377	258	公益事業	
GAMUDA BHD		2,862	2,827	23,401	947	資本財	
MISC BHD		1,590	2,281	44,527	1,801	運輸	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD		7,354	8,497	72,226	2,922	銀行	
PETRONAS GAS BHD		1,039	1,378	50,598	2,047	公益事業	
SP SETIA BHD		2,669	—	—	—	不動産	
SIME DARBY BERHAD		3,509	4,932	24,008	971	資本財	
PUBLIC BANK BERHAD		4,185	5,634	219,126	8,867	銀行	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD		173	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
PPB GROUP BERHAD		819	1,083	43,475	1,759	食品・飲料・タバコ	
IJM CORP BHD		4,797	4,576	18,996	768	資本財	
DIGI.COM BHD		4,856	5,673	62,800	2,541	電気通信サービス	
MAXIS BHD		3,327	3,932	51,203	2,072	電気通信サービス	
AXIATA GROUP BERHAD		4,065	5,451	52,396	2,120	電気通信サービス	
HONG LEONG BANK BERHAD		993	1,237	40,958	1,657	銀行	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD		3,417	4,619	62,546	2,531	素材	
PETRONAS DAGANGAN BHD		261	563	28,519	1,154	エネルギー	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD		1,204	1,583	19,166	775	運輸	
IHH HEALTHCARE BHD		3,539	3,561	45,404	1,837	ヘルスケア機器・サービス	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP		333	333	10,548	426	銀行	
HAP SENG CONSOLIDATED		970	1,331	23,614	955	資本財	
TOP GLOVE CORP BHD		1,776	2,904	52,454	2,122	ヘルスケア機器・サービス	
GENTING PLANTATIONS BHD		392	392	9,008	364	食品・飲料・タバコ	
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B		—	275	18,795	760	食品・飲料・タバコ	
WESTPORTS HOLDINGS BHD		1,484	1,484	13,421	543	運輸	
DIALOG GROUP BHD		5,613	6,672	54,082	2,188	エネルギー	
IOI PROPERTIES GROUP BHD		1,728	—	—	—	不動産	
QL RESOURCES BHD		808	1,014	20,295	821	食品・飲料・タバコ	
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD		157	245	19,094	772	食品・飲料・タバコ	
HARTALEGA HOLDINGS BHD		2,300	2,847	51,847	2,098	ヘルスケア機器・サービス	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD		93	115	39,271	1,589	食品・飲料・タバコ	
RHB BANK BHD		1,379	3,192	36,761	1,487	銀行	
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD		1,462	—	—	—	銀行	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN		1,691	2,417	23,053	932	素材	
SIME DARBY PLANTATION BHD		3,518	3,907	46,050	1,863	食品・飲料・タバコ	
SIME DARBY PROPERTY BHD		4,517	—	—	—	不動産	
AIRASIA GROUP BHD		2,152	2,152	4,121	166	運輸	
小計	株数・金額	111,636	120,934	1,769,898	71,626		
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	63,285	18,947	不動産	
KASIKORN BANK PCL-NVDR		2,527	3,081	87,469	26,188	銀行	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR		—	1,180	16,355	4,897	電気通信サービス	
TMB BANK PCL-NVDR		15,421	33,932	10,426	3,121	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		
(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 銘柄数 < 比率 >	155,207	267,346	697,154	2,328,495		
		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	
HNI 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	
INDOCIMENT TUNGgal 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	
SEMENT 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	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		
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		
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		
OTTOGGI 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	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
	銘柄	比	率	114	112	11,551,135
						<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	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		
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	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 LTD-A	75	388	944	14, 285		半導体・半導体製造装置	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LTD-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	
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	
UNISPLENDOUR 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 TECHNO-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 HENGRIU 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 FOR-A	128	809	336	5, 088		運輸	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD-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	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	千円	千円		
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	19	121	1,079	16,319	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	51,716	銀行	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	41	210	277	4,200	4,200	資本財	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	58	299	679	10,275	10,275	自動車・自動車部品	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	15	102	371	5,610	5,610	素材	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	130	1,680	601	9,093	9,093	素材	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	—	108	263	3,984	3,984	資本財	
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	20	103	502	7,601	7,601	素材	
TIANQI LITHIUM CORP-A	21	266	468	7,078	7,078	素材	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	—	84	320	4,852	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	4,825	素材	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	470	2,422	1,068	16,151	16,151	エネルギー	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	212	1,093	1,077	16,294	16,294	資本財	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	—	2,911	1,679	25,396	25,396	資本財	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	18	93	269	4,076	4,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINA SHIPBUILDING INDSTR-A	32	—	—	—	—	自動車・自動車部品	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	22	112	385	5,822	5,822	資本財	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	130	818	429	6,493	6,493	運輸	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	33	170	180	2,727	2,727	メディア・娯楽	
CHINA VANKE CO LTD -A	179	1,113	2,940	44,466	44,466	不動産	
CHINESE UNIVERSE PUBLISHIN-A	25	130	159	2,409	2,409	メディア・娯楽	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	72	370	398	6,025	6,025	自動車・自動車部品	
CITIC GUOAN INFORMATION-A	72	372	121	1,839	1,839	メディア・娯楽	
CITIC SECURITIES CO-A	182	1,194	2,815	42,567	42,567	各種金融	
COSCO SHIPPING DEVELOPM-E-A	146	751	144	2,191	2,191	資本財	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	141	613	217	3,281	3,281	運輸	
CRRC CORP LTD-A	374	2,313	1,431	21,650	21,650	資本財	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	274	1,412	983	14,868	14,868	運輸	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	58	295	405	6,133	6,133	ソフトウェア・サービス	
DONG-E-JIAOCO LTD-A	12	62	192	2,904	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	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	6,327	各種金融	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	33	258	222	3,357	3,357	資本財	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	55	283	187	2,832	2,832	不動産	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	65	332	234	3,549	3,549	各種金融	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	152	783	562	8,512	8,512	各種金融	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	42	215	696	10,532	10,532	不動産	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	37	189	396	5,998	5,998	自動車・自動車部品	
GEMDALE CORP-A	83	429	563	8,516	8,516	不動産	
GF SECURITIES CO LTD-A	109	562	772	11,675	11,675	各種金融	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	25	128	217	3,295	3,295	メディア・娯楽	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	150	772	440	6,653	6,653	不動産	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	104	538	125	1,903	1,903	運輸	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	39	226	237	3,598	3,598	自動車・自動車部品	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	26	134	421	6,369	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	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	6,427	各種金融	
AECC AVIATION POWER CO-A	42	214	532	8,047	8,047	資本財	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,375	7,081	2,421	36,616	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	千円	千円		
AIR CHINA LTD-A	86	378	262	3,966	3,966	運輸	
AISINO CORP-A	34	178	308	4,658	4,658	ソフトウェア・サービス	
ANGANG STEEL CO LTD-A	76	506	133	2,022	2,022	素材	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	74	490	3,035	45,897	45,897	素材	
ANXIN TRUST CO LTD-A	101	520	130	1,965	1,965	各種金融	
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	51	263	474	7,177	7,177	資本財	
AVIC CAPITAL CO LTD-A	166	853	338	5,120	5,120	各種金融	
BANK OF CHINA LTD-A	907	3,339	1,155	17,468	17,468	銀行	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	724	3,730	1,921	29,047	29,047	銀行	
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	42	304	240	3,640	3,640	銀行	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	95	487	416	6,295	6,295	銀行	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	213	1,096	661	9,994	9,994	銀行	
BANK OF NANJING CO LTD-A	157	806	619	9,371	9,371	銀行	
BANK OF NINGBO CO LTD-A	94	534	1,388	20,996	20,996	銀行	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	202	1,349	1,094	16,550	16,550	銀行	
BBMG CORPORATION-A	154	791	266	4,030	4,030	素材	
BEIJING CAPITAL CO LTD-A	89	—	—	—	—	公益事業	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY-A	78	403	396	5,989	5,989	食品・飲料・タバコ	
BEIJING SHIJI INFORMATION-A	16	84	276	4,181	4,181	ソフトウェア・サービス	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	25	130	328	4,972	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	15,312	自動車・自動車部品	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	102	525	337	5,104	5,104	各種金融	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	105	539	276	4,180	4,180	銀行	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	51	260	214	3,247	3,247	資本財	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	177	912	582	8,811	8,811	銀行	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	151	888	379	5,733	5,733	運輸	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	735	3,783	1,399	21,164	21,164	銀行	
CHINA FILM CO LTD-A	34	147	193	2,924	2,924	メディア・娯楽	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	55	285	664	10,044	10,044	不動産	
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	23	143	107	1,621	1,621	資本財	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	51	264	748	11,312	11,312	保険	
CHINA MERCHANTS BANK-A	381	2,159	7,551	114,176	114,176	銀行	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	106	543	985	14,901	14,901	各種金融	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	122	752	1,258	19,028	19,028	不動産	
CHINA MINSHENG BANKING-A	654	4,309	2,508	37,920	37,920	銀行	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	91	468	279	4,231	4,231	資本財	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	139	714	1,178	17,823	17,823	各種金融	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	62	319	263	3,988	3,988	各種金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	149	768	981	14,834	14,834	各種金融	
HLA CORP LTD-A	41	280	173	2,616	2,616	小売	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	51	262	1,089	16,471	16,471	食品・飲料・タバコ	
HENGTON OPTIC-ELECTRIC CO-A	35	180	324	4,898	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	3,154	素材	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	67	344	255	3,869	3,869	各種金融	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	150	644	236	3,583	3,583	公益事業	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	27	166	352	5,331	5,331	ヘルスケア機器・サービス	
HUANENG POWER INTL INC-A	90	1,572	679	10,268	10,268	公益事業	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	121	698	1,263	19,102	19,102	各種金融	
HUAXIA BANK CO LTD-A	237	1,987	1,291	19,533	19,533	銀行	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	76	470	262	3,972	3,972	保険	

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(中国オフショア)		百株	百株	千オフショア元	千円		
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	80	413	148	2,248	2,248	公益事業	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	11	77	792	11,977	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	39,832	銀行	
IFLYTEK CO LTD-A	38	210	725	10,967	10,967	ソフトウェア・サービス	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	124	636	384	5,808	5,808	各種金融	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	701	4,334	481	7,273	7,273	素材	
JIANGSU YANGHE BREWERY-A	28	142	1,404	21,234	21,234	食品・飲料・タバコ	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	38	197	255	3,860	3,860	素材	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO-A	50	255	153	2,324	2,324	素材	
JINKE PROPERTIES GROUP CO-A	99	507	422	6,393	6,393	不動産	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	35	178	322	4,876	4,876	ヘルスケア機器・サービス	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	28	145	257	3,895	3,895	小売	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	52	504	1,553	23,486	23,486	半導体・半導体製造装置	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	76	507	2,368	35,809	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	17,401	食品・飲料・タバコ	
MAANSHAN IRON & STEEL-A	110	566	148	2,250	2,250	素材	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	58	355	417	6,306	6,306	ヘルスケア機器・サービス	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	329	1,696	444	6,719	6,719	資本財	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	32	228	2,658	40,196	40,196	食品・飲料・タバコ	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	38	197	901	13,635	13,635	保険	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	78	400	1,234	18,670	18,670	食品・飲料・タバコ	
NINESTAR CORP-A	13	101	316	4,785	4,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NINGBO ZHOU SHAN PORT CO LT-A	—	836	286	4,335	4,335	運輸	
OFILM GROUP CO LTD-A	50	257	414	6,267	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	3,213	エネルギー	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	110	568	535	8,090	8,090	各種金融	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	63	326	300	4,539	4,539	メディア・娯楽	
PERFECT WORLD CO LTD-A	16	122	549	8,300	8,300	メディア・娯楽	
PETROCHINA CO LTD-A	299	1,540	688	10,408	10,408	エネルギー	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	200	1,129	8,344	126,175	126,175	保険	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	80	413	335	5,076	5,076	不動産	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	54	907	1,072	16,223	16,223	素材	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	142	795	1,631	24,670	24,670	資本財	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	72	335	410	6,209	6,209	各種金融	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	125	645	490	7,411	7,411	公益事業	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	123	792	588	8,897	8,897	エネルギー	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	16	107	236	3,576	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	13,389	素材	
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	82	548	166	2,513	2,513	ソフトウェア・サービス	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	—	845	272	4,114	4,114	資本財	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	145	773	362	5,481	5,481	資本財	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	37	192	649	9,826	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	9,438	運輸	
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	57	297	170	2,570	2,570	資本財	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	55	284	160	2,421	2,421	エネルギー	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	52	269	191	2,899	2,899	各種金融	
SHANXI TAI GANG STAINLESS-A	—	541	198	2,993	2,993	素材	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	16	83	888	13,440	13,440	食品・飲料・タバコ	
SHANXI XI SHAN COAL & ELEC-A	58	299	142	2,151	2,151	エネルギー	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	84	466	246	3,720	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	千円	千オフショア元	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	346	2,142	961	14,542	14,542	各種金融
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	61	313	171	2,588	2,588	公益事業
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	151	780	499	7,547	7,547	消費者サービス
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	16	82	155	2,348	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	1,850	素材
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	81	418	374	5,662	5,662	公益事業
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	27	136	280	4,236	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	4,447	各種金融
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	90	581	230	3,478	3,478	素材
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	55	285	224	3,395	3,395	各種金融
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	—	537	245	3,718	3,718	各種金融
SPRING AIRLINES CO LTD-A	14	87	308	4,661	4,661	運輸
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	49	254	215	3,264	3,264	資本財
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	28	143	210	3,178	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	4,140	資本財
TIANMA MICROELECTRONICS-A	38	194	273	4,141	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	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	2,966	素材
TONGWEI CO LTD-A	72	370	529	7,999	7,999	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	13	66	361	5,467	5,467	食品・飲料・タバコ
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A	26	135	110	1,671	1,671	商業・専門サービス
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	51	261	132	2,004	2,004	自動車・自動車部品
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	15	79	166	2,513	2,513	自動車・自動車部品
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	65	332	269	4,071	4,071	各種金融
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	33	200	741	11,216	11,216	メディア・娯楽
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	145	744	474	7,177	7,177	資本財
XIAMEN C & D INC-A	52	269	239	3,615	3,615	資本財
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	159	817	251	3,804	3,804	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	54	328	337	5,108	5,108	資本財
YOUNGOR GROUP CO-A	66	—	—	—	—	不動産
SHANGHAI ZHANJIANG HIGH-A	—	148	197	2,989	2,989	不動産
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	11	58	843	12,747	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	7,987	資本財
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	53	285	493	7,463	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	5,741	素材
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	167	—	—	—	—	公益事業
ZHONGJIN GOLD CORP-A	64	327	273	4,128	4,128	素材
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	319	2,813	1,111	16,800	16,800	素材
ZOOLMION HEAVY INDUSTRY S-A	118	609	423	6,399	6,399	資本財
ZTE CORP-A	63	442	1,902	28,763	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	4,643	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	81	417	663	10,025	10,025	エネルギー
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	362	1,864	367	5,552	5,552	公益事業
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	40	557	789	11,933	11,933	素材
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	85	439	866	13,102	13,102	資本財
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	18	114	252	3,812	3,812	自動車・自動車部品
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	250	1,286	622	9,411	9,411	耐久消費財・アパレル
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	45	235	1,109	16,771	16,771	ソフトウェア・サービス
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	—	294	1,341	20,287	20,287	ヘルスケア機器・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		
(中国オフショア)		百株	百株	千オフショア元	千円		
NAVINCO CO LTD-A	—	186	283	4,291	4,291	耐久消費財・アパレル	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	—	57	355	5,369	5,369	半導体・半導体製造装置	
ANGEL YEAST CO LTD-A	—	78	297	4,505	4,505	食品・飲料・タバコ	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	19	128	229	3,468	3,468	ソフトウェア・サービス	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	407	2,174	919	13,904	13,904	資本財	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	54	261	243	3,685	3,685	資本財	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	4	26	303	4,588	4,588	耐久消費財・アパレル	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	49	171	127	1,933	1,933	耐久消費財・アパレル	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	225	1,244	352	5,323	5,323	素材	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	99	378	548	8,298	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	2,438	エネルギー	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	36	249	256	3,881	3,881	各種金融	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	—	343	268	4,066	4,066	銀行	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	—	341	327	4,958	4,958	各種金融	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	—	165	360	5,445	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	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	43,297	資本財	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	—	638	1,164	17,613	17,613	各種金融	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	—	70	543	8,221	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	5,011	素材	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	—	51	610	9,235	9,235	各種金融	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	—	803	230	3,485	3,485	素材	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	—	311	560	8,473	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	9,939	ヘルスケア機器・サービス	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	—	252	1,210	18,305	18,305	メディア・娯楽	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	—	329	113	1,716	1,716	不動産	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	—	60	808	12,221	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	41,686	ヘルスケア機器・サービス	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	—	138	424	6,419	6,419	消費者サービス	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	—	153	405	6,128	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	2,850	素材	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	—	146	625	9,453	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	3,009	ソフトウェア・サービス	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	—	504	1,495	22,609	22,609	食品・飲料・タバコ	
YANZHOU COAL MINING CO-A	—	210	176	2,661	2,661	エネルギー	
WUXI APPTEC CO LTD-A	—	139	1,428	21,605	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	6,823	運輸	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	—	57	379	5,732	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	2,941	資本財	
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	—	64	202	3,065	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	2,206	資本財	
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	—	259	177	2,682	2,682	資本財	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	—	36	525	7,940	7,940	食品・飲料・タバコ	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	—	56	243	3,686	3,686	食品・飲料・タバコ	
ASYMCHM LABORATORIES TIAN-A	—	22	401	6,069	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	3,824	ヘルスケア機器・サービス	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	—	27	354	5,354	5,354	ヘルスケア機器・サービス	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	—	343	282	4,273	4,273	資本財	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	—	100	364	5,511	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	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 LTD-A	—	279	302	4,577	4,577	メディア・娯楽	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	—	161	398	6,032	6,032	資本財	
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	—	142	553	8,369	8,369	素材	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	—	70	381	5,767	5,767	食品・飲料・タバコ	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	—	147	410	6,201	6,201	ソフトウェア・サービス	
BEIJING SL PHARMACEUTICAL-A	—	98	110	1,677	1,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	—	99	340	5,144	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	2,463	食品・飲料・タバコ	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD-A	—	38	376	5,694	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	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	2,524	資本財	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	—	94	147	2,225	2,225	消費者サービス	
BY-HEALTH CO LTD-A	—	150	282	4,263	4,263	家庭用品・パーソナル用品	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	—	158	276	4,180	4,180	商業・専門サービス	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	—	16	976	14,757	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	4,383	自動車・自動車部品	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	—	69	263	3,982	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	2,056	公益事業	
CHINA ENTERPRISE CO LTD-A	—	387	161	2,440	2,440	不動産	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	—	278	371	5,611	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	2,217	資本財	
CHINA MERCHANTS ENERGY-A	—	577	378	5,723	5,723	エネルギー	
CHINA NATIONAL SOFTWARE-A	—	47	405	6,132	6,132	ソフトウェア・サービス	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	—	36	147	2,228	2,228	ヘルスケア機器・サービス	
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	—	72	227	3,441	3,441	ヘルスケア機器・サービス	
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	—	211	209	3,161	3,161	資本財	
CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	—	99	128	1,935	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	5,221	ソフトウェア・サービス	
CHONGQING BREWERY CO-A	—	46	257	3,896	3,896	食品・飲料・タバコ	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	—	75	251	3,806	3,806	食品・飲料・タバコ	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	—	260	197	2,991	2,991	エネルギー	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	—	263	916	13,854	13,854	各種金融	
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	—	735	127	1,933	1,933	運輸	
DAWNING INFORMATION INDUST-A	—	120	471	7,123	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	9,328	資本財	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	—	111	405	6,130	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	3,458	食品・飲料・タバコ	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	—	7	291	4,408	4,408	メディア・娯楽	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	—	483	124	1,876	1,876	半導体・半導体製造装置	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	—	43	956	14,461	14,461	半導体・半導体製造装置	
GLODON CO LTD-A	—	107	539	8,157	8,157	ソフトウェア・サービス	
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	—	311	161	2,445	2,445	不動産	
GRG BANKING EQUIPMENT CO-A	—	229	308	4,663	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	9,865	食品・飲料・タバコ	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY-H-A	—	287	191	2,894	2,894	素材	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	—	196	275	4,161	4,161	運輸	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	—	44	301	4,563	4,563	ヘルスケア機器・サービス	
GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	—	134	111	1,689	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	2,806	半導体・半導体製造装置	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	—	64	270	4,083	4,083	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		
(中国オショア)		百株	百株	千円	千円	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	—	169	289	4,374	4,374	食品・飲料・タバコ
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	—	296	166	2,510	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	3,432	資本財
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	—	172	643	9,735	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	5,562	素材
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	—	78	180	2,721	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	2,571	素材
HYTERA COMMUNICATIONS CORP-A	—	175	124	1,876	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	2,422	資本財
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	—	550	136	2,070	2,070	公益事業
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	—	123	521	7,881	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	6,852	ヘルスケア機器・サービス
JIANGSU CHANGSHU RURAL COM-A	—	260	178	2,700	2,700	銀行
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	—	84	607	9,189	9,189	資本財
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	—	118	420	6,364	6,364	食品・飲料・タバコ
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	—	29	234	3,540	3,540	素材
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	—	95	332	5,025	5,025	ヘルスケア機器・サービス
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOL-A	—	292	368	5,576	5,576	資本財
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	—	352	288	4,364	4,364	不動産
JIANGXI ZHENGJIANG TECH -A	—	232	400	6,054	6,054	食品・飲料・タバコ
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	—	111	171	2,598	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	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	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	5,734	食品・飲料・タバコ
JUEWEI FOOD CO LTD-A	—	55	295	4,472	4,472	食品・飲料・タバコ
JUNHEYAO AIRLINES CO LTD-A	—	156	148	2,252	2,252	運輸
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	—	95	149	2,253	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	3,138	食品・生活必需品小売り
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	—	242	143	2,166	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	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	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	4,949	素材
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	—	139	113	1,710	1,710	素材
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	—	482	223	3,374	3,374	小売
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	—	234	356	5,384	5,384	メディア・娯楽
NANJING IRON & STEEL CO-A	—	421	138	2,100	2,100	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	—	57	333	5,041	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	6,975	各種金融
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	—	44	671	10,147	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	2,558	ソフトウェア・サービス
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	—	123	257	3,892	3,892	自動車・自動車部品
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	—	222	184	2,782	2,782	各種金融
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	—	648	215	3,262	3,262	各種金融
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	—	817	168	2,544	2,544	素材
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	—	32	605	9,153	9,153	ソフトウェア・サービス
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	—	233	169	2,564	2,564	素材
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	—	400	176	2,673	2,673	各種金融
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	—	308	233	3,534	3,534	小売
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	—	155	277	4,197	4,197	素材
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	—	1,137	237	3,593	3,593	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		
(中国オショア)		百株	百株	千オショア元	千円	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	—	92	223	3,373		素材
SHANDONG SUN PAPER INDSTR-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 WAIQIAO QIAO 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 DEVELOPM-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 ZHONGHUA 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	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		
			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	
PIICC 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	30,654	217,964	289,672	4,379,850		
銘柄数 <比率>		238	463	—	<4.2%>		
(アラブ首長国連邦)			千アラブディルハム				
EMAR 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	
EMARA 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	
EMARA DEVELOPMENT PJSC	1,138	—	—	—		不動産	
小計	株数・金額	30,894	32,780	16,547	485,184		
銘柄数 <比率>		9	7	—	<0.5%>		
(サウジアラビア)			千サウジアラビアリヤル				
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	期首(前期末)		当期末			業種等		
	株数	株数	評価額		外貨建替額 邦貨換算額			
			外貨建替額	邦貨換算額				
(サウジアラビア)	百株	百株			千円			
SAUDI ELECTRICITY CO	—	1,500	2,340	67,139	千円	公益事業		
ALINMA BANK	—	1,738	2,506	71,886	千円	銀行		
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	—	314	2,168	62,191	千円	素材		
ALMARAI CO	—	469	2,176	62,423	千円	食品・飲料・タバコ		
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	—	437	2,023	58,029	千円	素材		
SAUDI BRITISH BANK	—	1,250	2,872	82,374	千円	銀行		
BANK ALBILAD	—	602	1,244	35,685	千円	銀行		
ETIHAD ETISALAT CO	—	625	1,603	45,987	千円	電気通信サービス		
JARIR MARKETING CO	—	96	1,246	35,757	千円	小売		
SAVOLA	—	435	1,630	46,752	千円	食品・飲料・タバコ		
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	—	1,442	1,152	33,060	千円	素材		
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	—	774	1,079	30,950	千円	素材		
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	—	1,170	797	22,864	千円	不動産		
BANK AL-JAZIRA	—	815	890	25,552	千円	銀行		
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	—	235	1,050	30,134	千円	素材		
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	—	329	592	16,999	千円	素材		
SAUDI CEMENT	—	112	477	13,699	千円	素材		
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	—	489	455	13,053	千円	素材		
RABIGH REFINING AND PETROCHE	—	327	427	12,248	千円	エネルギー		
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	—	91	603	17,319	千円	保険		
EMAAR ECONOMIC CITY	—	571	378	10,861	千円	不動産		
SAUDI AIRLINES CATERING CO	—	97	708	20,327	千円	消費者サービス		
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	—	41	412	11,816	千円	保険		
ARAB NATIONAL BANK	—	1,063	1,890	54,210	千円	銀行		
SAUDI ARABIAN OIL CO	—	2,132	6,588	188,967	千円	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	千円	銀行		
OOREDOO QPSC	128	1,287	803	23,618	千円	電気通信サービス		
QATAR NATIONAL BANK	662	8,114	13,868	407,859	千円	銀行		
INDUSTRIES QATAR	251	3,085	2,406	70,773	千円	資本財		
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	69	886	1,315	38,700	千円	公益事業		
QATAR ISLAMIC BANK	181	2,004	3,006	88,428	千円	銀行		
BARWA REAL ESTATE CO	249	3,346	948	27,883	千円	不動産		
COMMERCIAL BANK PSQC	271	3,352	1,303	38,322	千円	銀行		
QATAR INSURANCE CO	225	3,578	704	20,733	千円	保険		
EZDAN HOLDING GROUP	1,127	—	—	—	千円	不動産		
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	—	7,751	1,550	45,593	千円	素材		
QATAR FUEL QSC	—	832	1,339	39,402	千円	エネルギー		
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	—	1,440	1,158	34,067	千円	銀行		
小計	株数	・	金額	—	3,692	42,495	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	—	—	—	千南アフリカランド			
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	84	96	8,966	52,272	千南アフリカランド			
NEDBANK GROUP LTD	578	657	6,015	35,071	千南アフリカランド			
SASOL LTD	804	935	7,454	43,457	千南アフリカランド			
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	562	736	34,738	202,525	千南アフリカランド			
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	—	1,506	15,159	88,382	千南アフリカランド			

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		
(南アフリカ)		百株	百株	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	
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・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	
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	
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	
BID CORP LTD	479	571	13,722	80,004		食品・生活必需品小売	
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) 邦貨換算金額欄のく >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	邦貨換算金額	比率
			外貨建金額		
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 481	千口 621	千メキシコペソ 11,783	千円 52,670	% 0.1
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	481	621	11,783	52,670
(南アフリカ)				<0.1%>	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	444	537	千南アフリカランド 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 銘柄数 <比率>	1,644	1,774	10,798	62,955
合計	口数・金額 銘柄数 <比率>	2,126	2,396	—	115,626
		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	株式先物取引	MINI MS	百万円 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 ブラジルレアル=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 ニューヨークドル=3.60円	1 インドルピー=1.42円	1 オフショア元=15.12円
1 アラブ首長国連邦=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
(A) 資産	円
コール・ローン等	104,474,660,388
株式(評価額)	4,023,825,240
投資証券(評価額)	98,650,813,442
未収入金	115,626,115
未収配当金	568,682,282
差入委託証拠金	108,208,938
(A) 資産	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）

e MAXIS 新興国株式インデックス	11,943,689,005円
e MAXIS 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
e MAXIS 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
e MAXIS 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
e MAXIS 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
e MAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	1,016,687,297円
e MAXIS 全世界株式インデックス	478,833,975円
e MAXIS 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 プライムバランス（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
e MAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	243,705,734円
e MAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	141,074,462円
e MAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	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
(A) 配当等収益	円
受取配当金	2,285,101,368
受取利息	2,244,222,767
その他収益金	40,139,337
支払利息	932,964
△	△ 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算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 MAX I S バランス（波乗り型）	72,187,258円
e MAX 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V L（適格機関投資家限定）	13,328,223円
e MAX I S マイマネージャー 1990s	2,462,875円
e MAX 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 MAX 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)

日本債券インデックスマザーファンド

《第19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]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第19期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をNOMURA-BPI総合の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
主要運用対象	NOMURA-BPI総合に採用されている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は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合	債券組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	中率				
15期(2016年5月12日)	円 13,473	% 7.2	387.29	% 7.2	% 99.6	% — 529,456
16期(2017年5月12日)	13,180	△2.2	378.85	△2.2	99.3	0.2 457,117
17期(2018年5月14日)	13,283	0.8	381.82	0.8	98.4	0.3 544,273
18期(2019年5月13日)	13,503	1.7	388.16	1.7	99.8	0.1 608,830
19期(2020年5月12日)	13,524	0.2	388.75	0.2	99.6	0.1 630,705

(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	券 先 物 比	券 率
				騰 落 率			
(期 首) 2019年5月13日	円 13,503	% —	388.16	% —	% 99.8	% 0.1	
5月末	13,581	0.6	390.32	0.6	99.6	0.1	
6月末	13,663	1.2	392.69	1.2	99.8	0.1	
7月末	13,679	1.3	393.15	1.3	99.6	0.1	
8月末	13,863	2.7	398.50	2.7	99.6	0.1	
9月末	13,716	1.6	394.27	1.6	99.8	0.1	
10月末	13,660	1.2	392.61	1.1	99.4	0.1	
11月末	13,612	0.8	391.33	0.8	99.5	0.1	
12月末	13,571	0.5	390.14	0.5	100.9	0.6	
2020年1月末	13,629	0.9	391.77	0.9	100.2	0.1	
2月末	13,736	1.7	394.74	1.7	101.1	0.6	
3月末	13,513	0.1	388.45	0.1	99.8	0.1	
4月末	13,559	0.4	389.79	0.4	99.6	0.1	
(期 末) 2020年5月12日	13,524	0.2	388.75	0.2	99.6	0.1	

(注) 謄落率は期首比。

(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

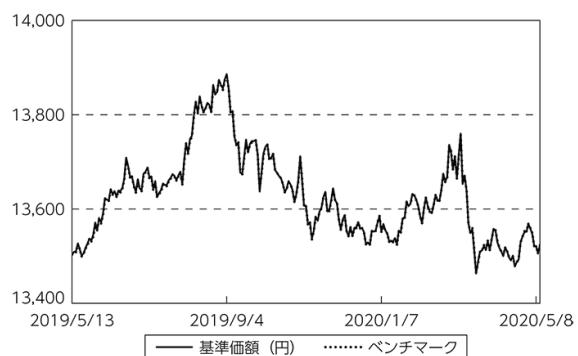
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率(0.2%)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。
- ・期の序盤は、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ましたが、その後下落しました。また、期の終盤は、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(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0.2%の上昇になったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・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が異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(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 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,628円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(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おります。

○ 売買及び取引の状況

(2019年5月14日～2020年5月12日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 367,425,827	千円 343,804,522
	地方債証券	24,378,782	24,530,720
	特殊債券	33,388,897	31,003,810 (752,447)
	社債券	14,599,007	14,254,870 (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 14,144	百万円 13,990	百万円 —	百万円 —

○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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 439,792	百万円 162,091	36.9	百万円 413,593	百万円 126,506	30.6

(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 2,946	百万円 302	百万円 4,337

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 4,900

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12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						残存期間別組入比率 5年以上 2年以上 2年未満	
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率				
					%	%		
国債証券	千円 484,304,000	千円 526,406,617	% 83.5	% —	% 56.8	% 18.2	% 8.4	
地方債証券	30,568,420	32,031,730	5.1	—	2.6	1.7	0.8	
(除く金融債)	(30,568,420)	(32,031,730)	(5.1)	(—)	(2.6)	(1.7)	(0.8)	
特殊債券	35,182,562	37,218,986	5.9	—	3.7	1.2	1.0	
(除く金融債)	(35,182,562)	(37,218,986)	(5.9)	(—)	(3.7)	(1.2)	(1.0)	
金融債券	3,300,000	3,306,410	0.5	—	0.0	0.3	0.2	
(金融債券)	(3,300,000)	(3,306,410)	(0.5)	(—)	(0.0)	(0.3)	(0.2)	
普通社債券	29,000,000	29,200,369	4.6	0.0	1.4	2.9	0.3	
(普通社債券)	(29,000,000)	(29,200,369)	(4.6)	(0.0)	(1.4)	(2.9)	(0.3)	
合計	582,354,982	628,164,115	99.6	0.0	64.6	24.4	10.6	
	(98,050,982)	(101,757,497)	(16.1)	(0.0)	(7.7)	(6.2)	(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	利率	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
国債証券	%			千円	
第404回利付国債(2年)	0.1	1,150,000	1,154,209	千円	2021/9/1
第405回利付国債(2年)	0.1	700,000	702,968	千円	2021/10/1
第407回利付国債(2年)	0.1	150,000	150,666	千円	2021/12/1
第408回利付国債(2年)	0.1	8,150,000	8,187,490	千円	2022/1/1
第409回利付国債(2年)	0.1	6,300,000	6,330,492	千円	2022/2/1
第128回利付国債(5年)	0.1	3,850,000	3,861,896	千円	2021/6/20
第129回利付国債(5年)	0.1	3,100,000	3,111,563	千円	2021/9/20
第130回利付国債(5年)	0.1	4,950,000	4,971,879	千円	2021/12/20
第131回利付国債(5年)	0.1	5,010,000	5,035,551	千円	2022/3/20
第132回利付国債(5年)	0.1	3,850,000	3,872,330	千円	2022/6/20
第133回利付国債(5年)	0.1	4,900,000	4,931,850	千円	2022/9/20
第134回利付国債(5年)	0.1	9,360,000	9,427,298	千円	2022/12/20
第135回利付国債(5年)	0.1	880,000	886,934	千円	2023/3/20
第136回利付国債(5年)	0.1	3,250,000	3,277,365	千円	2023/6/20
第137回利付国債(5年)	0.1	7,400,000	7,466,156	千円	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	5,150,000	5,198,513	千円	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	600,000	605,928	千円	2024/3/20
第140回利付国債(5年)	0.1	3,960,000	4,000,867	千円	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	4,640,000	4,689,833	千円	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	7,070,000	7,146,992	千円	2024/12/20
第1回利付国債(40年)	2.4	475,000	717,563	千円	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	870,000	1,281,701	千円	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	733,000	1,090,667	千円	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	1,098,000	1,649,832	千円	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	1,195,000	1,742,560	千円	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,060,000	1,526,103	千円	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	1,280,000	1,776,115	千円	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	1,280,000	1,666,419	千円	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	1,950,000	1,908,114	千円	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	2,400,000	2,750,064	千円	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	2,010,000	2,241,150	千円	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	1,690,000	1,709,451	千円	2059/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	3,633,000	3,688,257	千円	2021/6/20
第316回利付国債(10年)	1.1	2,280,000	2,312,148	千円	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	1,957,000	1,990,914	千円	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	2,480,000	2,519,605	千円	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	1,719,000	1,754,411	千円	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	1,980,000	2,017,600	千円	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	2,515,000	2,569,902	千円	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	1,470,000	1,499,355	千円	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	1,675,000	1,713,206	千円	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	2,800,000	2,857,932	千円	2022/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	3,835,000	3,923,435	千円	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	730,000	746,614	千円	2022/12/20

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面金額	評価額	
国債証券	%	千円	千円	千円	
第327回利付国債(10年)	0.8	2,540,000	2,604,465	2,604,465	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	3,700,000	3,782,177	3,782,177	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	5,860,000	6,036,386	6,036,386	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	3,330,000	3,438,424	3,438,424	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	1,060,000	1,087,358	1,087,358	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	5,040,000	5,178,902	5,178,902	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	6,550,000	6,741,587	6,741,587	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	4,330,000	4,464,100	4,464,100	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	4,470,000	4,596,366	4,596,366	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	3,880,000	3,994,149	3,994,149	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	940,000	958,724	958,724	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	3,580,000	3,672,614	3,672,614	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	6,660,000	6,841,351	6,841,351	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	2,250,000	2,314,305	2,314,305	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	4,270,000	4,373,675	4,373,675	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	8,240,000	8,349,262	8,349,262	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	6,010,000	6,093,118	6,093,118	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	6,170,000	6,258,909	6,258,909	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	4,440,000	4,506,511	4,506,511	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	3,390,000	3,441,494	3,441,494	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	4,920,000	4,997,539	4,997,539	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	5,700,000	5,790,915	5,790,915	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	3,790,000	3,851,019	3,851,019	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	5,070,000	5,150,207	5,150,207	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	5,510,000	5,595,460	5,595,460	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	4,300,000	4,365,102	4,365,102	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	4,460,000	4,525,606	4,525,606	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	6,290,000	6,376,676	6,376,676	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	5,350,000	5,420,887	5,420,887	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	6,400,000	6,478,016	6,478,016	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	4,950,000	5,007,123	5,007,123	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	2,970,000	3,002,194	3,002,194	2030/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	76,000	96,089	96,089	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	98,000	121,169	121,169	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	117,000	143,961	143,961	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	127,000	165,408	165,408	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	108,000	133,591	133,591	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	169,000	214,256	214,256	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	164,000	207,341	207,341	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	142,000	171,869	171,869	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	116,000	134,687	134,687	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	185,000	208,076	208,076	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	137,000	164,819	164,819	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	220,000	276,896	276,896	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	205,000	255,907	255,907	2033/12/20

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面金額	評価額	
国債証券	%	千円	千円	千円	
第14回利付国債(30年)	2.4	493,000	643,522	2034/3/20	
第15回利付国債(30年)	2.5	346,000	457,986	2034/6/20	
第16回利付国債(30年)	2.5	302,000	401,173	2034/9/20	
第17回利付国債(30年)	2.4	327,000	430,923	2034/12/20	
第18回利付国債(30年)	2.3	427,000	557,943	2035/3/20	
第19回利付国債(30年)	2.3	303,000	397,160	2035/6/20	
第20回利付国債(30年)	2.5	495,000	665,611	2035/9/20	
第21回利付国債(30年)	2.3	379,000	499,442	2035/12/20	
第22回利付国債(30年)	2.5	570,000	770,839	2036/3/20	
第23回利付国債(30年)	2.5	554,000	751,622	2036/6/20	
第24回利付国債(30年)	2.5	411,000	558,943	2036/9/20	
第25回利付国債(30年)	2.3	742,000	987,661	2036/12/20	
第26回利付国債(30年)	2.4	884,000	1,194,230	2037/3/20	
第27回利付国債(30年)	2.5	860,000	1,181,872	2037/9/20	
第28回利付国債(30年)	2.5	911,000	1,259,129	2038/3/20	
第29回利付国債(30年)	2.4	1,450,000	1,990,154	2038/9/20	
第30回利付国債(30年)	2.3	1,496,000	2,037,118	2039/3/20	
第31回利付国債(30年)	2.2	1,358,000	1,835,051	2039/9/20	
第32回利付国債(30年)	2.3	1,739,000	2,397,368	2040/3/20	
第33回利付国債(30年)	2.0	1,644,000	2,182,262	2040/9/20	
第34回利付国債(30年)	2.2	2,116,000	2,904,971	2041/3/20	
第35回利付国債(30年)	2.0	2,349,000	3,144,136	2041/9/20	
第36回利付国債(30年)	2.0	1,829,000	2,459,072	2042/3/20	
第37回利付国債(30年)	1.9	2,757,000	3,661,985	2042/9/20	
第38回利付国債(30年)	1.8	1,145,000	1,501,060	2043/3/20	
第39回利付国債(30年)	1.9	1,040,000	1,389,024	2043/6/20	
第40回利付国債(30年)	1.8	1,560,000	2,052,819	2043/9/20	
第41回利付国債(30年)	1.7	1,450,000	1,878,852	2043/12/20	
第42回利付国債(30年)	1.7	1,100,000	1,426,909	2044/3/20	
第43回利付国債(30年)	1.7	2,100,000	2,730,168	2044/6/20	
第44回利付国債(30年)	1.7	110,000	143,166	2044/9/20	
第45回利付国債(30年)	1.5	1,850,000	2,324,062	2044/12/20	
第46回利付国債(30年)	1.5	1,900,000	2,388,623	2045/3/20	
第47回利付国債(30年)	1.6	1,880,000	2,411,156	2045/6/20	
第48回利付国債(30年)	1.4	1,760,000	2,175,184	2045/9/20	
第49回利付国債(30年)	1.4	1,760,000	2,176,363	2045/12/20	
第50回利付国債(30年)	0.8	1,260,000	1,374,861	2046/3/20	
第51回利付国債(30年)	0.3	2,230,000	2,159,420	2046/6/20	
第52回利付国債(30年)	0.5	1,660,000	1,687,506	2046/9/20	
第53回利付国債(30年)	0.6	1,880,000	1,958,621	2046/12/20	
第54回利付国債(30年)	0.8	1,250,000	1,364,612	2047/3/20	
第55回利付国債(30年)	0.8	1,310,000	1,429,393	2047/6/20	
第56回利付国債(30年)	0.8	2,170,000	2,369,423	2047/9/20	
第57回利付国債(30年)	0.8	1,110,000	1,211,343	2047/12/20	
第58回利付国債(30年)	0.8	2,640,000	2,882,959	2048/3/20	

銘柄	利率	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
国債証券	%			千円	
第59回利付国債(30年)	0.7	730,000	778,442	千円	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	2,440,000	2,729,823		2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	2,340,000	2,494,557		2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	200,000	202,552		2049/3/20
第63回利付国債(30年)	0.4	30,000	29,575		2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	3,410,000	3,361,407		2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	1,400,000	1,379,910		2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	210,000	206,963		2050/3/20
第51回利付国債(20年)	2.0	200,000	204,846		2021/6/21
第52回利付国債(20年)	2.1	214,000	220,644		2021/9/21
第54回利付国債(20年)	2.2	480,000	498,350		2021/12/20
第55回利付国債(20年)	2.0	241,000	250,753		2022/3/21
第56回利付国債(20年)	2.0	449,000	469,671		2022/6/20
第58回利付国債(20年)	1.9	147,000	154,216		2022/9/20
第59回利付国債(20年)	1.7	589,000	617,902		2022/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	289,000	298,730		2023/3/20
第63回利付国債(20年)	1.8	442,000	469,094		2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	441,000	471,653		2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	318,000	341,691		2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	500,000	535,440		2023/12/20
第68回利付国債(20年)	2.2	846,000	923,019		2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	422,000	466,339		2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	160,000	175,489		2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	534,000	586,422		2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	620,000	681,181		2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	318,000	350,855		2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	575,000	637,450		2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	200,000	219,770		2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	210,000	231,783		2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	410,000	452,648		2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	50,000	55,457		2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	315,000	351,001		2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	350,000	390,103		2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	662,000	741,420		2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	413,000	464,872		2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	670,000	750,366		2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	490,000	554,106		2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	515,000	588,449		2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	450,000	511,524		2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	804,000	923,635		2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	410,000	468,490		2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	1,100,000	1,263,449		2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	468,000	540,540		2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	1,432,000	1,643,663		2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	390,000	446,967		2027/3/20

銘柄	利	当期末			
		率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%		千円	千円	
第94回利付国債(20年)	2.1	615,000	709,076	2027/3/20	
第95回利付国債(20年)	2.3	1,017,000	1,192,910	2027/6/20	
第96回利付国債(20年)	2.1	320,000	370,768	2027/6/20	
第97回利付国債(20年)	2.2	343,000	401,759	2027/9/20	
第98回利付国債(20年)	2.1	470,000	547,028	2027/9/20	
第99回利付国債(20年)	2.1	1,345,000	1,572,372	2027/12/20	
第100回利付国債(20年)	2.2	1,060,000	1,252,443	2028/3/20	
第101回利付国債(20年)	2.4	573,000	686,098	2028/3/20	
第102回利付国債(20年)	2.4	530,000	637,473	2028/6/20	
第103回利付国債(20年)	2.3	640,000	764,556	2028/6/20	
第104回利付国債(20年)	2.1	300,000	353,490	2028/6/20	
第105回利付国債(20年)	2.1	870,000	1,029,114	2028/9/20	
第106回利付国債(20年)	2.2	711,000	847,014	2028/9/20	
第107回利付国債(20年)	2.1	567,000	673,227	2028/12/20	
第108回利付国債(20年)	1.9	800,000	936,032	2028/12/20	
第109回利付国債(20年)	1.9	800,000	938,704	2029/3/20	
第110回利付国債(20年)	2.1	1,096,000	1,305,511	2029/3/20	
第111回利付国債(20年)	2.2	711,000	856,520	2029/6/20	
第112回利付国債(20年)	2.1	1,340,000	1,602,023	2029/6/20	
第113回利付国債(20年)	2.1	1,182,000	1,418,210	2029/9/20	
第114回利付国債(20年)	2.1	1,520,000	1,830,110	2029/12/20	
第115回利付国債(20年)	2.2	1,154,000	1,400,552	2029/12/20	
第116回利付国債(20年)	2.2	246,000	299,613	2030/3/20	
第117回利付国債(20年)	2.1	1,090,000	1,316,807	2030/3/20	
第118回利付国債(20年)	2.0	1,076,000	1,292,781	2030/6/20	
第119回利付国債(20年)	1.8	660,000	779,638	2030/6/20	
第120回利付国債(20年)	1.6	760,000	882,413	2030/6/20	
第121回利付国債(20年)	1.9	1,139,000	1,361,002	2030/9/20	
第122回利付国債(20年)	1.8	1,160,000	1,374,101	2030/9/20	
第123回利付国債(20年)	2.1	1,368,000	1,668,248	2030/12/20	
第124回利付国債(20年)	2.0	900,000	1,088,010	2030/12/20	
第125回利付国債(20年)	2.2	3,104,000	3,830,491	2031/3/20	
第127回利付国債(20年)	1.9	350,000	420,567	2031/3/20	
第128回利付国債(20年)	1.9	744,000	896,482	2031/6/20	
第130回利付国債(20年)	1.8	2,652,000	3,174,258	2031/9/20	
第131回利付国債(20年)	1.7	280,000	331,979	2031/9/20	
第132回利付国債(20年)	1.7	187,000	222,215	2031/12/20	
第133回利付国債(20年)	1.8	3,040,000	3,647,513	2031/12/20	
第134回利付国債(20年)	1.8	3,205,000	3,854,461	2032/3/20	
第137回利付国債(20年)	1.7	1,482,000	1,768,752	2032/6/20	
第138回利付国債(20年)	1.5	400,000	467,808	2032/6/20	
第139回利付国債(20年)	1.6	400,000	472,600	2032/6/20	
第140回利付国債(20年)	1.7	2,397,000	2,866,835	2032/9/20	
第141回利付国債(20年)	1.7	420,000	503,340	2032/12/20	
第142回利付国債(20年)	1.8	4,110,000	4,976,675	2032/12/20	

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面金額	評価額	
国債証券	%	千円		千円	
第143回利付国債(20年)	1.6	2,010,000		2,388,020	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	350,000		411,390	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	3,310,000		3,982,128	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	2,740,000		3,302,576	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	3,740,000		4,466,008	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	2,280,000		2,695,849	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	3,560,000		4,217,959	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	2,910,000		3,411,596	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	3,090,000		3,538,513	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	2,420,000		2,773,029	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	2,860,000		3,323,663	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	2,310,000		2,652,180	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	2,910,000		3,254,893	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	2,530,000		2,593,781	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	2,090,000		2,075,411	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	2,860,000		2,972,340	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	2,170,000		2,289,263	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	2,670,000		2,859,650	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	3,680,000		3,878,536	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	1,550,000		1,632,088	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	2,360,000		2,484,608	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	3,100,000		3,207,756	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	2,330,000		2,410,012	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	2,080,000		2,224,747	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	2,860,000		2,952,978	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	2,070,000		2,099,435	2039/3/20
第169回利付国債(20年)	0.3	1,300,000		1,294,150	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	3,080,000		3,065,955	2039/9/20
第171回利付国債(20年)	0.3	2,140,000		2,130,134	2039/12/20
第172回利付国債(20年)	0.4	200,000		202,796	2040/3/20
小計		484,304,000		526,406,617	
地方債証券					
第1回東京都公募公債(20年)	1.54	20,000		20,937	2023/6/20
第4回東京都公募公債(20年)	2.22	200,000		219,114	2024/9/20
第7回東京都公募公債(20年)	2.16	560,000		622,944	2025/9/19
第7回東京都公募公債(30年)	2.51	10,000		13,707	2038/9/17
第8回東京都公募公債(30年)	2.23	80,000		105,627	2038/9/17
第20回東京都公募公債(20年)	2.09	80,000		94,628	2029/9/20
第21回東京都公募公債(20年)	2.19	80,000		95,728	2029/12/20
第22回東京都公募公債(20年)	1.92	120,000		141,145	2030/6/20
第28回東京都公募公債(20年)	1.59	100,000		116,539	2033/3/18
第33回東京都公募公債(20年)	0.18	100,000		97,109	2036/6/20
第700回東京都公募公債	1.02	200,000		202,672	2021/9/17
第705回東京都公募公債	1.06	170,000		173,223	2022/3/18
第709回東京都公募公債	0.78	200,000		203,134	2022/6/20

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面	金額	
地方債証券	%		千円	千円	
第722回東京都公募公債	0.8	100,000		102,390	2023/6/20
第729回東京都公募公債	0.69	100,000		102,539	2024/3/19
第750回東京都公募公債	0.444	200,000		204,346	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	300,000		302,760	2027/3/19
第768回東京都公募公債	0.185	100,000		100,705	2027/6/18
平成25年度第4回北海道公募公債	0.85	100,000		102,499	2023/6/28
平成25年度第7回北海道公募公債	0.8	150,000		153,708	2023/8/30
平成25年度第9回北海道公募公債	0.7	300,000		306,756	2023/10/31
平成28年度第12回北海道公募公債	0.165	600,000		602,568	2026/12/28
平成29年度第15回北海道公募公債	0.23	117,000		118,085	2028/2/28
第29回1号宮城県公募公債	0.68	100,000		102,243	2023/10/25
第1回神奈川県公募公債(30年)	2.54	200,000		264,702	2035/6/20
第2回神奈川県公募公債(20年)	2.23	80,000		87,680	2024/9/20
第2回神奈川県公募公債(30年)	2.87	80,000		111,278	2036/6/20
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000		115,052	2034/9/20
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000		101,672	2022/6/20
第232回神奈川県公募公債	0.185	200,000		201,558	2028/3/17
第11回大阪府公募公債(20年)	1.693	200,000		235,988	2033/9/27
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000		10,112	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000		101,392	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000		56,933	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000		56,994	2022/3/29
第363回大阪府公募公債	0.77	500,000		508,330	2022/8/30
第376回大阪府公募公債	0.82	106,000		108,788	2023/9/27
第385回大阪府公募公債	0.65	200,000		205,028	2024/6/27
第388回大阪府公募公債	0.54	400,000		408,820	2024/9/27
第393回大阪府公募公債	0.468	110,000		112,252	2025/2/26
第394回大阪府公募公債	0.489	200,000		204,374	2025/3/28
第419回大阪府公募公債	0.196	700,000		705,131	2027/4/27
第429回大阪府公募公債	0.197	103,000		103,771	2028/2/25
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000		142,517	2022/3/16
平成24年度第10回京都府公募公債	0.67	100,000		101,829	2023/3/22
平成27年度第5回京都府公募公債(20年)	1.23	100,000		113,085	2035/8/17
第2回兵庫県公募公債(20年)	2.37	300,000		349,677	2027/9/17
第2回兵庫県公募公債(30年)	2.36	40,000		54,746	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000		109,146	2027/12/24
第5回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000		109,514	2028/5/26
第10回兵庫県公募公債(20年)	2.24	300,000		360,924	2030/2/22
平成28年度第2回兵庫県公募公債	0.08	400,000		400,236	2026/4/24
平成28年度第3回兵庫県公募公債	0.08	700,000		699,370	2026/5/22
平成29年度第14回兵庫県公募公債	0.164	300,000		301,431	2027/11/17
第29回兵庫県公募公債(20年)	0.443	200,000		201,658	2036/11/7
第3回静岡県公募公債(15年)	1.368	100,000		109,515	2027/10/29
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000		101,616	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	100,000		102,866	2023/7/25

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25年度第8回静岡県公募公債		0.699	130,000	132,999	2023/10/24
平成23年度第7回愛知県公募公債		1.11	100,000	101,311	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債		1.019	100,000	101,370	2021/9/30
平成23年度第13回愛知県公募公債		1.529	300,000	328,236	2026/11/13
平成23年度第14回愛知県公募公債		1.006	100,000	101,514	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債		0.996	100,000	101,660	2022/1/31
平成24年度第13回愛知県公募公債		0.772	100,000	101,880	2022/11/30
平成28年度第17回愛知県公募公債		0.225	200,000	202,052	2027/3/29
平成30年度第8回愛知県公募公債		0.255	600,000	607,656	2028/8/31
平成22年度第8回広島県公募公債		1.33	26,650	26,950	2021/3/25
平成23年度第7回広島県公募公債		1.0	100,000	101,798	2022/3/23
平成28年度第1回広島県公募公債(20年)		0.414	100,000	100,610	2036/9/26
平成29年度第7回広島県公募公債		0.2	100,000	100,898	2028/3/23
第4回埼玉県公募公債(20年)		2.18	200,000	230,642	2027/9/21
第16回埼玉県公募公債(20年)		1.216	100,000	112,875	2035/8/14
平成23年度第4回埼玉県公募公債		1.2	100,000	101,414	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債		0.801	100,000	101,881	2022/10/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債		0.335	100,000	101,436	2025/1/28
平成29年度第8回埼玉県公募公債		0.245	200,000	202,450	2028/1/26
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)		2.62	70,000	96,054	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)		2.28	80,000	106,405	2038/9/17
平成26年度第8回福岡県公募公債		0.441	100,000	101,896	2024/12/25
平成26年度第1回福岡県公募公債		0.654	100,000	102,571	2024/6/26
平成27年度第7回福岡県公募公債		0.464	100,000	102,292	2025/12/25
第9回千葉県公募公債(20年)		1.84	80,000	93,674	2030/10/11
平成23年度第9回千葉県公募公債		1.0	20,000	20,360	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債		1.05	20,000	20,396	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債		0.81	100,000	101,966	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債		0.58	82,500	83,838	2023/4/25
平成25年度第8回千葉県公募公債		0.67	100,000	102,261	2023/11/24
第7回群馬県公募公債(20年)		0.313	300,000	297,390	2036/6/13
平成24年度第1回大分県公募公債		0.8	100,260	102,152	2022/10/31
平成27年度第1回大分県公募公債		0.476	203,400	208,068	2025/10/30
第99回共同発行市場公募地方債		1.17	200,000	202,556	2021/6/25
第100回共同発行市場公募地方債		1.21	100,000	101,413	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債		1.05	100,000	101,313	2021/8/25
第106回共同発行市場公募地方債		0.97	1,500,000	1,524,000	2022/1/25
第109回共同発行市場公募地方債		1.05	170,000	173,369	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債		0.89	300,000	305,217	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債		0.77	200,000	203,358	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債		0.82	100,000	101,854	2022/9/22
第120回共同発行市場公募地方債		0.68	100,000	101,861	2023/3/24
第126回共同発行市場公募地方債		0.81	210,000	215,518	2023/9/25
第127回共同発行市場公募地方債		0.68	100,000	102,243	2023/10/25
第129回共同発行市場公募地方債		0.71	200,000	204,920	2023/12/25

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面金額	評価額	
地方債証券	%	千円	千円	千円	
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	102,703	2024/1/25	
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	204,868	2024/3/25	
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	300,000	307,767	2024/6/25	
第138回共同発行市場公募地方債	0.554	500,000	511,545	2024/9/25	
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	204,318	2024/11/25	
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	202,958	2025/1/24	
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	204,280	2025/3/25	
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	101,869	2025/4/25	
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	204,980	2025/5/23	
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	102,320	2025/12/25	
第162回共同発行市場公募地方債	0.105	300,000	300,570	2026/9/25	
第163回共同発行市場公募地方債	0.06	300,000	299,709	2026/10/23	
第170回共同発行市場公募地方債	0.18	400,000	402,656	2027/5/25	
第178回共同発行市場公募地方債	0.23	200,000	202,220	2028/1/25	
平成24年度第2回堺市公募公債	0.715	200,000	203,434	2022/12/19	
平成25年度第1回長崎県公募公債	0.81	200,000	205,264	2023/9/27	
平成28年度第2回島根県公募公債(20年)	0.506	100,000	102,028	2036/9/30	
平成30年度第1回福島県公募公債	0.264	100,000	101,390	2028/11/30	
平成23年度第1回滋賀県公募公債	1.02	100,000	101,536	2021/11/30	
平成25年度第1回栃木県公募公債	0.65	100,000	102,199	2023/11/29	
平成24年度第2回熊本県公募公債	0.8	50,000	50,939	2022/10/26	
平成23年度第1回浜松市公募公債	1.045	238,200	241,918	2021/11/25	
平成24年度第1回浜松市公募公債	0.844	100,000	102,193	2023/1/25	
平成25年度第1回浜松市公募公債	0.761	161,000	165,353	2024/1/24	
第5回大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	119,645	2028/9/21	
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,158	2022/1/27	
第1回名古屋市公募公債(20年)	1.99	200,000	214,130	2023/12/20	
第1回名古屋市公募公債(30年)	2.53	200,000	263,200	2035/3/20	
第9回名古屋市公募公債(20年)	2.07	400,000	467,228	2028/12/20	
第10回名古屋市公募公債(20年)	2.26	80,000	95,815	2029/8/17	
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	101,613	2021/12/20	
第1回京都市公募公債(20年)	2.14	200,000	219,420	2024/12/20	
第5回京都市公募公債(20年)	2.36	50,000	57,504	2026/12/18	
平成23年度第2回京都市公募公債	1.049	100,000	101,314	2021/8/26	
平成23年度第4回京都市公募公債	1.067	350,000	355,848	2021/12/22	
平成24年度第4回京都市公募公債	0.801	100,000	101,870	2022/10/21	
平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)	2.08	300,000	350,676	2028/12/20	
平成22年度第4回神戸市公募公債	1.895	100,000	117,587	2030/9/13	
第7回横浜市公募公債(20年)	2.06	200,000	222,406	2025/12/19	
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	80,000	94,825	2029/10/19	
平成24年度第2回横浜市公募公債	0.815	100,000	101,896	2022/10/17	
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	102,160	2023/2/20	
平成24年度第3回横浜市公募公債	0.729	100,000	101,812	2022/12/22	
平成27年度第2回横浜市公募公債	0.568	200,000	205,210	2025/6/16	
平成27年度第3回横浜市公募公債	0.524	500,000	512,315	2025/8/18	

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面	金額	
地方債証券	%		千円	千円	
第27回横浜市公募公債(20年)	1.599	60,000		70,075	2033/5/20
第33回横浜市公募公債(20年)	0.323	100,000		99,220	2036/4/28
第35回横浜市公募公債(20年)	0.443	300,000		302,952	2036/10/28
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	2.277	80,000		109,199	2040/9/20
平成23年度第3回札幌市公募公債	1.944	300,000		357,390	2031/7/29
平成26年度第5回札幌市公募公債	0.961	100,000		107,788	2029/9/20
平成27年度第9回札幌市公募公債	0.19	100,000		100,754	2025/12/19
第17回北九州市公募公債(20年)	1.529	100,000		116,333	2034/6/20
平成25年度第3回北九州市公募公債	0.728	300,000		307,359	2023/12/26
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	100,000		101,418	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債	0.8	200,000		203,776	2022/10/31
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000		51,120	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)	1.371	100,000		114,681	2034/9/20
平成25年度第2回広島市公募公債	0.72	100,000		102,500	2023/12/27
平成29年度第6回広島市公募公債	0.23	300,000		303,366	2028/2/25
平成24年度第1回相模原市公募公債	0.71	200,000		203,518	2022/12/20
平成23年度第1回三重県公募公債	1.021	98,410		99,923	2021/11/30
平成24年度第4回福井県公募公債	0.46	100,000		101,270	2023/4/26
平成26年度第4回福井県公募公債	0.425	100,000		101,962	2025/4/24
平成23年度第1回徳島県公募公債	1.02	100,000		101,536	2021/11/30
平成24年度第1回山梨県公募公債	0.8	200,000		203,764	2022/10/28
平成30年度第1回山梨県公募公債	0.289	100,000		101,586	2028/10/30
平成24年度第2回岡山県公募公債	0.68	100,000		101,869	2023/3/29
平成26年度第1回岡山市公募公債	0.33	100,000		101,414	2025/1/30
平成28年度第1回岡山県公募公債	0.18	300,000		302,103	2027/1/29
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券	0.06	200,000		199,684	2023/3/29
第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	2.34	100,000		117,655	2028/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券	0.704	100,000		102,180	2024/3/19
小計		30,568,420		32,031,730	
特殊債券(除く金融債)					
第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	400,000		473,572	2028/11/28
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000		136,425	2040/2/29
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	91,000		92,081	2021/5/31
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	122,000		123,638	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	200,000		203,018	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000		237,346	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	136,000		138,174	2021/11/30
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	300,000		304,797	2022/1/31
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	212,000		215,536	2022/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	109,000		110,867	2022/3/18
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.977	433,000		441,517	2022/4/28
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.737	100,000		118,449	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.83	200,000		256,692	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	512,000		521,661	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	430,000		438,294	2022/10/31

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177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.805		400,000	408,116	2022/11/30
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834		201,000	205,522	2023/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668		170,700	173,921	2023/3/17
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4		100,000	115,018	2023/4/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541		153,000	155,428	2023/4/28
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882		100,000	102,748	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911		223,000	229,504	2023/7/31
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801		100,000	102,693	2023/9/29
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.66		200,000	204,976	2024/2/29
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		332,000	340,243	2024/3/29
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601		124,000	127,129	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39		100,000	115,678	2024/8/31
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		283,000	289,322	2024/11/29
第256回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.425		213,000	217,698	2025/9/30
第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.01		100,000	99,872	2026/9/30
第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.174		106,000	107,034	2027/2/26
第318回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.16		100,000	100,935	2027/7/30
第2回政府保証地方公共団体金融機関債券(8年)	0.502		300,000	302,580	2021/12/24
第5回政府保証公営企業債券(15年)	2.2		300,000	314,286	2022/7/15
第18回政府保証地方公共団体金融機関債券(6年)	0.001		240,000	239,954	2022/5/30
第22回政府保証地方公共団体金融機関債券	1.3		30,000	30,332	2021/3/12
第29回政府保証地方公共団体金融機関債券	1.0		21,000	21,310	2021/10/18
第30回政府保証地方公共団体金融機関債券	1.0		401,000	407,243	2021/11/15
第31回政府保証地方公共団体金融機関債券	1.1		50,000	50,899	2021/12/14
第35回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.977		200,000	203,900	2022/4/22
第39回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.801		100,000	101,787	2022/8/15
第45回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.815		100,000	102,239	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.668		17,000	17,320	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.605		36,000	36,650	2023/5/16
第55回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.693		160,000	163,964	2023/12/18
第59回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.669		315,000	323,193	2024/4/12
第61回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.644		100,000	102,613	2024/6/14
第62回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.601		100,000	102,496	2024/7/16
第64回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.544		240,000	245,678	2024/9/13
第73回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.484		302,000	309,193	2025/6/13
第74回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.557		113,000	116,166	2025/7/15
第78回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.381		150,000	153,027	2025/11/18
第82回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.02		174,000	174,050	2026/3/13
第92回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.115		206,000	207,168	2027/1/19
第99回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.155		100,000	100,904	2027/8/13
第105回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.195		100,000	101,277	2028/2/15
第106回政府保証地方公共団体金融機関債券	0.145		116,000	117,042	2028/3/14
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815		100,000	102,255	2023/2/24
第17回政府保証民間都市開発債券	0.145		200,000	201,504	2026/2/26
第211回政府保証預金保険機関債券	0.1		100,000	100,186	2021/10/19

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	千円	
第3回政府保証新関西国際空港債券	0.644	100,000	102,636	2024/6/26	
第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債	0.001	400,000	399,924	2022/5/20	
第19回政府保証日本政策投資銀行	0.668	400,000	407,528	2023/3/15	
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,495	2023/12/18	
第60回政府保証日本政策投資銀行債券	0.001	1,000,000	998,050	2027/1/29	
第18回政府保証中部国際空港債券	0.668	558,000	568,579	2023/3/22	
第94回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	0.001	200,000	199,908	2021/9/17	
第9回道路債券(財投機関債)	2.9	100,000	131,534	2032/5/20	
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.35	200,000	228,616	2026/9/18	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.87	30,000	46,776	2046/12/20	
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.75	100,000	153,205	2047/3/20	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.67	130,000	196,939	2047/3/20	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.39	500,000	581,285	2027/7/20	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.34	200,000	232,906	2027/10/20	
第33回道路債券(財投機関債)	2.91	500,000	677,040	2034/6/20	
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	2.14	50,000	59,792	2030/5/10	
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.9	50,000	59,773	2032/3/19	
第87回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	0.893	200,000	203,654	2022/6/20	
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.711	100,000	117,576	2032/6/18	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.038	200,000	205,808	2023/3/20	
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.523	200,000	243,258	2044/12/20	
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.133	200,000	222,598	2035/3/20	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.974	100,000	138,919	2055/3/19	
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.284	100,000	113,866	2035/9/20	
第167回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	1.11	200,000	222,676	2035/12/20	
第1回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	2.266	50,000	59,603	2029/6/28	
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1.03	20,000	20,577	2023/3/22	
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.03	100,000	107,228	2023/12/20	
第8回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	2.043	200,000	237,652	2030/6/28	
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.33	50,000	55,006	2024/9/24	
第11回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	1.851	300,000	352,386	2030/10/28	
第14回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	2.187	80,000	97,311	2031/4/28	
第16回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	1.846	80,000	94,651	2031/8/28	
F 17回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.625	400,000	411,028	2022/1/28	
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	2.39	150,000	170,277	2026/3/24	
第23回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	1.68	300,000	351,876	2032/7/28	
F 24回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.681	70,000	73,306	2023/3/17	
第27回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	1.785	50,000	59,494	2033/1/28	
第33回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.035	400,000	407,316	2022/2/28	
第44回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)	1.298	100,000	114,034	2035/6/28	
F 67回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.805	300,000	335,628	2027/6/4	
F 89回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.602	300,000	332,289	2027/8/20	
F 90回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.609	300,000	334,389	2028/1/28	
F 104回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.314	100,000	106,127	2025/3/7	
F 122回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.412	300,000	327,513	2027/6/18	

銘柄	当期末				
	利	率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%		千円	千円	
F 123回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.6		100,000	114,058	2030/3/19
第128回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	0.155		400,000	400,388	2030/1/28
F 149回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.145		100,000	105,972	2025/12/19
F 197回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.052		300,000	320,919	2027/10/29
F 234回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)	1.605		100,000	118,342	2035/4/27
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	2.167		80,000	95,647	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	1.911		80,000	94,467	2030/10/29
第48回福祉医療機関債券(財投機関債)	0.175		700,000	703,444	2026/12/18
第54回福祉医療機関債券(財投機関債)	0.225		300,000	302,286	2028/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13		12,945	13,354	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08		13,434	13,955	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19		14,327	14,997	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27		13,750	14,381	2037/11/10
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.18		72,110	72,156	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16		152,482	152,692	2033/1/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29		13,623	14,185	2042/8/10
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.08		184,134	183,861	2033/4/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76		11,864	12,092	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	12,665	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13		13,641	14,163	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94		14,300	14,875	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25		12,327	12,710	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	15,131	2042/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19		12,925	13,405	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.24		15,205	16,058	2039/5/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15		13,318	13,816	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16		15,251	15,972	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7		10,243	10,305	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7		12,106	12,251	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64		14,673	14,964	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		14,733	15,032	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		44,502	45,369	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8		11,566	11,791	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12		11,725	12,004	2039/7/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28		46,208	50,040	2044/6/10
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67		11,723	11,953	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7		25,786	26,469	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69		14,048	14,496	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88		27,786	29,802	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87		28,785	30,689	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81		28,700	30,461	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88		13,981	14,545	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61		31,547	33,353	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84		13,240	13,706	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	34,530	2045/9/10

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41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09		14,491	15,171	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34		13,044	13,640	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6		38,321	40,734	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77		37,230	39,814	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79		31,426	33,484	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92		28,616	30,513	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89		89,235	95,062	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	31,438	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	32,224	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21		13,057	13,588	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64		32,824	34,807	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51		35,499	37,555	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	39,236	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42		40,990	43,379	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44		123,198	130,511	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	44,590	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	46,276	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21		45,257	47,551	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11		45,400	47,497	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12		47,405	49,644	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25		42,874	45,091	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32		48,101	50,852	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	2.066		80,000	96,404	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21		290,962	305,303	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.751		30,000	33,024	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08		43,511	45,425	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07		176,092	183,836	2048/12/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07		95,572	99,876	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07		47,322	49,458	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04		50,368	52,593	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	103,109	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02		102,232	106,677	2049/6/10
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95		54,972	57,187	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87		56,395	58,436	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84		114,766	118,763	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74		58,429	60,154	2050/1/10
第92回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.06		180,000	183,022	2021/12/20
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6		122,986	125,681	2050/2/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81		71,026	73,457	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9		71,165	73,956	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88		142,638	148,083	2050/8/10
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.441		300,000	327,369	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86		371,285	385,375	2050/12/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36		409,760	412,935	2051/6/10
第114回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1.473		190,000	208,876	2027/9/17

銘柄	当期末				
	利	率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.41	254,607	257,428	2051/12/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	430,050	436,586	2052/3/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.227	130,000	176,048	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.801	100,000	118,866	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	533,100	539,358	2052/10/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	89,468	90,510	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	90,492	91,786	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	91,731	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	182,278	184,148	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	182,034	183,903	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	457,365	462,720	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	185,300	187,030	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	186,566	188,972	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	93,640	95,053	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	95,866	2053/11/10
第143回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.192	200,000	217,636	2028/10/20
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	97,098	96,561	2054/8/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	195,896	194,714	2054/11/10
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.26	197,288	196,846	2054/12/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	197,722	198,410	2055/1/10
第174回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.129	180,000	200,809	2035/11/20
第6回沖縄興開発金融公庫債券(財投機関債)		2.04	50,000	55,025	2025/6/20
第7回国際協力機構債券(財投機関債)		1.991	70,000	83,783	2031/6/13
第39回東日本高速道路		0.03	1,000,000	1,000,230	2021/12/20
第33回中日本高速道路		1.084	50,000	50,721	2021/9/17
第39回中日本高速道路		1.057	400,000	406,696	2021/12/20
第65回中日本高速道路		0.03	700,000	700,126	2021/7/14
第72回中日本高速道路		0.05	300,000	300,090	2022/5/30
第29回西日本高速道路		0.31	500,000	505,570	2026/2/12
第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)		0.905	200,000	214,322	2029/11/27
第18回韓国輸出入銀行		0.27	100,000	99,815	2021/6/28
小計			35,182,562	37,218,986	
金融債券					
い第814号商工債券		0.17	200,000	200,400	2023/3/27
い第832号商工債券		0.06	300,000	298,755	2024/9/27
い第818号農林債券		0.08	200,000	199,904	2023/7/27
第322回信金中金債		0.03	300,000	299,874	2021/9/27
第327回信金中金債		0.06	200,000	199,988	2022/2/25
第336回信金中金債		0.1	300,000	300,111	2022/11/25
第338回信金中金債		0.11	200,000	200,146	2023/1/27
第11号商工債券(10年)		0.66	100,000	102,186	2024/9/20
第223号商工債券(3年)		0.11	300,000	300,117	2021/8/27
第230号商工債券(3年)		0.09	300,000	300,033	2022/3/25
第231号商工債券(3年)		0.08	100,000	99,990	2022/4/27
第236号商工債券(3年)		0.02	500,000	498,990	2022/9/27

銘柄	利率	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
金融債券	%			千円	
第2回信金中金債（10年）	0.52	300,000	305,916	305,916	2025/9/26
小計		3,300,000	3,306,410	3,306,410	
普通社債券					
第567回東京電力	1.958	100,000	106,715	106,715	2030/7/29
第499回中部電力	1.194	50,000	51,634	51,634	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	100,000	102,823	102,823	2024/5/24
第528回中部電力	0.13	200,000	199,752	199,752	2023/11/24
第496回関西電力	0.908	100,000	102,774	102,774	2025/2/25
第499回関西電力	0.68	200,000	203,348	203,348	2026/1/23
第508回関西電力	0.455	200,000	200,000	200,000	2027/4/23
第512回関西電力	0.32	200,000	200,202	200,202	2024/10/25
第517回関西電力	0.19	300,000	300,045	300,045	2023/6/20
第532回関西電力	0.18	100,000	99,696	99,696	2024/7/25
第381回中国電力	0.953	100,000	103,054	103,054	2024/4/25
第385回中国電力	0.728	100,000	102,297	102,297	2025/7/25
第402回中国電力	0.25	200,000	200,246	200,246	2024/10/25
第409回中国電力	0.4	300,000	300,489	300,489	2028/9/25
第304回北陸電力	0.989	100,000	102,795	102,795	2023/10/25
第307回北陸電力	1.055	100,000	104,413	104,413	2026/6/25
第310回北陸電力	0.748	200,000	204,724	204,724	2025/6/25
第322回北陸電力	0.38	200,000	200,486	200,486	2027/6/25
第475回東北電力	0.809	300,000	307,446	307,446	2024/9/25
第253回四国電力	1.0	100,000	102,603	102,603	2023/6/23
第426回九州電力	1.064	300,000	309,798	309,798	2024/2/23
第429回九州電力	0.909	200,000	205,742	205,742	2024/9/25
第484回九州電力	0.375	300,000	297,708	297,708	2029/11/22
第38回関西国際空港	1.112	50,000	50,881	50,881	2021/12/20
第5回日揮	0.2	700,000	699,118	699,118	2022/10/13
第7回明治ホールディングス	0.22	100,000	99,684	99,684	2024/9/13
第3回コカ・コーラウエスト	0.524	300,000	302,169	302,169	2022/6/17
第24回味の素	0.19	100,000	99,753	99,753	2024/3/8
第3回 キューピー	0.23	100,000	99,364	99,364	2026/2/13
第12回日本たばこ産業	0.11	200,000	199,140	199,140	2023/9/8
第13回日本たばこ産業	0.355	300,000	298,914	298,914	2028/9/8
第6回ヒューリック	0.494	300,000	298,758	298,758	2028/10/20
第7回ヒューリック	0.2	300,000	297,762	297,762	2024/6/25
第22回森ビル	0.18	200,000	199,376	199,376	2023/3/8
第31回東レ	0.25	100,000	99,903	99,903	2024/7/19
第9回クラレ	0.34	200,000	199,906	199,906	2027/4/30
第4回野村総合研究所	0.34	100,000	99,573	99,573	2028/3/23
第1回電通	0.11	300,000	298,815	298,815	2023/10/25
第2回電通	0.24	200,000	199,166	199,166	2025/10/24
第2回大塚ホールディングス	0.26	100,000	99,472	99,472	2026/3/6
第11回ヤフー	0.18	300,000	294,285	294,285	2024/7/31
第3回富士フィルムホールディングス	0.882	100,000	101,770	101,770	2022/12/2

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面	金額	
普通社債券	%		千円	千円	
第11回ブリヂストン	0.295	300,000		298,740	2027/4/21
第13回ブリヂストン	0.23	200,000		198,750	2026/4/17
第10回日本特殊陶業	0.11	100,000		99,415	2024/6/20
第1回日本製鉄	0.14	400,000		396,696	2024/6/20
第4回新日本製鐵	0.375	200,000		198,146	2027/5/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000		101,299	2021/9/17
第48回日本精工	0.16	200,000		199,472	2023/11/29
第51回日本精工	0.19	100,000		98,785	2026/9/2
第19回日立製作所	0.16	300,000		295,215	2027/3/12
第53回日本電気	0.26	200,000		199,732	2023/9/21
第56回日本電気	0.28	300,000		300,216	2023/4/21
第17回パナソニック	0.47	100,000		100,171	2026/9/18
第18回デンソー	0.315	500,000		498,285	2028/3/17
第29回三菱重工業	0.662	300,000		304,221	2024/9/3
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000		99,702	2021/8/2
第2回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.25	200,000		199,964	2022/10/31
第60回日産自動車	0.22	200,000		195,446	2023/3/20
第13回アイシン精機	0.827	100,000		102,005	2023/9/20
第1回明治安田生命2018基金	0.315	300,000		296,730	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	200,000		197,496	2024/8/2
第48回クレディセゾン	1.038	200,000		204,676	2023/10/20
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.724	300,000		300,012	2025/3/5
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.535	300,000		293,529	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		101,958	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.2	100,000		109,334	2026/10/30
第28回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	1.56	100,000		100,853	2021/1/20
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.16	200,000		216,282	2026/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	2.46	100,000		116,243	2031/1/20
第57回三菱東京UFJ銀行	2.22	200,000		210,224	2022/10/27
第8回三菱UFJ信託銀行（劣後特約付）	1.92	200,000		212,918	2025/10/28
第23回三井住友銀行（劣後特約付）	1.61	100,000		100,778	2020/12/17
第15回芙蓉総合リース	0.33	100,000		99,447	2024/12/6
第47回日産フィナンシャルサービス	0.23	200,000		195,554	2022/12/20
第20回東京センチュリーリース	0.19	100,000		99,801	2022/10/18
第23回東京センチュリーリース	0.2	200,000		199,414	2023/4/13
第42回ホンダファイナンス	0.05	100,000		99,731	2022/6/20
第91回トヨタファイナンス	0.19	300,000		300,087	2023/4/27
第23回リコーリース	0.05	200,000		199,620	2021/9/24
第27回リコーリース	0.16	100,000		99,874	2022/7/20
第30回リコーリース	0.16	200,000		199,852	2022/1/21
第35回リコーリース	0.04	100,000		99,638	2022/7/12
第37回リコーリース	0.02	300,000		298,470	2022/10/11
第7回イオンフィナンシャルサービス	0.19	200,000		198,358	2023/3/20
第79回アコム	0.29	300,000		294,039	2025/2/28
第47回日立キャピタル	0.874	100,000		101,448	2023/3/20

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面	金額	
普通社債券	%		千円	千円	
第70回日立キャピタル	0.2	200,000		199,704	2022/12/20
第78回日立キャピタル	0.02	300,000		298,344	2022/10/20
第82回日立キャピタル	0.09	300,000		298,167	2023/2/20
第194回オリックス	0.19	400,000		398,684	2023/11/8
第16回三井住友ファイナンス&リース	0.25	100,000		99,684	2024/9/13
第21回三井住友ファイナンス&リース	0.18	200,000		199,472	2023/11/27
第63回三菱UFJリース	0.19	400,000		398,976	2023/10/18
第66回三菱UFJリース	0.21	400,000		398,772	2024/4/11
第74回三菱UFJリース	0.09	400,000		398,372	2023/1/23
第75回三菱UFJリース	0.22	200,000		198,950	2025/1/23
第77回三菱UFJリース	0.29	300,000		300,333	2023/4/7
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000		108,785	2025/9/24
第50回野村ホールディングス	0.22	200,000		199,988	2022/8/10
第76回三井不動産	0.21	100,000		100,040	2023/4/28
第116回三井地所	0.643	100,000		101,589	2024/9/19
第125回三井地所	0.19	300,000		298,380	2025/3/14
第95回住友不動産	0.987	100,000		102,616	2024/1/26
第99回住友不動産	0.836	300,000		306,387	2024/7/29
第12回イオンモール	0.36	200,000		199,840	2023/7/3
第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.61	100,000		101,580	2024/9/20
第12回森トラスト総合リート投資法人	0.1	100,000		99,637	2023/2/20
第36回京王電鉄	0.325	100,000		99,703	2027/9/17
第38回京王電鉄	0.295	100,000		99,512	2027/11/29
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000		104,092	2022/2/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000		102,835	2022/12/20
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000		128,147	2044/1/29
第9回東海旅客鉄道	1.74	100,000		103,896	2022/9/20
第11回東海旅客鉄道	1.15	100,000		102,718	2022/12/20
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000		114,655	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000		118,110	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000		122,263	2045/3/6
第11回東京地下鉄	1.16	100,000		101,733	2021/12/9
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	200,000		199,264	2028/9/13
第16回三菱倉庫	0.21	200,000		198,978	2024/12/6
第63回日本電信電話	0.69	100,000		101,376	2023/3/20
第21回KDDI	0.669	100,000		101,528	2024/9/20
第27回KDDI	0.23	300,000		297,078	2026/4/24
第1回ソフトバンク	0.13	300,000		299,562	2023/3/17
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000		101,614	2023/9/20
第38回電源開発	0.978	100,000		102,824	2023/12/20
第39回電源開発	0.929	100,000		102,677	2024/2/20
第40回電源開発	0.889	200,000		205,412	2024/6/20
第57回電源開発	0.355	200,000		198,254	2028/7/20
第4回東京電力パワーグリッド	0.69	400,000		404,132	2024/6/20
第6回東京電力パワーグリッド	0.85	100,000		99,955	2027/8/31

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面金額	評価額	
普通社債券	%	千円	千円	千円	
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	200,000	197,844	2028/4/19	
第15回東京電力パワーグリッド	0.89	200,000	196,360	2030/7/24	
第27回東京電力パワーグリッド	0.6	200,000	201,276	2024/7/10	
第28回東京電力パワーグリッド	1.01	200,000	200,346	2029/7/10	
第30回東京電力パワーグリッド	0.58	100,000	100,373	2024/10/9	
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	200,000	199,500	2029/10/9	
第23回東京ガス	1.01	200,000	205,582	2023/6/9	
第13回広島ガス	0.405	200,000	199,992	2028/9/13	
第6回SCK	0.14	100,000	99,667	2022/7/21	
第4回ファーストリティイリング	0.749	100,000	102,261	2025/12/18	
第7回ファーストリティイリング	0.405	200,000	199,442	2028/6/6	
第14回フランス相互信用連合銀行	0.563	300,000	299,712	2021/10/15	
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	200,000	202,516	2025/10/15	
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	200,000	196,376	2024/10/10	
第8回新韓銀行	0.52	300,000	300,030	2022/11/2	
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.217	300,000	298,422	2023/1/25	
第1回韓国石油公社債	0.24	300,000	298,290	2022/1/21	
第10回ゴールドマン・サックス・グループ・インク	2.45	200,000	204,786	2021/12/28	
第17回ナショナル・オーストラリア銀行	0.44	100,000	99,751	2024/1/23	
小計		29,000,000	29,200,369		
合計		582,354,982	628,164,115		

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	百万円 609	百万円 —

○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
公社債	千円 628,164,115	% 99.2
コール・ローン等、その他	4,794,763	0.8
投資信託財産総額	632,958,878	100.0

○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
(A) 資産	円
コール・ローン等	632,958,789,687
公社債(評価額)	1,569,661,083
未収入金	628,164,115,113
未収利息	2,025,028,000
前払費用	1,072,909,364
差入委託証拠金	122,136,127
	4,940,000
(B) 負債	2,252,971,727
未払金	2,033,986,400
未払解約金	218,984,398
未払利息	929
(C) 純資産総額(A-B)	630,705,817,960
元本	466,348,174,986
次期繰越損益金	164,357,642,974
(D) 受益権総口数	466,348,174,986口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,524円

<注記事項>

- ①期首元本額 450,894,780,414円
 期中追加設定元本額 307,363,156,249円
 期中一部解約元本額 291,909,761,677円
 また、1口当たり純資産額は、期末1,3524円です。

○損益の状況 (2019年5月14日～2020年5月12日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取利息	4,923,899,054
支払利息	4,926,126,375
△	△ 2,227,321
(B) 有価証券売買損益	△ 4,979,230,706
売買益	1,783,604,569
売買損	△ 6,762,835,275
△	△ 3,760,840
(C) 先物取引等取引損益	△ 68,725,980
取引益	△ 72,486,820
取引損	△ 5,789
(D) 保管費用等	△ 59,098,281
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 157,935,569,429
(F) 前期繰越損益金	111,148,756,794
(G) 追加信託差損益金	△104,667,584,968
(H) 解約差損益金	164,357,642,974
(I) 計(E+F+G+H)	164,357,642,974
次期繰越損益金(I)	164,357,642,974

- (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算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。

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）

MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定) ファンド・マネジャー (国内債券)	153,625,622,366円
MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	142,596,390,869円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定)	20,033,909,074円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	18,818,550,250円
三菱UFJ バランスマネジメント40VA (適格機関投資家限定)	10,874,556,648円
三菱UFJ バランスマネジメント40VA (株式抑制型)	10,786,112,703円
eMAXIS 国内債券インデックス	10,738,572,510円
eMAXIS 国内債券インデックス	9,250,306,767円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	8,092,807,743円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	6,558,376,000円
eMAXIS Small Cap 国内債券インデックス	6,284,417,616円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	6,164,882,979円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	6,138,188,078円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	5,653,052,954円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 40型 (適格機関投資家限定)	4,686,187,121円
三菱UFJ バランスマネジメント50VA (適格機関投資家限定)	4,547,763,138円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,136,516,843円
eMAXIS Small Cap バランス (8資産均等型)	3,989,965,379円
国内債券セレクション (ラップ向け)	3,680,298,852円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	3,536,108,102円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	3,513,029,714円
三菱UFJ バランスマネジメント20VA (適格機関投資家限定)	3,221,373,956円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	2,365,605,066円

三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	2,035,608,272円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,974,933,223円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,931,137,648円
つみたて8資産均等バランス	1,609,028,373円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	1,188,668,654円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,187,494,871円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 20型（適格機関投資家限定）	1,134,033,350円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	664,017,745円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	651,394,383円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	494,190,717円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 50型（適格機関投資家限定）	493,158,520円
つみたて4資産均等バランス	484,552,426円
eMAXIS バランス（波乗り型）	408,544,762円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	385,698,534円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	332,696,834円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	256,630,202円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	243,287,476円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	242,394,210円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	220,647,949円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 60D（適格機関投資家限定）	201,177,980円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	137,013,411円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 60G（適格機関投資家限定）	124,190,981円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	97,163,240円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 30D（適格機関投資家限定）	87,659,350円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 45VA（適格機関投資家限定）	74,654,433円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	68,355,964円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 30G（適格機関投資家限定）	67,251,260円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	57,018,629円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	51,217,410円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	27,724,765円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	21,458,298円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 55VA（適格機関投資家限定）	19,965,089円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	18,206,223円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	15,046,178円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	12,048,218円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	11,726,700円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	11,414,627円
三菱UFJ バランスマネジメントVA 30型（適格機関投資家限定）	6,132,389円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,864,092円
コアバランス	1,676,166円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	1,511,500円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	922,473円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	62,733円
合計	466,348,174,986円

外国債券インデックスマザーファンド

《第19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]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第19期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。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。
主要運用対象	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国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	F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰落	中率			
15期(2016年5月12日)	円 19,674	% △6.1	% 109,931.94	% △6.2	% 98.9	% 156,155 百万円
16期(2017年5月12日)	19,894	1.1	111,054.04	1.0	98.8	— 132,430
17期(2018年5月14日)	20,178	1.4	112,563.85	1.4	98.9	— 120,314
18期(2019年5月13日)	20,412	1.2	113,996.81	1.3	98.7	— 137,361
19期(2020年5月12日)	21,324	4.5	119,287.72	4.6	98.6	— 149,310

(注) F T S E 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。F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、F T S E 世界国債インデックス（除く日本）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	F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2019年5月13日	円 20,412	% —	113,996.81	% —	% 98.7	% —
5月末	20,456	0.2	114,188.44	0.2	98.6	—
6月末	20,724	1.5	115,685.41	1.5	98.5	—
7月末	20,786	1.8	115,950.32	1.7	97.5	—
8月末	20,922	2.5	116,876.64	2.5	97.9	—
9月末	21,023	3.0	117,408.61	3.0	98.3	—
10月末	21,229	4.0	118,313.83	3.8	98.4	—
11月末	21,240	4.1	118,546.99	4.0	98.7	—
12月末	21,339	4.5	118,980.17	4.4	98.5	—
2020年1月末	21,509	5.4	120,069.31	5.3	98.4	—
2月末	21,764	6.6	121,401.29	6.5	98.5	—
3月末	21,796	6.8	121,796.59	6.8	98.5	—
4月末	21,381	4.7	119,329.72	4.7	98.0	—
(期 末) 2020年5月12日	円 21,324	% 4.5	119,287.72	% 4.6	% 98.6	% —

(注) 謄落率は期首比。

(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4.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率(4.6%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



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

●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

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

- ・期首に比べて米ドル、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4.6%の上昇になったため、カイ離は△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)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

(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14日～2020年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.011	(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)	(2)	(0.011)	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	2	0.011	
期中の平均基準価額は、21,088円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(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おります。

○売買及び取引の状況

(2019年5月14日～2020年5月12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 232,002	千アメリカドル 237,167
	カナダ	国債証券	千カナダドル 11,285	千カナダドル 8,629
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 64,122	千メキシコペソ 32,702
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	45,464	28,370
	イタリア	国債証券	30,287	17,127
	フランス	国債証券	54,275	40,198
	オランダ	国債証券	4,655	2,284
	スペイン	国債証券	46,061	37,465
	ベルギー	国債証券	7,444	5,106
	オーストリア	国債証券	5,067	2,865
	フィンランド	国債証券	1,678	1,216
	アイルランド	国債証券	2,563	1,567
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 27,366	千イギリスポンド 23,746
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 5,887	千スウェーデンクローネ 9,096
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 7,245	千ノルウェークローネ 1,553
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 10,182	千デンマーククローネ 4,981
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 9,677	千ポーランドズロチ 6,079
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 10,157	千オーストラリアドル 4,773
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 2,731	千シンガポールドル 1,268
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 7,190	千マレーシアリンギット 3,189
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 18,890	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 20,028	千南アフリカランド 108,243

(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 36,920	百万円 13,961	% 37.8	百万円 30,920	百万円 8,422	% 27.2

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三三菱UFJ銀行、三三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2020年5月12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 573,360	千アメリカドル 643,922	千円 69,234,594	% 46.4	% —	% 21.0	% 17.3	% 8.0	
	千カナダドル 31,990	千カナダドル 37,068	2,834,629	1.9	—	0.9	0.7	0.3	
メキシコ	千メキシコペソ 225,130	千メキシコペソ 249,067	1,113,331	0.7	—	0.4	0.2	0.1	
	千ユーロ	千ユーロ							
ヨーロ	ドイツ 74,720	91,388	10,602,937	7.1	—	4.2	2.3	0.6	
	イタリア 100,910	111,552	12,942,300	8.7	—	5.1	2.4	1.2	
	フランス 102,840	125,138	14,518,558	9.7	—	6.7	2.4	0.6	
	オランダ 19,710	24,530	2,846,004	1.9	—	1.3	0.4	0.2	
	スペイン 60,760	72,274	8,385,249	5.6	—	3.8	1.2	0.6	
	ベルギー 24,460	30,403	3,527,379	2.4	—	1.8	0.4	0.1	
	オーストリア 15,180	18,816	2,183,038	1.5	—	1.0	0.3	0.1	
	フィンランド 6,200	6,921	803,060	0.5	—	0.4	0.1	0.0	
	アイルランド 8,270	9,319	1,081,302	0.7	—	0.5	0.2	0.0	
イギリス	千イギリスポンド 52,160	千イギリスポンド 74,698	9,878,880	6.6	—	5.4	1.1	0.1	
	千スウェーデンクローネ 32,570	千スウェーデンクローネ 36,997	401,792	0.3	—	0.2	0.1	—	
ノルウェー	千ノルウェークローネ 30,660	千ノルウェークローネ 33,342	346,428	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
	千デンマーククローネ 36,130	千デンマーククローネ 46,864	729,213	0.5	—	0.4	0.0	0.1	
ポーランド	千ポーランドズロチ 30,230	千ポーランドズロチ 33,068	840,605	0.6	—	0.3	0.2	0.1	
	千オーストラリアドル 36,920	千オーストラリアドル 42,500	2,941,472	2.0	—	1.3	0.5	0.1	
シンガポール	千シンガポールドル 7,880	千シンガポールドル 8,898	673,847	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
	千マレーシアリンギット 26,470	千マレーシアリンギット 28,964	715,704	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
イスラエル	千イスラエルシェケル 14,800	千イスラエルシェケル 18,833	577,047	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
	合計	—	147,177,380	98.6	—	55.7	30.3	12.5	

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

(注) 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				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.125 T-NOTE 210731	1.125	7,100	7,181	772,159	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,200	2,227	239,491	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	3,400	3,444	370,308	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	2,000	2,030	218,349	2021/10/31
	1.25 T-NOTE 230731	1.25	2,000	2,063	221,860	2023/7/31
	1.375 T-NOTE 230215	1.375	3,000	3,095	332,854	2023/2/15
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,350	4,501	484,008	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,850	2,953	317,564	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,100	2,177	234,153	2023/9/30
	1.375 T-NOTE 250131	1.375	7,600	7,963	856,285	2025/1/31
	1.5 T-NOTE 211031	1.5	6,000	6,115	657,543	2021/10/31
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,300	2,351	252,782	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	4,200	4,349	467,671	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	3,250	3,369	362,270	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	1,500	1,577	169,596	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 241130	1.5	2,000	2,105	226,380	2024/11/30
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	5,700	6,046	650,114	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 270131	1.5	2,740	2,911	313,086	2027/1/31
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	5,000	5,365	576,869	2030/2/15
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,753	188,517	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 220831	1.625	7,640	7,886	847,957	2022/8/31
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	5,200	5,383	578,825	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 221215	1.625	5,000	5,182	557,234	2022/12/15
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	2,800	2,916	313,592	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	3,100	3,243	348,779	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	5,120	5,458	586,844	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	4,900	5,229	562,245	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	3,550	3,795	408,116	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	3,400	3,638	391,186	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	5,300	5,739	617,136	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	3,700	3,789	407,458	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	3,400	3,494	375,735	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,100	2,161	232,442	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	3,700	3,813	410,038	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,400	1,443	155,214	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,700	1,754	188,595	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220630	1.75	4,900	5,062	544,299	2022/6/30
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,800	1,865	200,597	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,700	2,811	302,301	2023/1/31
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	1,500	1,567	168,550	2023/5/15
	1.75 T-NOTE 241231	1.75	2,850	3,033	326,182	2024/12/31
	1.75 T-NOTE 261231	1.75	3,100	3,343	359,534	2026/12/31
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,300	2,359	253,739	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,550	2,623	282,058	2022/1/31
	1.875 T-NOTE 220228	1.875	5,100	5,254	565,016	2022/2/28
	1.875 T-NOTE 220331	1.875	2,450	2,528	271,882	2022/3/31

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
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円
国債証券	1.875 T-NOTE 220430	1.875	5,700	5,887	632,973
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	6,760	6,992	751,820
	1.875 T-NOTE 220731	1.875	4,500	4,666	501,757
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,500	1,557	167,466
	1.875 T-NOTE 220930	1.875	2,000	2,078	223,507
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,700	2,810	302,188
	2 T-NOTE 210831	2.0	1,850	1,893	203,636
	2 T-NOTE 211031	2.0	1,700	1,744	187,610
	2 T-NOTE 211115	2.0	2,650	2,722	292,730
	2 T-NOTE 211231	2.0	5,850	6,020	647,370
	2 T-NOTE 220215	2.0	2,200	2,270	244,130
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,900	3,015	324,255
	2 T-NOTE 221031	2.0	2,000	2,087	224,498
	2 T-NOTE 221130	2.0	6,200	6,479	696,726
	2 T-NOTE 240430	2.0	2,000	2,133	229,370
	2 T-NOTE 240531	2.0	3,850	4,111	442,055
	2 T-NOTE 240630	2.0	2,200	2,351	252,880
	2 T-NOTE 250215	2.0	4,700	5,063	544,468
	2 T-NOTE 250815	2.0	5,300	5,738	617,047
	2 T-NOTE 261115	2.0	5,150	5,632	605,640
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,650	1,686	181,371
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	4,500	4,610	495,746
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,200	2,258	242,864
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	4,060	4,187	450,206
	2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,800	1,874	201,519
	2.125 T-NOTE 221231	2.125	5,150	5,406	581,284
	2.125 T-NOTE 231130	2.125	4,500	4,793	515,440
	2.125 T-NOTE 240229	2.125	4,550	4,863	522,887
	2.125 T-NOTE 240331	2.125	3,460	3,703	398,234
	2.125 T-NOTE 240731	2.125	1,750	1,881	202,286
	2.125 T-NOTE 240930	2.125	2,250	2,425	260,782
	2.125 T-NOTE 241130	2.125	1,900	2,052	220,710
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	2,300	2,499	268,721
	2.25 T-BOND 460815	2.25	2,710	3,187	342,666
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	3,400	3,485	374,735
	2.25 T-NOTE 220415	2.25	2,700	2,806	301,746
	2.25 T-NOTE 231231	2.25	4,900	5,248	564,344
	2.25 T-NOTE 240131	2.25	7,300	7,829	841,862
	2.25 T-NOTE 240430	2.25	5,000	5,382	578,760
	2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,800	3,037	326,575
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	7,250	7,867	845,900
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,570	7,215	775,832
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,750	5,285	568,295
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,700	5,260	565,590
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	3,000	3,364	361,796
	2.375 T-NOTE 230131	2.375	5,000	5,292	569,016
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,300	4,671	502,284

銘 柄		当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	2.375 T-NOTE 270515	2.375	2,690	3,026	325,427	2027/5/15	
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	3,670	4,209	452,555	2029/5/15	
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,060	3,741	402,241	2045/2/15	
	2.5 T-BOND 460215	2.5	3,170	3,894	418,725	2046/2/15	
	2.5 T-BOND 460515	2.5	3,300	4,056	436,201	2046/5/15	
	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,400	3,646	392,071	2023/8/15	
	2.5 T-NOTE 240131	2.5	6,400	6,922	744,253	2024/1/31	
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,350	4,727	508,344	2024/5/15	
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,200	2,421	260,309	2025/1/31	
	2.625 T-NOTE 210715	2.625	4,600	4,732	508,869	2021/7/15	
	2.625 T-NOTE 230228	2.625	3,000	3,201	344,181	2023/2/28	
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	2,500	2,685	288,708	2023/6/30	
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	2,300	2,551	274,324	2025/3/31	
	2.625 T-NOTE 251231	2.625	2,600	2,913	313,207	2025/12/31	
	2.625 T-NOTE 260131	2.625	3,700	4,152	446,495	2026/1/31	
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	5,320	6,199	666,610	2029/2/15	
	2.75 T-BOND 420815	2.75	2,450	3,104	333,848	2042/8/15	
	2.75 T-BOND 421115	2.75	4,050	5,134	552,042	2042/11/15	
	2.75 T-BOND 470815	2.75	3,340	4,323	464,859	2047/8/15	
	2.75 T-BOND 471115	2.75	2,540	3,292	353,985	2047/11/15	
	2.75 T-NOTE 210815	2.75	11,660	12,040	1,294,574	2021/8/15	
	2.75 T-NOTE 230531	2.75	3,600	3,873	416,525	2023/5/31	
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	8,050	8,744	940,256	2023/11/15	
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	5,960	6,508	699,794	2024/2/15	
	2.75 T-NOTE 250228	2.75	2,150	2,394	257,427	2025/2/28	
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	6,000	6,719	722,433	2025/6/30	
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	5,840	6,556	704,983	2025/8/31	
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	6,260	7,275	782,292	2028/2/15	
	2.875 T-BOND 430515	2.875	3,000	3,881	417,286	2043/5/15	
	2.875 T-BOND 450815	2.875	4,350	5,686	611,423	2045/8/15	
	2.875 T-BOND 461115	2.875	3,080	4,062	436,796	2046/11/15	
	2.875 T-NOTE 211015	2.875	4,700	4,880	524,708	2021/10/15	
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	2,500	2,807	301,896	2025/4/30	
	2.875 T-NOTE 250531	2.875	2,400	2,699	290,263	2025/5/31	
	2.875 T-NOTE 251130	2.875	3,800	4,307	463,159	2025/11/30	
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	4,200	4,938	530,999	2028/5/15	
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	5,060	5,967	641,640	2028/8/15	
	3 T-BOND 420515	3.0	1,270	1,675	180,118	2042/5/15	
	3 T-BOND 441115	3.0	4,900	6,504	699,390	2044/11/15	
	3 T-BOND 450515	3.0	3,110	4,140	445,205	2045/5/15	
	3 T-BOND 451115	3.0	2,950	3,945	424,233	2045/11/15	
	3 T-BOND 470215	3.0	3,150	4,255	457,572	2047/2/15	
	3 T-BOND 470515	3.0	2,750	3,716	399,606	2047/5/15	
	3 T-BOND 480215	3.0	3,050	4,137	444,814	2048/2/15	
	3 T-BOND 480815	3.0	2,210	3,009	323,533	2048/8/15	
	3.125 T-BOND 411115	3.125	2,050	2,748	295,546	2041/11/15	
	3.125 T-BOND 420215	3.125	1,400	1,881	202,272	2042/2/15	

銘 柄		当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	3.125 T-BOND 430215	3.125	4,000	5,373	577,718	2043/2/15	
	3.125 T-BOND 440815	3.125	4,450	6,015	646,786	2044/8/15	
	3.125 T-BOND 480515	3.125	2,610	3,622	389,457	2048/5/15	
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	9,950	11,978	1,287,967	2028/11/15	
	3.375 T-BOND 440515	3.375	4,240	5,947	639,485	2044/5/15	
	3.625 T-BOND 430815	3.625	2,850	4,125	443,560	2043/8/15	
	3.625 T-BOND 440215	3.625	4,550	6,608	710,548	2044/2/15	
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,459	156,970	2041/8/15	
	3.75 T-BOND 431115	3.75	4,450	6,569	706,332	2043/11/15	
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,150	1,700	182,844	2040/8/15	
	4.25 T-BOND 390515	4.25	1,030	1,584	170,401	2039/5/15	
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,370	2,123	228,318	2040/11/15	
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,350	2,112	227,128	2039/11/15	
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,250	1,963	211,112	2040/5/15	
	4.375 T-BOND 410515	4.375	1,300	2,050	220,496	2041/5/15	
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,100	1,745	187,636	2039/8/15	
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,900	3,063	329,430	2040/2/15	
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,530	2,515	270,496	2041/2/15	
	5.25 T-BOND 281115	5.25	550	760	81,778	2028/11/15	
	5.25 T-BOND 290215	5.25	300	417	44,929	2029/2/15	
	5.5 T-BOND 280815	5.5	600	835	89,873	2028/8/15	
	6 T-BOND 260215	6.0	2,600	3,424	368,244	2026/2/15	
	6.25 T-BOND 230815	6.25	2,130	2,546	273,837	2023/8/15	
	8 T-BOND 211115	8.0	600	671	72,180	2021/11/15	
小 計					69,234,594		
カナダ	国債証券		千カナダドル	千カナダドル			
		0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,500	1,506	115,236	
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	3,120	3,140	240,175	
		1 CAN GOVT 220901	1.0	2,350	2,389	182,759	
		1 CAN GOVT 270601	1.0	1,200	1,244	95,195	
		1.25 CAN GOVT 250301	1.25	600	625	47,821	
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	850	882	67,476	
		1.5 CAN GOVT 240901	1.5	2,000	2,099	160,542	
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	970	1,034	79,121	
		1.75 CAN GOVT 210501	1.75	1,100	1,116	85,365	
		1.75 CAN GOVT 230301	1.75	800	833	63,765	
		2 CAN GOVT 230901	2.0	2,400	2,535	193,926	
		2 CAN GOVT 280601	2.0	900	1,007	77,028	
		2 CAN GOVT 511201	2.0	1,160	1,417	108,432	
		2.25 CAN GOVT 240301	2.25	800	858	65,665	
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,300	1,422	108,788	
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	890	1,026	78,522	
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,500	1,631	124,791	
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	850	893	68,329	
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	860	1,187	90,838	
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	310	479	36,686	
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	825	63,139	

銘 柏		当 期 末					
		利 率	額面金額	評 値 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	3.5 CAN GOVT 451201 4 CAN GOVT 410601 5 CAN GOVT 370601 5.75 CAN GOVT 290601 5.75 CAN GOVT 330601 8 CAN GOVT 270601	3.5 4.0 5.0 5.75 5.75 8.0	1,270 1,100 850 900 1,370 240	1,918 1,699 1,390 1,318 2,212 365	146,685 129,996 106,350 100,794 169,209 27,984	2045/12/1 2041/6/1 2037/6/1 2029/6/1 2033/6/1 2027/6/1
小 計					2,834,629		
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 MEXICAN BONOS 361120 5.75 MEXICAN BONO 260305 6.5 MEXICAN BONOS 210610 6.5 MEXICAN BONOS 220609 6.75 MEXICAN BONO 230309 7.25 MEXICAN BONO 211209 7.5 MEXICAN BONOS 270603 7.75 MEXICAN BONO 310529 7.75 MEXICAN BONO 341123 7.75 MEXICAN BONO 421113 8 MEXICAN BONOS 231207 8 MEXICAN BONOS 471107 8.5 MEXICAN BONOS 290531 8.5 MEXICAN BONOS 381118	10.0 10.0 5.75 6.5 6.5 6.75 7.25 7.5 7.75 7.75 7.75 8.0 8.0 8.5 8.5	19,300 6,600 11,700 26,740 19,400 10,500 6,500 24,150 9,150 9,500 13,240 23,450 10,800 22,000 12,100	23,096 8,825 11,940 27,129 20,015 10,988 6,729 26,795 10,309 10,749 14,468 25,763 12,087 25,914 14,253	103,242 39,450 53,372 121,267 89,469 49,117 30,081 119,775 46,085 48,052 64,674 115,162 54,031 115,837 63,711	2024/12/5 2036/11/20 2026/3/5 2021/6/10 2022/6/9 2023/3/9 2021/12/9 2027/6/3 2031/5/29 2034/11/23 2042/11/13 2023/12/7 2047/11/7 2029/5/31 2038/11/18
小 計					1,113,331		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 BUND 500815 0 OBL 220408 0 OBL 221007 0 OBL 230414 0 OBL 231013 0 SCHATS 220311 0.25 BUND 270215 0.25 BUND 280815 0.25 BUND 290215 0.5 BUND 250215 0.5 BUND 260215 0.5 BUND 270815 0.5 BUND 280215 1 BUND 240815 1 BUND 250815 1.25 BUND 480815 1.5 BUND 220904 1.5 BUND 230215 1.5 BUND 230515 1.5 BUND 240515 1.75 BUND 220704 1.75 BUND 240215	— — — — — — 0.25 0.25 0.25 0.5 0.5 0.5 0.5 0.5 1.0 1.0 1.25 1.5 1.5 1.5 1.5 1.75 1.75	470 1,700 2,000 1,400 2,150 3,900 2,600 1,990 5,700 4,000 2,600 2,300 1,900 1,750 1,750 2,800 3,062 2,850 1,300 2,500 1,500 1,550 2,300 4,450	478 1,724 2,037 1,432 2,208 3,954 2,768 2,135 6,130 4,244 2,788 2,498 2,072 1,884 3,935 1,369 2,660 1,604 1,694 2,425 4,881	55,539 200,127 236,336 166,178 256,213 458,842 321,221 247,787 711,261 492,494 323,470 289,887 240,427 218,680 355,299 456,583 158,877 308,650 186,140 196,556 281,371 566,327	2050/8/15 2022/4/8 2022/10/7 2023/4/14 2023/10/13 2022/3/11 2027/2/15 2028/8/15 2029/2/15 2025/2/15 2026/2/15 2027/8/15 2028/2/15 2024/8/15 2025/8/15 2048/8/15 2022/9/4 2023/2/15 2023/5/15 2024/5/15 2022/7/4 2024/2/15

銘 柏			当 期 末			
			利 率	額面金額	評 値 額	償還年月日
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ	国債証券	2 BUND 220104	2.0	1,500	1,568	182,000
		2 BUND 230815	2.0	1,450	1,583	183,718
		2.5 BUND 440704	2.5	1,880	3,104	360,189
		2.5 BUND 460815	2.5	2,030	3,441	399,306
		3.25 BUND 420704	3.25	1,030	1,828	212,104
		4 BUND 370104	4.0	1,690	2,934	340,482
		4.25 BUND 390704	4.25	1,650	3,106	360,421
		4.75 BUND 280704	4.75	930	1,344	155,940
		4.75 BUND 340704	4.75	2,040	3,567	413,849
		4.75 BUND 400704	4.75	1,190	2,415	280,193
		5.5 BUND 310104	5.5	1,290	2,136	247,874
		5.625 BUND 280104	5.625	1,250	1,860	215,912
		6.25 BUND 240104	6.25	1,130	1,422	165,093
		6.25 BUND 300104	6.25	750	1,254	145,514
		6.5 BUND 270704	6.5	1,200	1,827	212,058
イタリア	国債証券	0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	1,350	1,346	156,222
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,500	1,435	166,542
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,300	1,301	151,024
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	2,700	2,673	310,156
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	3,200	3,212	372,675
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,980	1,985	230,335
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	1,400	1,413	163,962
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,550	1,521	176,536
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,150	1,164	135,092
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	2,300	2,191	254,227
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,400	1,422	165,039
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,600	1,614	187,272
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	1,600	1,607	186,475
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	750	671	77,857
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,550	1,559	180,959
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,000	2,010	233,235
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,850	1,779	206,479
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	850	873	101,303
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,730	1,781	206,697
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	1,800	1,840	213,509
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,300	1,333	154,749
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	1,350	1,393	161,689
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,400	1,450	168,342
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,260	1,252	145,351
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	1,400	1,445	167,717
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,080	1,023	118,799
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,800	1,896	220,046
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,410	1,488	172,647
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,200	1,212	140,644
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,550	1,673	194,120
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	630	624	72,459
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,250	1,341	155,593

銘 柏			当 期 末			
			利 率	額面金額	評 値 額	償還年月日
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア	国債証券	3 ITALY GOVT 290801	3.0	550	602	69,933
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	590	642	74,502
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,150	1,270	147,439
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,190	1,359	157,743
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,700	1,937	224,800
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,800	1,860	215,825
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	3,000	3,120	362,044
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,500	1,656	192,130
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	920	1,123	130,331
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,050	2,496	289,609
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,300	2,542	294,975
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,120	2,385	276,722
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,450	1,691	196,274
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	3,000	3,166	367,426
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,700	1,904	220,958
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	2,000	2,458	285,232
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,220	1,662	192,928
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,500	1,617	187,618
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,920	2,247	260,710
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,310	3,076	356,897
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,620	2,231	258,924
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,050	2,829	328,241
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,100	2,709	314,334
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,150	1,273	147,763
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,200	2,451	284,377
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,730	2,415	280,223
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,530	3,511	407,376
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,070	2,758	320,078
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,100	1,482	171,994
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,200	1,526	177,111
フランス	国債証券	0 O.A.T 220525	—	2,700	2,730	316,794
		0 O.A.T 230325	—	3,100	3,148	365,258
		0 O.A.T 250325	—	2,000	2,040	236,737
		0 O.A.T 291125	—	2,100	2,103	244,049
		0.25 O.A.T 261125	0.25	1,500	1,550	179,889
		0.5 O.A.T 250525	0.5	2,750	2,878	333,977
		0.5 O.A.T 260525	0.5	3,250	3,411	395,763
		0.5 O.A.T 290525	0.5	2,200	2,312	268,337
		0.75 O.A.T 280525	0.75	3,190	3,419	396,735
		0.75 O.A.T 281125	0.75	3,100	3,327	386,023
		1 O.A.T 251125	1.0	1,920	2,066	239,710
		1 O.A.T 270525	1.0	2,900	3,148	365,340
		1.25 O.A.T 340525	1.25	2,070	2,348	272,418
		1.25 O.A.T 360525	1.25	2,730	3,104	360,232
		1.5 O.A.T 310525	1.5	3,390	3,926	455,504
		1.5 O.A.T 500525	1.5	1,180	1,424	165,274
		1.75 O.A.T 230525	1.75	6,850	7,333	850,866

銘 柏			当 期 末			
			利 率	額面金額	評 値 額	償還年月日
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 241125	1.75	2,900	3,193	370,539
		1.75 O.A.T 390625	1.75	2,370	2,926	339,492
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,270	1,719	199,551
		2 O.A.T 480525	2.0	1,840	2,444	283,645
		2.25 O.A.T 221025	2.25	3,850	4,117	477,680
		2.25 O.A.T 240525	2.25	2,740	3,046	353,469
		2.5 O.A.T 300525	2.5	2,950	3,690	428,134
		2.75 O.A.T 271025	2.75	3,270	3,996	463,649
		3 O.A.T 220425	3.0	5,500	5,882	682,518
		3.25 O.A.T 211025	3.25	1,600	1,687	195,795
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,960	3,146	365,007
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,550	3,135	363,773
		4 O.A.T 381025	4.0	1,840	3,001	348,192
		4 O.A.T 550425	4.0	1,440	2,862	332,088
		4 O.A.T 600425	4.0	1,310	2,736	317,491
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,590	4,191	486,300
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,560	4,579	531,328
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,400	3,968	460,415
		5.5 O.A.T 290425	5.5	2,750	4,131	479,354
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,220	3,758	436,055
オランダ	国債証券	6 O.A.T 251025	6.0	3,700	4,998	579,936
		8.5 O.A.T 230425	8.5	1,300	1,648	191,222
		0 NETH GOVT 220115	—	800	808	93,849
		0 NETH GOVT 240115	—	1,250	1,280	148,508
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,350	1,408	163,451
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	400	420	48,834
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,350	1,436	166,606
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,180	1,282	148,813
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,330	1,454	168,764
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,077	125,026
		2 NETH GOVT 240715	2.0	950	1,055	122,502
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	900	958	111,162
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,730	2,323	269,573
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	980	1,680	194,934
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,600	1,671	193,933
スペイン	国債証券	3.75 NETH GOVT 230115	3.75	300	336	38,985
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,300	2,357	273,462
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,490	2,506	290,780
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,150	1,677	194,651
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	650	794	92,162
		0.05 SPAIN GOVT 211031	0.05	1,000	1,003	116,474
		0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	1,100	1,113	129,165

銘 柏			当 期 末			
			利 率	額面金額	評 値 額	償還年月日
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン	国債証券	1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,950	2,060	239,004
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	1,500	1,591	184,592
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,900	2,015	233,831
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,100	2,234	259,259
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	1,320	1,403	162,828
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,450	1,550	179,928
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,800	1,923	223,109
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	850	931	108,084
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,900	2,078	241,156
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,220	2,463	285,862
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	2,000	2,202	255,558
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	1,740	2,022	234,673
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	970	1,215	140,985
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,050	2,288	265,516
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,310	1,688	195,916
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	820	1,250	145,054
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	2,300	2,638	306,144
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,470	2,136	247,925
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	2,350	2,709	314,368
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,050	2,517	292,134
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,550	2,489	288,862
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,300	1,529	177,510
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,300	2,111	244,995
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,350	1,846	214,265
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,160	2,021	234,581
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,750	2,012	233,481
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,850	4,434	514,502
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,850	2,042	237,004
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,450	1,938	224,887
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,800	2,603	302,102
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	600	614	71,263
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	800	831	96,498
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,300	1,375	159,616
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,080	1,153	133,863
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,100	2,252	261,332
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	1,060	1,147	133,186
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,100	1,183	137,345
		1 BEL GOVT 310622	1.0	650	712	82,683
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	940	1,061	123,163
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	300	347	40,273
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	880	1,067	123,815
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	390	485	56,300
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	630	778	90,374
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	570	842	97,689
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	820	891	103,402
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	360	520	60,444
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,180	1,328	154,080

銘 柏			当 期 末			
			利 率	額面金額	評 値 額	償還年月日
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円
ベルギー	国債証券	3 BEL GOVT 340622	3.0	610	836	96,998
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	970	1,655	192,064
		4 BEL GOVT 220328	4.0	750	814	94,518
		4 BEL GOVT 320328	4.0	620	898	104,191
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	950	1,012	117,479
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,100	1,227	142,381
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,300	2,218	257,427
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	680	872	101,203
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,520	2,538	294,543
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,200	1,734	201,236
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 220920	—	400	406	47,106
		0 AUSTRIA GOVT 230715	—	950	967	112,225
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	600	605	70,234
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,150	1,213	140,765
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	850	910	105,611
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,010	1,085	125,990
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	910	990	114,959
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	450	583	67,679
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	200	289	33,549
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	700	767	89,084
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,200	1,297	150,528
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	420	795	92,243
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	590	778	90,321
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	450	755	87,660
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	650	716	83,177
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,050	1,108	128,589
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	650	75,459
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	480	1,083	125,714
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,000	1,665	193,243
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	550	720	83,555
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	970	1,425	165,338
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	250	253	29,362
		0 FINNISH GOVT 230915	—	350	356	41,387
		0 FINNISH GOVT 240915	—	250	255	29,622
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	200	198	23,083
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	421	48,888
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	1,000	1,055	122,493
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	250	264	30,669
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	200	211	24,543
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	350	381	44,212
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	500	535	62,091
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	280	320	37,147
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	240	306	35,603
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	250	265	30,806
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	315	36,656
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	200	220	25,541
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	531	61,610

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額	償還年月日	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
フィンランド	国債証券	2.75 FINNISH GOVT 280704 4 FINNISH GOVT 250704	2.75 4.0	530 300	658 369	76,419 42,921	
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 221018 0.4 IRISH GOVT 350515 0.8 IRISH GOVT 220315 0.9 IRISH GOVT 280515 1 IRISH GOVT 260515 1.1 IRISH GOVT 290515 1.3 IRISH GOVT 330515 1.35 IRISH GOVT 310318 1.5 IRISH GOVT 500515 1.7 IRISH GOVT 370515 2 IRISH GOVT 450218 2.4 IRISH GOVT 300515 3.4 IRISH GOVT 240318 3.9 IRISH GOVT 230320 5.4 IRISH GOVT 250313	— 0.4 0.8 0.9 1.0 1.1 1.3 1.35 1.5 1.7 2.0 2.4 3.4 3.9 5.4	250 320 500 1,200 970 700 300 230 310 400 590 800 600 400 700	252 313 511 1,279 1,033 759 333 256 357 470 753 973 685 448 890	29,276 36,415 59,310 148,481 119,945 88,166 38,736 29,733 41,434 54,586 87,436 112,906 79,524 52,072 103,276	2028/7/4 2025/7/4 2022/10/18 2035/5/15 2022/3/15 2028/5/15 2026/5/15 2029/5/15 2033/5/15 2031/3/18 2050/5/15 2037/5/15 2045/2/18 2030/5/15 2024/3/18 2023/3/20 2025/3/13
小計						56,889,831	
イギリス							
国債証券		0.5 GILT 220722 0.625 GILT 250607 0.75 GILT 230722 0.875 GILT 291022 1 GILT 240422 1.25 GILT 270722 1.5 GILT 260722 1.5 GILT 470722 1.625 GILT 281022 1.625 GILT 711022 1.75 GILT 220907 1.75 GILT 370907 1.75 GILT 490122 1.75 GILT 570722 2 GILT 250907 2.25 GILT 230907 2.5 GILT 650722 2.75 GILT 240907 3.25 GILT 440122 3.5 GILT 450122 3.5 GILT 680722 3.75 GILT 520722 4 GILT 220307 4 GILT 600122 4.25 GILT 271207 4.25 GILT 320607 4.25 GILT 360307 4.25 GILT 390907	0.5 0.625 0.75 0.875 1.0 1.25 1.5 1.5 1.625 1.625 1.75 1.75 1.75 1.75 2.0 2.25 2.5 2.75 3.25 3.5 3.5 3.75 4.0 4.0 4.25 4.25 4.25 4.25	1,100 1,500 2,450 570 1,700 1,770 1,660 1,940 2,150 280 3,000 1,700 930 1,250 780 1,700 1,440 510 1,830 1,750 1,850 1,210 1,050 1,110 980 1,220 1,290 1,150	1,112 1,541 2,506 604 1,763 1,913 1,808 2,386 2,415 442 3,121 2,039 1,215 1,782 862 1,825 2,637 569 2,897 2,912 4,300 2,358 1,126 2,527 1,280 1,777 2,028 1,930	147,117 203,820 331,480 79,986 233,242 253,098 239,176 315,671 319,392 58,502 412,810 269,661 160,763 235,698 114,053 241,443 348,792 75,295 383,166 385,127 568,745 311,938 148,979 334,274 169,401 235,023 268,231 255,251	2022/7/22 2025/6/7 2023/7/22 2029/10/22 2024/4/22 2027/7/22 2026/7/22 2047/7/22 2028/10/22 2071/10/22 2022/9/7 2037/9/7 2049/1/22 2057/7/22 2025/9/7 2023/9/7 2065/7/22 2024/9/7 2044/1/22 2045/1/22 2068/7/22 2052/7/22 2022/3/7 2060/1/22 2027/12/7 2032/6/7 2036/3/7 2039/9/7

銘 柄		当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 値 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	4.25 GILT 401207	4.25	1,170	2,005	265,286	2040/12/ 7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,410	2,674	353,699	2046/12/ 7
		4.25 GILT 491207	4.25	930	1,855	245,439	2049/12/ 7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,320	2,921	386,429	2055/12/ 7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,260	1,968	260,399	2034/ 9/ 7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,210	2,211	292,513	2042/12/ 7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,070	1,570	207,691	2030/12/ 7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,410	2,464	325,915	2038/12/ 7
		5 GILT 250307	5.0	1,130	1,397	184,777	2025/ 3/ 7
		6 GILT 281207	6.0	1,080	1,614	213,531	2028/12/ 7
		8 GILT 210607	8.0	300	325	43,045	2021/ 6/ 7
小 計						9,878,880	
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	2,550	2,734	29,694	2028/ 5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	4,400	4,740	51,484	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	5,660	6,118	66,447	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,100	5,428	58,950	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,630	5,283	57,382	2025/ 5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,900	7,445	80,863	2022/ 6/ 1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,330	5,245	56,970	2039/ 3/30
小 計						401,792	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェーカローネ			
	国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	1,800	1,973	20,500	2030/ 8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	4,160	4,488	46,634	2026/ 2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,300	2,490	25,880	2025/ 3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	3,050	3,368	34,998	2027/ 2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	2,200	2,480	25,768	2029/ 9/ 6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	5,150	5,470	56,841	2023/ 5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	2,850	3,230	33,564	2028/ 4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,400	4,904	50,960	2024/ 3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,750	4,935	51,278	2021/ 5/25
小 計						346,428	
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	7,350	7,864	122,378	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	4,400	4,742	73,798	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,650	3,920	60,995	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	4,850	5,466	85,062	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	6,020	6,345	98,732	2021/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,860	18,524	288,245	2039/11/15
小 計						729,213	
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	1,900	1,929	49,040	2021/ 7/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	1,250	1,292	32,849	2022/ 4/25
		2.25 POLAND 241025	2.25	1,000	1,060	26,955	2024/10/25
		2.5 POLAND 230125	2.5	2,500	2,624	66,724	2023/ 1/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	2,600	2,774	70,523	2024/ 4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	5,500	5,927	150,684	2026/ 7/25

銘 柄		当 期 末				
		利 率	額面金額	評 値 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	2.5 POLAND 270725	2.5	2,050	2,208	56,152	2027/7/25
	2.75 POLAND 280425	2.75	2,660	2,917	74,163	2028/4/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,950	2,166	55,073	2025/7/25
	4 POLAND 231025	4.0	2,700	3,003	76,358	2023/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,700	1,829	46,506	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,550	1,737	44,156	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	2,070	2,806	71,346	2029/4/25
	POLAND 220725	—	800	789	20,068	2022/7/25
小 計					840,605	
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	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	2,800	2,787	192,899	2024/11/21
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	760	774	53,606	2032/5/21
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	1,000	1,049	72,603	2031/6/21
	2 AUST GOVT 211221	2.0	1,150	1,182	81,862	2021/12/21
	2.25 AUST GOVT 221121	2.25	1,000	1,051	72,741	2022/11/21
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	2,300	2,561	177,306	2028/5/21
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	2,300	2,637	182,514	2030/5/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,700	1,863	128,985	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,950	2,238	154,931	2027/11/21
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,950	2,255	156,090	2028/11/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,830	2,133	147,681	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	596	41,279	2035/6/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,350	1,703	117,893	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,800	2,051	142,013	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,090	2,513	173,993	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	820	1,044	72,259	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	800	1,071	74,185	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,490	3,034	210,023	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	1,270	1,785	123,602	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,950	2,493	172,593	2027/4/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,750	2,019	139,804	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,760	1,857	128,571	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,600	1,792	124,027	2022/7/15
小 計					2,941,472	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	1.25 SINGAPORGVT 211001	1.25	550	556	42,170	2021/10/1
	1.75 SINGAPORGVT 220401	1.75	350	358	27,175	2022/4/1
	1.75 SINGAPORGVT 230201	1.75	250	258	19,597	2023/2/1
	1.875 SINGAPORGVT 500301	1.875	250	292	22,126	2050/3/1
	2 SINGAPORGVT 240201	2.0	100	105	7,987	2024/2/1
	2.125 SINGAPORGVT 260601	2.125	630	685	51,884	2026/6/1
	2.25 SINGAPORGVT 210601	2.25	420	428	32,451	2021/6/1
	2.25 SINGAPORGVT 360801	2.25	260	300	22,771	2036/8/1
	2.375 SINGAPORGVT 250601	2.375	300	326	24,734	2025/6/1
	2.375 SINGAPORGVT 390701	2.375	200	239	18,145	2039/7/1
	2.625 SINGAPORGVT 280501	2.625	300	342	25,963	2028/5/1
	2.75 SINGAPORGVT 230701	2.75	450	481	36,474	2023/7/1

銘 柄		当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
	国債証券	2.75 SINGAPORGVT 420401	2.75	290	374	28,330	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGVT 460301	2.75	520	687	52,099	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGVT 290701	2.875	250	293	22,232	2029/7/1
		2.875SINGAPORGVT 300901	2.875	300	356	27,001	2030/9/1
		3 SINGAPORGVT 240901	3.0	600	662	50,197	2024/9/1
		3.125SINGAPORGVT 220901	3.125	800	849	64,340	2022/9/1
		3.375 SINGAPORGVT 330901	3.375	410	526	39,868	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGVT 270301	3.5	650	769	58,296	2027/3/1
小	計				673,847		
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
	国債証券	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	922	22,796	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,200	1,239	30,625	2023/3/15
		3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	300	315	7,806	2027/5/31
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	1,100	1,172	28,963	2028/6/15
		3.795 MALAYSIAGO 220930	3.795	500	517	12,791	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	200	209	5,165	2023/8/17
		3.828 MALAYSIAGO 340705	3.828	500	542	13,400	2034/7/5
		3.844 MALAYSIAGO 330415	3.844	600	645	15,944	2033/4/15
		3.882 MALAYSIAGO 220310	3.882	500	514	12,719	2022/3/10
		3.882 MALAYSIAGO 250314	3.882	1,000	1,062	26,247	2025/3/14
		3.892 MALAYSIAGO 270315	3.892	500	536	13,268	2027/3/15
		3.899 MALAYSIAGO 271116	3.899	1,100	1,185	29,285	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	1,000	1,074	26,553	2026/11/30
		3.906 MALAYSIAGO 260715	3.906	1,700	1,821	45,015	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGO 250915	3.955	800	858	21,212	2025/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	922	22,805	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	1,060	1,172	28,974	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	2,250	2,302	56,896	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGO 240715	4.181	1,000	1,068	26,395	2024/7/15
		4.254 MALAYSIAGO 350531	4.254	850	949	23,466	2035/5/31
		4.392 MALAYSIAGO 260415	4.392	900	986	24,386	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGO 300415	4.498	1,100	1,241	30,676	2030/4/15
		4.642 MALAYSIAGO 331107	4.642	1,200	1,391	34,374	2033/11/7
		4.736 MALAYSIAGO 460315	4.736	1,050	1,239	30,631	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGO 370407	4.762	1,600	1,885	46,579	2037/4/7
		4.921 MALAYSIAGO 480706	4.921	600	729	18,019	2048/7/6
		4.935 MALAYSIAGO 430930	4.935	1,200	1,443	35,680	2043/9/30
		5.248 MALAYSIA 280915	5.248	860	1,012	25,018	2028/9/15
小	計				715,704		
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	1,900	2,163	66,302	2028/9/28
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	2,000	2,272	69,635	2024/3/31
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	1,200	1,723	52,820	2047/3/31
		4.25 ISRAEL FIXED 230331	4.25	1,000	1,119	34,315	2023/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 220131	5.5	3,800	4,211	129,047	2022/1/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	1,400	2,455	75,235	2042/1/31

銘 柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 値 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
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	千円	
国債証券	6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	3,500	4,885	149,690
小 合	計				2026/10/30
	計			577,047	
				147,177,380	

(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 値 額	比 率
公社債	千円 147,177,380	% 98.2
コール・ローン等、その他	2,708,393	1.8
投資信託財産総額	149,885,773	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（149,217,319千円）の投資信託財産総額（149,885,773千円）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=107.52円	1 カナダドル=76.47円	1 メキシコペソ=4.47円	1 ヨーロ=116.02円
1 イギリスポンド=132.25円	1 スウェーデンクローネ=10.86円	1 ノルウェークローネ=10.39円	1 デンマーククローネ=15.56円
1 ポーランドズロチ=25.42円	1 オーストラリアドル=69.21円	1 シンガポールドル=75.73円	1 マレーシアリンギット=24.71円
1 イスラエルシェケル=30.64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
(A) 資産	円
コール・ローン等	150,196,638,522
公社債(評価額)	1,606,933,871
未収入金	147,177,380,764
未収利息	310,865,338
前払費用	978,667,015
(B) 負債	122,791,534
未払金	886,399,564
未払解約金	874,057,047
未払利息	12,342,455
(C) 純資産総額(A-B)	62
元本	149,310,238,958
次期繰越損益金	70,021,031,430
(D) 受益権総口数	79,289,207,528
1万口当たり純資産額(C/D)	21,324円

<注記事項>

- ①期首元本額 67,295,786,020円
 期中追加設定元本額 16,311,803,664円
 期中一部解約元本額 13,586,558,254円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,1324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)

MU AM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	26,414,882,933円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	10,200,387,984円
e MAX I S 先進国債券インデックス	5,122,242,114円
e MAX I S S l i m 先進国債券インデックス	4,324,032,523円
e MAX I S S l i m バランス(8資産均等型)	2,779,451,871円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	2,640,109,093円
三菱UFJ バランスファンド4OVA(適格機関投資家限定)	2,239,490,397円
三菱UFJ バランスファンド2OVA(適格機関投資家限定)	2,047,844,821円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,961,147,101円
海外債券セレクション(ラップ向け)	1,612,485,673円
e MAX I S バランス(8資産均等型)	1,607,967,471円
外国債券インデックスファンドi(適格機関投資家限定)	1,547,760,325円
三菱UFJ バランスファンドVA 4O型(適格機関投資家限定)	1,474,962,155円
つみたて8資産均等バランス	1,122,245,178円
ファンド・マネジャー(海外債券)	932,502,192円
三菱UFJ バランスファンドVA 5O型(適格機関投資家限定)	634,889,113円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型)	527,920,565円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(成長型)	389,643,524円
つみたて4資産均等バランス	320,391,297円
e MAX I S バランス(4資産均等型)	254,438,953円
e MAX I S 最適化バランス(マイゴールキーパー)	246,002,409円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定型)	212,749,942円
e MAX I S バランス(波乗り型)	204,923,110円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)	139,293,594円
アドバンスト・バランスII(FOF用)(適格機関投資家限定)	136,358,854円

○損益の状況 (2019年5月14日~2020年5月12日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取利息	3,210,854,000
その他収益金	3,211,621,552
支払利息	10,773
(B) 有価証券売買損益	△ 778,325
売買益	3,077,906,571
売買損	10,426,914,791
(C) 保管費用等	△ 7,349,008,220
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 16,592,181
(E) 前期繰越損益金	6,272,168,390
(F) 追加信託差損益金	70,065,888,298
(G) 解約差損益金	18,186,103,890
(H) 計(D+E+F+G)	△15,234,953,050
次期繰越損益金(H)	79,289,207,528
	79,289,207,528

(注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換算によるものを含みます。

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

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

e MAX I S 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	120,739,411円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	110,224,076円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	104,661,150円
e MAX I S 最適化バランス (マイディフェンダー)	103,150,429円
アドバンスト・バランスI (F O F s用) (適格機関投資家限定)	100,614,309円
三菱UF J バランスVA60G (適格機関投資家限定)	48,020,053円
三菱UF J 外国債券インデックスファンドVA	42,361,257円
三菱UF J バランスVA60D (適格機関投資家限定)	42,179,647円
三菱UF J バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	39,539,015円
三菱UF J バランスVA30G (適格機関投資家限定)	31,615,729円
三菱UF J DC年金インデックス (先進国債券)	31,018,793円
三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	23,572,599円
三菱UF J バランスVA30D (適格機関投資家限定)	22,213,126円
e MAX I S 最適化バランス (マイフォワード)	18,294,746円
三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	17,141,039円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	16,600,604円
三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	9,597,890円
三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	7,735,425円
e MAX I S 最適化バランス (マイストライカー)	7,730,040円
三菱UF J バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	6,341,987円
三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	4,392,572円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	4,053,511円
三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	2,528,547円
三菱UF J バランスファンドVA30型 (適格機関投資家限定)	2,528,431円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	2,322,536円
三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	2,195,263円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,638,542円
コアバランス	1,570,604円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1,312,036円
e MAX I S マイマネージャー 1970s	679,371円
e MAX I S マイマネージャー 1980s	295,303円
e MAX I S マイマネージャー 1990s	40,197円
合計	70,021,031,430円

新興国債券インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2021年1月26日

[計算期間：2020年1月28日～2021年1月26日]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月26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	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て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て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)		債組入比率	債先物比率	純資産額
		期騰落	中率			
7期(2017年1月26日)	円 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
11期(2021年1月26日)	13,819	△ 4.2	32,923.96	△ 3.7	97.6	— 37,779

(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		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 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2020年1月27日	円 14,424	% —	34,193.00	% —	% 97.4
1月末	14,295	△ 0.9	33,847.00	△ 1.0	96.8
2月末	14,027	△ 2.8	33,243.73	△ 2.8	97.1
3月末	12,126	△15.9	28,753.19	△15.9	94.8
4月末	12,368	△14.3	29,315.06	△14.3	94.7
5月末	13,151	△ 8.8	31,237.36	△ 8.6	96.4
6月末	13,296	△ 7.8	31,553.01	△ 7.7	95.6
7月末	13,296	△ 7.8	31,502.50	△ 7.9	96.2
8月末	13,321	△ 7.6	31,592.84	△ 7.6	97.3
9月末	13,005	△ 9.8	30,913.68	△ 9.6	96.9
10月末	12,969	△10.1	30,873.65	△ 9.7	97.0
11月末	13,630	△ 5.5	32,444.02	△ 5.1	96.3
12月末	13,999	△ 2.9	33,305.11	△ 2.6	96.7
(期 末) 2021年1月26日	13,819	△ 4.2	32,923.96	△ 3.7	97.6

(注) 謄落率は期首比。

(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

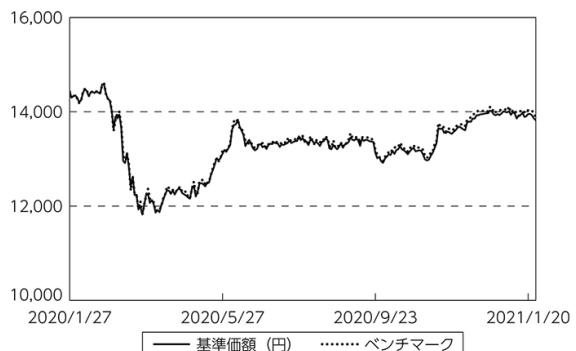
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.2%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率(△3.7%)を0.5%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

◎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、新型コロナウイルスの感染拡大とともに大きな影響が警戒されるなど、市場参加者のリスク回避姿勢が強まり下落しましたが、その後は各国での金融および財政支援策等を受け、経済回復期待や投資家心理の改善等を背景に上昇し、期を通じてみると上昇しました。

◎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。

●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-MEM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3.7%の下落になったため、カイ離は△0.5%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ありません。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(2020年1月28日～2021年1月26日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他の費用	円 14	% 0.108	(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)	(11)	(0.084)	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)	(3)	(0.024)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	14	0.108	
期中の平均基準価額は、13,314円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(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おります。

○売買及び取引の状況

(2020年1月28日～2021年1月26日)

公社債

			買付額	売付額
外 国	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 312,143	千メキシコペソ 192,395
	ブラジル	国債証券	千ブラジルレアル 86,266	千ブラジルレアル 43,037
	チリ	国債証券	千チリペソ 2,467,606	千チリペソ 1,277,777
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 13,517,357	千コロンビアペソ 3,476,148
	ペルー	国債証券	千ペルーヌエボソル 4,330	千ペルーヌエボソル 2,642
	トルコ	国債証券	千トルコリラ 6,877	千トルコリラ 16,268
	チェコ	国債証券	千チェコクロナ 383,348	千チェコクロナ 323,943
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント 1,972,273	千ハンガリーフォリント 752,867
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 40,130	千ポーランドズロチ 28,339
	ロシア	国債証券	千ロシアルーブル 814,462	千ロシアルーブル 366,986
	ルーマニア	国債証券	千ルーマニアレイ 21,956	千ルーマニアレイ 10,724
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 44,271	千マレーシアリンギット 14,765
	タイ	国債証券	千タイバーツ 316,672	千タイバーツ 163,267
	インドネシア	国債証券	千インドネシアルピア 155,113,165	千インドネシアルピア 84,049,849
	中国	国債証券	千中国元 240,401	千中国元 —
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 125,555	千南アフリカランド 83,406

(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

(2020年1月28日～2021年1月26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	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 1,194	百万円 268	% 22.4	百万円 1,188	百万円 291	% 24.5
為替直物取引	20,352	4,411	21.7	12,151	2,733	22.5

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、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2021年1月26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
メキシコ	千メキシコペソ 600,100	千メキシコペソ 682,291	千円 3,520,626	% 9.3	% —	% 5.6	% 2.9	% 0.8
ブラジル	千ブラジルレアル 153,870	千ブラジルレアル 154,431	千円 2,931,115	% 7.8	% 7.8	% 1.8	% 3.9	% 2.0
チリ	千チリペソ 6,080,000	千チリペソ 7,148,730	千円 1,012,260	% 2.7	% —	% 1.8	% 0.9	% —
コロンビア	千コロンビアペソ 60,580,000	千コロンビアペソ 68,040,329	千円 1,966,365	% 5.2	% —	% 3.3	% 1.4	% 0.5
ペルー	千ペルーヌエボソル 28,700	千ペルーヌエボソル 34,927	千円 994,374	% 2.6	% —	% 2.5	% 0.1	% —
ウルグアイ	千ウルグアイペソ 15,200	千ウルグアイペソ 15,984	千円 39,481	% 0.1	% —	% 0.0	% —	% 0.1
ドミニカ	千ドミニカペソ 24,000	千ドミニカペソ 25,520	千円 45,681	% 0.1	% 0.1	% 0.1	% 0.0	% —
トルコ	千トルコリラ 52,600	千トルコリラ 48,717	千円 682,045	% 1.8	% 1.8	% 0.7	% 0.5	% 0.6
チエコ	千チェコクロナ 304,100	千チェコクロナ 297,056	千円 1,428,839	% 3.8	% —	% 2.8	% 1.0	% —
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 3,808,000	千ハンガリーフォリント 4,222,652	千円 1,486,373	% 3.9	% —	% 2.1	% 1.6	% 0.2
ポーランド	千ポーランドズロチ 99,750	千ポーランドズロチ 109,687	千円 3,041,635	% 8.1	% —	% 3.5	% 2.8	% 1.8
ロシア	千ロシアルーブル 1,808,100	千ロシアルーブル 1,938,846	千円 2,675,608	% 7.1	% —	% 4.4	% 1.8	% 0.9
ルーマニア	千ルーマニアレイ 40,460	千ルーマニアレイ 44,102	千円 1,139,172	% 3.0	% —	% 1.0	% 1.5	% 0.5
マレーシア	千マレーシアリンギット 93,340	千マレーシアリンギット 100,603	千円 2,581,496	% 6.8	% —	% 3.9	% 2.5	% 0.5
タイ	千タイバーツ 828,400	千タイバーツ 945,876	千円 3,272,732	% 8.7	% —	% 5.5	% 2.3	% 0.8
フィリピン	千フィリピンペソ 20,000	千フィリピンペソ 25,869	千円 55,877	% 0.1	% —	% 0.1	% —	% —
インドネシア	千インドネシアルピア 437,130,000	千インドネシアルピア 472,319,067	千円 3,495,161	% 9.3	% —	% 6.7	% 2.2	% 0.4
中国	千中国元 239,200	千中国元 238,138	千円 3,812,600	% 10.1	% —	% 5.4	% 4.6	% —

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
南アフリカ	千南アフリカランド 434,600	千南アフリカランド 394,348	千円 2,681,569	% 7.1	% 7.1	% 6.7	% 0.4	% —
合計	—	—	36,863,016	97.6	16.8	58.0	30.5	9.0

(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) 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	利 率	額面金額	当 期 末			償還年月日	
			評 価 額				
			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	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	56,700	67,875	350,237	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	14,700	20,420	105,371	2036/11/20	
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	62,200	65,180	336,332	2026/3/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	56,200	57,906	298,796	2022/6/9	
	6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	35,000	36,781	189,794	2023/3/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	59,700	68,070	351,243	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	24,300	28,417	146,636	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	32,400	37,946	195,805	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	41,900	47,614	245,692	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	63,300	69,547	358,862	2023/12/7	
	8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	33,000	36,962	190,725	2024/9/5	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	30,300	35,239	181,837	2047/11/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	55,000	66,960	345,517	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	35,400	43,366	223,772	2038/11/18	
小計					3,520,626		
ブラジル		千ブラジルリアル	千ブラジルリアル				
国債証券	10 (IN) BRAZIL NT 270101	10.0	18,320	20,758	393,994	2027/1/1	
	10 (IN) BRAZIL NTN 250101	10.0	26,850	30,097	571,252	2025/1/1	
	10 (IN) BRAZIL NTN 310101	10.0	2,300	2,615	49,642	2031/1/1	
	10(IN) BRAZIL NTN 290101	10.0	10,800	12,293	233,331	2029/1/1	
	10(IN) BRAZIL NTN-F230101	10.0	26,600	29,005	550,520	2023/1/1	
	BRAZIL-LTN 220701	—	12,000	11,268	213,881	2022/7/1	
	BRAZIL-LTN 230701	—	24,900	21,639	410,712	2023/7/1	
	BRAZIL-LTN 240101	—	32,100	26,753	507,778	2024/1/1	
小計					2,931,115		
チリ		千チリペソ	千チリペソ				
国債証券	2.5 BONOS TESORER 250301	2.5	1,640,000	1,740,778	246,494	2025/3/1	
	4 BONOS TESORERIA 230301	4.0	490,000	534,075	75,625	2023/3/1	
	4.5 BONOS TESORER 260301	4.5	1,000,000	1,163,750	164,787	2026/3/1	
	4.7 BONOS TESORER 300901	4.7	960,000	1,149,936	162,830	2030/9/1	
	5 BONOS TESORERIA 350301	5.0	1,100,000	1,345,919	190,582	2035/3/1	
	6 BONOS TESORERIA 430101	6.0	890,000	1,214,271	171,940	2043/1/1	
小計					1,012,260		
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	8,900,000	10,855,133	313,713	2024/7/24	
	4.375 COLOMBI (GL) 230321	4.375	1,680,000	1,720,033	49,708	2023/3/21	
	6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	8,180,000	8,722,405	252,077	2028/4/28	
	6.25 TITULOS DE T 251126	6.25	5,690,000	6,269,400	181,185	2025/11/26	
	7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	6,210,000	6,589,324	190,431	2022/5/4	
	7 TITULOS DE TESO 320630	7.0	6,000,000	6,541,210	189,040	2032/6/30	
	7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	6,100,000	6,749,168	195,050	2034/10/18	
	7.25 TITULOS DE T 501026	7.25	3,000,000	3,206,991	92,682	2050/10/26	
	7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	7,770,000	9,012,945	260,474	2026/8/26	
	7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	5,760,000	6,700,794	193,652	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	1,672,923	48,347	
小	計				1,966,365	2027/6/28	
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	5.35 PERU 400812 5.4 PERU 340812 5.7 PERU 240812 5.94 PERU 290212 6.15 PERU 320812 6.35 PERU 280812 6.9 PERU 370812 6.95 PERU 310812 8.2 PERU 260812	5.35 5.4 5.7 5.94 6.15 6.35 6.9 6.95 8.2	2,100 1,900 1,300 4,700 2,800 3,900 4,200 5,300 2,500	2,150 2,077 1,512 5,727 3,359 4,857 5,112 6,778 3,351	61,210 59,132 43,055 163,066 95,638 138,303 145,543 192,992 95,431	2040/8/12 2034/8/12 2024/8/12 2029/2/12 2032/8/12 2028/8/12 2037/8/12 2031/8/12 2026/8/12
小	計				994,374		
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 9.875 URUGUAY(GL) 220620	8.5 9.875	7,000 8,200	7,419 8,564	18,326 21,155	
小	計				39,481		
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 9.75 DOMINICAN 260605	8.9 9.75	8,000 16,000	8,264 17,256	14,793 30,888	
小	計				45,681		
トルコ			千トルコリラ	千トルコリラ			
	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 240320 10.5 TURKEY GOVT 270811 10.6 TURKEY GOVT 260211 10.7 TURKEY GOVT 220817 11 TURKEY GOVT 220302 11 TURKEY GOVT 270224 12.2 TURKEY GOVT 230118 12.4 TURKEY GOVT 280308 16.2 TURKEY GOVT 230614 7.1 TURKEY GOVT 230308 8 TURKEY GOVT 250312 8.5 TURKEY GOVT 220914 9 TURKEY GOVT 240724	10.4 10.5 10.6 10.7 11.0 11.0 12.2 12.4 16.2 7.1 8.0 8.5 9.0	2,400 5,200 6,200 4,400 4,400 4,500 5,600 4,100 1,300 3,400 4,000 3,400 3,700	2,221 4,667 5,654 4,199 4,241 4,126 5,469 4,015 1,363 2,996 3,356 3,138 3,267	31,096 65,338 79,161 58,797 59,382 57,771 76,577 56,223 19,091 41,947 46,984 43,934 45,739	2024/3/20 2027/8/11 2026/2/11 2022/8/17 2022/3/2 2027/2/24 2023/1/18 2028/3/8 2023/6/14 2023/3/8 2025/3/12 2022/9/14 2024/7/24
小	計				682,045		
チェコ			千チェコクロナ	千チェコクロナ			
	国債証券	0.25 CZECH REPUBL 270210 0.45 CZECH REPUBL 231025 0.95 CZECH REPUBL 300515	0.25 0.45 0.95	101,600 80,500 122,000	97,343 80,622 119,090	468,223 387,792 572,824	
小	計				1,428,839		
ハンガリー			千ハンガリーフォント	千ハンガリーフォント			
	国債証券	1.5 HUNGARY 230823 2.5 HUNGARY 241024 2.75 HUNGARY 261222	1.5 2.5 2.75	250,000 210,000 733,000	254,629 221,371 784,561	89,629 77,922 276,165	
					2023/8/23 2024/10/24 2026/12/22		

銘 柄		当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ハンガリー		%	千ハンガリーフォント	千ハンガリーフォント	千円		
国債証券	3 HUNGARY 240626	3.0	384,000	410,534	144,508	2024/ 6/26	
	3 HUNGARY 271027	3.0	421,000	459,637	161,792	2027/10/27	
	3 HUNGARY 300821	3.0	260,000	284,064	99,990	2030/ 8/21	
	3 HUNGARY 381027	3.0	120,000	130,200	45,830	2038/10/27	
	3.25 HUNGARY 311022	3.25	338,000	378,187	133,121	2031/10/22	
	5.5 HUNGARY 250624	5.5	412,000	488,812	172,061	2025/ 6/24	
	6 HUNGARY 231124	6.0	333,000	382,117	134,505	2023/11/24	
	6.75 HUNGARY 281022	6.75	182,000	248,430	87,447	2028/10/22	
	7 HUNGARY 220624	7.0	165,000	180,105	63,397	2022/ 6/24	
小 計					1,486,373		
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	2.25 POLAND 220425	2.25	7,300	7,512	208,319	2022/ 4/25	
	2.25 POLAND 241025	2.25	9,500	10,225	283,560	2024/10/25	
	2.5 POLAND 230125	2.5	9,100	9,549	264,803	2023/ 1/25	
	2.5 POLAND 240425	2.5	8,900	9,584	265,777	2024/ 4/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	14,500	16,052	445,141	2026/ 7/25	
	2.5 POLAND 270725	2.5	8,100	9,025	250,277	2027/ 7/25	
	2.75 POLAND 280425	2.75	9,150	10,442	289,581	2028/ 4/25	
	2.75 POLAND 291025	2.75	10,800	12,369	343,011	2029/10/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	9,100	10,262	284,584	2025/ 7/25	
	4 POLAND 231025	4.0	6,800	7,538	209,048	2023/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	6,500	7,123	197,528	2022/ 9/23	
小 計					3,041,635		
ロシア			千ロシアルーブル	千ロシアルーブル			
国債証券	4.5 RUSSIA OFZ 250716	4.5	38,000	36,379	50,204	2025/ 7/16	
	6 RUSSIA OFZ 271006	6.0	108,900	109,268	150,791	2027/10/ 6	
	6.5 RUSSIA OFZ 240228	6.5	90,000	93,290	128,740	2024/ 2/28	
	6.9 RUSSIA OFZ 290523	6.9	92,200	97,084	133,976	2029/ 5/23	
	7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	44,500	46,511	64,185	2023/ 1/25	
	7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	62,000	65,017	89,724	2023/ 8/16	
	7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	125,700	133,562	184,316	2028/ 1/19	
	7.1 RUSSIA OFZ 241016	7.1	106,400	112,722	155,556	2024/10/16	
	7.15 RUSSIA OFZ 251112	7.15	88,500	94,149	129,926	2025/11/12	
	7.25 RUSSIA OFZ 340510	7.25	83,300	88,340	121,909	2034/ 5/10	
	7.4 RUSSIA OFZ 221207	7.4	86,700	91,166	125,809	2022/12/ 7	
	7.4 RUSSIA OFZ 240717	7.4	98,000	104,691	144,474	2024/ 7/17	
	7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	98,000	102,507	141,459	2022/ 7/20	
	7.65 RUSSIA OFZ 300410	7.65	97,000	106,988	147,643	2030/ 4/10	
	7.7 RUSSIA OFZ 330323	7.7	95,700	105,461	145,536	2033/ 3/23	
	7.7 RUSSIA OFZ 390316	7.7	85,800	94,852	130,896	2039/ 3/16	
	7.75 RUSSIA OFZ 260916	7.75	107,600	117,929	162,742	2026/ 9/16	
	7.95 RUSSIA OFZ 261007	7.95	101,100	111,579	153,979	2026/10/ 7	
	8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	111,000	124,381	171,646	2027/ 2/ 3	
	8.5 RUSSIA OFZ 310917	8.5	87,700	102,960	142,085	2031/ 9/17	
小 計					2,675,608		

銘 柄		当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ルーマニア		%	千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ	千円		
国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 240429	3.25	4,400	4,561	117,821	2024/4/29	
	3.4 ROMANIA GOVER 220308	3.4	2,900	2,948	76,168	2022/3/8	
	3.5 ROMANIA GOVER 221219	3.5	3,800	3,909	100,970	2022/12/19	
	3.65 ROMANIA GOVE 310924	3.65	3,300	3,520	90,939	2031/9/24	
	4.25 ROMANIA GOVE 230628	4.25	4,200	4,416	114,072	2023/6/28	
	4.5 ROMANIA GOVER 240617	4.5	3,300	3,557	91,878	2024/6/17	
	4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	5,700	6,272	162,015	2025/2/24	
	5 ROMANIA GOVERN 290212	5.0	4,560	5,352	138,252	2029/2/12	
	5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	4,800	5,772	149,116	2027/7/26	
	5.85 ROMANIA GOVE 230426	5.85	3,500	3,791	97,937	2023/4/26	
小 計					1,139,172		
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	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	5,900	6,404	164,332	2028/6/15	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	12,100	12,663	324,947	2023/8/17	
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	6,570	6,929	177,809	2034/7/5	
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	6,300	6,866	176,197	2029/8/15	
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	11,700	12,763	327,510	2027/11/16	
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	10,720	11,695	300,095	2026/11/30	
	3.948 MALAYSIA IN 220414	3.948	7,300	7,491	192,228	2022/4/14	
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	9,000	9,735	249,805	2025/9/15	
	4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	6,700	7,179	184,224	2024/9/30	
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	6,350	6,809	174,729	2024/7/15	
	4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	7,200	8,051	206,606	2028/10/31	
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	3,500	4,014	103,009	2037/4/7	
小 計					2,581,496		
タイ			千タイバーツ	千タイバーツ			
国債証券	1.45 THAILAND 241217	1.45	49,700	51,324	177,583	2024/12/17	
	1.6 THAILAND 291217	1.6	42,100	43,599	150,855	2029/12/17	
	1.6 THAILAND 350617	1.6	20,000	20,295	70,222	2035/6/17	
	1.875 THAILAND 220617	1.875	44,000	44,885	155,302	2022/6/17	
	2 THAILAND 221217	2.0	42,300	43,550	150,683	2022/12/17	
	2.125 THAILAND 261217	2.125	63,400	68,390	236,632	2026/12/17	
	2.4 THAILAND 231217	2.4	51,600	54,416	188,282	2023/12/17	
	2.875 THAILAND 281217	2.875	48,800	55,416	191,740	2028/12/17	
	2.875 THAILAND 460617	2.875	49,200	58,735	203,223	2046/6/17	
	3.3 THAILAND 380617	3.3	46,500	57,380	198,538	2038/6/17	
	3.4 THAILAND 360617	3.4	62,000	76,851	265,906	2036/6/17	
	3.625 THAILAND 230616	3.625	47,900	51,483	178,131	2023/6/16	
	3.65 THAILAND 310620	3.65	54,600	67,153	232,351	2031/6/20	
	3.775 THAILAND 320625	3.775	67,700	84,692	293,035	2032/6/25	
	3.85 THAILAND 251212	3.85	83,800	96,486	333,844	2025/12/12	
	4.875 THAILAND 290622	4.875	54,800	71,213	246,397	2029/6/22	
小 計					3,272,732		

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	
フィリピン		%	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ	千円	
	国債証券	6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	20,000	25,869	55,877
小	計				55,877	2036/1/14
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	9,081,387	67,202
		11 INDONESIA 250915	11.0	3,250,000	3,967,437	29,359
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	34,200,000	34,989,336	258,921
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	39,500,000	39,453,390	291,955
		6.5 INDONESIA 250615	6.5	33,200,000	34,600,376	256,042
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	34,400,000	34,646,304	256,382
		7 INDONESIA 220515	7.0	19,450,000	20,115,190	148,852
		7 INDONESIA 270515	7.0	23,450,000	24,768,124	183,284
		7 INDONESIA 300915	7.0	23,800,000	24,983,812	184,880
		7.5 INDONESIA 320815	7.5	10,900,000	11,547,569	85,452
		7.5 INDONESIA 380515	7.5	17,100,000	17,894,979	132,422
		8.25 INDONESIA 290515	8.25	9,500,000	10,709,350	79,249
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	8,800,000	9,861,016	72,971
		8.25 INDONESIA 360515	8.25	20,000,000	22,417,600	165,890
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	33,800,000	36,904,192	273,091
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	27,930,000	31,497,219	233,079
		8.375 INDONESIA 340315	8.375	30,700,000	34,725,691	256,970
		8.375 INDONESIA 390415	8.375	18,700,000	21,365,124	158,101
		8.75 INDONESIA 310515	8.75	15,400,000	17,943,310	132,780
		9 INDONESIA 290315	9.0	15,500,000	18,112,525	134,032
		9.5 INDONESIA 310715	9.5	10,500,000	12,735,135	94,239
小	計				3,495,161	
中国			千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	24,000	23,081	369,538
		2.36 CHINA GOVT 230702	2.36	11,000	10,885	174,279
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	25,000	23,988	384,055
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	19,000	18,719	299,704
		2.88 CHINA GOVT 231105	2.88	16,000	16,047	256,919
		2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	16,000	16,027	256,607
		3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	12,000	12,102	193,760
		3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	22,000	21,953	351,471
		3.19 CHINA GOVT 240411	3.19	13,000	13,149	210,524
		3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	22,000	22,262	356,429
		3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	14,200	14,434	231,099
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	10,000	10,075	161,310
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	11,000	11,097	177,678
		3.29 CHINA GOVT 231018	3.29	8,000	8,130	130,166
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	16,000	16,180	259,056
小	計				3,812,600	
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	71,900	85,129	578,881
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	22,400	15,399	104,714
					2036/3/31	

銘 柄		当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
				外貨建金額	
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	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	22,300	14,570	99,076 2041/2/28
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	20,500	17,519	119,131 2031/2/28
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	18,300	19,464	132,361 2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	50,800	48,376	328,958 2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	34,000	30,677	208,609 2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	34,300	28,438	193,379 2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	35,000	28,710	195,230 2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	59,100	48,606	330,522 2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRICA 350228	8.875	40,400	35,621	242,226 2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	25,600	21,834	148,477 2040/1/31
小 合	計				2,681,569
	合				36,863,016

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

○投資信託財産の構成

(2021年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 36,863,016	% 97.5
コール・ローン等、その他	944,801	2.5
投資信託財産総額	37,807,817	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(37,764,052千円)の投資信託財産総額(37,807,817千円)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=103.77円	1 アルゼンチンペソ=1.19円	1 メキシコペソ=5.16円	1 ブラジルレアル=18.98円
100 チリペソ=14.16円	100 コロンビアペソ=2.89円	1 ベルヌエボソル=28.47円	1 ウルグアイペソ=2.47円
1 ドミニカペソ=1.79円	1 トルコリラ=14.00円	1 チェコクロナ=4.81円	100 ハンガリーフォリント=35.20円
1 ポーランドズロチ=27.73円	1 ロシアルーブル=1.38円	1 ルーマニアレイ=25.83円	1 マレーシアリンギット=25.66円
1 タイバーツ=3.46円	1 フィリピンペソ=2.16円	100 インドネシアルピア=0.74円	1 中国元=16.01円
1 南アフリカランド=6.80円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月26日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	37,872,308,263
公社債(評価額)	442,118,454
未収入金	36,863,016,418
未収利息	64,491,700
前払費用	466,392,142
(B) 負債	36,289,549
未払金	92,671,911
未払解約金	88,465,126
未払利息	4,206,781
(C) 純資産総額(A-B)	4
元本	37,779,636,352
次期繰越損益金	27,338,600,598
(D) 受益権総口数	10,441,035,754
1万口当たり純資産額(C/D)	27,338,600,598円
	13,819円

<注記事項>

- ①期首元本額 21,159,314,350円
 期中追加設定元本額 7,957,478,368円
 期中一部解約元本額 1,778,192,120円
 また、1口当たり純資産額は、期末1,3819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 DCC新興国債券インデックスファンド	8,289,038,543円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	6,701,099,641円
eMAXIS 新興国債券インデックス	4,369,267,511円
つみたて8資産均等バランス	3,083,076,433円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	2,920,955,754円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	733,924,793円
eMAXIS バランス (波乗り型)	349,165,960円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	276,608,799円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	237,931,636円
海外債券セレクション (ラップ向け)	213,938,524円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	63,828,067円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	48,189,414円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	25,141,369円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	10,364,781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
新興国債券インデックスファンド (ラップ向け)	4,094,625円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,540,970円
コアバランス	1,499,789円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	820,167円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	250,590円
合計	27,338,600,598円

○損益の状況 (2020年1月28日～2021年1月26日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取利息	1,680,664,935
その他収益金	1,680,646,366
支払利息	93,520
(B) 有価証券売買損益	△ 74,951
売買益	△ 2,569,409,798
売買損	1,074,665,905
(C) 保管費用等	△ 3,644,075,703
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 34,941,672
(E) 前期繰越損益金	△ 923,686,535
(F) 追加信託差損益金	9,360,886,858
(G) 解約差損益金	2,520,072,061
(H) 計(D+E+F+G)	△ 516,236,630
次期繰越損益金(H)	10,441,035,754
	10,441,035,754

(注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換算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12期》決算日2021年1月26日

[計算期間：2020年1月28日～2021年1月26日]

「東証REIT指数マザーファンド」は、1月26日に第12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12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)		投資信託組入比率	不動産投信比率	純資産額
		期騰落	中率			
8期(2017年1月26日)	円 27,236	% 13.6	% 3,399.04	% 13.4	% 97.9	% 2.3 百万円 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
12期(2021年1月26日)	31,049	△14.8	3,872.69	△14.6	98.0	2.0 42,741

(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REIT指数		投 資 信 託 組 入 比	不 動 産 指 数 率
		騰 落 率	(配当込み)		
(期首) 2020年1月27日	円 36,432	% —	4,533.90	% —	% 98.4
1月末	37,036	1.7	4,608.85	1.7	98.6
2月末	33,901	△6.9	4,218.40	△7.0	98.3
3月末	26,800	△26.4	3,343.59	△26.3	97.1
4月末	26,558	△27.1	3,313.25	△26.9	98.2
5月末	28,744	△21.1	3,586.37	△20.9	98.6
6月末	28,256	△22.4	3,525.99	△22.2	98.6
7月末	28,332	△22.2	3,535.10	△22.0	98.1
8月末	29,936	△17.8	3,735.15	△17.6	96.9
9月末	29,645	△18.6	3,698.94	△18.4	97.3
10月末	28,159	△22.7	3,512.43	△22.5	98.0
11月末	29,147	△20.0	3,635.82	△19.8	98.1
12月末	30,903	△15.2	3,854.76	△15.0	98.3
(期末) 2021年1月26日	31,049	△14.8	3,872.69	△14.6	98.0
					2.0

(注) 謄落率は期首比。

(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

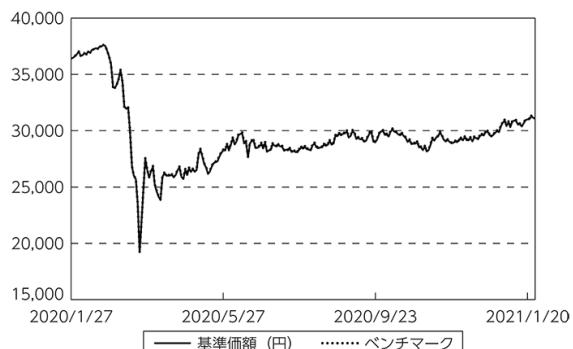
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.8%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率（-14.6%）を0.2%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
◎国内REIT市況

- ・国内REIT市況は下落しました。
- ・新型コロナウイルスの世界的流行を受け、国内REIT市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
・資産のほぼ全額を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14.6%の下落となったため、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。
※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

(2020年1月28日～2021年1月26日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (投資信託証券) (先物・オプション)	円 2 (0) (1)	% 0.005 (0.001) (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
合計	2	0.005	
期中の平均基準価額は、29,458円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(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おります。

○売買及び取引の状況

(2020年1月28日～2021年1月26日)

投資信託証券

銘柄	買付		売付		
	口数	金額	口数	金額	
国内	エスコンジャパンリート投資法人	千口 0.484 (0.014)	千円 50,863 (1,920)	千口 0.103	千円 10,937
	サンケイリアルエステート投資法人	0.755	70,694	0.136	14,141
	S O S i L A 物流リート投資法人	1 (0.057)	155,737 (6,737)	0.182	22,136
	日本アコモデーションファンド投資法人	0.748	442,907	0.273	171,947
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	2	208,456	1	110,037
	森ビルズリート投資法人	2	339,658	0.946	142,707
	産業ファンド投資法人	3	537,295	1	175,503
	アドバンス・レジデンス投資法人	1	597,806	0.774	244,223
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1	242,841	0.499	88,317
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	391,847	0.414	174,932
	G L P 投資法人	7	1,176,229	2	291,647
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.937 (0.009)	280,981 (3,180)	0.339	106,903
	日本プロロジスリート投資法人	3	1,022,600	1	358,848
	星野リゾート・リート投資法人	0.32	136,182	0.127	56,342
	O n e リート投資法人	0.325	80,476	0.127	35,260
	イオンリート投資法人	2	244,419	1	130,585
	ヒューリックリート投資法人	1	233,056	0.862	126,009
	日本リート投資法人	0.676	227,788	0.264	101,527
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	13	195,819	5	90,430
	日本ヘルスケア投資法人	0.031 (△ 0.16)	5,415 (△ 33,195)	0.021	4,179
	積水ハウス・リート投資法人	6	426,970	2	178,227
	トーセイ・リート投資法人	0.469	48,449	0.178	19,700
	ケネディクス商業リート投資法人	0.791	152,381	0.382	78,387
	ヘルスケア&メディカル投資法人	0.448	52,093	0.177	21,293
	サムティ・レジデンシャル投資法人	0.416	39,275	0.196	18,889
	野村不動産マスターファンド投資法人	6	888,971	2	394,247
	いちごホテルリート投資法人	0.384	25,398	0.134	10,396
	ラサールロジポート投資法人	2 (0.304)	384,581 (53,709)	0.757	119,194
	スターアジア不動産投資法人	1 (2)	73,079 (72,326)	0.489	31,953
	マリモ地方創生リート投資法人	0.203	20,214	0.099	10,228
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.958 (0.03)	461,999 (15,823)	0.227	108,247
	大江戸温泉リート投資法人	0.348	22,188	0.17	11,247
	さくら総合リート投資法人	0.288 (△ 0.82)	20,835 (△ 72,326)	0.138	10,931
	投資法人みらい	2	90,163	1	47,051
	森トラスト・ホテルリート投資法人	0.48	47,274	0.261	26,917
	三菱地所物流リート投資法人	0.512 (0.021)	197,171 (9,065)	0.16	60,618
	C R E ロジスティクスファンド投資法人	0.981	144,851	0.167	23,222
	ザイマックス・リート投資法人	0.337	30,958	0.118	12,029

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
タカラレーベン不動産投資法人	千口 0.664	千円 56,902	千口 0.231	千円 21,927
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1 (0.044)	187,618 (5,532)	0.185	22,900
日本ビルファンド投資法人	2	1,674,468	0.794	571,681
ジャパンリアルエステイト投資法人	2	1,236,071	0.821	537,787
日本リテールファンド投資法人	3	587,322	1	270,562
オリックス不動産投資法人	4	632,912	1	286,838
日本プライムリアルティ投資法人	1	466,398	0.648	229,938
プレミア投資法人	1	216,591	0.743	94,512
東急リアル・エステート投資法人	1	200,011	0.549	88,422
グローバル・ワン不動産投資法人	1	142,198	0.572	62,740
ユナイテッド・アーバン投資法人	4	547,423	2	292,340
森トラスト総合リート投資法人	1	198,091	0.589	89,197
インヴィンシブル投資法人	9	273,376	4	142,839
フロンティア不動産投資法人	0.722	243,728	0.373	130,083
平和不動産リート投資法人	1	137,266	0.551	64,218
日本ロジスティクスファンド投資法人	1	358,538	0.536	144,159
福岡リート投資法人	1	134,657	0.427	59,248
ケネディクス・オフィス投資法人	0.644	390,921	0.252	171,260
いちごオフィスリート投資法人	1	136,493	0.635	53,966
大和証券オフィス投資法人	0.47	284,961	0.254	166,716
阪急阪神リート投資法人	0.943	114,894	0.37	50,372
スターツプロシード投資法人	0.324	61,150	0.127	24,399
大和ハウスリート投資法人	2 (0.066)	757,194 (18,722)	1	269,946
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6	302,129	2	133,986
大和証券リビング投資法人	2 (0.328)	268,212 (33,195)	0.953	92,537
ジャパンエクセルント投資法人	1	239,850	0.751	109,274
エスコンジャパンリート投資法人(新)	— (△ 0.014)	— (△ 1,920)	—	—
S O S i L A 物流リート(新)	0.057 (△ 0.057)	6,737 (△ 6,737)	—	—
コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)	0.011 (△ 0.009)	3,108 (△ 3,180)	—	—
ラサールロジポート投資法人(新)	0.304 (△ 0.304)	53,709 (△ 53,709)	—	—
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人(新)	— (△ 0.03)	— (△ 15,823)	—	—
三菱地所物流リート投資法人(新)	0.021 (△ 0.021)	9,065 (△ 9,065)	—	—
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人(新)	— (△ 0.044)	— (△ 5,532)	—	—
大和ハウスリート投資法人(新)	0.066 (△ 0.066)	18,722 (△ 18,722)	—	—
合計	132 (2)	19,708,673 (—)	50	7,821,264

(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
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 13,851	百万円 13,423	百万円 149	百万円 152

○利害関係人との取引状況等

(2020年1月28日～2021年1月26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	%	
投資信託証券	19,708	7,595	38.5	7,821	3,853	49.3	
不動産投信指数先物取引	14,004	11,154	79.6	13,572	10,223	75.3	

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	買付額
投資信託証券	百万円 732

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)	1,890千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,086千円
(B) / (A)	57.5%

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モルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2021年1月26日現在)

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		比率
	口数	千口	口数	千円	
エスコンジャパンリート投資法人	0.318	0.318	0.713	88,198	0.2
サンケイリアルエステート投資法人	0.449	0.449	1	107,974	0.3
SOSiLA物流リート投資法人	—	—	1	144,751	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人	1	1	1	834,720	2.0
MCUBS MiddCity投資法人	3	3	5	499,196	1.2
森ヒルズリート投資法人	3	3	5	754,912	1.8
産業ファンド投資法人	3	3	6	1,186,530	2.8
アドバンス・レジデンス投資法人	2	2	4	1,265,992	3.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1	1	2	517,687	1.2
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	1	2	913,748	2.1
GLP投資法人	7	7	13	2,321,870	5.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1	1	1	553,134	1.3
日本プロジスリート投資法人	4	4	6	2,195,165	5.1
星野リゾート・リート投資法人	0.471	0.471	0.664	337,976	0.8
Oneリート投資法人	0.482	0.482	0.68	177,344	0.4
イオンリート投資法人	3	3	4	604,012	1.4
ヒューリックリート投資法人	2	2	3	539,596	1.3
日本リート投資法人	1	1	1	499,492	1.2
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	19	19	28	397,199	0.9
日本ヘルスケア投資法人	0.15	0.15	—	—	—
積水ハウス・リート投資法人	9	9	12	938,092	2.2
トーセイ・リート投資法人	0.674	0.674	0.965	110,492	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	1	1	1	396,348	0.9
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.66	0.66	0.931	125,405	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.62	0.62	0.84	92,652	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人	9	9	14	2,154,444	5.0
いちごホテルリート投資法人	0.513	0.513	0.763	52,189	0.1
ラサールロジポート投資法人	2	2	4	788,616	1.8
スターアジア不動産投資法人	1	1	4	218,994	0.5
マリモ地方創生リート投資法人	0.305	0.305	0.409	45,971	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.762	0.762	1	798,052	1.9
大江戸温泉リート投資法人	0.526	0.526	0.704	48,012	0.1
さくら総合リート投資法人	0.67	0.67	—	—	—
投資法人みらい	3	3	4	188,008	0.4
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.726	0.726	0.945	108,297	0.3
三菱地所物流リート投資法人	0.609	0.609	0.982	407,530	1.0
CREロジスティクスファンド投資法人	0.582	0.582	1	212,471	0.5
ザイマックス・リート投資法人	0.449	0.449	0.668	67,601	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	0.878	0.878	1	123,627	0.3
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.478	0.478	1	223,005	0.5
日本ビルファンド投資法人	2	2	4	2,901,810	6.8
ジャパンリアルエステイト投資法人	3	3	4	2,613,437	6.1
日本リテールファンド投資法人	5	5	8	1,525,461	3.6
オリックス不動産投資法人	6	6	8	1,461,293	3.4
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	2	975,044	2.3
プレミア投資法人	2	2	3	498,930	1.2

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	千口	口数	千円	比率%
東急リアル・エステート投資法人		2	2	479,407	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人		2	3	309,666	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人		6	9	1,252,220	2.9
森トラスト総合リート投資法人		2	3	416,876	1.0
インヴィンシブル投資法人		13	18	632,154	1.5
フロンティア不動産投資法人		1	1	600,920	1.4
平和不動産リート投資法人		1	2	344,262	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人		2	2	889,512	2.1
福岡リート投資法人		1	2	352,317	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	0.958		1	870,750	2.0
いちごオフィスリート投資法人		2	3	284,170	0.7
大和証券オフィス投資法人		0.714	0.93	603,570	1.4
阪急阪神リート投資法人		1	1	252,682	0.6
スターツプロシード投資法人		0.482	0.679	132,540	0.3
大和ハウスリート投資法人		4	6	1,675,147	3.9
ジャパン・ホテル・リート投資法人		9	14	728,100	1.7
大和証券リビング投資法人		3	5	559,445	1.3
ジャパンエクセレント投資法人		2	4	500,051	1.2
エスコンジャパンリート投資法人(新)	0.014		—	—	—
コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)	0.009		0.011	3,155	0.0
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人(新)	0.03		—	—	—
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人(新)	0.044		—	—	—
合計	口数・金額	180	264	41,902,242	
	銘柄数<比率>	67	63	<98.0%>	

(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、SOSiLA物流リート投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、MCUBSMidCity投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、One REリート投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、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、サムティ・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、ラザ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、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ィート投資法人、日本リテールファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、プレミア投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、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、スターツプロシード投資法人、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、大和証券リビング投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUF G証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている2020年7月31日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容

当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

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	百万円
			867	—

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2021年1月26日現在)

区 分	当 期 末	
	数 量	口
貸付有価証券<投資証券>総口数		58,204

○投資信託財産の構成

(2021年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 41,902,242	% 80.4
コール・ローン等、その他	10,234,076	19.6
投資信託財産総額	52,136,318	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月26日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コレ・ローン等	52,123,219,049
投資証券(評価額)	9,871,365,904
未収入金	41,902,242,790
未収配当金	8,548,210
その他未収益	246,015,675
差入委託証拠金	607,470
	94,439,000
(B) 負債	9,381,627,894
未払金	29,475,365
未払解約金	40,462,407
未払利息	△ 113,025
受入担保金	9,311,803,147
(C) 純資産総額(A-B)	42,741,591,155
元本	13,765,968,496
次期繰越損益金	28,975,622,659
(D) 受益権総口数	13,765,968,496口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,049円

<注記事項>

- ①期首元本額 9,655,654,154円
 期中追加設定元本額 8,237,978,896円
 期中一部解約元本額 4,127,664,554円
 また、1口当たり純資産額は、期末3,1049円です。

○損益の状況 (2020年1月28日～2021年1月26日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取配当金	1,396,384,755
受取利息	1,389,353,881
その他収益金	86,199
支払利息	6,883,805
	60,870
(B) 有価証券売買損益	△ 4,585,374,740
売買益	1,036,284,105
売買損	△ 5,621,658,845
(C) 先物取引等取引損益	△ 140,889,780
取引益	226,706,750
取引損	△ 367,596,530
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 3,329,879,765
(E) 前期繰越損益金	25,521,886,917
(F) 追加信託差損益金	15,043,419,230
(G) 解約差損益金	△ 8,259,803,723
(H) 計(D+E+F+G)	28,975,622,659
次期繰越損益金(H)	28,975,622,659

(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算によるもの含みます。

(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。

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)

e MAXIS 国内リートインデックス	4,834,346,941円
e MAXIS Small バランス (8資産均等型)	3,022,289,628円
e MAXIS Small 国内リートインデックス	1,568,358,792円
つみたて8資産均等バランス	1,390,532,938円
e MAXIS バランス (8資産均等型)	1,338,349,673円
J-REITインデックスファンド (ラップ向け)	346,235,589円
三菱UFJ ブライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	248,890,232円
オルタナティブ資産セレクション (ラップ向け)	247,937,366円
e MAXIS バランス (波乗り型)	157,651,441円
三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド	146,122,921円
e MAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	94,014,242円
e MAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	71,423,963円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	52,259,175円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	51,165,582円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	50,093,979円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	49,122,865円
e MAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	28,766,434円
e MAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	21,683,340円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	19,514,505円
e MAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	14,824,877円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	8,525,995円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	2,964,387円
e MAXIS マイマネージャー 1980s	464,631円
e MAXIS マイマネージャー 1970s	316,248円
e MAXIS マイマネージャー 1990s	112,752円
合計	13,765,968,496円

MUAM G-REITマザーファンド

《第15期》決算日2021年1月5日

[計算期間：2020年1月7日～2021年1月5日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月5日に第15期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	S&P先進国REITインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース)		投信証組入比率	純資産額
		期騰落	中率		
11期(2017年1月5日)	円 16,039	% 6.2	41,801.16	% 5.5	% 98.8 百万円 18,949
12期(2018年1月5日)	16,420	2.4	42,522.26	1.7	98.0 18,551
13期(2019年1月7日)	15,011	△8.6	38,602.62	△9.2	98.8 19,712
14期(2020年1月6日)	18,377	22.4	47,161.24	22.2	99.0 30,217
15期(2021年1月5日)	15,806	△14.0	40,236.52	△14.7	99.0 40,409

(注) S&P先進国REITインデックスとは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指標です。なお、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。S&P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's®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SPDJIに、特定目的での利用を許諾するサプライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいざれも、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も負いません。

(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 REIT インデックス			先進国騰落率	投資信託 証組入比率
		騰	落	率		
(期首) 2020年1月6日	円 18,377	% —		47,161.24	% —	% 99.0
1月末	18,923	3.0		48,553.04	3.0	99.0
2月末	17,805	△3.1		45,640.42	△3.2	98.8
3月末	13,378	△27.2		34,126.01	△27.6	99.0
4月末	14,298	△22.2		36,418.41	△22.8	99.4
5月末	14,433	△21.5		36,769.78	△22.0	99.3
6月末	14,590	△20.6		37,151.26	△21.2	98.8
7月末	14,857	△19.2		37,787.41	△19.9	99.3
8月末	15,317	△16.7		39,001.97	△17.3	99.3
9月末	14,683	△20.1		37,350.97	△20.8	99.1
10月末	14,203	△22.7		36,104.61	△23.4	99.5
11月末	15,983	△13.0		40,687.85	△13.7	99.7
12月末	16,149	△12.1		41,107.17	△12.8	98.7
(期末) 2021年1月5日	15,806	△14.0		40,236.52	△14.7	99.0

(注) 謄落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.0%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因
(下落要因)

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

●投資環境について

◎外国REIT市況

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

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

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(2020年1月7日～2021年1月5日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 （株式） （投資信託証券）	円 4 (0) (4)	% 0.025 (0.000) (0.025)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 有価証券取引税 （株式） （投資信託証券）	3 (0) (3)	0.022 (0.000) (0.022)	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他の費用 （保管費用） （その他）	19 (6) (13)	0.120 (0.037) (0.082)	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用（権利割当にかかる現地徴収税等）
合計	26	0.167	
期中の平均基準価額は、15,486円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(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おります。

○売買及び取引の状況

(2020年1月7日～2021年1月5日)

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	アメリカ	百株 —	千アメリカドル —	百株 32	千アメリカドル 10

(注) 金額は受渡代金。

投資信託証券

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	356	594	119 (820)	197 (1,529)
KEPPEL REIT	218 (—)	233 (△ 2)	53	58
FRASERS COMMERCIAL TRUST	52 (—)	73 (△ 0.80723)	— (181)	— (285)
ASCOTT RESIDENCE TRUST	231 (—)	224 (△ 1)	— (—)	— (1)
ESR-REIT	248 (—)	94 (△ 0.62301)	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS	130 (—)	126 (△ 1)	83	96
FRASERS CENTREPOINT TRUST	265	652	—	—
STARHILL GLOBAL REIT	351 (—)	168 (△ 0.32712)	209	109
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	385 (—)	701 (△ 13)	183	357
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	211 (—)	265 (△ 5)	39 (—)	52 (2)
FIRST REAL ESTATE INV'T TRUST	123 (—)	67 (△ 4)	—	—
AIMS APAC REIT	111 (—)	131 (△ 0.5395)	67	76
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	1,675 (—)	118 (△ 2)	—	—
LIPPO MALLS INDONESIA RE-RTS	— (1,136)	— (—)	—	—
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	57 (—)	198 (△ 2)	11	47
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	278 (—)	784 (△ 0.53177)	47	141
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	152 (—)	90 (△ 0.38498)	—	—
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	268 (—)	534 (△ 3)	—	—
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	181	98	82	51
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	118	52	—	—
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	270 (—)	239 (△ 14)	45	43
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	108 (—)	35 (△ 0.70826)	—	—
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	399 (—)	151 (△ 0.35317)	127	46
SPH REIT	189	163	55	48
FRASERS HOSPITALITY TRUST	174 (—)	73 (△ 0.03654)	96	34

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

(注) 金額は受渡代金。

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

○株式売買比率

(2020年1月7日～2021年1月5日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	1,141千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	一千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	—

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年1月7日～2021年1月5日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2021年1月5日現在)

外国株式

2021年1月5日現在の組入れはございません。

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
(アメリカ)		百株
FIVE STAR SENIOR LIVING INC		32
合計	株 銘柄	数 数
		32 1

外国投資信託証券

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
CLIPPER REALTY INC	2	2	20	2,099	0.0
GLADSTONE LAND CORP	4	5	83	8,606	0.0
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7	12	162	16,723	0.0
VICI PROPERTIES INC	94	169	4,182	431,418	1.1
AMERICOLD REALTY TRUST	39	65	2,344	241,878	0.6
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTY	12	20	471	48,647	0.1
RETAIL VALUE INC	3	5	83	8,581	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	14	12	216	22,290	0.1
BRT APARTMENTS CORP	2	2	32	3,324	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10	15	245	25,327	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2	7	1,272	131,276	0.3
SAFEHOLD INC	2	4	297	30,692	0.1
AMERICAN FINANCE TRUST INC	21	36	272	28,065	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	16	33	689	71,072	0.2
ARA US HOSPITALITY TRUST	97	—	—	—	—
COREPOINT LODGING INC	7	13	85	8,867	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4	7	104	10,789	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	202	202	27	2,854	0.0
PRIME US REIT	111	137	110	11,363	0.0
NETSTREIT CORP	—	4	83	8,616	0.0
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	—	3	46	4,813	0.0
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	—	203	142	14,672	0.0
APARTMENT INCOME REIT CO	—	47	1,794	185,127	0.5
CTO REALTY GROWTH INC	—	1	61	6,384	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	149	225	3,195	329,621	0.8
LIBERTY PROPERTY TRUST	32	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	31	48	10,653	1,098,862	2.7
SIMON PROPERTY GROUP INC	63	104	8,645	891,820	2.2
VORNADO REALTY TRUST	32	49	1,812	187,001	0.5
KIMCO REALTY CORP	87	135	1,943	200,484	0.5
AVALONBAY COMMUNITIES INC	28	44	6,915	713,302	1.8
APARTMENT INV'T & MGMT CO -A	30	47	238	24,651	0.1
小計	口数・金額	5,292	7,750	279,047	28,783,798
	銘柄数・比率	158	156	—	<71.2%>
(カナダ)			千カナダドル		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4	7	246	19,902	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14	22	522	42,141	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	16	27	1,343	108,418	0.3
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	18	30	241	19,509	0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	6	7	150	12,142	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	29	45	590	47,658	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	6	—	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	30	48	802	64,741	0.2
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	12	19	729	58,851	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	14	18	192	15,559	0.0

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

銘柄		期首(前期末)		当期末		
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	WERELDHAVE NV	千口	千口	千ユーロ	千円	%
		7	13	144	18,215	0.0
小計	口数・金額	52	79	3,300	417,268	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<1.0%>	
(ユーロ…スペイン)	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	14 74 50	19 105 80	92 797 644	11,695 100,782 81,489	0.0 0.2 0.2
小計	口数・金額	139	206	1,534	193,966	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.5%>	
(ユーロ…ベルギー)	BEFIMMO INTERVEST OFFICES & WAREHOUS RETAIL ESTATES WAREHOUSES DE PAUW SCA AEDIFICA MONTEA CARE PROPERTY INVEST XIOR STUDENT HOUSING NV COFINIMMO	4 4 2 26 4 2 — — 5	7 7 3 41 10 3 7 4 8	278 165 198 1,206 1,021 317 204 204 1,033	35,188 20,906 25,055 152,473 129,136 40,177 25,797 25,897 130,663	0.1 0.1 0.1 0.4 0.3 0.1 0.1 0.1 0.3
小計	口数・金額	49	94	4,629	585,296	
	銘柄数<比率>	7	9	—	<1.4%>	
(ユーロ…アイルランド)	HIBERNIA REIT PLC IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	149 84	198 122	224 182	28,392 23,046	0.1 0.1
小計	口数・金額	233	320	406	51,439	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	
ユ一口計	口数・金額	607	927	16,444	2,078,915	
	銘柄数<比率>	26	29	—	<5.1%>	
(イギリス)	BRITISH LAND CO PLC GREAT PORTLAND ESTATES PLC HAMMERSHOLM PLC LAND SECURITIES GROUP PLC INTU PROPERTIES PLC PRIMARY HEALTH PROPERTIES SEGRO PLC WORKSPACE GROUP PLC SHAFTESBURY PLC BIG YELLOW GROUP PLC DERWENT LONDON PLC LONDONMETRIC PROPERTY PLC HANSTEEN HOLDINGS PLC RDI REIT PLC SAFESTORE HOLDINGS PLC TRITAX BIG BOX REIT PLC	195 55 159 154 201 244 231 26 44 30 21 172 90 61 43 351	299 79 1,239 240 — 405 379 43 94 51 35 285 — 89 65 550	千イギリスポンド 1,422 526 286 1,598 — 618 3,709 325 516 566 1,091 666 — 80 512 925	199,114 73,697 40,107 223,677 — 86,615 519,036 45,551 72,255 79,281 152,757 93,262 — 11,292 71,750 129,552	0.5 0.2 0.1 0.6 — 0.2 1.3 0.1 0.2 0.2 0.4 0.2 — 0.0 0.2 0.3

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

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

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

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

(注) 比率および合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2021年1月5日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
投資証券	千円 40,003,986	% 97.9
コール・ローン等、その他	845,640	2.1
投資信託財産総額	40,849,626	100.0

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月5日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2020年1月7日～2021年1月5日)

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

(注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

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