253022

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	2080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数 1990s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	ベビーファンド	ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド受益証券およびＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	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。
	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。
	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（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。
	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。
	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。
	新興国債券インデックスマザーファンド	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
	東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	MUAM G-REITマザーファンド	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	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。
	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。
	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。
	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。
	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。
	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。
	新興国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	株式および外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
	MUAM G-REITマザーファンド	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※ 当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
※ 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

ｅＭＡＸＩＳ
マイマネージャー 1990s

第３期（決算日：2020年１月27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 1990s」は、去る１月27日に第３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
お客さま専用フリーダイヤル　０１２０－１５１０３４
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

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。
・－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	基準価額			マイライフサイクル指数 1990s		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	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率						
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
2017年10月2日	10,000	－	－	100.00	－	－	－	－	－	－	10
1期(2018年1月26日)	11,023	0	10.2	110.30	10.3	81.0	2.4	1.9	0.0	13.6	12
2期(2019年1月28日)	9,675	0	△12.2	96.90	△12.1	87.1	3.1	1.9	0.0	6.8	13
3期(2020年1月27日)	11,102	0	14.7	111.30	14.9	85.7	3.6	3.0	0.0	7.0	18

(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数は、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ｅＭＡＸＩＳシリーズのファンドを参照して算出する指数であり、３つの想定生まれ年別指数の総称です。各指数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数とは違う指数が適合する場合があります。指数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数 1990sを算出するために参照したファンド
ｅＭＡＸＩＳ ＴＯＰＩＸインデックス、ｅＭＡＸＩＳ 先進国株式インデックス、ｅＭＡＸＩＳ 新興国株式インデックス、ｅＭＡＸＩＳ 国内債券インデックス、ｅＭＡＸＩＳ 先進国債券インデックス、ｅＭＡＸＩＳ 新興国債券インデックス、ｅＭＡＸＩＳ 国内リートインデックス、ｅＭＡＸＩＳ 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、不動産投信指数先物を含めて表示しております。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。
(注) 設定日の純資産総額は、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 1990s		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率					
（期　首）	円	%		%	%	%	%	%	%
2019年１月28日	9,675	－	96.90	－	87.1	3.1	1.9	0.0	6.8
１月末	9,724	0.5	97.50	0.6	83.8	3.0	1.9	0.0	6.8
２月末	10,114	4.5	101.40	4.6	86.0	3.2	2.9	0.0	6.7
３月末	10,116	4.6	101.40	4.6	85.4	3.7	2.9	0.0	7.0
４月末	10,420	7.7	104.50	7.8	86.0	3.1	2.9	0.0	6.9
５月末	9,708	0.3	97.30	0.4	84.8	3.8	2.9	0.0	7.2
６月末	10,061	4.0	100.90	4.1	85.3	3.5	2.9	0.0	7.2
７月末	10,193	5.4	102.20	5.5	86.1	2.7	2.9	0.0	7.3
８月末	9,664	△ 0.1	96.90	0.0	83.9	4.2	2.9	0.0	7.9
９月末	10,082	4.2	101.10	4.3	85.9	2.3	2.9	0.0	7.8
10月末	10,537	8.9	105.70	9.1	85.0	3.5	2.9	0.0	7.6
11月末	10,756	11.2	107.90	11.4	84.3	4.0	2.9	0.0	7.7
12月末	11,107	14.8	111.40	15.0	86.0	4.3	2.9	0.0	6.8
（期　末）									
2020年１月27日	11,102	14.7	111.30	14.9	85.7	3.6	3.0	0.0	7.0

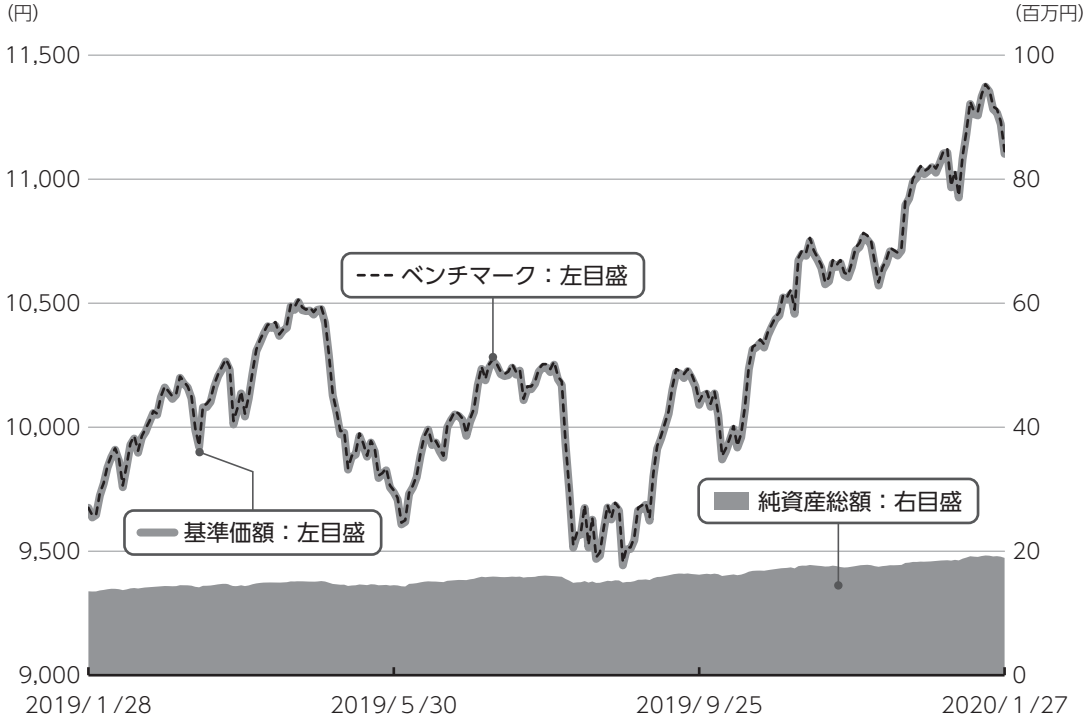
（注）騰落率は期首比。
（注）株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
（注）株式先物比率には、不動産投信指数先物を含めて表示しております。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
（注）「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第３期：2019年１月29日～2020年１月27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３期首	9,675円
第３期末	11,102円
既払分配金	0円
騰落率	14.7%

※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14.7%の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（14.9%）を0.2%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－ＲＥＩＴマザーファンド	16.7%	4.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	10.5%	29.7%
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	23.6%	2.1%
新興国債券インデックスマザーファンド	8.8%	2.0%
ＴＯＰＩＸマザーファンド	12.2%	27.0%
外国株式インデックスマザーファンド	22.7%	33.2%
日本債券インデックスマザーファンド	1.5%	0.5%
外国債券インデックスマザーファンド	6.2%	0.5%

第３期：2019年１月29日～2020年１月27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2019年９月末にかけて米中貿易摩擦問題や英国の欧州連合（ＥＵ）離脱問題の進退等を受け、国内株式市況は上下する展開になりました。10月から期末にかけて、円安が進行したことや米中貿易交渉の進展期待等を受け、国内株式市況は上昇して終えました。

▶ 外国株式市況

外国株式市況は上昇しました。

外国株式市況は、米国の堅調な企業決算内容などを受けて上昇しました。

▶ 新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、世界的な株式市況の上昇などを受けて上昇しました。

▶ 国内債券市況

国内債券市況は上昇しました。

期の前半は、世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことなどから国内債券市況は上昇しました。期の後半は、日本銀行による追加緩和期待の後退や米中貿易交渉の進展などから国内債券市況は下落しましたが、期を通して見ると国内債券市況は上昇しました。

▶ 外国債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

先進国の債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首との比較では上昇しました。

▶ 新興国債券市況

新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。

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

▶ 国内ＲＥＩＴ市況

国内ＲＥＩＴ市況は上昇しました。

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

▶ 外国ＲＥＩＴ市況

外国ＲＥＩＴ市況は上昇しました。

外国ＲＥＩＴ市況は、米国長期金利の低下などを受けて上昇しました。

▶ 為替市況

米ドル、ユーロ、アルゼンチンペソが対円でそれぞれ下落しました。

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

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s

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1990s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	30.0%	27.0%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	31.0%	33.0%
新興国株式インデックスマザーファンド	新興国株式	30.0%	30.0%
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	1.0%	1.0%
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	1.0%	1.0%
新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	1.0%	2.0%
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	国内ＲＥＩＴ	2.0%	2.0%
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	先進国ＲＥＩＴ	4.0%	4.0%

▶ 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・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ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

▶東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

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

▶MUAM G－ＲＥＩＴマザーファンド

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について

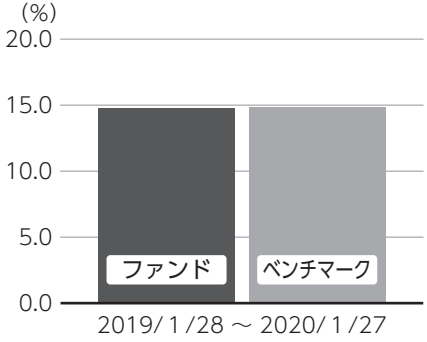
▶ ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s

基準価額の騰落率は14.7％の上昇となり、ベンチマークの騰落率（14.9％）を0.2％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	△0.1％程度
その他（信託報酬等）	△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）



▶ ＴＯＰＩＸ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。

※貸株収入要因等が含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶ 外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因※によるものです。

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

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶ 新興国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

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：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。

▶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：ポートフォリオ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※

※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３期 2019年１月29日～2020年１月27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	1,413

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

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

今後の運用方針（作成対象期間末での見解です。）

▶ ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s

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 1990s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。

2019年１月29日～2020年１月27日

１万口当たりの費用明細

項目	当期 金額（円）	当期 比率（%）	項目の概要
(a)信託報酬	56	0.543	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（期中の日数÷年間日数）
（投信会社）	(24)	(0.238)	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)	(0.239)	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)	(0.065)	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	2	0.022	(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）	(2)	(0.018)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(c)有価証券取引税	2	0.023	(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）	(2)	(0.022)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(d)その他費用	4	0.043	(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）	(4)	(0.037)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（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）	(0)	(0.003)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	64	0.631	

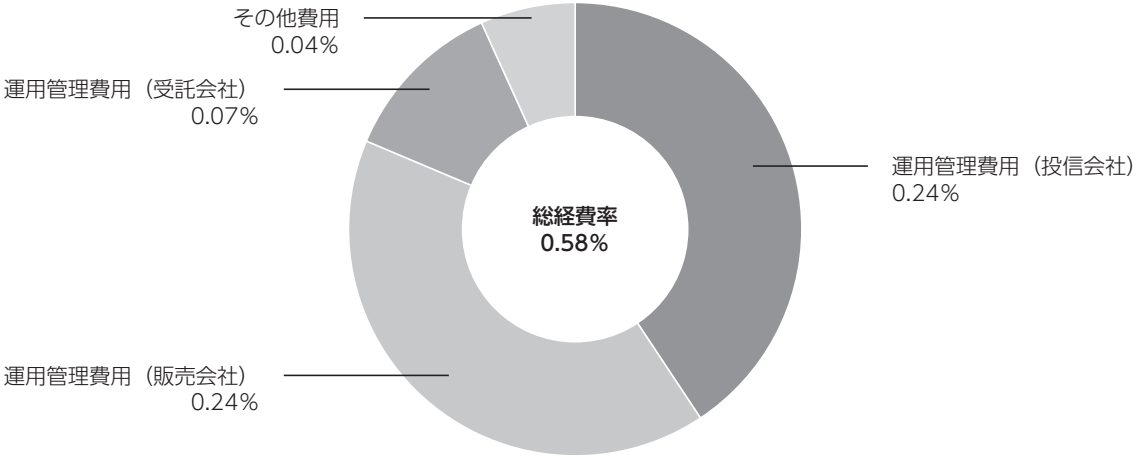
期中の平均基準価額は、10,236円です。

（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

（2019年１月29日～2020年１月27日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	121	216	48	85
新興国株式インデックスマザーファンド	582	1,384	166	415
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	31	104	17	56
新興国債券インデックスマザーファンド	170	230	8	11
ＴＯＰＩＸマザーファンド	726	1,275	420	717
外国株式インデックスマザーファンド	503	1,384	140	401
日本債券インデックスマザーファンド	25	34	5	6
外国債券インデックスマザーファンド	13	28	2	4

○株式売買比率

（2019年１月29日～2020年１月27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			
	ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴ マザーファンド	新興国株式 インデックス マザーファンド	ＴＯＰＩＸ 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	1,273千円	51,432,852千円	515,553,093千円	449,334,963千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	127千円	86,651,020千円	266,181,331千円	396,879,954千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	9.95	0.59	1.93	1.13

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月29日～2020年１月27日）

利害関係人との取引状況

＜ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s＞

該当事項はございません。

＜ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	7,323	1,208	16.5	1,309	89	6.8

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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	64,815	4,224	6.5	36,758	4,563	12.4

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。

＜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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	11,102	4,523	40.7	4,521	2,708	59.9
不動産投信指数先物取引	8,607	3,237	37.6	8,620	3,792	44.0

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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	14,430	3,894	27.0	6,509	1,538	23.6

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。

＜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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	314,226	34,033	10.8	201,326	63,164	31.4
新株予約権証券	－	－	－	0.7052	0.7052	100.0
貸付有価証券(株式)	409,906	306,859	74.9	396,636	325,468	82.1

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。

＜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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	393,044	282,679	71.9	184,083	159,499	86.6

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。

＜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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	270,170	89,154	33.0	230,357	50,004	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ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。
（注）公社債には現先などによるものを含みません。

＜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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	27,514	2,512	9.1	20,736	1,379	6.7

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ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	5,453	3,420	6,131

＜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
	百万円	百万円	百万円
公社債	1,648	503	2,584

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
	百万円
投資信託証券	697

＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

種　　類	買　　付　　額
	百万円
株式	32

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

種　　類	買　　付　　額
	百万円
公社債	3,700

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項　　目	当　　期
売買委託手数料総額（A）	3千円
うち利害関係人への支払額（B）	0.004千円
（B）／（A）	0.1%

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2019年１月29日～2020年１月27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	百万円	百万円	百万円	
10	－	－	10	当初設定時における取得

○組入資産の明細

（2020年１月27日現在）

親投資信託残高

銘　　柄	期首(前期末)	当　期　末	
	口　数	口　数	評　価　額
	千口	千口	千円
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	333	406	774
新興国株式インデックスマザーファンド	1,719	2,135	5,615
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	92	106	389
新興国債券インデックスマザーファンド	102	264	381
ＴＯＰＩＸマザーファンド	2,416	2,723	5,102
外国株式インデックスマザーファンド	1,630	1,993	6,277
日本債券インデックスマザーファンド	50	70	96
外国債券インデックスマザーファンド	33	44	95

○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、2020年１月27日現在における貸付株数の総株数は25,632,800株です。
うち利害関係人であるモルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券に対する貸付は、10,614,900株です。

○投資信託財産の構成

（2020年１月27日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	774	4.1
新興国株式インデックスマザーファンド	5,615	29.5
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	389	2.0
新興国債券インデックスマザーファンド	381	2.0
ＴＯＰＩＸマザーファンド	5,102	26.9
外国株式インデックスマザーファンド	6,277	33.0
日本債券インデックスマザーファンド	96	0.5
外国債券インデックスマザーファンド	95	0.5
コール・ローン等、その他	274	1.5
投資信託財産総額	19,003	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（31,707,739千円）の投資信託財産総額（31,778,399千円）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（117,121,685千円）の投資信託財産総額（117,858,843千円）に対する比率は99.4%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（30,487,031千円）の投資信託財産総額（30,590,151千円）に対する比率は99.7%です。

（注）外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（603,141,979千円）の投資信託財産総額（632,028,646千円）に対する比率は95.4%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（146,164,409千円）の投資信託財産総額（146,400,738千円）に対する比率は99.8%です。

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

１アメリカドル＝109.06円	１カナダドル＝82.94円	１アルゼンチンペソ＝1.81円	１メキシコペソ＝5.79円
１ブラジルレアル＝26.07円	100チリペソ＝14.02円	100コロンビアペソ＝3.24円	１ペルーヌエボソル＝32.80円
１ウルグアイペソ＝2.93円	１ドミニカペソ＝2.05円	１ユーロ＝120.30円	１イギリスポンド＝142.51円
１スイスフラン＝112.39円	１スウェーデンクローネ＝11.40円	１ノルウェークローネ＝12.05円	１デンマーククローネ＝16.10円
１トルコリラ＝18.34円	１チェココルナ＝4.78円	100ハンガリーフォリント＝35.76円	１ポーランドズロチ＝28.27円
１ロシアルーブル＝1.75円	１ルーマニアレイ＝25.16円	１オーストラリアドル＝74.30円	１ニュージーランドドル＝71.82円
１香港ドル＝14.03円	１シンガポールドル＝80.60円	１マレーシアリンギット＝26.87円	１タイバーツ＝3.55円
１フィリピンペソ＝2.15円	100インドネシアルピア＝0.81円	100韓国ウォン＝9.34円	１ニュー台湾ドル＝3.63円
１インドルピー＝1.54円	１オフショア元＝15.69円	１アラブディルハム＝29.74円	１サウジアラビアリヤル＝29.11円
１イスラエルシェケル＝31.54円	１カタールリアル＝29.83円	１南アフリカランド＝7.56円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月27日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	19,003,452
コール・ローン等	265,442
MUAM G-REITマザーファンド(評価額)	774,626
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	5,615,014
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド(評価額)	389,494
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	381,311
ＴＯＰＩＸマザーファンド(評価額)	5,102,863
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	6,277,222
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	96,617
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	95,936
未収入金	4,927
(B) 負債	79,353
未払解約金	32,504
未払信託報酬	46,593
その他未払費用	256
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	18,924,099
元本	17,045,492
次期繰越損益金	1,878,607
(D) 受益権総口数	17,045,492口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,102円

＜注記事項＞

①期首元本額　13,985,624円
　期中追加設定元本額　4,597,984円
　期中一部解約元本額　1,538,116円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.1102円です。

○損益の状況 (2019年１月29日～2020年１月27日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 8
支払利息	△ 8
(B) 有価証券売買損益	2,276,126
売買益	2,380,006
売買損	△ 103,880
(C) 信託報酬等	△ 86,682
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	2,189,436
(E) 前期繰越損益金	△ 559,223
(F) 追加信託差損益金	248,394
(配当等相当額)	(774,333)
(売買損益相当額)	(△ 525,939)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	1,878,607
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	1,878,607
追加信託差損益金	248,394
(配当等相当額)	(779,977)
(売買損益相当額)	(△ 531,583)
分配準備積立金	1,630,213

(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	2019年１月29日～2020年１月27日
費用控除後の配当等収益額	373,163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	228,850円
収益調整金額	779,977円
分配準備積立金額	1,028,200円
当ファンドの分配対象収益額	2,410,190円
１万口当たり収益分配対象額	1,413円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

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

［お知らせ］

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

②後掲載のマザーファンドは、ベンチマーク等の変更を行う前の報告書を掲載している場合があります。

＜訂正のお知らせとお詫び＞

「ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s」の運用報告書（全体版）の「第２期：決算日 2019 年 1 月 28 日」におきまして、「利害関係人との取引状況等」に下記の通り記載漏れがございました。

謹んでお詫び申し上げますとともに、今後はこのようなことがないよう、再発防止に努めてまいります。

何卒、今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

記

（誤）　ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s　　24頁

○利害関係人との取引状況等　　（ 2018年１月27日 ～ 2019年１月28日）
＜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	Ｂ／Ａ	売付額等Ｃ	うち利害関係人との取引状況Ｄ	Ｄ／Ｃ
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	156,017	77,044	49.4	227,795	71,829	31.5
貸付有価証券(株式)	391,498	391,498	100.0	384,227	384,227	100.0

（正）　ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s　　24頁

○利害関係人との取引状況等　　（ 2018年１月27日 ～ 2019年１月28日）
＜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	Ｂ／Ａ	売付額等Ｃ	うち利害関係人との取引状況Ｄ	Ｄ／Ｃ
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	156,017	77,044	49.4	227,795	71,829	31.5
新株予約権証券	－	－	－	5	1	20.0
貸付有価証券(株式)	391,498	391,498	100.0	384,227	384,227	100.0

以上

ＴＯＰＩＸマザーファンド

《第18期》決算日2019年３月25日

［計算期間：2018年３月27日～2019年３月25日］

「ＴＯＰＩＸマザーファンド」は、３月25日に第18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18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）と連動する投資成果をめざして運用を行います。ＴＯＰＩＸ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。
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	期中騰落率	東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2015年３月25日)	15,711	39.6	1,592.01	36.8	98.4	1.3	245,366
15期(2016年３月25日)	13,743	△12.5	1,366.05	△14.2	98.2	1.9	220,801
16期(2017年３月27日)	15,678	14.1	1,524.39	11.6	98.8	1.0	296,391
17期(2018年３月26日)	17,551	11.9	1,671.32	9.6	98.1	1.1	275,958
18期(2019年３月25日)	16,939	△ 3.5	1,577.41	△ 5.6	99.3	1.4	245,020

(注) 東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは、東京証券取引所第一部に上場する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代表的な株価指数です。ＴＯＰＩＸに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

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

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
	円	%		%	%	%
（期　首） 2018年３月26日	17,551	－	1,671.32	－	98.1	1.1
３月末	18,190	3.6	1,716.30	2.7	98.4	1.7
４月末	18,839	7.3	1,777.23	6.3	98.3	1.5
５月末	18,534	5.6	1,747.45	4.6	98.5	1.5
６月末	18,383	4.7	1,730.89	3.6	99.4	0.9
７月末	18,621	6.1	1,753.29	4.9	99.4	0.6
８月末	18,438	5.1	1,735.35	3.8	100.2	0.6
９月末	19,462	10.9	1,817.25	8.7	98.5	1.5
10月末	17,634	0.5	1,646.12	△ 1.5	98.1	1.9
11月末	17,868	1.8	1,667.45	△ 0.2	98.5	1.5
12月末	16,037	△ 8.6	1,494.09	△10.6	99.2	0.9
2019年１月末	16,826	△ 4.1	1,567.49	△ 6.2	99.3	0.7
２月末	17,264	△ 1.6	1,607.66	△ 3.8	99.4	0.6
（期　末） 2019年３月25日	16,939	△ 3.5	1,577.41	△ 5.6	99.3	1.4

（注）騰落率は期首比。
（注）株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
（注）「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

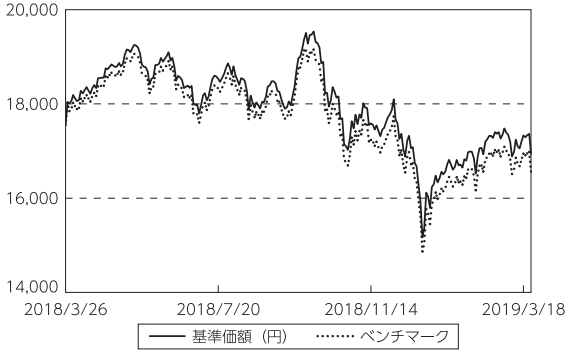
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－5.6%）を2.1%上回りました。

基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎国内株式市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

・株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）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5.6%の下落となったため、カイ離は2.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

・配当要因※　　2.2%

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

（主なマイナス要因）

・取引要因

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2018年３月27日～2019年３月25日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	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
（株式）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
(b) その他費用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（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	0	0.002	
期中の平均基準価額は、17,937円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2018年３月27日～2019年３月25日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	85,935 (△ 6,194)	176,465,389 (－)	92,055	190,442,992

（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
	証券	千円	証券	千円
国内	－	－	10,000	1,940
	(10,000)	(－)		

(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 63,237	百万円 62,524	百万円 －	百万円 －

○株式売買比率

(2018年３月27日～2019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	366,908,382千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	249,054,742千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	1.47

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2018年３月27日～2019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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	176,465	71,101	40.3	190,442	79,523	41.8
新株予約権証券	－	－	－	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	347,867	347,867	100.0	345,950	345,950	100.0

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　　付　　額	売　　付　　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	3,353	3,869	4,391

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
	百万円
株式	185

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項　　目	当　　期
売買委託手数料総額（A）	4,981千円
うち利害関係人への支払額（B）	27千円
（B）／（A）	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中京銀行、カブドットコム証券、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券、三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ、三菱ＵＦＪリース、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券、日立キャピタルです。

○組入資産の明細

（2019年３月25日現在）

国内株式

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	5	4.7	14,288
日本水産	143	146	116,362
マルハニチロ	24.1	21.1	84,505
カネコ種苗	4.4	4.4	5,913
サカタのタネ	18.7	17.8	66,127
ホクト	12.9	12.2	24,021
ホクリヨウ	1.8	2	1,220
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	33.2	31.4	3,234
日鉄鉱業	3.5	3.3	15,048
三井松島ホールディングス	6.4	6.1	7,997
国際石油開発帝石	617.7	585.6	606,388
日本海洋掘削	4.4	－	－
石油資源開発	20.1	21	46,851
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7.5	7.1	10,912
建設業（3.0%）			
ヒノキヤグループ	－	3.1	6,702
ショーボンドホールディングス	12	10.4	75,504
ミライト・ホールディングス	39.1	41.1	63,992
タマホーム	9.5	7	7,189
サンヨーホームズ	2.2	2.1	1,860
日本アクア	－	3.5	1,872
ファーストコーポレーション	4.2	4.5	3,519
ベステラ	1.8	2.8	3,830
ＴＡＴＥＲＵ	11.1	17.8	4,539
スペースバリューホールディングス	－	17.8	9,220
ダイセキ環境ソリューション	3	2.8	1,747
第一カッター興業	1.3	1.8	3,043
安藤・間	98.8	93.4	70,984
東急建設	48.9	42.8	36,166
コムシスホールディングス	44.7	51.8	149,287
ミサワホーム	10.6	11.5	9,223
ビーアールホールディングス	12.6	11.9	4,022
高松コンストラクショングループ	8.2	9.1	24,096
東建コーポレーション	4.7	4.5	31,590
ソネック	1.6	1.5	1,071
ヤマウラ	5.9	5.6	5,594
大成建設	126.5	119.9	606,694
大林組	380.9	361.2	396,597
清水建設	388.6	368.4	352,558
飛島建設	115.5	10.3	13,956
長谷工コーポレーション	148.2	150.6	214,906
松井建設	14	13.3	9,270
錢高組	1.8	1.5	7,875
鹿島建設	558	282.3	451,962
不動テトラ	96.1	8.3	12,118
大末建設	4.1	4.3	3,891
鉄建建設	7.7	7.3	19,987
西松建設	29.4	26	65,624
三井住友建設	91.6	86.9	66,304
大豊建設	46	8.1	25,798
前田建設工業	90.6	85.9	96,637
佐田建設	8.2	7.8	2,956
ナカノフドー建設	9.7	9.2	4,480
奥村組	20.9	19.8	70,092
東鉄工業	15.2	14.5	43,572
イチケン	2.3	2.2	4,153
富士ピー・エス	－	3.7	1,835
淺沼組	45	4.3	11,167
戸田建設	148	140	97,160
熊谷組	19.9	17.2	58,996
青木あすなろ建設	8.3	5.9	6,212
北野建設	26	2.5	7,762
植木組	1.6	1.5	3,516
三井ホーム	16	－	－
矢作建設工業	17.3	16.4	12,890
ピーエス三菱	15	12.7	8,572

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本ハウスホールディングス	24.3	23	10,189
大東建託	46	42.9	669,240
新日本建設	15.1	14.3	13,885
ＮＩＰＰＯ	29.4	31.9	65,107
東亜道路工業	2.6	2.3	6,785
前田道路	40	37.7	79,961
日本道路	3.4	3.3	21,681
東亜建設工業	10.3	10.5	16,401
若築建設	6.8	6.1	9,113
東洋建設	39.9	44.1	19,139
五洋建設	151	143.2	74,464
世紀東急工業	17.1	17.5	10,552
福田組	4.1	3.9	16,380
住友林業	81.2	85.4	125,367
日本基礎技術	14.1	12.4	4,699
日成ビルド工業	18.8	－	－
ヤマダ・エスバイエルホーム	57	－	－
巴コーポレーション	15.8	15	5,160
大和ハウス工業	375.2	333.5	1,148,574
ライト工業	24.4	23.1	32,386
積水ハウス	413.3	368.8	663,655
日特建設	10.8	10.3	6,272
北陸電気工事	7	5.8	5,121
ユアテック	20	19.3	15,478
西部電気工業	2.1	－	－
四電工	1.9	1.8	4,847
中電工	16.4	15.5	35,262
関電工	50.6	54.8	52,608
きんでん	84.5	80.1	143,859
東京エネシス	14.4	12.4	11,755
トーエネック	3.6	3.4	10,217
住友電設	10	8.3	15,089
日本電設工業	19.5	20.5	45,920
協和エクシオ	45.6	47.2	138,343
新日本空調	9.8	10.1	19,695
ＮＤＳ	2	－	－
九電工	25	23.8	81,277
三機工業	26.9	27.2	33,075
日揮	109.4	103.7	151,713

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
中外炉工業	3.8	3.4	6,137
ヤマト	10.4	10.8	5,184
太平電業	8.6	8.1	19,083
高砂熱学工業	35	30.4	53,139
三晃金属工業	1.4	1.5	4,380
朝日工業社	2.6	2.5	7,252
明星工業	23	21.8	16,328
大氣社	16.8	16.4	52,316
ダイダン	8.5	8.1	20,306
日比谷総合設備	14.2	11.5	21,424
東芝プラントシステム	27.5	26.1	51,521
ＯＳＪＢホールディングス	56.1	53.2	14,576
東洋エンジニアリング	14.9	14.2	8,860
千代田化工建設	82.5	86.9	24,332
新興プランテック	24.5	21.6	25,315
食料品（4.3%）			
日本製粉	37.8	35.8	67,733
日清製粉グループ本社	139.3	121.9	299,752
日東富士製粉	0.8	0.8	4,960
昭和産業	10.4	9.9	29,749
鳥越製粉	10.1	9.6	7,248
中部飼料	13.9	13.2	15,615
フィード・ワン	76.4	72.5	12,832
東洋精糖	1.9	1.6	1,640
日本甜菜製糖	6.5	6.1	12,309
三井製糖	9	8.5	24,420
塩水港精糖	13.6	11.7	2,749
日新製糖	5.4	5.1	10,643
森永製菓	26.7	27.1	130,893
中村屋	2.9	2.8	12,418
江崎グリコ	31.8	32.4	186,300
名糖産業	5.5	5.2	7,628
井村屋グループ	4.5	4.6	11,398
不二家	7.3	6	13,116
山崎製パン	93	88.2	157,437
第一屋製パン	2	1.9	1,941
モロゾフ	1.9	1.8	8,631
亀田製菓	7.1	6.7	35,979
寿スピリッツ	11	11.4	47,652

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
カルビー	51.8	49.2	146,517
森永乳業	22.8	21.6	77,760
六甲バター	5.7	7.9	16,645
ヤクルト本社	68.1	79.9	602,446
明治ホールディングス	75.2	76.4	669,264
雪印メグミルク	27.4	26	69,524
プリマハム	80	15.2	31,418
日本ハム	98	46.6	184,769
林兼産業	4.1	3.6	2,008
丸大食品	61	11.5	21,643
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8	9.7	38,800
伊藤ハム米久ホールディングス	73.3	69.5	48,094
サッポロホールディングス	41.6	39.4	98,815
アサヒグループホールディングス	238.3	225.9	1,061,730
キリンホールディングス	546.9	488	1,246,352
宝ホールディングス	85.2	80.8	106,009
オエノンホールディングス	32.3	30.6	12,240
養命酒製造	3.5	3.3	6,972
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールデ	79.9	82.6	222,854
サントリー食品インターナショナル	87	72.2	358,834
ダイドーグループホールディングス	5.8	6.1	30,408
伊藤園	37.7	32.8	178,104
キーコーヒー	11.2	10.6	22,567
ユニカフェ	3.4	3	2,970
ジャパンフーズ	1.6	1.5	1,927
日清オイリオグループ	13.4	13.9	46,495
不二製油グループ本社	30.8	26.3	95,863
かどや製油	1.2	1.2	6,444
Ｊ－オイルミルズ	5.9	5.6	23,044
キッコーマン	88.9	71.2	375,936
味の素	261.7	238.3	417,978
キユーピー	63.4	60.1	156,500
ハウス食品グループ本社	43.4	41.2	179,426
カゴメ	45.6	43.2	130,464
焼津水産化学工業	5.5	5.2	5,969
アリアケジャパン	10.4	9.9	59,004
ピエトロ	1.5	1.4	2,324
エバラ食品工業	2.5	2.6	5,725
ニチレイ	54.2	56	150,808

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東洋水産	62.4	55.5	229,770
イートアンド	3.1	3.7	6,367
大冷	1.3	1.2	2,185
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1.7	2.9	1,571
日清食品ホールディングス	49.6	45.9	341,037
永谷園ホールディングス	12	5.7	14,569
一正蒲鉾	4.4	4.2	4,460
フジッコ	12.3	11.7	25,704
ロック・フィールド	12.3	11.6	18,548
日本たばこ産業	704	623	1,683,657
ケンコーマヨネーズ	7.5	6	13,050
わらべや日洋ホールディングス	7.4	7.1	12,872
なとり	6.3	6	10,320
イフジ産業	2	1.9	1,349
ピックルスコーポレーション	1.7	2.6	4,781
北の達人コーポレーション	32.8	42.4	17,723
ユーグレナ	43.9	46	30,728
ミヨシ油脂	4.4	4.1	4,268
理研ビタミン	4.3	5.1	18,385
繊維製品（0.6%）			
片倉工業	13.6	12.9	16,008
グンゼ	8.9	7.1	32,802
東洋紡	43.9	44.6	66,944
ユニチカ	34.6	30.8	12,905
富士紡ホールディングス	6.6	5.5	14,861
倉敷紡績	120	10	20,820
シキボウ	6	5.5	5,808
日本毛織	33.5	34.6	31,313
ダイトウボウ	18	17	1,360
トーア紡コーポレーション	5	4.5	2,002
ダイドーリミテッド	13.3	12.6	4,208
帝国繊維	12.4	11.8	31,647
帝人	97.5	85.9	160,289
東レ	861.4	816.7	587,778
サカイオーベックス	3	2.6	4,570
住江織物	3	3.1	8,165
日本フエルト	6.3	6	2,772
イチカワ	8	1.5	2,085
日東製網	1.3	1.2	1,652

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アツギ	7.9	8.7	8,491
ダイニック	4.5	4.3	3,147
セーレン	27.3	25.9	43,537
ソトー	4.4	4.2	4,120
東海染工	1.7	1.4	1,535
小松マテーレ	18.2	17.3	13,476
ワコールホールディングス	32.8	30.7	81,508
ホギメディカル	7.5	13.1	50,893
レナウン	32.1	30.4	3,040
クラウディアホールディングス	2.7	2.6	1,232
ＴＳＩホールディングス	41	38.8	24,832
マツオカコーポレーション	2.1	3.3	11,121
ワールド	－	10.3	23,030
三陽商会	6.2	6.3	10,476
ナイガイ	4.3	3.8	1,907
オンワードホールディングス	70.9	63.2	35,771
ルックホールディングス	20	3.8	5,643
キムラタン	54.2	51.9	1,349
ゴールドウイン	3.4	9.5	138,415
デサント	27.1	23.3	62,304
キング	5.9	5.6	3,113
ヤマトインターナショナル	7.9	6.9	2,835
パルプ・紙（0.3%）			
特種東海製紙	6.5	6.7	27,805
王子ホールディングス	500	473.9	328,886
日本製紙	53.2	50.4	115,164
三菱製紙	16.9	17.1	8,926
北越コーポレーション	66.3	69.8	45,509
中越パルプ工業	4.7	4.5	6,003
巴川製紙所	18	3.5	3,426
大王製紙	47.3	51.3	66,946
阿波製紙	2.9	2.7	1,344
レンゴー	114.5	108.6	108,165
トーモク	6.8	6.5	10,738
ザ・パック	8.4	8	26,200
化学（7.3%）			
クラレ	199.8	177.6	248,995
旭化成	740.5	749	864,720
共和レザー	6.9	6.5	4,738

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
昭和電工	79	69.9	257,232
住友化学	874	828.7	434,238
住友精化	4.9	5.1	20,145
日産化学	69.1	64.6	323,000
ラサ工業	4.2	3.7	5,768
クレハ	10.2	9.7	61,595
多木化学	1.6	3.1	18,414
テイカ	9.1	8.6	21,267
石原産業	21.3	20.2	22,886
片倉コープアグリ	2.9	3.1	3,642
日東エフシー	6.9	6.6	5,095
日本曹達	82	16.6	48,123
東ソー	171.6	162.7	277,240
トクヤマ	34.5	30.3	77,568
セントラル硝子	24.2	22.9	57,135
東亜合成	69.7	66.1	76,808
大阪ソーダ	10.8	11.3	30,645
関東電化工業	28.4	25	18,725
デンカ	43.6	41.4	129,996
信越化学工業	197.7	185.5	1,689,719
日本カーバイド工業	3.7	3.6	5,338
堺化学工業	8.1	7	16,730
第一稀元素化学工業	－	8.6	7,464
エア・ウォーター	97.9	86.2	138,178
大陽日酸	91.5	86.7	139,413
日本化学工業	4.4	3.6	7,196
東邦アセチレン	1.7	1.6	2,278
日本パーカライジング	60.7	57.5	79,292
高圧ガス工業	17.6	16.7	13,861
チタン工業	1.3	1.3	3,062
四国化成工業	17.1	17.7	20,779
戸田工業	2.4	2.2	4,719
ステラ　ケミファ	6	6.2	18,910
保土谷化学工業	3.8	3.7	12,154
日本触媒	18.7	17.7	128,502
大日精化工業	9.2	8.7	26,361
カネカ	160	28	114,240
三菱瓦斯化学	97.9	108.3	173,280
三井化学	107.9	95.6	256,781

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＪＳＲ	119.4	105.7	182,861
東京応化工業	20.6	18.1	55,386
大阪有機化学工業	7.7	9.7	10,466
三菱ケミカルホールディングス	795.3	703.8	566,629
ＫＨネオケム	18.2	16	42,032
ダイセル	160.1	163.5	190,804
住友ベークライト	96	18.2	72,618
積水化学工業	246.6	230.1	406,126
日本ゼオン	100.1	94.9	104,579
アイカ工業	33.3	31.6	112,338
宇部興産	59.8	53.2	123,902
積水樹脂	18.3	17.4	33,373
タキロンシーアイ	24	22.8	14,295
旭有機材	7	7.3	11,928
日立化成	58.7	48.7	119,558
ニチバン	5.8	5.5	12,584
リケンテクノス	25.6	28.7	12,455
大倉工業	28	5.4	9,039
積水化成品工業	14.9	15.7	14,459
群栄化学工業	2.9	2.7	6,820
タイガースポリマー	5.8	5.5	3,206
ミライアル	3.9	3	3,198
ダイキアクシス	3.9	3.7	3,045
ダイキョーニシカワ	23.4	22.2	23,598
竹本容器	1.3	3.8	5,377
森六ホールディングス	4.5	5.7	14,780
日本化薬	77.1	67	87,301
カーリットホールディングス	11	11.2	8,736
日本精化	9.8	8.5	10,098
扶桑化学工業	8.4	10.7	19,998
トリケミカル研究所	2.1	2.3	12,213
ＡＤＥＫＡ	51.1	51.9	82,676
日油	45.9	40.6	150,626
新日本理化	18.7	19	3,686
ハリマ化成グループ	9.2	8.7	8,830
花王	278.8	261	2,203,362
第一工業製薬	23	3.9	13,084
石原ケミカル	－	2.7	4,689
日華化学	3.7	3.5	3,360

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ニイタカ	1.7	1.6	2,358
三洋化成工業	7.5	7.1	36,778
有機合成薬品工業	7.7	8.1	1,595
大日本塗料	13.6	11.9	12,982
日本ペイントホールディングス	91.6	86.9	373,670
関西ペイント	124.7	118.3	250,796
神東塗料	8.7	8.3	1,435
中国塗料	34	34.6	32,766
日本特殊塗料	7.5	7.9	9,077
藤倉化成	15	14.2	8,122
太陽ホールディングス	9.1	8.7	31,842
ＤＩＣ	46.9	47.6	153,272
サカタインクス	24.2	23	23,253
東洋インキＳＣホールディングス	117	22.3	54,679
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	7.9	8.2	7,740
富士フイルムホールディングス	235.5	223.3	1,117,393
資生堂	211.2	213.6	1,667,788
ライオン	157.9	149.7	347,304
高砂香料工業	7.1	7.4	24,494
マンダム	22.1	24.2	67,784
ミルボン	15.2	13.3	65,835
ファンケル	27.5	47.9	134,167
コーセー	19.2	18.2	344,890
コタ	4.9	5.1	7,624
シーズ・ホールディングス	15.4	2.9	17,052
シーボン	1.4	1.3	3,450
ポーラ・オルビスホールディングス	48.4	45.9	157,437
ノエビアホールディングス	7.2	6.8	35,904
アジュバンコスメジャパン	2.5	2.4	2,270
エステー	8.1	7.7	14,637
アグロ　カネショウ	4.6	4.4	9,248
コニシ	18.6	19	29,982
長谷川香料	15	12.8	23,129
星光ＰＭＣ	6.5	7.2	5,601
小林製薬	31.8	30.1	269,094
荒川化学工業	10.2	9.6	12,268
メック	7.8	7.4	7,466
日本高純度化学	3.1	3	7,140
タカラバイオ	29.7	28.1	71,402

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＪＣＵ	7	13.9	24,561
新田ゼラチン	7.8	6.7	4,690
ＯＡＴアグリオ	1.8	1.5	2,490
デクセリアルズ	29.1	27.7	20,470
アース製薬	8.5	8.1	41,715
北興化学工業	11.6	11	5,819
大成ラミック	3.5	3.5	9,859
クミアイ化学工業	51.6	44.4	33,788
日本農薬	29.6	25.7	11,616
アキレス	8.6	7.8	14,578
有沢製作所	19	16.9	13,689
日東電工	85.6	81.2	468,605
レック	6.7	11.5	16,847
三光合成	－	9.2	3,091
きもと	19.3	18.3	3,074
藤森工業	9.5	9.6	28,896
前澤化成工業	7.8	7.4	7,511
未来工業	－	5.8	14,784
ウェーブロックホールディングス	－	2.2	1,740
ＪＳＰ	6.6	6.3	15,189
エフピコ	9.4	8.9	56,871
天馬	8.8	7.4	15,103
信越ポリマー	23.3	19.3	15,613
東リ	28.2	26.8	7,021
ニフコ	20.8	43.1	118,223
バルカー	9.2	8.7	19,140
ユニ・チャーム	240.4	227.9	801,752
ショーエイコーポレーション	－	0.6	545
医薬品（5.8%）			
協和発酵キリン	142	134.7	306,981
武田薬品工業	417.6	938.4	4,315,701
アステラス製薬	1,165.1	991.1	1,616,979
大日本住友製薬	84	79.7	211,762
塩野義製薬	162.2	140.6	906,588
田辺三菱製薬	138.3	112.4	168,375
わかもと製薬	13	12.8	3,520
あすか製薬	12.9	13.3	15,680
日本新薬	29.7	28.1	208,783
ビオフェルミン製薬	1.9	1.8	4,167

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
中外製薬	118.2	112.1	820,572
科研製薬	20.5	19.4	98,358
エーザイ	135.7	128.7	780,565
ロート製薬	62.3	55.1	151,139
小野薬品工業	267.7	253.9	549,058
久光製薬	33.5	31.8	151,686
持田製薬	7.9	8.1	88,857
参天製薬	214.7	203.8	325,468
扶桑薬品工業	4	3.8	9,598
日本ケミファ	1.5	1.4	4,089
ツムラ	40.5	33.3	108,058
日医工	29.9	27.6	41,400
キッセイ薬品工業	21	19	53,086
生化学工業	22	20.9	26,292
栄研化学	9.2	18.9	49,026
日水製薬	4.8	4.5	5,373
鳥居薬品	7.1	5.8	12,777
ＪＣＲファーマ	8	7.6	47,196
東和薬品	5.4	5.2	46,488
富士製薬工業	3.9	7.3	12,344
沢井製薬	22.8	22.1	141,440
ゼリア新薬工業	24.3	21.3	39,383
第一三共	324.4	307.6	1,307,300
キョーリン製薬ホールディングス	31.7	23.7	49,959
大幸薬品	6	4.8	8,923
ダイト	6.6	6.3	17,444
大塚ホールディングス	235.6	204.8	890,060
大正製薬ホールディングス	25.4	24.1	249,676
ペプチドリーム	51.8	53.6	282,472
石油・石炭製品（0.7%）			
日本コークス工業	95.8	90.8	9,261
昭和シェル石油	106.1	51.5	86,623
ニチレキ	14.5	13.7	15,165
ユシロ化学工業	6.4	5.6	7,145
ビーピー・カストロール	4.9	3.8	5,217
富士石油	27.5	26.1	6,759
ＭＯＲＥＳＣＯ	4.1	3.9	5,588
出光興産	95.2	103.9	412,483
ＪＸＴＧホールディングス	1,809.3	1,808	952,454

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コスモエネルギーホールディングス	32.8	31.1	78,745
ゴム製品（0.8%）			
横浜ゴム	65.6	62.2	125,644
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	67.1	55.2	70,987
ブリヂストン	375.3	330.4	1,390,984
住友ゴム工業	116.7	96.6	127,705
藤倉ゴム工業	9.9	9.4	4,089
オカモト	39	7.5	42,675
フコク	5	4.7	4,150
ニッタ	11.7	12.1	42,955
住友理工	22	20.8	18,740
三ツ星ベルト	28	14.1	27,495
バンドー化学	21.6	20.5	22,652
ガラス・土石製品（0.9%）			
日東紡績	16.9	16	31,536
ＡＧＣ	115.9	106.3	400,751
日本板硝子	57.3	51.4	45,900
石塚硝子	1.5	1.8	3,153
日本山村硝子	47	4.5	6,583
日本電気硝子	49	46.5	132,153
オハラ	4.5	4.2	5,124
住友大阪セメント	220	21.7	92,984
太平洋セメント	71.6	67.9	246,137
日本ヒューム	11.4	10.8	8,067
日本コンクリート工業	24.4	23.1	6,329
三谷セキサン	5.9	5	14,610
アジアパイルホールディングス	14.6	15.2	9,044
東海カーボン	102.9	97.6	133,028
日本カーボン	5.8	5.1	24,301
東洋炭素	7.4	6.3	12,663
ノリタケカンパニーリミテド	6.7	6.4	32,832
ＴＯＴＯ	87.2	82.7	372,150
日本碍子	138.4	131.2	213,724
日本特殊陶業	97.3	90.6	188,448
ダントーホールディングス	8	9	945
ＭＡＲＵＷＡ	3.9	3.7	18,759
品川リフラクトリーズ	3	2.8	8,876
黒崎播磨	2.2	2.1	12,138
ヨータイ	6.8	9.4	4,935

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イソライト工業	5.8	5.5	2,799
東京窯業	14.4	13.7	4,973
ニッカトー	3.8	4.9	4,444
フジミインコーポレーテッド	10.1	9.6	23,011
クニミネ工業	－	3.6	2,908
エーアンドエーマテリアル	2.5	2.1	2,188
ニチアス	62	29.4	62,092
ニチハ	17.1	14.9	43,299
鉄鋼（1.0%）			
新日鐵住金	501.7	493.9	969,031
神戸製鋼所	205.2	194.6	163,269
中山製鋼所	15.5	14.7	7,247
合同製鐵	6	5.1	8,736
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	302.8	287.1	544,341
日新製鋼	30.9	－	－
東京製鐵	60	56.9	52,803
共英製鋼	12.6	12	19,116
大和工業	23.8	22.6	67,641
東京鐵鋼	4.6	4.4	5,623
大阪製鐵	7.4	7.1	13,845
淀川製鋼所	16.4	14.4	30,153
東洋鋼鈑	28	－	－
丸一鋼管	39.7	37.6	122,388
モリ工業	3.7	3.2	7,667
大同特殊鋼	19.9	17.4	76,647
日本高周波鋼業	4.1	3.9	2,031
日本冶金工業	92.7	87.9	21,447
山陽特殊製鋼	12.9	13.4	30,940
愛知製鋼	6.3	6	20,820
日立金属	120.8	114.5	148,850
日本金属	2.8	2.5	2,947
大平洋金属	6.9	7.2	19,843
新日本電工	67.1	63.7	14,205
栗本鐵工所	5.7	5.4	7,884
虹技	1.7	1.6	2,220
日本鋳鉄管	12	1.1	965
三菱製鋼	8.3	7.9	12,513
日亜鋼業	16.4	15.5	5,502
日本精線	1.8	1.5	5,017

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エンビプロ・ホールディングス	－	3	1,881
シンニッタン	8.7	16.5	5,791
新家工業	2.6	2.4	3,916
非鉄金属（0.8%）			
大紀アルミニウム工業所	18.4	17.5	11,882
日本軽金属ホールディングス	327.3	289.6	71,531
三井金属鉱業	30.3	28.7	80,675
東邦亜鉛	6.2	5.9	18,644
三菱マテリアル	74.1	70.2	204,422
住友金属鉱山	143.3	145.6	461,552
ＤＯＷＡホールディングス	28.4	24.8	91,016
古河機械金属	18.5	17.5	24,517
エス・サイエンス	53.1	47	2,914
大阪チタニウムテクノロジーズ	11.7	12.3	20,356
東邦チタニウム	20.1	19	17,898
ＵＡＣＪ	17	16.1	34,550
ＣＫサンエツ	－	2	6,210
古河電気工業	37.3	30.7	87,003
住友電気工業	419.2	397.4	587,357
フジクラ	135.4	128.4	53,414
昭和電線ホールディングス	14.1	12.3	8,585
東京特殊電線	1.4	1.4	2,975
タツタ電線	22.2	21.1	9,516
カナレ電気	1.9	1.8	3,454
平河ヒューテック	5.6	4.4	6,586
リョービ	13.8	13.1	31,400
アーレスティ	13.7	13.1	8,541
アサヒホールディングス	19.2	20	43,360
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	6.3	6	8,232
宮地エンジニアリンググループ	3.2	3.2	6,137
トーカロ	31.1	27.4	23,235
アルファＣｏ	3.9	3.7	4,909
ＳＵＭＣＯ	103.2	117.5	145,112
川田テクノロジーズ	2.3	2.4	18,480
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	1.6	2.1	6,081
信和	－	4.3	4,575
東洋製罐グループホールディングス	76.7	67.7	155,642
ホッカンホールディングス	28	5.4	10,535

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コロナ	6.2	5.9	6,377
横河ブリッジホールディングス	20.8	19.8	37,540
駒井ハルテック	2.5	2	3,788
高田機工	1	1	2,622
三和ホールディングス	107.5	109.8	139,555
文化シヤッター	33	31.3	25,478
三協立山	15.5	14.7	21,873
アルインコ	8.1	8.4	8,198
東洋シヤッター	2.9	2.6	1,861
ＬＩＸＩＬグループ	165.3	156.8	230,025
日本フイルコン	8.6	8.1	4,171
ノーリツ	25	23.7	39,626
長府製作所	12.7	10.8	24,462
リンナイ	20	18.9	145,530
ダイニチ工業	6	5.7	3,841
日東精工	15.5	14.7	8,011
三洋工業	1.4	1.4	2,655
岡部	22.7	21.5	20,468
ジーテクト	12.4	11.7	17,842
中国工業	1.7	1.6	889
東プレ	20.9	19.8	41,263
高周波熱錬	21.6	20.5	18,245
東京製綱	8	6.5	6,292
サンコール	6.3	6	3,744
モリテック　スチール	6.6	8.3	3,386
パイオラックス	16.6	17	36,057
エイチワン	8.2	10.4	9,453
日本発條	111.7	105.9	103,358
中央発條	1.3	1.3	3,771
アドバネクス	1.8	1.4	2,291
立川ブラインド工業	4.9	4.7	5,259
三益半導体工業	8.7	9.5	14,231
機械（4.8%）			
日本ドライケミカル	1.5	2.9	3,132
日本製鋼所	36.6	32.2	65,140
三浦工業	48.5	46	113,896
タクマ	38	38.8	50,750
ツガミ	30	23.9	19,024
オークマ	13.1	13.5	77,760

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東芝機械	63	12	25,872
アマダホールディングス	173	164	173,840
アイダエンジニアリング	28.5	29.5	23,570
滝澤鉄工所	3.5	3.3	5,177
ＦＵＪＩ	33.6	31.8	47,477
牧野フライス製作所	57	12.5	51,625
オーエスジー	51.7	52.4	104,695
ダイジェット工業	1.4	1.2	2,036
旭ダイヤモンド工業	33.3	27.9	20,785
ＤＭＧ森精機	62.1	67.3	89,778
ソディック	24.5	23.2	18,699
ディスコ	15.2	14.4	216,720
日東工器	6.9	5.8	12,504
日進工具	3	3.1	7,715
パンチ工業	9.3	7.4	4,410
冨士ダイス	4.2	4.7	3,078
豊和工業	6.2	5.9	5,876
ＯＫＫ	4.3	4.4	3,515
石川製作所	2.9	2.6	4,485
東洋機械金属	8.7	7.6	4,484
津田駒工業	26	2.3	4,112
エンシュウ	29	2.8	3,273
島精機製作所	14.2	14.7	51,009
オプトラン	8.2	10.4	20,872
ＮＣホールディングス	3.6	3.4	1,710
イワキポンプ	－	3.5	3,279
フリュー	8	8.5	8,330
ヤマシンフィルタ	16.7	18.5	13,819
日阪製作所	16.1	13.1	11,711
やまびこ	21.7	20.6	21,424
平田機工	3.1	5	36,850
ペガサスミシン製造	10.5	9.9	6,197
マルマエ	－	2.9	1,998
タツモ	－	3.3	2,389
ナブテスコ	61.7	58.5	181,057
三井海洋開発	11.9	11.3	36,668
レオン自動機	10	10.4	15,932
ＳＭＣ	35.6	31.5	1,261,575
新川	9.2	8	3,376

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホソカワミクロン	4.2	3.7	18,204
ユニオンツール	5.1	4.6	13,266
オイレス工業	14.5	14.9	27,877
日精エー・エス・ビー機械	3.8	3.1	11,718
サトーホールディングス	14.8	12.8	31,756
技研製作所	5.7	7.4	24,568
日本エアーテック	3.8	3.3	1,877
カワタ	－	2.2	2,943
日精樹脂工業	9.4	8.9	7,947
オカダアイヨン	3.3	3.6	4,748
ワイエイシイホールディングス	3.8	4.2	2,982
小松製作所	547.4	486.7	1,243,275
住友重機械工業	64.9	61.5	217,095
日立建機	53	43.1	123,826
日工	3.1	2.9	6,684
巴工業	4.8	4.6	11,463
井関農機	11.3	10.7	17,237
ＴＯＷＡ	8.8	9.2	6,237
丸山製作所	2.5	2.3	3,049
北川鉄工所	5.4	4.8	10,833
ローツェ	5.6	4.7	7,571
タカキタ	3.9	3.7	2,138
クボタ	608.1	575.9	892,932
荏原実業	3.3	3.1	6,088
三菱化工機	3.9	3.7	5,664
月島機械	22.5	21.3	29,905
帝国電機製作所	7.9	7.5	8,422
東京機械製作所	4.4	4.2	1,759
新東工業	26.9	25.5	23,970
澁谷工業	9.9	9.4	30,315
アイチ　コーポレーション	19.6	18.6	13,057
小森コーポレーション	28.5	29.1	33,697
鶴見製作所	9.6	8.4	16,615
住友精密工業	19	1.8	5,376
酒井重工業	2.1	2	5,174
荏原製作所	46.6	47.6	142,800
石井鐵工所	1.7	1.6	3,040
西島製作所	11.6	11	10,032
北越工業	12.7	11.1	12,432

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダイキン工業	154.8	146.7	1,793,407
オルガノ	4.1	3.9	11,992
トーヨーカネツ	4.8	4	8,344
栗田工業	61.4	58.2	157,722
椿本チエイン	67	14.1	54,849
大同工業	4.3	5.1	4,375
木村化工機	9.4	8.9	3,328
アネスト岩田	19.1	16.7	15,631
ダイフク	57.7	59.2	333,888
サムコ	3.1	3	2,508
加藤製作所	5.4	5.5	14,553
油研工業	2.2	1.8	3,160
タダノ	54.7	51.9	52,886
フジテック	36.3	39.1	47,584
ＣＫＤ	31.5	29.9	29,511
キトー	8.6	8.1	13,397
平和	35.1	30	66,930
理想科学工業	11.3	9.5	16,815
ＳＡＮＫＹＯ	28.4	26.9	112,980
日本金銭機械	10.4	11.9	12,911
マースグループホールディングス	7.2	6.8	14,851
福島工業	7	6.6	24,024
オーイズミ	4.8	4.5	1,629
ダイコク電機	5.2	4.9	6,928
竹内製作所	19	18	33,678
アマノ	35.1	30.7	75,890
ＪＵＫＩ	16.8	15	16,410
サンデンホールディングス	13.8	13.1	9,759
蛇の目ミシン工業	10.3	9.8	4,527
マックス	17.4	16.5	26,152
グローリー	33.8	29.8	78,195
新晃工業	11.5	10	14,930
大和冷機工業	18.2	15.5	16,941
セガサミーホールディングス	112.4	106.6	139,859
日本ピストンリング	4.1	3.9	6,275
リケン	5.2	5	24,900
ＴＰＲ	12.7	14.5	31,001
ツバキ・ナカシマ	11.4	16.3	30,106
ホシザキ	35.7	31.4	213,520

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大豊工業	9.2	8.8	8,069
日本精工	232.8	220.8	223,008
ＮＴＮ	262.4	231	76,692
ジェイテクト	120.8	103.1	139,700
不二越	105	10	43,900
日本トムソン	36.2	31.9	15,950
ＴＨＫ	70.7	67	180,967
ユーシン精機	5	8.3	8,524
前澤給装工業	4.4	4.2	8,131
イーグル工業	14	13.3	16,279
前澤工業	8.3	7.2	2,419
日本ピラー工業	11.5	10.9	13,766
キッツ	50.5	43.6	34,051
マキタ	147.8	130.8	475,458
日立造船	89.9	85.2	28,712
三菱重工業	190	180.1	828,640
ＩＨＩ	87.1	82.6	214,347
スター精密	18.2	18.3	29,865
電気機器（12.9%）			
日清紡ホールディングス	69.2	59.7	55,222
イビデン	69.4	65.8	108,899
コニカミノルタ	265.4	234.9	252,282
ブラザー工業	138.4	140	279,020
ミネベアミツミ	210.5	199.5	321,394
日立製作所	2,722	483.9	1,702,844
三菱電機	1,133.7	1,074.9	1,508,084
富士電機	342	69.8	224,058
東洋電機製造	4.5	4.2	4,943
安川電機	131.4	124.6	418,656
シンフォニアテクノロジー	73	14.9	19,891
明電舎	96	21.3	32,141
オリジン電気	3.3	2.9	5,800
山洋電気	5.5	5.2	20,566
デンヨー	10.5	9.9	13,315
東芝テック	81	13.5	42,592
芝浦メカトロニクス	16	1.9	6,669
マブチモーター	31.6	29.7	112,563
日本電産	136.4	129.3	1,727,448
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4.1	5.8	8,868

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トレックス・セミコンダクター	－	3.6	4,208
東光高岳	5.7	5.4	7,246
ダブル・スコープ	16.5	15.7	23,628
宮越ホールディングス	4.2	4	3,932
ダイヘン	62	11.8	31,883
田淵電機	15.7	14.9	1,713
ヤーマン	16.4	15.6	18,361
ＪＶＣケンウッド	83.2	82.1	21,510
ミマキエンジニアリング	10.1	9.6	6,153
第一精工	5.3	4.5	4,630
日新電機	26.6	25.2	24,645
大崎電気工業	24.3	21.4	14,766
オムロン	120.5	114.2	581,278
日東工業	18.2	17.2	36,808
ＩＤＥＣ	14	14.4	26,438
正興電機製作所	－	1.9	1,461
不二電機工業	1.2	1.2	1,537
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	204	38.6	82,835
サクサホールディングス	2.9	2.7	4,584
メルコホールディングス	5.5	4.5	16,695
テクノメディカ	2.8	2.4	5,020
日本電気	146.7	139.1	522,320
富士通	1,166	103.6	809,530
沖電気工業	46	46.6	62,024
岩崎通信機	5	5	3,990
電気興業	6.4	5.6	18,200
サンケン電気	66	12.6	25,237
ナカヨ	2.2	2.1	3,139
アイホン	6.4	6.1	11,010
ルネサスエレクトロニクス	58.7	111.4	57,705
セイコーエプソン	168.8	133.4	222,644
ワコム	87.9	77.8	35,087
アルバック	26.1	21.4	65,270
アクセル	4.7	4.5	2,097
ＥＩＺＯ	10.4	9.9	44,104
ジャパンディスプレイ	232.9	254.2	17,794
日本信号	31.3	27.4	26,934
京三製作所	27	23.1	8,477
能美防災	15	14.2	25,602

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホーチキ	8.2	6.8	7,459
星和電機	－	4.3	2,094
エレコム	9.9	10	33,150
パナソニック	1,295.1	1,228	1,154,442
シャープ	78.9	106.6	125,894
アンリツ	82.6	69.2	141,790
富士通ゼネラル	34.6	32.8	47,986
ソニー	757.4	721	3,338,230
ＴＤＫ	59.3	56.2	478,824
帝国通信工業	5	4.7	5,672
タムラ製作所	43.7	41.4	24,219
アルプスアルパイン	97.7	111.9	251,439
池上通信機	36	3.4	3,814
パイオニア	188.9	－	－
日本電波工業	10.2	9.7	3,802
鈴木	4.8	5.8	3,683
日本トリム	2.4	2	11,320
ローランド　ディー．ジー．	5.8	5.5	12,534
フォスター電機	13.3	12.6	19,227
クラリオン	60	－	－
ＳＭＫ	29	3	7,749
ヨコオ	7.3	7.7	12,004
ティアック	81	7.7	1,470
ホシデン	28.6	31.6	28,566
ヒロセ電機	18.3	15.4	175,406
日本航空電子工業	29	24.6	36,752
ＴＯＡ	12.2	11.5	12,029
マクセルホールディングス	22.5	23.1	36,498
古野電気	13.5	13.8	13,800
ユニデンホールディングス	31	3.2	6,944
アルパイン	27	－	－
スミダコーポレーション	11.6	9.2	13,836
アイコム	6.3	5.9	13,292
リオン	4.8	4.9	10,270
本多通信工業	8.8	9.2	4,922
船井電機	11.4	10.9	7,706
横河電機	113.5	107.6	233,169
新電元工業	4	3.8	16,150
アズビル	34	69.4	175,929

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東亜ディーケーケー	5.6	5.3	3,943
日本光電工業	47.4	47.4	163,530
チノー	3.9	3.7	4,858
共和電業	12.8	11.2	4,334
日本電子材料	4.5	4.2	2,746
堀場製作所	22.5	21.3	126,309
アドバンテスト	63.2	73.3	183,103
小野測器	4.8	5	3,015
エスペック	10	9.5	19,028
キーエンス	55.6	52.8	3,647,952
日置電機	5.9	5.6	25,732
シスメックス	88.2	83.8	565,314
日本マイクロニクス	19.7	17.4	12,719
メガチップス	8.9	8.5	13,566
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6.6	6.3	22,963
澤藤電機	1.2	1.3	2,080
原田工業	－	3.3	3,039
コーセル	15.7	13.7	15,850
イリソ電子工業	9.5	9.8	48,412
新日本無線	6.9	－	－
オプテックスグループ	9.2	18.9	33,112
千代田インテグレ	5.5	4.5	8,914
アイ・オー・データ機器	4.7	4	4,556
レーザーテック	23.2	22	105,270
スタンレー電気	86.7	76	221,692
岩崎電気	4.4	4.2	5,783
ウシオ電機	68.8	65.2	85,477
岡谷電機産業	6.1	7.6	2,834
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9.6	9.9	6,870
エノモト	－	2.2	1,929
日本セラミック	11.5	10.9	31,490
遠藤照明	5.7	5.4	4,060
古河電池	8.1	7.7	5,351
双信電機	4.9	5.2	2,813
山一電機	8.2	7.8	8,346
図研	7.4	7	10,129
日本電子	41	21.2	40,619
カシオ計算機	91.2	95.1	136,944
ファナック	107.7	102.1	1,919,480

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本シイエムケイ	20	27.4	17,371
エンプラス	5.1	4.9	14,033
大真空	4.1	3.9	4,122
ローム	50.9	52	357,760
浜松ホトニクス	82.6	77.1	321,121
三井ハイテック	14.9	11.9	12,114
新光電気工業	42.8	36.1	29,963
京セラ	186.1	163.8	1,032,759
太陽誘電	50.9	47.8	98,515
村田製作所	118.9	112.8	1,806,492
ユーシン	17.1	15	14,745
双葉電子工業	18.5	17.6	31,680
北陸電気工業	4.6	4	4,168
ニチコン	35.7	33.8	32,887
日本ケミコン	9.2	7.6	14,341
ＫＯＡ	15.7	16.2	24,397
市光工業	16.9	16.1	9,531
小糸製作所	67.9	64.4	393,484
ミツバ	20.9	19.8	12,375
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	21.5	18.6	82,305
キヤノン電子	10.4	9.9	16,938
キヤノン	610.3	578.7	1,817,118
リコー	340.9	323.2	364,892
象印マホービン	－	20	21,240
ＭＵＴＯＨホールディングス	1.5	1.5	2,874
東京エレクトロン	75.6	71.7	1,161,540
輸送用機器（7.9%）			
トヨタ紡織	33	37.6	63,356
芦森工業	2.3	2.2	3,469
ユニプレス	21.9	20.8	35,713
豊田自動織機	91.8	87	486,330
モリタホールディングス	18.2	18.8	32,712
三櫻工業	14.4	13.6	6,949
デンソー	251.5	236.7	1,040,059
東海理化電機製作所	29.9	28.3	52,977
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	40.9	38.8	42,951
川崎重工業	88.2	83.6	221,707
名村造船所	34	32.3	12,015
サノヤスホールディングス	13.8	14.1	2,495

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本車輌製造	41	3.9	10,416
三菱ロジスネクスト	13.5	12.8	14,912
近畿車輛	1.7	1.6	3,174
日産自動車	1,337.1	1,267.7	1,198,483
いすゞ自動車	328.5	339.8	497,127
トヨタ自動車	1,378.2	1,197.9	7,918,119
日野自動車	161.8	134.2	126,282
三菱自動車工業	419.6	397.9	234,761
エフテック	7.2	7.5	6,772
レシップホールディングス	4.1	3.8	2,926
ＧＭＢ	1.8	2.1	1,810
ファルテック	2	1.9	1,736
武蔵精密工業	12.1	26.1	38,732
日産車体	44.3	21	19,971
新明和工業	49.3	48.3	64,673
極東開発工業	21.1	21.4	32,035
日信工業	23	19.7	28,171
トピー工業	9.3	8.8	19,888
ティラド	4.1	3.9	8,853
曙ブレーキ工業	52.7	59	7,729
タチエス	19.2	18.2	28,555
ＮＯＫ	60.9	57.8	100,109
フタバ産業	34.7	29.9	15,548
ＫＹＢ	11.8	11.2	31,169
大同メタル工業	14.2	17.4	12,580
プレス工業	60.2	53.3	31,287
ミクニ	14.4	13.6	5,848
太平洋工業	23.7	22.5	34,155
ケーヒン	26	24.7	44,385
河西工業	13.9	13.2	11,444
アイシン精機	93.3	88.5	357,982
マツダ	355.8	337.4	418,207
今仙電機製作所	10.5	10	9,860
本田技研工業	1,020.1	906.8	2,686,395
スズキ	224.7	196.7	979,172
ＳＵＢＡＲＵ	352	333.7	894,316
安永	5.5	5.2	7,030
ヤマハ発動機	160.1	151.8	321,057
ショーワ	29.4	25.4	35,915

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＴＢＫ	13.5	12.8	5,363
エクセディ	13.7	14.6	35,667
豊田合成	41.2	34.7	81,371
愛三工業	19.9	16.8	11,373
盟和産業	1.7	1.6	1,729
日本プラスト	4.6	8.4	6,468
ヨロズ	11.5	10	15,800
エフ・シー・シー	18.5	19.3	44,525
シマノ	45.7	43.3	724,842
テイ・エス　テック	26.3	25	78,750
ジャムコ	5.7	5.4	12,792
精密機器（2.0%）			
テルモ	173.8	152.1	1,030,477
クリエートメディック	3.7	3.5	3,276
日機装	39.2	34.7	43,860
島津製作所	135.5	138.3	414,761
ＪＭＳ	10.4	9.9	6,623
クボテック	2.4	2.3	834
長野計器	8.9	8.4	6,694
ブイ・テクノロジー	2.7	2.5	34,150
東京計器	7.2	6.8	7,575
愛知時計電機	1.5	1.4	5,684
インターアクション	4.5	5	8,070
オーバル	11.1	10.5	2,541
東京精密	20.5	19.4	53,524
マニー	13.8	13.1	67,203
ニコン	197.5	187.3	287,318
トプコン	60.9	57.7	77,548
オリンパス	168.9	160.1	755,672
理研計器	10.8	9.5	20,168
タムロン	9.1	9.5	19,038
ＨＯＹＡ	230.8	216.4	1,578,854
シード	1.2	4.6	5,510
ノーリツ鋼機	11.5	8.5	20,196
エー・アンド・デイ	10.3	9.8	7,330
朝日インテック	－	45.6	228,912
シチズン時計	135.3	117.6	71,736
リズム時計工業	4.3	3.6	4,957
大研医器	10.1	8.5	4,726

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
メニコン	15.5	14.7	46,231
シンシア	0.9	1.6	995
松風	5.5	5.2	6,734
セイコーホールディングス	17.5	16.6	43,790
ニプロ	78.5	74.4	106,020
その他製品（2.0%）			
中本パックス	2.2	3	4,446
スノーピーク	3.5	4.1	5,768
パラマウントベッドホールディングス	12	12.4	59,644
トランザクション	5.1	5.8	4,141
ＳＨＯ－ＢＩ	3.8	3.1	1,057
ニホンフラッシュ	5.3	4.6	8,537
前田工繊	11.3	11.8	30,101
永大産業	15	14.1	5,781
アートネイチャー	12.1	11.5	7,314
バンダイナムコホールディングス	117.2	111.1	571,054
アイフィスジャパン	2.5	2.4	1,399
共立印刷	18.8	17.9	3,866
ＳＨＯＥＩ	5.1	5.2	23,946
フランスベッドホールディングス	13.4	15.2	13,832
パイロットコーポレーション	19.8	18.7	80,784
萩原工業	6.3	6	8,406
トッパン・フォームズ	24.3	23	21,390
フジシールインターナショナル	25.4	24.1	92,905
タカラトミー	47.4	45	54,000
廣済堂	10.5	9.1	7,471
エステールホールディングス	3.3	2.9	1,992
アーク	47.7	41	4,018
タカノ	5	4.2	3,549
プロネクサス	10.6	9.2	11,049
ホクシン	8	6.6	884
ウッドワン	3.8	3.6	3,758
大建工業	8.9	8.1	17,828
凸版印刷	320	151.7	249,394
大日本印刷	148.4	151.5	370,872
図書印刷	7.6	10.1	9,898
共同印刷	3.5	3.3	7,698
ＮＩＳＳＨＡ	23.3	22.1	25,194
光村印刷	1	0.9	2,123

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
宝印刷	5.9	5.2	8,439
アシックス	112.6	106.7	148,953
ツツミ	3.5	3.4	7,180
小松ウオール工業	3.8	3.3	6,220
ヤマハ	76.4	63.9	349,533
河合楽器製作所	3.8	3.3	10,692
クリナップ	10.5	10	5,720
ピジョン	68.5	65	295,425
兼松サステック	0.9	0.7	1,116
キングジム	9.4	8.9	7,467
リンテック	26.9	25.6	60,774
イトーキ	23.9	19.8	10,058
任天堂	69.8	66.2	2,015,790
三菱鉛筆	18.7	17.7	37,329
タカラスタンダード	23.4	22.2	37,051
コクヨ	54.4	51.6	81,631
ナカバヤシ	11.1	10.6	5,713
グローブライド	5.1	5.2	13,920
オカムラ	39.6	37.5	42,225
美津濃	11.2	10.6	27,570
電気・ガス業（2.0%）			
東京電力ホールディングス	905	858.1	603,244
中部電力	346.8	328.9	579,192
関西電力	462.6	438.6	750,006
中国電力	156.7	148.6	216,064
北陸電力	111.1	105.3	93,506
東北電力	265.5	251.7	365,971
四国電力	102.1	96.8	132,712
九州電力	250.4	221.5	292,823
北海道電力	113.7	100.6	65,289
沖縄電力	18.3	19.9	39,461
電源開発	90.2	85.5	234,526
エフオン	5.7	5.1	3,733
イーレックス	17.9	18.7	19,653
レノバ	－	13.2	12,249
東京瓦斯	241.9	210.9	647,884
大阪瓦斯	220	208.6	478,737
東邦瓦斯	56.2	53.2	266,000
北海道瓦斯	30	5.8	8,357

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
広島ガス	23.3	22.1	7,735
西部瓦斯	13.7	12.1	29,185
静岡ガス	32.2	33.1	29,227
メタウォーター	6.4	5.2	15,860
陸運業（4.9%）			
ＳＢＳホールディングス	11.2	10.6	18,221
東武鉄道	121.1	113.4	358,911
相鉄ホールディングス	36.3	36.8	122,176
東京急行電鉄	307.9	292	556,260
京浜急行電鉄	155.3	147.2	267,020
小田急電鉄	168.6	172.2	448,408
京王電鉄	63.3	60.1	416,493
京成電鉄	78.9	80.6	313,131
富士急行	15.5	14.7	60,270
新京成電鉄	2.9	2.8	5,955
東日本旅客鉄道	203.6	191.1	2,012,283
西日本旅客鉄道	102.3	96.4	795,107
東海旅客鉄道	101.5	96.2	2,364,596
西武ホールディングス	144.5	137	252,354
鴻池運輸	16	17.1	30,557
西日本鉄道	31.4	29.8	79,566
ハマキョウレックス	8	8.2	34,645
サカイ引越センター	6	5.6	38,808
近鉄グループホールディングス	107.4	101.8	517,144
阪急阪神ホールディングス	143.2	135.8	549,990
南海電気鉄道	50.9	45.4	138,016
京阪ホールディングス	47.8	45.3	202,038
神戸電鉄	2.6	2.6	10,387
名古屋鉄道	84.5	81.5	244,500
山陽電気鉄道	8.3	7.8	17,534
日本通運	42.2	40	244,000
ヤマトホールディングス	188.2	178.5	512,205
山九	27.5	28.3	149,707
丸運	6.1	5.8	1,664
丸全昭和運輸	38	8.2	24,157
センコーグループホールディングス	64.6	56.1	51,387
トナミホールディングス	2.6	2.4	14,616
ニッコンホールディングス	40.8	38.7	101,432
日本石油輸送	1.3	1.2	3,470

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
福山通運	15.7	13	53,950
セイノーホールディングス	80.4	76.2	114,985
エスライン	－	3.1	3,357
神奈川中央交通	2.7	2.5	9,800
日立物流	23.6	22.4	72,912
丸和運輸機関	5.6	5.4	20,574
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	11.8	10.3	13,163
九州旅客鉄道	90.1	85.4	311,283
ＳＧホールディングス	76.1	96.2	304,954
海運業（0.2%）			
日本郵船	89.8	85.1	137,691
商船三井	67.9	60.4	143,872
川崎汽船	49.6	31.4	37,020
ＮＳユナイテッド海運	5.1	5.6	13,944
明治海運	11.4	10.8	3,661
飯野海運	54.7	48.2	18,605
共栄タンカー	0.8	0.9	1,335
乾汽船	8.3	9.1	7,425
空運業（0.6%）			
日本航空	199.2	186.4	713,539
ＡＮＡホールディングス	210.4	186.1	738,817
パスコ	10	2	1,678
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	3	2.8	18,256
日新	9.3	8.8	16,033
三菱倉庫	37.2	35.2	104,649
三井倉庫ホールディングス	61	12.5	22,287
住友倉庫	74	38.3	53,390
澁澤倉庫	5.9	5.6	9,486
東陽倉庫	19.4	18.4	5,740
日本トランスシティ	26	22.4	10,640
ケイヒン	2.1	2	2,808
中央倉庫	6.5	6.2	6,348
川西倉庫	2.2	2.1	2,746
安田倉庫	9.6	8.4	7,686
ファイズ	－	1.4	1,090
東洋埠頭	3.3	3.1	4,628
宇徳	9.2	8.7	4,802
上組	67.6	62.8	158,256

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンリツ	2.7	2.4	1,694
キムラユニティー	2.9	2.7	2,988
キユーソー流通システム	3.1	2.5	5,050
近鉄エクスプレス	20.3	19.2	33,408
東海運	6.1	5.8	1,624
エーアイテイー	7.6	6.6	7,293
内外トランスライン	3.8	3.2	4,220
日本コンセプト	2.1	2.8	2,592
情報・通信業（8.4%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	12.3	11.6	30,276
クロスキャット	－	2.1	2,139
システナ	8.9	37.6	42,112
デジタルアーツ	5.5	5.7	49,932
新日鉄住金ソリューションズ	17.5	15.8	45,914
キューブシステム	6.5	5.6	4,384
エイジア	1.7	2.1	2,874
コア	4.7	4.5	5,247
ソリトンシステムズ	3.6	5.9	6,348
ソフトクリエイトホールディングス	5.3	4.6	6,812
ＴＩＳ	37.1	35.2	175,824
ネオス	3.3	3.8	3,853
電算システム	3.9	4	13,240
グリー	59.6	72.8	33,269
コーエーテクモホールディングス	19	21.6	44,733
三菱総合研究所	4.8	4.1	13,735
ボルテージ	2.2	1.9	1,003
電算	1.2	1.2	2,538
ＡＧＳ	6.3	6	4,332
ファインデックス	9.2	8.9	6,586
ヒト・コミュニケーションズ	2.5	－	－
ブレインパッド	2.4	2	12,080
ＫＬａｂ	21.6	18.9	15,989
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	8	14	14,966
イーブックイニシアティブジャパン	1.8	1.7	2,655
ネクソン	124	268.7	448,729
アイスタイル	27.9	27	22,194
エムアップ	3.7	3.6	10,011
エイチーム	7.6	6.6	11,576
テクノスジャパン	10.1	8.9	6,327

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ｅｎｉｓｈ	3.6	3.7	1,524
コロプラ	36.2	30.2	20,596
モバイルクリエイト	9	－	－
オルトプラス	5.4	6.5	1,891
ブロードリーフ	27.6	52.3	29,915
クロス・マーケティンググループ	－	2.9	1,145
デジタルハーツホールディングス	5.9	4.8	5,980
システム情報	－	2.1	3,645
メディアドゥホールディングス	3.6	3.2	8,985
じげん	－	11.2	6,260
ブイキューブ	6.8	5.6	2,564
エンカレッジ・テクノロジ	－	1	1,068
サイバーリンクス	1.7	1.6	1,649
ディー・エル・イー	7.2	7.4	1,339
フィックスターズ	1.9	10.1	13,271
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5.6	5.6	5,577
オプティム	1.9	2.3	11,960
セレス	3.4	3.4	6,922
ベリサーブ	1.5	0.9	6,003
ティーガイア	11.1	10.6	19,906
セック	1.1	1.7	5,465
日本アジアグループ	11.7	11.1	3,774
豆蔵ホールディングス	8.3	7.2	7,113
テクマトリックス	6.1	7.4	13,246
プロシップ	1.6	3	3,768
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	301.6	254.2	101,680
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	7.8	17.4	129,282
ザッパラス	5.3	5.5	2,277
システムリサーチ	1.1	1.4	4,025
インターネットイニシアティブ	18.1	17.2	38,717
さくらインターネット	13.2	12.6	6,627
ヴィンクス	2.3	3.5	3,297
ＧＭＯクラウド	2.5	2.3	8,199
ＳＲＡホールディングス	5.9	5.6	13,977
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	2.2	2.1	3,315
システムインテグレータ	1.6	3	2,334
朝日ネット	10.1	8.5	4,437
ｅＢＡＳＥ	2.2	3.1	7,458
アバント	－	3.8	5,574

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アドソル日進	4.3	3.7	5,879
フリービット	7.4	6.3	5,877
コムチュア	5.7	5.9	19,352
サイバーコム	2	1.9	3,828
アステリア	－	5.3	5,029
マークラインズ	－	3.6	4,802
メディカル・データ・ビジョン	4.2	9.4	10,246
ｇｕｍｉ	12.8	13.5	9,436
ショーケース・ティービー	2.1	2.3	1,619
モバイルファクトリー	2	2.9	4,033
テラスカイ	－	0.6	2,112
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	1.8	4.7	6,650
ＰＣＩホールディングス	1.9	1.8	4,406
パイプドHD	1.7	1.6	1,374
アイビーシー	1.2	1.7	2,544
ネオジャパン	2	2	1,774
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	－	0.7	1,407
ランドコンピュータ	－	1.2	1,430
ダブルスタンダード	－	0.7	3,612
オープンドア	4.4	5.2	17,082
マイネット	2.2	3.4	3,396
アカツキ	2.2	3.7	21,608
ベネフィットジャパン	－	0.6	529
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1.2	1.9	2,523
ＬＩＮＥ	33.6	32.1	121,177
カナミックネットワーク	－	1.6	3,043
ノムラシステムコーポレーション	－	0.9	631
チェンジ	－	1.4	5,152
シンクロ・フード	0.9	4.5	2,520
オークネット	3.5	5.5	6,803
エイトレッド	－	0.8	953
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9.1	11.5	8,774
マクロミル	10.4	18.7	25,600
ビーグリー	－	2	1,862
オロ	－	1	5,640
ソルクシーズ	4.2	4.5	3,442
フェイス	3.9	4.2	3,456
プロトコーポレーション	－	3.3	6,157
ハイマックス	1.5	1.3	2,373

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
野村総合研究所	70.7	67.1	328,119
サイバネットシステム	9.1	8.7	4,785
ＣＥホールディングス	3.1	2.8	2,094
日本システム技術	1.3	1.7	2,369
インテージホールディングス	12.9	13.5	11,434
東邦システムサイエンス	3.7	3.1	2,842
ソースネクスト	15.6	40.9	18,200
インフォコム	－	8.7	15,616
ＦＩＧ	－	9.3	2,883
アルテリア・ネットワークス	－	8.8	10,859
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	－	2.4	3,804
フォーカスシステムズ	6.3	7.1	6,638
クレスコ	2.5	3.2	10,576
フジ・メディア・ホールディングス	116.5	109.4	164,756
オービック	35.1	36.6	396,744
ジャストシステム	18.1	15	41,355
ＴＤＣソフト	4.9	9.2	7,838
ヤフー	802.1	687.7	185,679
トレンドマイクロ	54.3	56.2	283,810
インフォメーション・ディベロプメント	3.5	3	4,245
日本オラクル	18	21.4	161,998
アルファシステムズ	3.7	3.3	8,976
フューチャー	15.1	14.3	24,867
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8.3	7.5	10,222
ソフトバンク・テクノロジー	4.6	4.5	10,962
トーセ	3	2.8	2,466
オービックビジネスコンサルタント	5.7	10.8	45,522
伊藤忠テクノソリューションズ	25.3	48.1	121,933
アイティフォー	13.5	12.8	11,737
東計電算	2	1.6	4,800
エックスネット	1.7	1.9	1,710
大塚商会	33.4	57.1	220,977
サイボウズ	14.9	12.3	9,815
ソフトブレーン	8.7	8.3	3,776
電通国際情報サービス	6.9	6.5	23,887
デジタルガレージ	20	20.5	62,217
ＥＭシステムズ	7.7	8.6	11,283
ウェザーニューズ	3.8	3.6	11,142
ＣＩＪ	8.7	8.2	6,609

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東洋ビジネスエンジニアリング	1.1	1.1	2,480
日本エンタープライズ	11.4	10.8	1,836
WOWOW	5.3	5.1	15,141
スカラ	8.9	7.4	5,801
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	9.4	8.9	5,144
ネットワンシステムズ	45.4	37.3	97,837
システムソフト	26.3	25	2,475
アルゴグラフィックス	5.1	4.5	20,025
マーベラス	18.9	16.1	14,119
エイベックス	20.6	18.1	25,774
日本ユニシス	30.9	32.9	91,988
兼松エレクトロニクス	7.1	5.7	18,610
東京放送ホールディングス	67	70	142,030
日本テレビホールディングス	102.1	96.8	160,784
朝日放送グループホールディングス	11	10.5	8,379
テレビ朝日ホールディングス	30.6	29	56,666
スカパーＪＳＡＴホールディングス	84.9	80.5	38,076
テレビ東京ホールディングス	9.1	8.6	20,244
日本ＢＳ放送	3.8	3.6	3,751
ビジョン	2.9	3.3	15,840
スマートバリュー	－	2.3	1,860
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2.9	4	3,524
ワイヤレスゲート	5.2	4.6	1,913
コネクシオ	7.9	7.5	10,552
日本通信	100.3	91	10,283
クロップス	2.4	1.9	1,318
日本電信電話	798.4	721.4	3,433,864
ＫＤＤＩ	1,001.7	929.5	2,274,021
ソフトバンク	－	838.7	1,082,342
光通信	13.4	12.4	254,324
ＮＴＴドコモ	823.5	757.4	1,843,132
エムティーアイ	15	12.2	7,612
ＧＭＯインターネット	40.5	38.4	68,659
アイドママーケティングコミュニケーション	1.8	2.3	1,145
カドカワ	32.4	30.8	36,436
学研ホールディングス	3.7	3.5	18,830
ゼンリン	13.4	21	52,815
昭文社	5.1	4.9	2,058
インプレスホールディングス	9.2	8.7	1,235

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アイネット	6.3	6	7,716
松竹	7.4	7	82,390
東宝	73.2	69.4	293,909
東映	4.2	4.4	65,780
エヌ・ティ・ティ・データ	345.6	280.8	329,940
ピー・シー・エー	1.6	1.3	3,913
ビジネスブレイン太田昭和	1.9	1.8	3,304
ＤＴＳ	11.5	11.8	47,790
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51.7	49.1	186,089
シーイーシー	6.6	11.3	22,859
カプコン	23.8	45.2	111,146
アイ・エス・ビー	2.2	2	3,778
ジャステック	6.4	6.1	5,764
ＳＣＳＫ	25.7	27.8	133,718
日本システムウエア	3.7	3.5	7,899
アイネス	14.1	13.4	17,138
ＴＫＣ	10.3	8.9	35,733
富士ソフト	15.4	15.7	64,841
ＮＳＤ	18.3	17.3	43,665
コナミホールディングス	45.5	43.1	209,035
福井コンピュータホールディングス	3.2	3.5	6,762
ＪＢＣＣホールディングス	8.8	8.3	11,495
ミロク情報サービス	9.8	10.5	29,326
ソフトバンクグループ	503.6	440.8	4,718,764
卸売業（5.1%）			
ホウスイ	0.9	0.8	675
高千穂交易	4.3	4.1	4,079
伊藤忠食品	2.8	2.6	12,870
エレマテック	5.2	4.9	8,310
ＪＡＬＵＸ	3.1	3	7,785
あらた	5.5	5.9	22,449
トーメンデバイス	1.7	1.6	3,992
東京エレクトロン　デバイス	4	3.8	6,862
フィールズ	8.5	9.3	6,528
双日	660.8	584.7	232,710
アルフレッサ　ホールディングス	124.1	117.6	363,384
横浜冷凍	27.8	27.7	24,459
神栄	1.5	1.5	1,150
ラサ商事	4.9	5.6	4,810

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ラクーンホールディングス	6.5	5	3,360
アルコニックス	11.8	11.2	14,179
神戸物産	7.2	16	62,320
ペッパーフードサービス	6	－	－
あい　ホールディングス	17.9	15.1	27,225
ディーブイエックス	4	4.1	4,091
ダイワボウホールディングス	9.5	9.6	60,000
マクニカ・富士エレホールディングス	20.9	29.3	43,393
ラクト・ジャパン	1.5	2.3	19,711
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21	19.9	21,372
八洲電機	8.6	8.2	6,781
メディアスホールディングス	2.1	6	3,774
ＵＫＣホールディングス	7.2	6.8	13,198
ジューテックホールディングス	2.5	2.4	2,592
大光	2.8	3.4	2,216
ＯＣＨＩホールディングス	3.2	3.1	4,048
ＴＯＫＡＩホールディングス	59	55.9	48,018
黒谷	－	1.8	799
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1.7	1.8	1,576
三洋貿易	6.1	5.3	9,709
ビューティガレージ	1.5	1.7	2,267
ウイン・パートナーズ	8.1	6.9	8,273
ミタチ産業	2.6	3.2	2,332
シップヘルスケアホールディングス	23.3	22.1	97,682
明治電機工業	3.8	3.3	5,534
デリカフーズホールディングス	2.2	1.9	2,494
スターティアホールディングス	2.5	2.1	1,167
コメダホールディングス	20.6	24.5	51,033
富士興産	4.3	4.1	2,824
協栄産業	1.3	1.3	1,977
小野建	9.7	9.5	15,238
南陽	－	2.2	4,617
佐鳥電機	8.2	7.8	7,183
エコートレーディング	2.5	2.4	1,320
伯東	6.8	7.2	8,697
コンドーテック	8.9	8.2	8,175
中山福	6.4	6.1	3,446
ナガイレーベン	14.8	15.3	35,939
三菱食品	12.3	11.6	32,967

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
松田産業	8.1	7.7	10,818
第一興商	16.6	15.8	85,794
メディパルホールディングス	111.9	114.2	293,037
ＳＰＫ	2.4	2.3	5,430
萩原電気ホールディングス	3.9	3.9	12,070
アズワン	8.7	7.6	65,892
スズデン	3.9	3.7	6,811
尾家産業	3.3	3.4	4,362
シモジマ	6.8	6.5	7,800
ドウシシャ	11.8	10	17,300
小津産業	2.4	2.3	4,353
高速	6.6	6.3	7,673
たけびし	3.9	3.7	5,402
リックス	2.5	2.4	3,808
丸文	9.9	9.4	6,241
ハピネット	7.6	8.8	13,376
橋本総業ホールディングス	2.3	1.9	3,021
日本ライフライン	31.8	33.2	59,361
タカショー	－	5.1	2,198
エクセル	4.5	3.9	9,789
マルカキカイ	3.6	3.4	7,072
ＩＤＯＭ	33.9	35.7	11,316
日本エム・ディ・エム	7.5	6.2	6,634
進和	6.6	6.3	13,368
エスケイジャパン	2.7	2.6	1,994
ダイトロン	5.1	4.8	7,756
シークス	7.1	13.5	21,546
田中商事	3.4	3.5	2,100
オーハシテクニカ	6.3	6	8,826
白銅	4	3.4	5,729
伊藤忠商事	819.4	740.5	1,498,401
丸紅	917.6	1,044	819,957
高島	1.9	1.7	3,136
長瀬産業	67.3	59.5	94,664
蝶理	7.1	6.8	10,669
豊田通商	124.6	118.2	429,066
三共生興	19	18	8,622
兼松	47.6	42.3	54,990
ツカモトコーポレーション	2	1.9	2,420

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井物産	948.5	872.2	1,537,688
日本紙パルプ商事	5.8	6	25,890
日立ハイテクノロジーズ	38.8	32.2	145,866
カメイ	14.6	13.8	15,842
東都水産	1.7	1.5	3,774
ＯＵＧホールディングス	1.8	1.7	4,418
スターゼン	4.4	3.9	15,307
山善	43.6	41.3	47,908
椿本興業	2.5	2.4	9,528
住友商事	704.3	626.1	983,603
内田洋行	5.1	4.9	15,631
三菱商事	783.6	742.9	2,363,907
第一実業	5.1	4.8	15,576
キヤノンマーケティングジャパン	31.9	30.3	65,448
西華産業	6.9	6	8,658
佐藤商事	10	9.5	8,607
菱洋エレクトロ	10.4	10.7	17,334
東京産業	11.1	10.5	5,376
ユアサ商事	10.6	10.8	34,776
神鋼商事	2.5	2.4	6,336
小林産業	7.4	6.3	2,154
阪和興業	20.9	18.4	59,616
正栄食品工業	6.1	5.6	16,912
カナデン	10.7	10.1	12,069
菱電商事	8	8.4	12,474
フルサト工業	6.2	5.8	9,662
岩谷産業	24.8	23.5	85,540
すてきナイスグループ	4.8	4.5	3,987
昭光通商	40	3.8	2,310
ニチモウ	1.7	1.6	2,720
極東貿易	16	3.3	5,342
イワキ	15.7	12.7	4,991
三愛石油	30	28.4	26,298
稲畑産業	26.8	25.4	38,328
ＧＳＩクレオス	3	2.8	3,270
明和産業	10.3	9.8	4,341
クワザワ	－	2.9	1,319
ワキタ	23.8	22.6	24,724
東邦ホールディングス	33.1	31.3	85,104

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンゲツ	37.2	32	64,192
ミツウロコグループホールディングス	16.2	15.3	12,821
シナネンホールディングス	4.6	4.4	9,455
伊藤忠エネクス	24.7	23.4	21,387
サンリオ	31.3	32.7	81,586
サンワテクノス	6.6	6.4	5,708
リョーサン	14	11.7	35,100
新光商事	12.2	10	18,510
トーホー	5	4.8	10,425
三信電気	10.3	8.8	15,910
東陽テクニカ	12.9	12.2	10,614
モスフードサービス	14.6	13.9	39,003
加賀電子	10.1	10.5	21,661
ソーダニッカ	11.5	10.9	6,223
立花エレテック	7.6	7.8	13,080
フォーバル	4.9	4.6	3,693
ＰＡＬＴＡＣ	15.7	19.1	113,836
三谷産業	12.1	12.4	3,534
太平洋興発	4.7	4.2	3,217
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2.3	2.4	10,548
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	0.9	996
国際紙パルプ商事	－	18.5	5,587
ヤマタネ	5.6	5.3	8,421
丸紅建材リース	11	1	1,986
日鉄住金物産	8.7	7.5	35,437
泉州電業	3.7	3.5	9,369
トラスコ中山	23.2	22	63,514
オートバックスセブン	44.4	42.1	77,169
モリト	8.9	7.7	6,213
加藤産業	17.5	16.6	61,005
北恵	－	2	1,802
イノテック	9.6	6.3	6,129
イエローハット	10.5	10	28,510
ＪＫホールディングス	11.2	9.6	5,548
日伝	9.3	8.8	14,238
北沢産業	9.2	7.9	2,030
杉本商事	6	5.7	9,861
因幡電機産業	14.7	15	64,875
バイテックホールディングス	5.1	4.8	9,244

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東テク	3.7	3.5	7,962
ミスミグループ本社	129.7	132.5	346,487
アルテック	9.5	7.8	1,622
タキヒヨー	3.7	3.2	5,446
蔵王産業	1.8	1.7	2,305
スズケン	50.9	48.3	297,045
ジェコス	7.7	7.3	7,453
ルネサスイーストン	10.2	9.7	4,112
小売業（4.7%）			
ローソン	28.2	26.8	164,552
サンエー	8.4	8	34,160
カワチ薬品	8.7	8.2	14,604
エービーシー・マート	20.3	16.5	107,085
ハードオフコーポレーション	4.9	4.2	3,536
アスクル	9.7	11.1	30,291
ゲオホールディングス	20.4	16.1	24,230
アダストリア	17.2	14.7	35,868
ジーフット	6.7	6.4	4,115
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1.4	1.4	1,006
くらコーポレーション	6.6	6.2	31,496
キャンドゥ	5.3	5	8,315
パルグループホールディングス	5.7	5.4	16,659
エディオン	43.4	44.9	44,406
サーラコーポレーション	19.2	21.5	13,201
ワッツ	4.4	3.5	2,492
ハローズ	4.2	4	8,416
フジオフードシステム	－	4.4	11,330
あみやき亭	2.4	2.3	8,579
ひらまつ	15.4	21.1	7,321
大黒天物産	2.7	2.5	9,400
ハニーズホールディングス	10.8	9.3	10,230
ファーマライズホールディングス	2.5	2.5	1,337
アルペン	8.6	8.1	13,875
ハブ	2.1	3.4	3,349
クオールホールディングス	12.3	15.6	22,620
ジンズ	7.6	7.2	42,120
ビックカメラ	65.8	56.5	66,444
ＤＣＭホールディングス	60.2	57.1	58,641
ペッパーフードサービス	－	8.3	18,318

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＭｏｎｏｔａＲＯ	39.7	66.9	158,419
東京一番フーズ	2.8	2.7	1,684
ＤＤホールディングス	2.5	2.3	4,353
きちりホールディングス	3	2.8	2,130
アークランドサービスホールディングス	9.3	7.7	15,692
Ｊ．フロント　リテイリング	133.3	135.4	170,874
ドトール・日レスホールディングス	19.6	18.6	39,227
マツモトキヨシホールディングス	46.2	43.8	157,242
ブロンコビリー	5.8	5.5	14,619
ＺＯＺＯ	109.7	114.4	238,524
トレジャー・ファクトリー	3.2	3.1	2,365
物語コーポレーション	3.2	2.6	23,478
ココカラファイン	11.7	11.9	52,062
三越伊勢丹ホールディングス	208.8	198	221,760
Ｈａｍｅｅ	2.8	3.2	2,400
ウエルシアホールディングス	29.5	28	100,240
クリエイトＳＤホールディングス	16.5	15.6	42,010
丸善ＣＨＩホールディングス	13	12.4	4,364
ミサワ	2	1.9	767
ティーライフ	1.5	1.4	1,234
エー・ピーカンパニー	2.1	2	1,096
チムニー	3.4	3.2	8,604
シュッピン	6.7	7.2	5,673
ネクステージ	11.8	16.3	19,266
ジョイフル本田	16.4	31	41,664
鳥貴族	4.1	3.5	5,922
キリン堂ホールディングス	4	4.2	6,174
ホットランド	6.5	5.5	8,288
すかいらーくホールディングス	69.3	98.7	176,673
ＳＦＰホールディングス	－	3.2	6,054
綿半ホールディングス	4.2	3.9	8,197
ヨシックス	1.8	1.7	5,992
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	37.1	30.8	33,787
ブックオフコーポレーション	6.4	－	－
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.5	4.3	2,631
ＢＥＥＮＯＳ	1.7	2.5	2,795
あさひ	8.3	8.8	13,261
日本調剤	3.9	3.7	13,986
コスモス薬品	5.6	4.7	88,031

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トーエル	5.4	5.1	4,013
一六堂	2.4	－	－
オンリー	1.7	1.8	1,776
セブン＆アイ・ホールディングス	468	443.7	1,881,288
薬王堂	4.9	4.6	11,872
クリエイト・レストランツ・ホールディング	30	28.5	38,133
ツルハホールディングス	24.2	23	206,080
サンマルクホールディングス	8	8.4	21,613
フェリシモ	2.8	2.3	2,497
トリドールホールディングス	13.8	13.1	29,815
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	7.4	9.5	9,300
ウイルプラスホールディングス	－	1.2	979
ジャパンミート	－	4	7,576
サツドラホールディングス	1.8	1.6	2,934
デファクトスタンダード	－	0.7	305
ダイユー・リックホールディングス	5.2	5.7	4,742
バロックジャパンリミテッド	8.9	8.6	7,284
クスリのアオキホールディングス	8.9	10.5	80,010
力の源ホールディングス	－	3	2,340
スシローグローバルホールディングス	10.7	11.6	86,420
ＬＩＸＩＬビバ	10.6	9	12,816
メディカルシステムネットワーク	12.7	11.2	5,801
総合メディカル	4.9	－	－
はるやまホールディングス	5.2	5	4,450
ノジマ	19.6	18.8	36,904
カッパ・クリエイト	13.9	14.8	22,629
ライトオン	9.4	8.9	6,586
ジーンズメイト	3.4	3.2	1,324
良品計画	14.8	15	383,550
三城ホールディングス	13.8	13.1	5,135
アドヴァン	11.4	16.2	16,880
アルビス	2.7	4	9,332
コナカ	14.3	13.5	5,994
ハウス　オブ　ローゼ	1.4	1.3	2,341
Ｇ－７ホールディングス	3.3	3.1	6,888
イオン北海道	11.2	10.6	7,950
コジマ	19.2	15.6	9,328
ヒマラヤ	3	3.3	3,032
コーナン商事	15.9	13.9	37,418

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エコス	4.5	3.9	5,951
ワタミ	13.2	13.9	22,823
マルシェ	2.9	2.8	2,240
パン・パシフィック・インターナショナルホ	72.4	63.4	446,336
西松屋チェーン	24.5	23.2	21,645
ゼンショーホールディングス	57.9	49.9	129,740
幸楽苑ホールディングス	7.1	6.7	17,011
ハークスレイ	2.7	2.2	2,466
サイゼリヤ	16.6	17.4	37,201
ＶＴホールディングス	37.8	35.9	15,293
魚力	3.1	2.9	4,216
ポプラ	2.9	2.8	1,472
フジ・コーポレーション	1.9	2.1	4,645
ユナイテッドアローズ	13.8	12.1	44,709
ハイデイ日高	14.6	15.3	31,793
京都きもの友禅	7.1	6.7	2,713
コロワイド	37.1	35.2	83,740
ピーシーデポコーポレーション	16.7	14	6,216
壱番屋	7.9	7.5	35,137
トップカルチャー	4	3.8	1,219
ＰＬＡＮＴ	2.6	2.4	2,376
スギホールディングス	24.5	23.2	111,824
ヴィア・ホールディングス	9.9	13	8,957
スクロール	17.2	16.3	6,177
ヨンドシーホールディングス	11.4	11.7	24,043
ユニー・ファミリーマートホールディングス	35.7	118.4	340,518
木曽路	13.7	13	35,256
ＳＲＳホールディングス	13.2	12.5	12,912
千趣会	20.2	19.2	4,435
タカキュー	8.6	8.2	1,410
ケーヨー	20.6	19.6	9,584
上新電機	13.2	12.5	31,662
日本瓦斯	20.5	17.2	56,330
ロイヤルホールディングス	19.8	18.5	49,580
東天紅	0.8	0.8	988
いなげや	12.4	11.8	15,328
島忠	27	24	67,968
チヨダ	13.2	11.1	19,203
ライフコーポレーション	8.5	8	18,432

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リンガーハット	13.8	13	30,459
さが美グループホールディングス	10	－	－
ＭｒＭａｘＨＤ	13.9	14.5	6,249
テンアライド	10.3	9.8	4,194
ＡＯＫＩホールディングス	22.3	21.2	25,143
オークワ	16	15.1	16,685
コメリ	17.2	16.3	43,781
青山商事	21.4	18.5	47,101
しまむら	13	12.3	114,390
はせがわ	5.9	5.6	2,223
高島屋	175	83.1	123,652
松屋	22.5	21.3	21,172
エイチ・ツー・オー　リテイリング	52.9	54.3	81,775
近鉄百貨店	4.3	4	13,540
パルコ	10.7	10.2	10,210
丸井グループ	106.9	89.6	198,374
アクシアル　リテイリング	9.3	8.8	29,832
井筒屋	6.1	5.4	1,420
イオン	429.7	407.4	915,835
イズミ	20.2	21.5	106,532
東武ストア	1.3	－	－
平和堂	22.7	21.5	50,288
フジ	13.3	12.8	23,923
ヤオコー	12.7	12	67,200
ゼビオホールディングス	15.2	12.8	15,872
ケーズホールディングス	47.3	110	107,800
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6.6	6.2	4,030
日産東京販売ホールディングス	16.4	15.6	4,882
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4.4	5.2	11,960
総合メディカルホールディングス	－	9.2	15,318
ブックオフグループホールディングス	－	5.5	4,565
アインホールディングス	15	14.2	114,594
元気寿司	2.8	3	15,420
ヤマダ電機	374.2	322.5	180,600
アークランドサカモト	18.9	18	25,416
ニトリホールディングス	44.3	45.8	618,300
グルメ杵屋	8	7.5	9,127
愛眼	8.9	8.4	2,536
ケーユーホールディングス	5.8	5.5	4,735

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
吉野家ホールディングス	36.7	37	64,195
松屋フーズホールディングス	5.4	5.1	19,635
サガミホールディングス	14.9	14.2	18,687
関西スーパーマーケット	8.4	8	8,496
王将フードサービス	8.2	7.8	57,096
プレナス	12.5	11.9	20,420
ミニストップ	8.3	7.8	13,010
アークス	20.9	19.9	47,282
バローホールディングス	26	22.8	60,830
藤久	0.9	0.8	606
ベルク	5	5.2	26,312
大庄	6	5.7	8,601
ファーストリテイリング	18.7	14.2	747,346
サンドラッグ	47.3	39.8	123,977
サックスバー　ホールディングス	10.5	9	10,107
ヤマザワ	2.3	2.2	3,645
やまや	2.3	1.8	4,244
ベルーナ	27.4	26	22,594
銀行業（6.2%）			
島根銀行	2.4	2.2	1,667
じもとホールディングス	75.5	71.6	8,090
めぶきフィナンシャルグループ	581	550.9	158,108
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15.1	14.3	23,595
九州フィナンシャルグループ	183.5	174	81,432
ゆうちょ銀行	316.8	300.4	371,895
富山第一銀行	28.4	25.3	9,563
コンコルディア・フィナンシャルグループ	679.8	675.3	285,651
西日本フィナンシャルホールディングス	75.9	67.9	64,233
関西みらいフィナンシャルグループ	－	49.8	41,533
三十三フィナンシャルグループ	－	9.2	14,710
第四北越フィナンシャルグループ	－	18.4	57,960
新生銀行	96.8	77.8	121,368
あおぞら銀行	66.6	59.2	171,206
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,828.1	7,298.2	4,038,823
りそなホールディングス	1,227.1	1,163.4	566,226
三井住友トラスト・ホールディングス	219.8	208.4	844,645
三井住友フィナンシャルグループ	846.4	747.2	2,925,288
第四銀行	13.7	－	－
北越銀行	11.2	－	－

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
千葉銀行	401	375.5	227,177
群馬銀行	227.1	212.1	98,838
武蔵野銀行	17.8	15.8	35,328
千葉興業銀行	30.7	29.1	8,788
筑波銀行	46.5	44.1	8,467
七十七銀行	35.1	33.3	51,981
青森銀行	8.7	8.2	24,017
秋田銀行	7.2	6.8	15,347
山形銀行	12.6	11.9	23,395
岩手銀行	7.8	7.4	24,346
東邦銀行	100	94.8	28,345
東北銀行	5.7	5.4	5,869
みちのく銀行	7.2	6.8	11,213
ふくおかフィナンシャルグループ	454	86.1	214,475
静岡銀行	295	266.9	226,865
十六銀行	15	14.2	32,915
スルガ銀行	114.4	108.5	55,769
八十二銀行	202.4	191.9	87,122
山梨中央銀行	69	13.1	18,078
大垣共立銀行	17.7	16.8	39,328
福井銀行	9.6	9.1	15,269
北國銀行	12.7	11.3	38,872
清水銀行	3.8	4.4	8,192
富山銀行	2.2	2	6,270
滋賀銀行	105	21.3	56,445
南都銀行	13.1	12.4	26,622
百五銀行	107.3	95.4	34,725
京都銀行	42.7	38	179,360
紀陽銀行	42.1	37.5	57,712
三重銀行	5	－	－
ほくほくフィナンシャルグループ	74.4	70.6	85,214
広島銀行	165.1	156.5	88,892
山陰合同銀行	66.3	62.9	51,326
中国銀行	77.3	68.4	74,145
鳥取銀行	3.6	3.6	5,122
伊予銀行	159.5	140.5	84,019
百十四銀行	119	11.3	26,588
四国銀行	17.1	15.2	16,127
阿波銀行	90	17	48,484

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大分銀行	6.4	6.5	22,620
宮崎銀行	7.4	7.1	19,212
佐賀銀行	6.8	6.4	12,051
十八銀行	69	6.5	18,044
沖縄銀行	10.9	9.7	34,677
琉球銀行	21.7	24.5	29,326
セブン銀行	419.4	358.2	117,131
みずほフィナンシャルグループ	15,192.4	14,406.2	2,500,916
高知銀行	4.1	3.8	2,945
山口フィナンシャルグループ	105	132.3	128,992
長野銀行	3.7	3.5	5,796
名古屋銀行	9	8.6	30,487
北洋銀行	168.6	159.8	45,223
愛知銀行	3.8	3.8	13,433
第三銀行	6.3	－	－
中京銀行	4.6	4.4	9,944
大光銀行	3.8	3.6	5,824
愛媛銀行	15.6	14.8	16,886
トマト銀行	4.3	4.1	4,321
みなと銀行	10.1	－	－
京葉銀行	99	46.8	32,432
関西アーバン銀行	15.6	－	－
栃木銀行	57.9	54.9	12,846
北日本銀行	3.5	3.3	6,804
東和銀行	19.6	18.6	13,689
福島銀行	10.5	9.2	3,422
大東銀行	5.4	5.1	3,253
トモニホールディングス	92.2	82	34,932
フィデアホールディングス	108.6	102.9	13,582
池田泉州ホールディングス	118.7	112.5	33,750
証券、商品先物取引業（0.8%）			
ＦＰＧ	39	33.3	30,702
マーキュリアインベストメント	2.3	4.1	2,771
ＳＢＩホールディングス	126.5	126.3	301,730
日本アジア投資	10.1	9	1,683
ジャフコ	16	17.4	69,426
大和証券グループ本社	957	850.7	466,779
野村ホールディングス	1,923.7	1,865.5	744,334
岡三証券グループ	95	90.3	40,002

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
丸三証券	35.6	31.5	21,514
東洋証券	40	37.9	5,609
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123.8	126.4	52,456
光世証券	2.7	2.5	1,755
水戸証券	34.6	30.7	6,416
いちよし証券	23.5	22.2	17,493
松井証券	54.8	51.9	61,605
だいこう証券ビジネス	5.4	4.3	1,780
マネックスグループ	118.5	99	39,006
カブドットコム証券	70.5	72.2	40,432
極東証券	15	14.2	15,307
岩井コスモホールディングス	11.4	10.9	14,159
藍澤證券	20.9	19.8	13,107
マネーパートナーズグループ	14.3	12.4	3,521
スパークス・グループ	－	25	6,075
小林洋行	3.2	3	831
保険業（2.2%）			
かんぽ生命保険	42.2	40	97,640
ＳＯＭＰＯホールディングス	219.3	186.9	749,469
アニコム　ホールディングス	7.6	8.7	24,159
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	292.4	277.2	929,451
ソニーフィナンシャルホールディングス	91.9	87.1	179,251
第一生命ホールディングス	632.5	599.8	933,588
東京海上ホールディングス	421.3	384.3	2,062,922
アドバンテッジリスクマネジメント	2.7	－	－
Ｔ＆Ｄホールディングス	345.8	327.9	373,642
アドバンスクリエイト	2.6	2.5	4,322
その他金融業（1.2%）			
全国保証	31.5	29.9	120,646
ジェイリース	－	2.2	840
イントラスト	1.8	3	1,371
日本モーゲージサービス	－	1.4	1,859
Ｃａｓａ	－	3.6	3,574
アルヒ	9.5	9.6	20,246
プレミアグループ	－	2.3	7,785
クレディセゾン	84.9	74.3	112,564
アクリーティブ	6.1	－	－
芙蓉総合リース	12.8	12.1	67,518
興銀リース	21	19.9	54,446

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京センチュリー	22.5	21.4	98,975
日本証券金融	45.8	46.7	28,954
アイフル	187.6	161.7	45,599
リコーリース	8.8	8.3	29,133
イオンフィナンシャルサービス	79.4	67.7	153,475
アコム	224.7	213.1	82,682
ジャックス	13.6	11.7	21,843
オリエントコーポレーション	241.9	286.7	33,257
日立キャピタル	30.8	25	65,550
アプラスフィナンシャル	53.6	50.9	4,275
オリックス	745.9	707.3	1,144,411
三菱ＵＦＪリース	283.8	239.2	132,516
九州リースサービス	4.8	5.2	3,634
日本取引所グループ	328.5	286.4	556,761
イー・ギャランティ	5.9	9.9	10,484
アサックス	1.5	4.4	2,415
ＮＥＣキャピタルソリューション	4.5	4.3	7,679
不動産業（2.5%）			
いちご	159.8	134.8	50,145
日本駐車場開発	134.9	127.9	20,975
ヒューリック	233.4	221.3	236,127
三栄建築設計	4.5	4.2	6,703
スター・マイカ	4.1	4.9	6,766
野村不動産ホールディングス	74.4	70.6	152,213
三重交通グループホールディングス	22.7	21.5	12,405
サムティ	9.5	14.6	21,505
ディア・ライフ	11.2	13.6	5,725
コーセーアールイー	1.9	3.1	2,201
エー・ディー・ワークス	148.2	163.4	5,555
日本商業開発	6.3	6.6	10,579
プレサンスコーポレーション	15.3	16.8	23,318
ユニゾホールディングス	13.1	16	33,472
ＴＨＥグローバル社	5.2	5.4	2,640
日本管理センター	7.4	7	5,467
サンセイランディック	3.2	2.8	2,007
エストラスト	1.5	1.4	992
フージャースホールディングス	27.2	23	15,571
オープンハウス	18.2	17.3	66,172
東急不動産ホールディングス	270.7	285.2	186,235

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
飯田グループホールディングス	93.3	88.4	177,772
イーグランド	1.3	1.5	1,074
ムゲンエステート	6.9	7.3	4,380
ビーロット	－	1.6	2,305
ファーストブラザーズ	3.1	2.9	3,097
ハウスドゥ	1.8	5.8	8,027
シーアールイー	1.8	3.5	3,342
プロパティエージェント	－	1.1	1,267
ケイアイスター不動産	4	2.8	4,824
アグレ都市デザイン	－	1.3	733
グッドコムアセット	－	1.8	2,737
ジェイ・エス・ビー	－	0.4	1,520
テンポイノベーション	－	0.9	1,377
グローバル・リンク・マネジメント	－	0.8	544
パーク２４	62	62	150,412
パラカ	3.6	2.7	5,254
三井不動産	558.3	562.5	1,558,406
三菱地所	832.3	742.8	1,480,771
平和不動産	19.7	20.1	43,054
東京建物	122.2	115.9	153,915
ダイビル	28.8	31.2	32,479
京阪神ビルディング	18.5	18.9	19,334
住友不動産	268	238.3	1,109,048
大京	17.8	－	－
テーオーシー	38.5	24.3	18,540
東京楽天地	1.8	1.5	7,215
レオパレス２１	133.4	130.8	30,868
スターツコーポレーション	15.2	14.4	33,523
フジ住宅	14.3	13.5	11,083
空港施設	11.6	12.4	6,807
明和地所	6.1	5.8	3,694
ゴールドクレスト	8.8	8.4	12,852
日本エスリード	4.4	4.1	7,002
日神不動産	14.9	15.7	7,253
日本エスコン	20	19.1	13,828
タカラレーベン	52.4	49.7	18,289
サンヨーハウジング名古屋	5.8	6	5,418
イオンモール	72	53.1	94,730
毎日コムネット	－	2.3	1,736

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ファースト住建	4.2	3.9	4,672
ランド	245.8	432.8	3,462
カチタス	11.4	11.8	41,359
トーセイ	13.6	14.6	14,673
穴吹興産	1.2	1.2	3,438
エヌ・ティ・ティ都市開発	69.5	－	－
サンフロンティア不動産	13.5	14.6	17,155
エフ・ジェー・ネクスト	8.5	9.3	8,286
インテリックス	3.1	3	2,043
ランドビジネス	6.6	5.4	4,255
グランディハウス	9.8	9.3	4,380
日本空港ビルデング	32.7	33.8	159,705
サービス業（4.9%）			
日本工営	7.3	6.9	15,835
ＬＩＦＵＬＬ	37.6	39.8	22,208
ジェイエイシーリクルートメント	8.7	8.3	18,965
日本M&Aセンター	37.5	76.6	231,715
メンバーズ	2.7	3.4	6,096
中広	1.1	1.1	613
タケエイ	11.2	10.7	7,800
Ｅ・Ｊホールディングス	－	1.3	1,400
トラスト・テック	4.9	5.7	20,149
コシダカホールディングス	5.7	27.5	44,082
アルトナー	－	1.9	1,651
パソナグループ	10.3	12.5	18,675
ＣＤＳ	2.9	2.5	2,952
リンクアンドモチベーション	19.9	18.9	14,742
ＧＣＡ	12.3	10.4	8,392
エス・エム・エス	21.4	37.7	70,913
サニーサイドアップ	－	1.1	1,978
パーソルホールディングス	100	102.7	182,908
リニカル	7	5.8	8,085
クックパッド	34	32.3	8,688
エスクリ	3.8	2.8	1,811
アイ・ケイ・ケイ	6.3	5	3,975
学情	4.9	4.2	5,170
スタジオアリス	5.4	5.2	11,653
シミックホールディングス	6	5.7	8,926
ＮＪＳ	2.7	2.3	3,261

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
綜合警備保障	43.1	40.9	189,776
カカクコム	81.5	76.9	152,954
アイロムグループ	3.7	3.9	5,690
セントケア・ホールディング	4.6	5.6	3,052
サイネックス	1.6	1.7	1,232
ルネサンス	5.3	5.7	11,679
ディップ	15.3	16.6	30,344
オプトホールディング	7.5	6.3	10,754
新日本科学	13.2	13.9	11,523
ツクイ	25.5	24.2	17,375
キャリアデザインセンター	2.5	2.6	3,304
ベネフィット・ワン	－	28.5	55,689
エムスリー	114	216.2	382,674
ツカダ・グローバルホールディング	8.6	6.5	3,880
ブラス	0.6	0.8	473
アウトソーシング	32.3	54.1	71,357
ウェルネット	10.9	9.7	10,233
ワールドホールディングス	3.6	2.8	5,020
ディー・エヌ・エー	58.4	55.4	94,013
博報堂ＤＹホールディングス	150.5	142.8	248,186
ぐるなび	17.1	14.6	10,366
エスアールジータカミヤ	12.8	10.6	6,996
ジャパンベストレスキューシステム	13.4	8.1	12,765
ファンコミュニケーションズ	30.1	28.2	16,045
ライク	4.2	4	3,640
ビジネス・ブレークスルー	5	4.3	1,711
ＷＤＢホールディングス	4.9	4.7	14,194
ティア	5.7	5.2	3,426
ＣＤＧ	1	0.9	1,162
バリューコマース	9.7	6.9	15,373
インフォマート	54.8	56.3	73,471
ＪＰホールディングス	34	29.3	8,497
エコナックホールディングス	21.1	18.5	2,238
ＥＰＳホールディングス	16.3	15.5	28,272
レッグス	2.7	2.5	2,137
プレステージ・インターナショナル	22.5	19.2	24,595
アミューズ	7.2	6.2	15,152
ドリームインキュベータ	3.6	3.1	4,935
クイック	6.7	6.4	11,366

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＴＡＣ	6.5	5.6	1,243
ケネディクス	143.5	90.2	49,970
電通	132	125.1	572,332
テイクアンドギヴ・ニーズ	5.1	3.9	5,514
ぴあ	3.6	2.9	13,122
イオンファンタジー	3.5	3.3	9,177
シーティーエス	10.7	11.6	7,180
ネクシィーズグループ	4.2	3	6,582
みらかホールディングス	32.3	28.7	79,786
アルプス技研	9.5	9	16,029
サニックス	17.2	18	4,230
ダイオーズ	2.1	2.4	3,338
日本空調サービス	11.3	11.6	7,899
オリエンタルランド	128	121.4	1,493,220
ダスキン	29.1	27.6	72,063
明光ネットワークジャパン	13.7	13	12,441
ファルコホールディングス	5.6	5.6	7,705
秀英予備校	2.4	2.2	1,097
田谷	2	1.9	1,235
ラウンドワン	33.6	31.9	44,309
リゾートトラスト	45.8	43.5	66,381
ビー・エム・エル	13.9	13.2	41,910
ワタベウェディング	1.7	1.7	1,094
りらいあコミュニケーションズ	17.1	18.6	18,135
リソー教育	18.3	52.1	25,268
早稲田アカデミー	1.5	1.5	2,131
ユー・エス・エス	132.3	125.4	249,295
東京個別指導学院	3.8	3.6	3,848
サイバーエージェント	71.2	63.3	264,277
楽天	555.4	478.8	494,600
クリーク・アンド・リバー社	5.6	6	6,648
テー・オー・ダブリュー	10.3	9	6,372
山田コンサルティンググループ	－	2.9	6,902
セントラルスポーツ	4	3.8	12,844
フルキャストホールディングス	9.5	10.3	23,453
エン・ジャパン	－	11.2	34,216
リソルホールディングス	1.2	1.1	4,840
テクノプロ・ホールディングス	19.3	20.6	134,106
アトラ	1.8	2	732

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
インターワークス	2.4	2	1,516
アイ・アールジャパンホールディングス	－	3.1	5,316
ＫｅｅＰｅｒ技研	3.5	3.8	4,499
ファーストロジック	1.7	2	1,202
三機サービス	1.2	2.1	2,841
Ｇｕｎｏｓｙ	4.9	7.1	16,152
デザインワン・ジャパン	2.1	2	600
イー・ガーディアン	5.5	4.9	10,294
リブセンス	6.9	5.6	1,472
ジャパンマテリアル	29.6	28.1	35,237
ベクトル	13	12.5	16,937
ウチヤマホールディングス	5.3	5.1	2,335
チャーム・ケア・コーポレーション	－	2.5	3,567
ライクキッズネクスト	1.1	2.4	2,054
キャリアリンク	3.5	3.8	1,512
ＩＢＪ	8.6	6.9	6,299
アサンテ	3.9	4.1	9,126
Ｎ・フィールド	6	6.6	4,851
バリューＨＲ	2.4	2.2	5,346
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	2.2	2.6	13,156
ライドオンエクスプレスホールディングス	4.4	4.2	5,119
ＥＲＩホールディングス	3	2.9	2,447
アビスト	1.5	1.6	5,328
シグマクシス	4.3	4.9	4,949
ウィルグループ	4.7	6.7	8,676
エスクロー・エージェント・ジャパン	14.8	14.1	3,412
日本ビューホテル	3.4	3.2	3,603
リクルートホールディングス	835.7	735.8	2,218,437
エラン	2.6	7.1	9,237
土木管理総合試験所	3.3	4.5	2,169
日本郵政	614.7	841.9	1,102,047
ベルシステム２４ホールディングス	18.1	17.2	24,200
鎌倉新書	1.5	7.5	10,312
ソネット・メディア・ネットワークス	－	1	1,001
一蔵	1.4	1.1	632
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	1.8	2.3	4,163
グローバルグループ	1.2	1.2	1,180
エボラブルアジア	2.2	3	7,110
アトラエ	－	2	7,360

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ストライク	1	2.6	5,896
ソラスト	6.5	25	30,775
セラク	1.8	2.3	1,239
インソース	1.3	3.4	8,214
ベイカレント・コンサルティング	－	5.4	18,954
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	－	1.3	1,094
アイモバイル	－	2.4	2,390
キャリアインデックス	1.1	3.5	3,066
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	0.8	4.1	6,478
船場	1.6	1.6	1,526
グレイステクノロジー	－	2.8	5,815
ジャパンエレベーターサービスホールディン	－	6.1	14,420
フルテック	－	1.1	1,261
グリーンズ	－	2.9	4,094
ツナグ・ソリューションズ	－	0.9	617
ソウルドアウト	－	0.8	3,072
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	－	1.1	1,107
日総工産	－	2.5	5,912
キュービーネットホールディングス	－	4.7	9,404
スプリックス	－	2.9	7,487
アドバンテッジリスクマネジメント	－	4	3,436
リログループ	59.2	56.1	169,141
東祥	6.7	6.4	20,256
エイチ・アイ・エス	16.9	18.3	72,834
ラックランド	2.1	2.1	4,223
共立メンテナンス	19.3	15.7	89,490
イチネンホールディングス	12.1	10.7	12,658
建設技術研究所	7.5	7.1	10,366
スペース	7	6.7	9,132
長大	3.2	4.1	2,915
燦ホールディングス	2.6	2.2	5,436
スバル興業	0.7	0.7	3,962
東京テアトル	4.5	4	5,360
タナベ経営	2.1	2	2,520
ナガワ	2.2	2.9	17,545
よみうりランド	2.4	2.2	9,823
東京都競馬	8.1	6.7	22,679
常磐興産	4.3	4.1	6,920
カナモト	16.5	15.4	39,655

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京ドーム	43.9	38.4	41,164
西尾レントオール	9.9	10.4	32,760
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	59	56.4	1,861
トランス・コスモス	12	11.4	25,023
乃村工藝社	25.3	24	71,352
藤田観光	4.3	4.1	11,037
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6.7	5.5	7,540
日本管財	11.6	11	21,197
トーカイ	10.5	9.9	26,640
白洋舎	1.2	1.2	3,471
セコム	115	109	1,017,733
セントラル警備保障	5.2	4.9	22,736
丹青社	22.2	19.4	24,657
メイテック	12.7	13	62,985
応用地質	12.2	11	12,056
船井総研ホールディングス	22.5	21.2	55,120
進学会ホールディングス	4.9	4.7	2,655
オオバ	8.5	8.1	4,843
いであ	2.2	2.1	2,076
学究社	2.9	3.4	4,613
ベネッセホールディングス	39.7	37.6	108,024
イオンディライト	13.3	12.7	51,498
ナック	7.2	6.5	7,091
ニチイ学館	20.6	14.6	18,848
ダイセキ	18.2	17.2	45,115
ステップ	4	3.8	5,475
合計 株数・金額	137,359	125,044	243,354,142
合計 銘柄数＜比率＞	2,057	2,137	＜99.3%＞

（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
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	3,438	－

○有価証券の貸付及び借入の状況

（2019年３月25日現在）

区分	当期末
	数量
	株
貸付有価証券＜株式＞総株数	12,612,000
（モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券）	(12,612,000)

（注）（　）内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

（2019年３月25日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
株式	243,354,142	90.0
コール・ローン等、その他	27,080,053	10.0
投資信託財産総額	270,434,195	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2019年３月25日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	270,415,775,707
コール・ローン等	26,627,704,539
株式(評価額)	243,354,142,420
未収配当金	309,774,714
その他未収収益	54,824,034
差入委託証拠金	69,330,000
(B) 負債	25,395,095,329
未払金	1,700,644,938
未払解約金	364,932,268
未払利息	△ 615,774
受入担保金	23,330,133,897
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	245,020,680,378
元本	144,648,237,224
次期繰越損益金	100,372,443,154
(D) 受益権総口数	144,648,237,224口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	16,939円

○損益の状況 （2018年３月27日～2019年３月25日）

項　　目	当　期
	円
(A) 配当等収益	5,904,915,648
受取配当金	5,628,938,719
受取利息	74,707
その他収益金	292,335,250
支払利息	△ 16,433,028
(B) 有価証券売買損益	△ 13,457,121,907
売買益	17,555,660,423
売買損	△ 31,012,782,330
(C) 先物取引等取引損益	△ 215,972,860
取引益	982,173,920
取引損	△ 1,198,146,780
(D) 保管費用等	△ 377,207
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	△ 7,768,556,326
(F) 前期繰越損益金	118,725,832,066
(G) 追加信託差損益金	98,693,618,222
(H) 解約差損益金	△109,278,450,808
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	100,372,443,154
次期繰越損益金(Ｉ)	100,372,443,154

(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　157,232,250,877円
　期中追加設定元本額　120,208,869,168円
　期中一部解約元本額　132,792,882,821円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.6939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）

ファンド・マネジャー（国内株式）	12,356,149,314円
ｅＭＡＸＩＳ ＴＯＰＩＸインデックス	11,206,777,934円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	2,087,619,625円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	99,215,326円
コアバランス	193,769円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	32,045,813円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	56,887,607円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	48,563,390円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 国内株式（ＴＯＰＩＸ）	4,308,442,221円
国内株式セレクション（ラップ向け）	1,661,601,972円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	1,669,841,262円
つみたて日本株式（ＴＯＰＩＸ）	2,310,455,913円
つみたて８資産均等バランス	519,436,419円
つみたて４資産均等バランス	129,372,667円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	1,454,860円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	2,088,174円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	2,290,556円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	7,168,416円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	6,737,201円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	6,312,876円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（３地域均等型）	179,871,116円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	2,675,517円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	352,120,860円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	546,775,131円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	449,644,148円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	72,051,134円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	346,790,891円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	36,975,422円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	241,898,878円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	221,775,463円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	50,636,665円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	68,291,175円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	265,390,196円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	196,895,501円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	491,121,938円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,814,684円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,586,745,495円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	239,254,979円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	2,792,239,479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）	14,739,950,377円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	441,947,184円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	8,922,811円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,622,543円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	62,850,292円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	23,868,371円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	435,025,743円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	876,601,820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）	1,894,108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）	165,101,552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
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）	467,170,250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）	187,681,581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）	621,794,310円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	50,188,782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）	11,502,186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）	2,810,438,365円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンド	9,101,572,441円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	4,598,253円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	18,900,160円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	19,726,208円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	17,248,132円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ１	1,618,674,880円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ	297,921,033円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	43,255,633円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	301,401,498円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	30,436,821円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	191,111,598円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞ＴＯＰＩＸ・ファンド	1,892,995,162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）	520,527,966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）	2,037,413,184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）	1,742,705,835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）	1,422,408,692円
三菱ＵＦＪ ＤＣ国内株式インデックスファンド	51,759,428,812円
合計	144,648,237,224円

外国株式インデックスマザーファンド

《第18期》決算日2019年５月13日

［計算期間：2018年５月15日～2019年５月13日］

「外国株式インデックスマザーファンド」は、５月13日に第18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18期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	ＭＳＣＩ Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）（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 Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）（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 Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）（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 Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（円換算ベース）	期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
14期(2015年５月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	227,514
15期(2016年５月12日)	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	270,065
16期(2017年５月12日)	24,302	23.2	163.31	20.4	92.9	1.9	2.4	332,985
17期(2018年５月14日)	26,785	10.2	176.07	7.8	94.4	3.4	2.2	337,226
18期(2019年５月13日)	27,724	3.5	178.38	1.3	93.8	3.8	2.5	437,368

(注) ＭＳＣＩ Kokusai Index（ＭＳＣＩコクサイ インデックス）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。ＭＳＣＩ Kokusai Index（円換算ベース）は、ＭＳＣＩ Kokusai Index（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 Kokusai Index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) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。
(注) 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 Kokusai Index (MSCIコクサイ インデックス)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(円換算ベース)	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2018年5月14日	26,785	－	176.07	－	94.4	3.4	2.2
5月末	26,344	△1.6	172.74	△ 1.9	93.9	3.1	2.2
6月末	26,558	△0.8	174.02	△ 1.2	94.9	3.0	2.3
7月末	27,606	3.1	180.76	2.7	94.8	3.0	2.2
8月末	28,202	5.3	184.18	4.6	92.8	5.5	2.2
9月末	28,916	8.0	188.72	7.2	93.6	4.6	2.1
10月末	26,374	△1.5	171.88	△ 2.4	94.8	2.9	2.4
11月末	26,984	0.7	175.40	△ 0.4	92.8	4.7	2.4
12月末	24,170	△9.8	156.81	△10.9	92.2	6.4	2.4
2019年1月末	25,738	△3.9	166.68	△ 5.3	93.6	3.9	2.5
2月末	27,280	1.8	176.62	0.3	92.8	4.8	2.4
3月末	27,471	2.6	177.42	0.8	91.5	6.2	2.5
4月末	28,697	7.1	185.03	5.1	92.9	4.8	2.4
(期末)							
2019年5月13日	27,724	3.5	178.38	1.3	93.8	3.8	2.5

(注) 騰落率は期首比。
(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

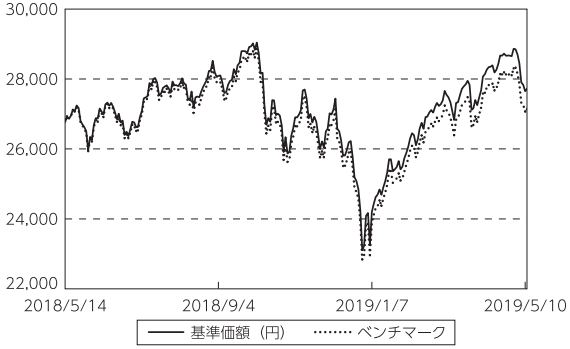
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.3%)を2.2%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。

●投資環境について

◎外国株式市況

・外国株式市況は、米国の堅調な企業決算内容などが好感され、上昇しました。

◎為替市況

・為替市況は、期首に比べて0.4%の円安・米ドル高、5.7%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

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

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは1.3%の上昇になったため、カイ離は2.2%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）

・配当要因※　　2.2%

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

（主なマイナス要因）

・取引要因

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2018年５月15日～2019年５月13日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	2	0.008	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(1)	(0.004)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(1)	(0.004)	
(b) 有価証券取引税	8	0.030	(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）	(8)	(0.029)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	8	0.028	(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）	(7)	(0.025)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(1)	(0.004)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	18	0.066	
期中の平均基準価額は、27,083円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2018年５月15日～2019年５月13日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 159,596 (3,635)	千アメリカドル 1,266,047 (6,587)	百株 90,722 (2,708)	千アメリカドル 698,263 (24,854)
	カナダ	24,236 (460)	千カナダドル 98,291 (1,313)	12,644 (941)	千カナダドル 50,726 (1,601)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	12,220 (519)	58,080 (△ 3,396)	7,724	32,264
	イタリア	24,796 (1,035)	12,694 (278)	12,220 (843)	6,763 (278)
	フランス	14,864 (41)	64,964 (△ 7)	8,280	33,274
	オランダ	9,603 (△ 887)	27,618 (△ 1,722)	5,869	14,799
	スペイン	26,755 (25,582)	19,306 (344)	38,932 (1,455)	11,434 (51)
	ベルギー	1,026	6,387	536	3,304
	オーストリア	521 (－)	1,922 (△ 29)	248	948
	ルクセンブルク	1,616	2,375	435	1,014
	フィンランド	4,874 (213)	6,722 (－)	2,882	3,732
	アイルランド	1,711 (226)	4,250 (2,907)	834	4,683
	ポルトガル	2,098	1,169	1,208	651
	イギリス	－ (864)	－ (1,560)	864	1,523
	イギリス	154,976 (184,969)	千イギリスポンド 97,327 (△ 459)	90,745 (145,993)	千イギリスポンド 58,718 (14)
	スイス	9,102 (535)	千スイスフラン 60,523 (△ 433)	4,758 (56)	千スイスフラン 31,298 (3)
	スウェーデン	13,024 (1,138)	千スウェーデンクローネ 176,897 (－)	7,161 (1,006)	千スウェーデンクローネ 94,731 (754)
	ノルウェー	2,916 (80)	千ノルウェークローネ 46,678 (－)	1,486	千ノルウェークローネ 24,481

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	デンマーク	百株 2,174 (18)	千デンマーククローネ 80,639 (—)	百株 1,272	千デンマーククローネ 45,310
	オーストラリア	37,421 (1,606)	千オーストラリアドル 64,911 (363)	21,741 (410)	千オーストラリアドル 35,667 (32)
	ニュージーランド	4,223	千ニュージーランドドル 2,955	2,625	千ニュージーランドドル 1,461
	香港	47,515 (776)	千香港ドル 190,679 (—)	37,453	千香港ドル 94,571
	シンガポール	19,481	千シンガポールドル 12,045	10,442	千シンガポールドル 6,106
	イスラエル	1,723 (△ 26)	千イスラエルシェケル 6,066 (—)	899 (—)	千イスラエルシェケル 3,457 (920)

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

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	HCP INC	20	590	10	275
	MACERICH CO/THE	5	256	3	175
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6	880	2	371
	PROLOGIS INC	40	2,719	17	1,114
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5	497	3	279
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7	350	1	86
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11	1,316	6	719
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	912	1	460
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4	469	2	185
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5	663	3	455
	WELLTOWER INC	22	1,522	12	816
	BOSTON PROPERTIES INC	8	1,068	4	543
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4	470	1	186
外	REALTY INCOME CORP	16	1,017	7	457
	REGENCY CENTERS CORP	4	302	1	88
	SL GREEN REALTY CORP	4	408	3	373
	UDR INC	11	470	4	192
	VENTAS INC	18	1,124	9	559
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	75	768	26	272
	WEYERHAEUSER CO	40	1,211	22	706
	AMERICAN TOWER CORP	23	3,891	12	1,757
	AGNC INVESTMENT CORP	30	548	5	89
	WP CAREY INC	17	1,183	—	—
	VEREIT INC	36	276	24	174
	DUKE REALTY CORP	25	739	16	451
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	—	22	353
	IRON MOUNTAIN INC	19	668	13	448
国	EQUINIX INC	4	1,923	2	976
	CROWN CASTLE INTL CORP	22	2,579	11	1,249
	EQUITY RESIDENTIAL	20	1,404	11	730
	COLONY CAPITAL INC	—	—	47	280
	INVITATION HOMES INC	15	368	4	97
	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	—	9	173
		(21)	(513)		
	GGP INC	11	234	—	—
				(57)	(1,194)
	HOST HOTELS & RESORTS INC	28	547	11	224
	LIBERTY PROPERTY TRUST	6	280	2	84
	PUBLIC STORAGE	8	1,799	4	963
	SIMON PROPERTY GROUP INC	15	2,810	8	1,512
	VORNADO REALTY TRUST	9	664	5	365
	KIMCO REALTY CORP	26	455	17	284

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8	1,504	4	827
	小計	643 (21)	38,901 (513)	383 (57)	19,363 (1,194)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4	108	4	108
	小計	4	108	4	108
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	1	257	0.636	85
	KLEPIERRE	8	263	4	150
	UNIBAIL-RODAMCO SE	—	—	— (7)	— (1,558)
	COVIVIO	1	168	—	—
	ICADE	2	145	2	146
	小計	14	834	7 (7)	381 (1,558)
	オランダ				
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10 (7)	1,885 (1,558)	4	752
	小計	10 (7)	1,885 (1,558)	4	752
	ユーロ計	25 (7)	2,720 (1,558)	12 (7)	1,134 (1,558)
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	39	230	24	140
	HAMMERSON PLC	30	138	14	64
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32	294	16	147
	SEGRO PLC	55	372	22	140
	小計	157	1,036	77	493
	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	304	805	197	529
	SCENTRE GROUP	247	1,010	111	439
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIEL/CDI	— (58)	— (870)	58	851
	ONEMARKET LTD	— (7)	— (12)	7	10
	GPT GROUP	86	484	23	118
	MIRVAC GROUP	159	387	53	119
	STOCKLAND	99	398	34	138
	WESTFIELD CORP	—	—	— (158)	— (1,442)
	DEXUS	36	417	12	120
	GOODMAN GROUP	74	870	46	454
	小計	1,007 (66)	4,374 (882)	545 (158)	2,782 (1,442)

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	LINK REIT	94	7,870	50	3,636
	小計	94	7,870	50	3,636
	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	76 (　—)	147 (△　2)	66	118
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	153	285	79	137
	CAPITALAND MALL TRUST	247	543	180	381
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	141 (　—)	388 (△　4)	45	116
	小計	619 (　—)	1,364 (△　7)	371	753

(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 242,816	百万円 238,585	百万円 —	百万円 —

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

○株式売買比率

(2018年５月15日～2019年５月13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	327,449,149千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	332,915,144千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.98

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2018年５月15日～2019年５月13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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	263,448	47,407	18.0	172,797	40,731	23.6

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

○組入資産の明細

（2019年５月13日現在）

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AMERICAN EXPRESS CO	590	753	8,923	979,287	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	1,391	1,822	13,934	1,529,176	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	257	330	2,549	279,769	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	46	55	521	57,250	各種金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	354	454	7,311	802,353	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	40	—	—	—	小売
AES CORP	515	683	1,110	121,849	公益事業
AFLAC INC	628	790	4,051	444,646	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	718	917	4,739	520,092	保険
APACHE CORP	303	388	1,213	133,164	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	630	983	2,750	301,822	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	41	49	733	80,508	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	491	662	11,539	1,266,329	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	175	227	4,743	520,585	素材
ANTHEM INC	205	268	7,201	790,344	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	437	522	3,816	418,791	エネルギー
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,097	1,436	5,254	576,580	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	391	525	3,987	437,566	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	452	559	19,853	2,178,746	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	211	278	6,276	688,781	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	215	259	1,851	203,187	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,309	1,693	7,962	873,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	96	122	5,681	623,535	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,300	4,287	24,399	2,677,567	電気通信サービス
BALL CORP	268	337	2,170	238,158	素材
ALLSTATE CORP	287	357	3,442	377,769	保険
AVERY DENNISON CORP	72	88	943	103,551	素材
CHUBB LTD	371	477	6,915	758,858	保険
ANALOG DEVICES INC	295	382	4,233	464,589	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	21	26	2,617	287,249	小売
CVS HEALTH CORP	810	1,342	7,402	812,359	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	695	831	2,559	280,884	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	2,775	3,450	38,818	4,259,958	銀行
CIGNA CORP	197	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	475	612	8,039	882,249	資本財
COCA-COLA CO/THE	3,237	4,196	20,224	2,219,418	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	387	490	4,437	487,012	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	143	186	722	79,287	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	679	832	6,551	719,004	運輸
CHEVRON CORP	1,519	1,981	24,177	2,653,219	エネルギー
TAPESTRY INC	228	300	970	106,467	耐久消費財・アパレル
ROCKWELL COLLINS INC	130	—	—	—	資本財
CONOCOPHILLIPS	956	1,192	7,383	810,281	エネルギー
CME GROUP INC	272	371	6,792	745,455	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	251	317	1,550	170,183	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	666	855	6,118	671,487	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
DOMINION ENERGY INC	517	783	5,844	641,428	公益事業
DEVON ENERGY CORP	398	496	1,553	170,526	エネルギー
DEERE & CO	218	317	4,947	542,894	資本財
DANAHER CORP	500	654	8,618	945,847	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	1,207	1,865	25,004	2,743,992	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	100	131	1,604	176,109	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	561	740	6,517	715,250	公益事業
DR HORTON INC	285	377	1,643	180,399	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	413	513	3,835	420,853	小売
DAVITA INC	113	132	688	75,599	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	114	147	1,431	157,138	資本財
DTE ENERGY COMPANY	145	192	2,420	265,606	公益事業
EXXON MOBIL CORP	3,390	4,390	33,616	3,689,108	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	169	216	3,928	431,085	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	462	600	5,701	625,716	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	513	648	4,343	476,617	資本財
EXELON CORP	771	1,005	4,959	544,221	公益事業
ECOLAB INC	208	269	4,885	536,089	素材
EQUIFAX INC	96	123	1,474	161,782	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	179	228	3,749	411,468	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	351	449	3,659	401,617	資本財
EDISON INTERNATIONAL	261	338	2,002	219,717	公益事業
ENTERGY CORP	146	190	1,839	201,836	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	34	42	1,057	116,011	保険
NEXTERA ENERGY INC	377	496	9,514	1,044,148	公益事業
MACY'S INC	238	305	685	75,234	小売
FEDEX CORP	203	259	4,624	507,466	運輸
FORD MOTOR CO	2,964	3,848	3,994	438,410	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	271	321	1,098	120,542	各種金融
FIRSTENERGY CORP	359	531	2,240	245,855	公益事業
FLUOR CORP	112	143	440	48,355	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	1,100	1,434	1,630	178,978	素材
GENERAL MILLS INC	454	619	3,190	350,157	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	202	261	4,521	496,175	資本財
WW GRAINGER INC	43	48	1,308	143,561	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	6,936	9,024	9,141	1,003,182	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	127	166	2,438	267,651	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	117	153	1,509	165,656	小売
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	192	246	425	46,659	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	185	232	565	62,099	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	286	347	7,020	770,377	各種金融
HALLIBURTON CO	698	900	2,283	250,565	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	578	767	13,179	1,446,371	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	138	166	596	65,437	自動車・自動車部品
HP INC	1,337	1,642	3,141	344,705	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	285	372	1,975	216,770	保険
HERSHEY CO/THE	114	149	1,898	208,300	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	934	1,171	22,799	2,501,976	小売
HASBRO INC	91	122	1,235	135,546	耐久消費財・アパレル
INGERSOLL-RAND PLC	199	254	3,127	343,236	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	703	943	12,760	1,400,356	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	313	401	1,832	201,066	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ILLINOIS TOOL WORKS	246	309	4,731	519,278	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	316	403	930	102,099	メディア・娯楽
IDEX CORP	62	81	1,258	138,071	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	65	89	1,218	133,673	素材
JOHNSON & JOHNSON	2,149	2,783	38,698	4,246,798	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	84	103	1,248	137,006	運輸
KELLOGG CO	207	274	1,611	176,857	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	281	359	4,585	503,203	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,194	1,508	7,825	858,727	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	704	827	2,137	234,590	食品・生活必需品小売り
KOHLS CORP	138	177	1,189	130,558	小売
ELI LILLY & CO	792	927	10,775	1,182,498	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	81	102	1,701	186,758	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	127	143	758	83,232	運輸
LENNAR CORP-A	228	309	1,605	176,151	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	664	836	8,915	978,413	小売
LEGGETT & PLATT INC	99	135	521	57,258	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	201	247	591	64,891	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	315	407	2,665	292,466	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	206	265	9,075	995,979	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	174	220	1,440	158,103	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	30	37	1,032	113,356	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	62	81	1,922	210,984	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	247	300	3,963	435,003	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	637	800	16,002	1,756,081	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	204	260	5,578	612,217	各種金融
MEDTRONIC PLC	1,082	1,394	12,313	1,351,270	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	2,179	2,698	21,098	2,315,364	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	922	1,174	4,575	502,092	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	248	368	418	45,964	耐久消費財・アパレル
3M CO	476	604	10,623	1,165,806	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	129	169	2,521	276,745	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	361	508	1,302	142,884	消費者サービス
MASCO CORP	251	311	1,182	129,723	資本財
MONSANTO CO	352	—	—	—	素材
M & T BANK CORP	108	140	2,344	257,336	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	408	522	5,020	550,996	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	50	63	858	94,162	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	1,084	1,339	6,207	681,182	各種金融
MCKESSON CORP	166	204	2,670	293,027	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	714	869	4,164	457,031	保険
MANPOWERGROUP INC	52	66	617	67,724	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	137	178	3,381	371,055	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	229	282	5,728	628,660	運輸
BANK OF AMERICA CORP	7,927	9,673	28,615	3,140,234	銀行
NISOURCE INC	285	386	1,084	119,044	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	132	171	5,152	565,391	資本財
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	373	—	—	—	銀行
NEWMONT GOLDCORP CORP	431	850	2,562	281,242	素材
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	842	—	—	—	メディア・娯楽
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	95	126	1,979	217,198	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	11	14	1,476	162,054	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NUCOR CORP	255	327	1,859	204,094	素材
NEWELL BRANDS INC	392	474	727	79,852	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	350	—	—	—	メディア・娯楽
NOBLE ENERGY INC	369	483	1,164	127,833	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	612	782	4,303	472,289	エネルギー
OMNICOM GROUP	183	235	1,876	205,884	メディア・娯楽
PEPSICO INC	1,137	1,464	18,752	2,057,935	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	76	95	938	102,944	素材
ALTRIA GROUP INC	1,526	1,949	10,159	1,114,957	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	94	114	1,085	119,069	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,028	2,585	27,407	3,007,746	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	380	478	6,332	694,883	銀行
PFIZER INC	4,768	5,998	24,424	2,680,349	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	338	428	4,334	475,707	保険
PULTEGROUP INC	198	266	841	92,382	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	106	137	2,382	261,407	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	135	176	2,673	293,383	エネルギー
CITIGROUP INC	2,114	2,533	17,203	1,887,947	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	230	299	1,692	185,683	保険
PPG INDUSTRIES INC	203	248	2,794	306,674	素材
PENTAIR PLC	146	174	663	72,861	資本財
PRAXAIR INC	229	—	—	—	素材
P G & E CORP	412	—	—	—	公益事業
PPL CORP	554	758	2,354	258,393	公益事業
PROGRESSIVE CORP	465	604	4,437	486,957	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	407	525	3,113	341,725	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	136	173	2,188	240,146	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	231	295	5,326	584,485	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	187	236	1,985	217,875	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	926	1,094	1,646	180,726	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	30	42	703	77,156	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	81	107	3,817	418,920	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	338	532	1,578	173,254	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	98	127	737	80,903	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	102	125	2,084	228,748	資本財
SCHLUMBERGER LTD	1,108	1,422	5,625	617,356	エネルギー
STRYKER CORP	269	349	6,547	718,475	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	964	1,261	5,785	634,869	各種金融
SEMPRA ENERGY	192	284	3,673	403,080	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	67	87	3,845	422,035	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	122	159	2,263	248,383	資本財
SUNTRUST BANKS INC	380	464	2,963	325,160	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	218	274	3,953	433,880	保険
SOUTHERN CO/THE	806	1,068	5,703	625,877	公益事業
AT&T INC	4,911	7,550	23,119	2,537,181	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	236	306	1,407	154,442	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	296	394	2,554	280,293	各種金融
SYSCO CORP	396	512	3,793	416,270	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	135	158	688	75,511	素材
SCANA CORP	98	—	—	—	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	788	995	11,207	1,229,864	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	100	113	1,191	130,768	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
TORCHMARK CORP	90	106	937	102,848	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	739	958	3,802	417,320	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	320	417	11,242	1,233,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	210	253	1,302	142,963	資本財
UNION PACIFIC CORP	630	764	13,451	1,476,192	運輸
UNUM GROUP	188	223	808	88,689	保険
UNITED TECHNOLOGIES CORP	606	850	11,668	1,280,546	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	775	998	24,014	2,635,403	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,326	1,592	8,309	911,853	銀行
MARATHON OIL CORP	679	855	1,306	143,338	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	549	721	7,260	796,784	運輸
VALERO ENERGY CORP	350	442	3,702	406,289	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	75	93	1,259	138,249	ヘルスケア機器・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	274	350	1,728	189,696	メディア・娯楽
VF CORP	269	349	3,251	356,766	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	105	138	1,785	195,933	素材
WILLIAMS COS INC	662	1,278	3,522	386,554	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	672	836	4,470	490,558	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	255	329	2,610	286,452	公益事業
WALMART INC	1,194	1,507	15,359	1,685,514	食品・生活必需品小売り
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	50	1,385	152,087	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	3,742	4,639	21,876	2,400,739	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	347	442	4,733	519,472	商業・専門サービス
WATERS CORP	63	78	1,704	187,021	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	58	64	865	95,030	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	163	219	707	77,656	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	409	534	3,060	335,822	公益事業
KEYCORP	859	1,080	1,869	205,186	銀行
CARMAX INC	148	185	1,465	160,778	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	161	211	2,583	283,480	ヘルスケア機器・サービス
TOLL BROTHERS INC	118	—	—	—	耐久消費財・アパレル
YUM! BRANDS INC	255	324	3,293	361,465	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	505	1,282	6,956	763,358	小売
CA INC	255	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	102	132	1,965	215,736	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	108	142	1,475	161,883	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	227	292	2,026	222,440	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	277	440	2,395	262,855	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	266	339	3,966	435,244	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	326	512	1,471	161,497	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	250	323	2,763	303,225	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	563	805	2,257	247,738	銀行
STERICYCLE INC	61	—	—	—	商業・専門サービス
INTEL CORP	3,744	4,734	21,874	2,400,456	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	3,953	4,664	24,887	2,731,204	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	72	93	2,093	229,714	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	94	118	2,487	272,925	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	349	454	11,228	1,232,165	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	853	1,019	4,160	456,564	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	246	313	2,941	322,804	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	237	306	2,444	268,259	食品・飲料・タバコ
SYMANTEC CORP	495	647	1,255	137,812	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ROSS STORES INC	308	386	3,769	413,702	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	187	248	2,214	243,067	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	1,050	1,320	11,086	1,216,625	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	538	661	11,367	1,247,473	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	138	162	1,250	137,208	銀行
NORTHERN TRUST CORP	172	218	2,131	233,920	各種金融
MICROSOFT CORP	5,864	7,566	96,188	10,555,763	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	67	88	1,691	185,616	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	162	428	2,361	259,136	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	1,137	1,287	10,095	1,107,903	消費者サービス
ORACLE CORP	2,503	2,751	15,037	1,650,262	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	346	452	16,333	1,792,432	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	68	83	3,030	332,586	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	574	751	3,460	379,727	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	146	187	1,551	170,312	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	126	159	1,096	120,296	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	100	129	1,327	145,696	小売
LAM RESEARCH CORP	129	160	3,182	349,196	半導体・半導体製造装置
COPART INC	—	212	1,421	155,968	商業・専門サービス
WYNN RESORTS LTD	77	99	1,289	141,514	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	3,729	4,710	20,325	2,230,506	メディア・娯楽
XILINX INC	200	262	3,063	336,179	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	280	362	2,518	276,393	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	188	238	1,309	143,742	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	60	78	2,536	278,318	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,044	1,342	8,804	966,239	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	117	139	1,359	149,180	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	89	118	5,865	643,675	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	194	255	6,252	686,149	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	42	54	1,341	147,225	銀行
PAYCHEX INC	258	334	2,847	312,470	ソフトウェア・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	451	947	103,950	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	43	56	720	79,020	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	104	126	1,500	164,618	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	51	64	939	103,129	運輸
AUTODESK INC	157	226	3,939	432,363	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	149	181	477	52,441	メディア・娯楽
SALESFORCE.COM INC	548	793	12,687	1,392,367	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	94	119	469	51,491	小売
ALPHABET INC-CL A	238	309	36,186	3,971,087	メディア・娯楽
EAST WEST BANCORP INC	116	154	775	85,096	銀行
UNITED THERAPEUTICS CORP	32	41	394	43,267	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	94	115	912	100,133	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	206	257	1,086	119,223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	1,179	1,257	10,794	1,184,612	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	226	293	1,339	146,991	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	120	155	1,867	204,941	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	225	292	1,664	182,679	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	327	431	81,499	8,943,779	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	193	249	2,629	288,562	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	109	139	1,380	151,490	ヘルスケア機器・サービス
KLA-TENCOR CORP	125	169	1,933	212,137	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
STEEL DYNAMICS INC	191	231	750	82,340	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	214	267	1,325	145,510	各種金融
CERNER CORP	238	307	2,120	232,751	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	123	158	417	45,765	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	67	112	2,179	239,229	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	211	273	2,541	278,912	商業・専門サービス
EBAY INC	795	948	3,544	389,008	小売
IAC/INTERACTIVECORP	58	81	1,859	204,011	メディア・娯楽
NVIDIA CORP	484	600	10,144	1,113,282	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	189	246	2,566	281,600	小売
BOOKING HOLDINGS INC	39	48	8,792	964,881	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,015	1,343	28,074	3,080,875	各種金融
BB&T CORP	630	798	3,981	436,970	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	818	1,026	4,938	541,916	各種金融
BORGWARNER INC	173	218	840	92,255	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	151	213	579	63,633	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	91	116	1,472	161,611	食品・飲料・タバコ
TIME WARNER INC	621	—	—	—	メディア・娯楽
AMERISOURCEBERGEN CORP	130	161	1,248	137,011	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	39	64	631	69,259	保険
AETNA INC	260	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	196	255	1,872	205,438	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	395	512	4,341	476,421	公益事業
AON PLC	200	249	4,474	491,085	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	446	583	2,477	271,921	食品・飲料・タバコ
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	60	—	—	—	保険
HESS CORP	228	277	1,764	193,647	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	306	344	909	99,838	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TD AMERITRADE HOLDING CORP	226	285	1,524	167,284	各種金融
RED HAT INC	141	183	3,389	371,954	ソフトウェア・サービス
F5 NETWORKS INC	51	62	930	102,145	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	178	232	825	90,603	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	130	167	1,281	140,646	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	213	261	1,797	197,215	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	146	190	1,538	168,815	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	321	646	1,518	166,669	半導体・半導体製造装置
BIOGEN INC	169	209	4,731	519,270	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	116	152	4,814	528,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	394	506	14,097	1,547,089	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	202	265	4,480	491,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	730	970	1,393	152,977	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELGENE CORP	629	725	6,932	760,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	471	600	3,550	389,595	ソフトウェア・サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	452	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	144	183	1,352	148,414	運輸
FASTENAL CO	229	297	1,949	213,989	資本財
FISERV INC	333	413	3,524	386,789	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	440	536	561	61,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEKTAR THERAPEUTICS	—	176	615	67,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,319	1,779	1,021	112,071	メディア・娯楽
APPLE INC	4,108	4,923	97,087	10,654,337	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	128	160	1,550	170,126	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	863	1,119	1,529	167,857	銀行
ZIONS BANCORP NA	162	205	995	109,229	銀行
COSTAR GROUP INC	29	38	1,898	208,293	商業・専門サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	178	231	3,049	334,642	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	108	146	1,197	131,369	運輸
CENTURYLINK INC	769	1,018	1,109	121,742	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	105	145	748	82,185	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	364	520	1,154	126,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	307	428	2,882	316,380	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	231	275	1,305	143,259	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BUNGE LTD	116	140	755	82,936	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	60	77	1,218	133,732	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	304	389	970	106,492	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	137	172	3,502	384,405	食品・飲料・タバコ
NVR INC	2	3	1,151	126,395	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	144	—	—	—	エネルギー
COOPER COS INC/THE	39	49	1,456	159,816	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	204	—	—	—	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	245	312	2,963	325,235	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	75	153	946	103,843	保険
AGCO CORP	44	—	—	—	資本財
DISCOVERY INC - A	112	161	460	50,530	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	315	434	2,735	300,189	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	100	129	1,533	168,304	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	192	242	1,011	110,982	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	456	540	1,383	151,782	メディア・娯楽
AMERIPRISE FINANCIAL INC	118	144	2,088	229,187	各種金融
ANDEAVOR	118	—	—	—	エネルギー
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	214	290	1,144	125,568	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	467	591	4,811	528,055	各種金融
NASDAQ INC	94	117	1,084	119,032	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	109	175	382	42,004	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	115	150	985	108,119	メディア・娯楽
VIACOM INC-CLASS B	288	361	1,058	116,130	メディア・娯楽
AUTOLIV INC	70	89	671	73,671	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	244	337	1,645	180,600	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	20	25	1,796	197,175	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	204	272	1,413	155,091	食品・飲料・タバコ
QURATE RETAIL INC	354	419	507	55,645	小売
ARROW ELECTRONICS INC	67	90	646	70,989	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	125	157	2,612	286,732	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	108	133	1,049	115,161	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	253	311	622	68,345	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	50	63	1,373	150,689	素材
RANGE RESOURCES CORP	228	—	—	—	エネルギー
CIMAREX ENERGY CO	78	109	740	81,224	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	41	57	719	78,974	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	184	247	1,166	127,978	公益事業
WYNDHAM DESTINATIONS INC	77	—	—	—	消費者サービス
HANESBRANDS INC	274	372	632	69,399	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	751	953	23,585	2,588,302	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	380	479	930	102,143	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
LEIDOS HOLDINGS INC	118	151	1,141	125,266	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	113	134	684	75,118	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	93	106	896	98,399	資本財
AVNET INC	90	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPG PHOTONICS CORP	31	37	570	62,640	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	267	374	894	98,160	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	190	253	563	61,879	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	41	49	2,345	257,406	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	94	121	1,443	158,450	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	100	135	2,390	262,364	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	261	388	667	73,237	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	281	356	3,237	355,301	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	290	348	2,769	303,881	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	82	103	1,804	198,067	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	39	54	722	79,251	資本財
MERCADOLIBRE INC	33	44	2,482	272,478	小売
VMWARE INC-CLASS A	57	87	1,743	191,321	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	229	272	1,401	153,769	保険
SEATTLE GENETICS INC	91	116	785	86,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	46	58	2,019	221,595	小売
LKQ CORP	256	323	884	97,057	小売
HORMEL FOODS CORP	237	307	1,224	134,372	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	71	—	—	—	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	115	148	1,126	123,568	素材
HARRIS CORP	95	122	2,220	243,703	資本財
HUMANA INC	114	142	3,476	381,472	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	—	303	1,131	124,211	公益事業
INVESCO LTD	331	426	909	99,830	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	140	185	1,529	167,900	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	112	136	720	79,019	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	132	172	1,732	190,164	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	118	210	2,363	259,417	エネルギー
MSCI INC	72	91	2,048	224,761	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	69	90	380	41,724	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	153	201	1,183	129,925	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,242	1,613	13,636	1,496,512	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,450	1,825	29,337	3,219,527	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	144	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CABOT OIL & GAS CORP	379	455	1,183	129,899	エネルギー
FLOWSERVE CORP	97	139	693	76,068	資本財
HELMERICH & PAYNE	85	116	667	73,246	エネルギー
T-MOBILE US INC	233	352	2,652	291,047	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C	262	306	821	90,115	メディア・娯楽
RESMED INC	113	151	1,702	186,811	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	73	96	1,483	162,835	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	184	240	2,056	225,631	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	105	410	1,395	153,162	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	201	256	1,882	206,619	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	72	91	874	95,962	運輸
PERRIGO CO PLC	104	136	710	78,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP	107	135	1,078	118,378	素材
WABTEC CORP	66	142	1,043	114,524	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
EVERSOURCE ENERGY	256	329	2,367	259,786	公益事業
INGREDION INC	59	73	631	69,319	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	265	350	4,905	538,340	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC	105	138	833	91,489	素材
EATON VANCE CORP	86	126	500	54,872	各種金融
DELTA AIR LINES INC	150	182	1,032	113,277	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	144	188	2,038	223,753	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	125	164	2,310	253,572	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	218	274	3,350	367,654	小売
FORTINET INC	120	146	1,213	133,132	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	58	71	607	66,613	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	20	26	1,917	210,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	113	108	566	62,132	銀行
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	—	20	143	15,785	運輸
GENERAL MOTORS CO	1,022	1,317	4,991	547,818	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	270	356	3,571	391,976	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	268	338	2,797	306,957	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	37	44	920	100,969	資本財
HCA HEALTHCARE INC	226	286	3,539	388,465	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	135	173	762	83,729	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	391	720	3,830	420,367	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	85	124	1,272	139,652	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	122	142	771	84,637	資本財
DEXCOM INC	—	91	1,088	119,409	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	44	60	822	90,288	資本財
XYLEM INC	143	190	1,486	163,173	資本財
ABIOMED INC	—	44	1,163	127,720	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC	82	114	544	59,793	メディア・娯楽
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	48	63	880	96,644	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	126	172	1,786	196,020	銀行
ALLEGHANY CORP	12	15	1,053	115,625	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	63	82	2,590	284,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	348	456	3,958	434,388	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	1,908	2,492	46,937	5,150,924	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	229	300	1,669	183,230	公益事業
ALBEMARLE CORP	88	110	799	87,730	素材
PVH CORP	62	78	935	102,613	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	1,609	2,097	4,131	453,352	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	291	372	917	100,635	商業・専門サービス
APTIV PLC	212	274	2,120	232,729	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	140	163	798	87,679	資本財
SPLUNK INC	111	151	2,026	222,340	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	154	204	850	93,324	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	46	62	558	61,297	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	1,277	1,561	12,091	1,326,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	107	133	3,199	351,061	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	164	234	1,588	174,321	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	105	129	1,134	124,497	各種金融
ZOETIS INC	390	498	5,100	559,772	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	288	417	496	54,503	メディア・娯楽
SPRINT CORP	722	850	526	57,755	電気通信サービス
SNAP-ON INC	47	59	1,002	109,989	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CAPRI HOLDINGS LTD	125	156	670	73,559	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	505	712	2,739	300,635	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	64	79	1,069	117,400	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	237	312	3,701	406,176	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	109	154	3,143	344,969	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	138	185	5,110	560,874	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	71	86	1,065	116,962	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	71	92	2,437	267,493	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	74	97	980	107,593	資本財
ALPHABET INC-CL C	251	326	38,027	4,173,125	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	67	85	1,128	123,822	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	97	119	406	44,637	運輸
VOYA FINANCIAL INC	148	164	890	97,718	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	40	249	27,352	素材
ANTERO RESOURCES CORP	154	—	—	—	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	108	166	2,233	245,059	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	355	429	1,285	141,033	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	228	292	2,679	294,012	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	94	128	672	73,827	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	71	163	1,764	193,581	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	—	194	1,671	183,434	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	87	109	1,093	119,996	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	91	121	1,255	137,784	メディア・娯楽
OWENS CORNING	85	117	592	65,013	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	174	228	1,322	145,130	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	73	98	2,314	253,940	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	625	670	2,348	257,717	各種金融
QORVO INC	102	130	981	107,664	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	146	193	1,614	177,181	保険
ACUITY BRANDS INC	32	40	580	63,753	資本財
JONES LANG LASALLE INC	36	46	638	70,066	不動産
ARAMARK	202	266	833	91,463	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	392	491	1,771	194,380	銀行
LEAR CORP	52	64	908	99,698	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	70	93	668	73,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	165	223	580	63,692	素材
TARGA RESOURCES CORP	176	253	1,023	112,268	エネルギー
GRUBHUB INC	—	94	631	69,337	小売
CHEMOURS CO/THE	140	176	476	52,333	素材
WESTROCK CO	203	264	984	108,089	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	486	632	2,064	226,593	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	913	1,161	12,821	1,407,040	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	73	915	100,438	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	79	118	427	46,957	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,276	1,529	2,262	248,272	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	6	9	365	40,091	運輸
CDW CORP/DE	124	155	1,659	182,115	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SABRE CORP	189	277	570	62,608	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	382	547	1,387	152,283	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	38	55	1,461	160,345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	132	172	807	88,576	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	146	187	1,235	135,567	商業・専門サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
GODADDY INC - CLASS A	—	179	1,395	153,187	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	60	—	—	—	素材
WAYFAIR INC- CLASS A	—	63	920	100,976	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	170	211	405	44,552	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	150	171	683	75,000	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	69	98	387	42,575	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	168	217	838	91,991	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC	32	41	940	103,251	消費者サービス
DOMINO'S PIZZA INC	35	39	1,113	122,162	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	149	166	6,281	689,349	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	69	89	2,220	243,711	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	119	146	737	80,936	資本財
UGI CORP	136	176	972	106,736	公益事業
WESTAR ENERGY INC	113	—	—	—	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	165	224	1,228	134,779	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	250	311	2,573	282,435	資本財
IHS MARKIT LTD	318	413	2,325	255,157	商業・専門サービス
XL GROUP LTD	204	—	—	—	保険
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	161	238	1,402	153,873	ソフトウェア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	162	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COTY INC-CL A	407	503	590	64,795	家庭用品・パーソナル用品
ARCONIC INC	369	467	1,051	115,374	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	153	1,037	113,908	食品・飲料・タバコ
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	170	256	529	58,128	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	53	66	987	108,368	保険
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	16	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
TELEFLEX INC	36	46	1,421	155,960	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	141	206	678	74,425	電気通信サービス
BEIGENE LTD-ADR	—	33	443	48,709	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENVISION HEALTHCARE CORP	101	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC	354	441	1,006	110,501	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	87	130	1,880	206,411	ヘルスケア機器・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	83	93	967	106,172	各種金融
DXC TECHNOLOGY CO	228	291	1,720	188,774	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	119	162	736	80,870	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	58	77	796	87,450	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC	165	209	399	43,813	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC	133	180	779	85,511	資本財
ROLLINS INC	71	152	554	60,887	商業・専門サービス
TESARO INC	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XPO LOGISTICS INC	—	127	781	85,777	運輸
BAKER HUGHES A GE CO	325	528	1,180	129,494	エネルギー
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	61	110	433	47,522	保険
DOWDUPONT INC	1,872	2,380	7,494	822,467	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	101	125	395	43,396	運輸
SQUARE INC - A	215	323	2,134	234,241	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	271	349	866	95,097	公益事業
PTC INC	—	117	1,027	112,740	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	326	428	13,034	1,430,429	半導体・半導体製造装置
APERGY CORP	57	—	—	—	エネルギー
EVERGY INC	—	267	1,552	170,397	公益事業
ALTICE USA INC- A	—	323	793	87,072	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	
LINDE PLC	—	571	10,378	1,138,927	素材
WIX.COM LTD	—	40	582	63,920	ソフトウェア・サービス
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	—	278	619	67,936	各種金融
BURLINGTON STORES INC	—	67	1,121	123,043	小売
KKR & CO INC -A	—	483	1,168	128,236	各種金融
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	286	954	104,766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIGNA CORP	—	394	6,254	686,394	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	—	158	1,064	116,816	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOX CORP - CLASS A	—	369	1,424	156,273	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	—	148	566	62,137	メディア・娯楽
DOW INC	—	793	4,212	462,278	素材
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	929	1,204	831	91,299	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	174	232	874	95,957	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	177	227	1,459	160,202	資本財
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	—	410	321	35,319	食品・生活必需品小売り
小計 株数・金額	244,756	314,557	2,558,910	280,814,854	
小計 銘柄数<比率>	601	598	—	<64.2%>	
(カナダ)			千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	1,166	1,491	15,718	1,283,856	銀行
IMPERIAL OIL LTD	231	298	1,130	92,372	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	232	212	1,823	148,970	商業・専門サービス
TC ENERGY CORP	699	955	6,011	491,037	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	291	377	2,604	212,720	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	490	621	3,335	272,434	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	457	520	1,528	124,872	素材
BARRICK GOLD CORP	944	1,812	2,915	238,138	素材
BCE INC	115	162	968	79,128	電気通信サービス
BOMBARDIER INC-B	1,756	2,265	482	39,406	資本財
BANK OF MONTREAL	518	662	6,895	563,215	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	673	875	5,612	458,408	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	959	1,271	9,193	750,895	銀行
BAUSCH HEALTH COS INC	243	329	1,117	91,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	192	280	875	71,538	資本財
CAMECO CORP	350	412	570	46,608	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	239	261	541	44,214	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	348	458	5,073	414,384	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	973	1,246	4,729	386,331	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	598	755	9,368	765,181	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	52	62	895	73,141	小売
ENBRIDGE INC	1,324	2,103	10,390	848,730	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	22	29	1,788	146,123	保険
CGI INC	204	260	2,502	204,425	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	257	347	466	38,121	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	78	78	286	23,394	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	174	190	1,291	105,484	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,583	2,054	4,888	399,294	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	275	328	2,081	169,989	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	273	354	2,243	183,261	銀行
ONEX CORPORATION	63	90	679	55,501	各種金融
POWER CORP OF CANADA	278	358	1,068	87,314	保険
POWER FINANCIAL CORP	192	274	855	69,871	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	329	475	1,296	105,879	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC	1,325	1,658	7,089	579,079	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	36	81	817	66,800	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	116	148	4,357	355,889	運輸
ENCANA CORP	788	1,584	1,401	114,502	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	189	252	1,365	111,541	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	150	162	367	30,037	資本財
GOLDCORP INC	704	—	—	—	素材
KINROSS GOLD CORP	901	1,314	536	43,789	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	134	165	448	36,617	資本財
GREAT-WEST LIFECO INC	238	285	911	74,422	保険
METHANEX CORP	65	68	446	36,496	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	670	1,058	194	15,900	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	73	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	170	204	1,030	84,146	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	160	246	1,124	91,866	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	389	563	664	54,309	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	116	116	570	46,569	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	566	700	871	71,184	素材
FORTIS INC	342	430	2,142	175,014	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	345	453	3,665	299,375	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	484	688	456	37,314	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,478	1,897	14,090	1,150,946	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	151	189	1,855	151,550	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	351	466	1,259	102,883	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	116	187	574	46,906	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	76	—	—	—	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A	123	149	545	44,543	公益事業
METRO INC/CN	174	250	1,217	99,404	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	215	273	1,478	120,724	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	106	140	1,594	130,258	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP	483	—	—	—	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	814	1,105	1,340	109,481	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	244	401	317	25,940	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	205	277	550	44,979	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	404	524	2,497	203,982	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	101	159	501	40,987	エネルギー
DOLLARAMA INC	86	303	1,213	99,119	小売
KEYERA CORP	173	219	684	55,899	エネルギー
ALTAGAS LTD	155	303	565	46,156	公益事業
ATCO LTD -CLASS I	76	76	344	28,139	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	138	207	432	35,337	不動産
INTER PIPELINE LTD	300	423	877	71,692	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	151	210	391	31,986	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	228	228	202	16,574	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	21	2,419	197,612	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	183	250	2,255	184,241	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	49	49	295	24,101	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	106	149	833	68,080	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	352	—	—	—	各種金融
LINAMAR CORP	44	—	—	—	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD	225	351	769	62,815	公益事業
EMERA INC	54	54	271	22,194	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
SHOPIFY INC - CLASS A	71	94	3,264	266,631	ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	515	638	4,465	364,702	素材
WSP GLOBAL INC	—	102	714	58,352	資本財
AURORA CANNABIS INC	—	741	834	68,151	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANOPY GROWTH CORP	—	219	1,394	113,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STARS GROUP INC/THE	—	199	526	43,008	消費者サービス
IA FINANCIAL CORP INC	—	121	618	50,503	保険
CRONOS GROUP INC	—	199	410	33,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計 株数・金額	32,504	43,615	191,304	15,625,753	
小計 銘柄数<比率>	88	88	—	<3.6%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
COMMERZBANK AG	855	1,024	775	95,564	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,653	2,072	1,438	177,313	各種金融
SIEMENS AG-REG	611	794	8,497	1,047,355	資本財
RWE AG	418	537	1,191	146,813	公益事業
BASF SE	735	952	6,216	766,157	素材
VOLKSWAGEN AG	27	33	508	62,617	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	770	943	5,083	626,574	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	140	187	1,643	202,558	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	1,767	2,290	2,180	268,805	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	266	347	2,390	294,617	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	661	967	5,567	686,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANZ SE-REG	356	440	8,755	1,079,118	保険
MAN SE	25	—	—	—	資本財
CONTINENTAL AG	88	113	1,523	187,828	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	910	1,179	2,171	267,646	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	122	154	923	113,790	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	194	234	433	53,474	運輸
HUGO BOSS AG -ORD	46	67	405	49,957	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	778	1,027	2,955	364,220	運輸
SAP SE	786	1,019	11,240	1,385,365	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	185	256	396	48,834	メディア・娯楽
DEUTSCHE BOERSE AG	154	197	2,336	287,959	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	172	226	1,639	202,009	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	29	40	293	36,170	運輸
ADIDAS AG	150	187	4,719	581,735	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,669	3,459	5,159	635,873	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	124	155	3,261	401,991	保険
THYSSENKRUPP AG	352	425	612	75,494	素材
BEIERSDORF AG	82	101	994	122,599	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	119	156	1,070	131,939	素材
MERCK KGAA	104	130	1,258	155,125	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	147	192	2,893	356,662	自動車・自動車部品
PUMA SE	—	8	493	60,851	耐久消費財・アパレル
LANXESS AG	71	90	426	52,597	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	332	435	2,194	270,433	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG	17	25	300	37,005	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	284	374	1,564	192,787	不動産
GEA GROUP AG	145	171	430	53,089	資本財
SYMRISE AG	101	127	1,073	132,368	素材
K+S AG-REG	141	—	—	—	素材
HENKEL AG & CO KGAA	86	104	864	106,520	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	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		99	125	431	53,155	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		40	53	323	39,891	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE		48	61	791	97,593	保険
BRENNTAG AG		130	167	753	92,827	資本財
AXEL SPRINGER SE		33	49	235	28,967	メディア・娯楽
FUCHS PETROLUB SE -PREF		63	67	238	29,363	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		679	679	193	23,884	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG		83	104	299	36,863	資本財
VONOVIA SE		389	511	2,453	302,343	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG		122	180	473	58,306	素材
ZALANDO SE		85	122	477	58,901	小売
COVESTRO AG		154	194	854	105,328	素材
SCHAEFFLER AG - PREF		161	—	—	—	自動車・自動車部品
UNIPER SE		162	197	519	64,085	公益事業
INNOGY SE		108	145	582	71,850	公益事業
METRO AG		118	183	255	31,475	食品・生活必需品小売り
KION GROUP AG		53	68	376	46,366	資本財
LINDE AG - TENDER		148	—	—	—	素材
1&1 DRILLISCH AG		39	59	192	23,685	電気通信サービス
MTU AERO ENGINES AG		39	55	1,112	137,174	資本財
WIRECARD AG		94	118	1,599	197,142	ソフトウェア・サービス
DELIVERY HERO SE		—	101	424	52,369	小売
SARTORIUS AG-VORZUG		—	36	595	73,423	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		127	153	555	68,469	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	19,677	24,693	109,627	13,511,533	
	銘柄数<比率>	62	61	—	<3.1%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		1,000	1,232	2,084	256,904	保険
INTESA SANPAOLO		10,692	15,379	3,321	409,347	銀行
TELECOM ITALIA SPA		9,443	12,095	565	69,645	電気通信サービス
ENI SPA		2,038	2,626	3,746	461,750	エネルギー
UNICREDIT SPA		1,602	2,074	2,325	286,627	銀行
ENEL SPA		6,530	8,434	4,681	577,028	公益事業
RECORDATI SPA		72	114	404	49,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLANTIA SPA		364	504	1,158	142,815	運輸
INTESA SANPAOLO-RSP		843	—	—	—	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA		139	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA		524	623	567	69,971	銀行
SNAM SPA		1,864	2,394	1,085	133,745	エネルギー
TELECOM ITALIA-RSP		4,414	6,267	273	33,727	電気通信サービス
LEONARDO SPA		332	423	425	52,492	資本財
TERNA SPA		1,155	1,430	791	97,593	公益事業
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		880	—	—	—	保険
PRYSMIAN SPA		158	247	407	50,244	資本財
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		426	595	548	67,660	食品・飲料・タバコ
POSTE ITALIANE SPA		373	573	515	63,578	保険
MONCLER SPA		—	181	665	82,071	耐久消費財・アパレル
PIRELLI & C SPA		—	430	246	30,356	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	42,860	55,628	23,816	2,935,362	
	銘柄数<比率>	19	18	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)		137	176	1,941	239,235	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	223	288	9,607	1,184,092	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	471	618	1,308	161,237	自動車・自動車部品
AXA SA	1,551	2,006	4,433	546,475	保険
DANONE	482	639	4,465	550,335	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	474	625	1,096	135,120	食品・生活必需品小売り
VIVENDI	826	1,081	2,676	329,888	メディア・娯楽
INGENICO GROUP	43	67	481	59,328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	613	801	2,090	257,594	銀行
AIR LIQUIDE SA	343	444	5,041	621,379	素材
TOTAL SA	1,922	2,501	11,722	1,444,817	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	399	515	1,752	215,968	資本財
VINCI SA	405	526	4,520	557,141	資本財
SANOFI	909	1,168	8,500	1,047,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	392	565	1,170	144,297	公益事業
L'OREAL	201	261	6,143	757,141	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	154	199	701	86,454	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	453	569	4,058	500,241	資本財
BNP PARIBAS	898	1,164	5,298	652,983	銀行
ESSILORLUXOTTICA	166	298	3,289	405,400	耐久消費財・アパレル
CAPGEMINI SE	128	166	1,733	213,622	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	52	52	174	21,561	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	191	245	702	86,534	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	25	32	2,004	247,007	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA	75	91	911	112,361	消費者サービス
KERING	60	78	3,980	490,563	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	104	135	1,839	226,757	ソフトウェア・サービス
ATOS SE	76	97	664	81,842	ソフトウェア・サービス
ORANGE	1,599	2,066	2,837	349,767	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	126	177	354	43,721	保険
IMERYS SA	32	32	131	16,246	素材
SAFRAN SA	266	345	4,257	524,695	資本財
RENAULT SA	153	199	1,110	136,831	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	165	226	1,154	142,334	メディア・娯楽
LAGARDERE SCA	110	—	—	—	メディア・娯楽
JCDECAUX SA	67	67	190	23,441	メディア・娯楽
SOCIETE BIC SA	26	29	219	27,033	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	176	229	748	92,291	資本財
THALES SA	84	107	1,079	133,069	資本財
PERNOD RICARD SA	170	220	3,379	416,486	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	910	1,207	1,395	171,939	銀行
ENGIE	1,467	1,893	2,484	306,265	公益事業
ALSTOM	117	161	624	76,916	資本財
ARKEMA	55	73	585	72,220	素材
LEGRAND SA	213	276	1,660	204,671	資本財
SCOR SE	132	176	628	77,467	保険
ADP	23	32	504	62,210	運輸
EDF	447	648	789	97,257	公益事業
NATIXIS	739	932	474	58,429	各種金融
WENDEL	20	26	323	39,876	各種金融
BUREAU VERITAS SA	209	276	596	73,528	商業・専門サービス
EURAZEO SE	32	44	289	35,668	各種金融
EURAZEO SE-NEW	—	2	14	1,777	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	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SUEZ		276	415	514	63,408	公益事業
EIFFAGE		60	81	716	88,329	資本財
ILIAD SA		19	24	252	31,141	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		158	169	275	33,960	メディア・娯楽
BIOMERIEUX		29	40	288	35,540	ヘルスケア機器・サービス
GETLINK SE		368	498	710	87,557	運輸
EDENRED		177	243	992	122,386	商業・専門サービス
REMY COINTREAU		20	20	246	30,422	食品・飲料・タバコ
REXEL SA		221	292	322	39,773	資本財
BOLLORE		633	846	349	43,104	運輸
DASSAULT AVIATION SA		1	2	362	44,733	資本財
SEB SA		16	21	338	41,737	耐久消費財・アパレル
IPSEN		28	40	399	49,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA		46	62	380	46,845	各種金融
FAURECIA		62	83	329	40,669	自動車・自動車部品
TELEPERFORMANCE		44	59	981	120,967	商業・専門サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		59	89	746	91,971	メディア・娯楽
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		—	30	375	46,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDLINE SA		—	85	440	54,315	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	21,359	27,984	127,168	15,673,512	
	銘柄数<比率>	69	71	—	<3.6%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.		165	236	764	94,266	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV		824	1,030	882	108,718	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		860	1,129	1,462	180,289	自動車・自動車部品
FERRARI NV		98	128	1,601	197,402	自動車・自動車部品
EXOR NV		86	112	627	77,354	各種金融
AIRBUS SE		464	604	7,099	875,052	資本財
STMICROELECTRONICS NV		510	694	1,036	127,752	半導体・半導体製造装置
WOLTERS KLUWER		232	290	1,758	216,726	商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV		2,775	3,377	915	112,806	電気通信サービス
AKZO NOBEL N.V.		201	233	1,746	215,203	素材
HEINEKEN NV		206	269	2,580	318,055	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV		751	961	3,573	440,450	ヘルスケア機器・サービス
RELX NV		772	—	—	—	商業・専門サービス
AEGON NV		1,435	1,879	805	99,234	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		1,023	1,228	2,527	311,553	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD NV		97	117	577	71,231	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV		94	122	1,098	135,430	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		145	185	1,831	225,681	素材
ING GROEP NV		3,104	4,034	4,213	519,276	銀行
ASML HOLDING NV		310	425	7,460	919,514	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA		1,302	1,603	8,481	1,045,352	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		48	83	318	39,309	エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER		82	—	—	—	資本財
NN GROUP NV		244	316	1,176	145,056	保険
ALTICE EUROPE NV		479	—	—	—	メディア・娯楽
ABN AMRO GROUP NV-CVA		340	428	829	102,232	銀行
ADYEN NV		—	11	723	89,152	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	16,659	19,505	54,094	6,667,108	
	銘柄数<比率>	26	24	—	<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	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		216	269	403	49,705	資本財
ENDESA SA		243	318	709	87,473	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		195	273	1,030	126,998	資本財
IBERDROLA SA		4,657	6,433	5,141	633,744	公益事業
TELEFONICA SA		3,732	4,838	3,438	423,844	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		12,896	16,803	6,925	853,558	銀行
BANKINTER SA		515	662	449	55,421	銀行
REPSOL SA		1,001	1,454	2,078	256,139	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		5,322	6,895	3,501	431,549	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		277	372	966	119,134	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		871	1,128	2,842	350,349	小売
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		558	—	—	—	運輸
MAPFRE SA		969	1,250	327	40,366	保険
FERROVIAL SA		392	516	1,061	130,774	資本財
ENAGAS SA		172	240	609	75,080	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		363	435	823	101,500	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		4,391	5,932	617	76,151	銀行
CAIXABANK SA		2,858	3,668	1,007	124,198	銀行
GRIFOLS SA		241	308	710	87,545	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA		350	454	3,012	371,306	ソフトウェア・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		483	—	—	—	運輸
BANKIA SA		911	1,302	303	37,414	銀行
AENA SME SA		54	69	1,138	140,372	運輸
小計	株数・金額	41,679	53,629	37,100	4,572,629	
	銘柄数<比率>	23	21	—	<1.0%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS		155	198	901	111,063	保険
UCB SA		105	128	875	107,877	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		67	87	722	89,077	各種金融
UMICORE		170	217	662	81,634	素材
COLRUYT SA		53	63	407	50,241	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV		200	262	1,572	193,769	銀行
SOLVAY SA		57	76	694	85,580	素材
PROXIMUS		107	168	418	51,587	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		35	59	278	34,346	メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		609	790	5,855	721,654	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	1,562	2,052	12,388	1,526,833	
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		244	320	1,076	132,719	銀行
VERBUND AG		—	71	314	38,710	公益事業
OMV AG		120	157	691	85,254	エネルギー
VOESTALPINE AG		89	123	326	40,195	素材
ANDRITZ AG		51	73	261	32,171	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		111	145	336	41,474	銀行
小計	株数・金額	617	890	3,006	370,525	
	銘柄数<比率>	5	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP		25	42	198	24,465	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		—	818	613	75,584	不動産
TENARIS SA		380	497	580	71,569	エネルギー
SES		317	369	568	70,106	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	
(ユーロ…ルクセンブルク)		百株	百株	千ユーロ	千円	
EUROFINS SCIENTIFIC		10	12	497	61,260	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL		533	707	1,149	141,671	素材
小計	株数・金額	1,266	2,448	3,607	444,657	
	銘柄数<比率>	5	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		4,662	5,834	2,533	312,232	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		450	552	590	72,763	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ		84	112	293	36,148	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		426	566	1,377	169,798	素材
FORTUM OYJ		367	455	848	104,592	公益事業
KONE OYJ-B		269	353	1,756	216,526	資本財
METSO OYJ		102	108	336	41,511	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		357	465	1,838	226,557	保険
WARTSILA OYJ ABP		368	472	638	78,705	資本財
ELISA OYJ		110	150	578	71,287	電気通信サービス
NESTE OYJ		104	407	1,175	144,846	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		69	99	291	35,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	7,372	9,578	12,258	1,510,910	
	銘柄数<比率>	12	12	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		128	168	1,722	212,307	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		—	160	713	87,973	資本財
PADDY POWER BETFAIR PLC		68	80	557	68,708	消費者サービス
BANK OF IRELAND GROUP PLC		761	1,020	540	66,665	銀行
AIB GROUP PLC		667	897	362	44,627	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		—	228	590	72,797	素材
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD		472	472	—	—	銀行
CRH PLC		676	851	2,429	299,435	素材
小計	株数・金額	2,775	3,879	6,916	852,515	
	銘柄数<比率>	6	8	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,874	2,590	852	105,061	公益事業
JERONIMO MARTINS		183	243	335	41,341	食品・生活必需品小売り
GALP ENERGIA SGPS SA		412	525	729	89,912	エネルギー
小計	株数・金額	2,469	3,359	1,917	236,315	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額	158,300	203,649	391,901	48,301,903	
	銘柄数<比率>	240	240	—	<11.0%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		13,647	17,749	2,795	399,162	銀行
BP PLC		15,849	20,780	10,893	1,555,193	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		57,648	73,795	4,505	643,212	銀行
ASTRAZENECA PLC		1,013	1,314	7,480	1,068,037	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC		328	419	628	89,716	資本財
NEXT PLC		120	149	839	119,816	小売
DIAGEO PLC		1,998	2,518	8,172	1,166,805	食品・飲料・タバコ
SKY PLC		825	—	—	—	メディア・娯楽
BAE SYSTEMS PLC		2,553	3,251	1,526	217,886	資本財
UNILEVER PLC		986	1,152	5,314	758,741	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC		7,792	10,156	2,458	351,065	食品・生活必需品小売り
RELX PLC		856	2,042	3,557	507,866	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		1,211	1,677	455	64,967	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	534	697	4,286	612,019	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	2,072	2,683	4,326	617,675	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,789	6,250	1,693	241,827	保険
SAGE GROUP PLC/THE	893	1,100	786	112,332	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	16,007	20,786	13,552	1,934,886	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,835	2,380	6,757	964,703	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	528	706	563	80,386	公益事業
SCHRODERS PLC	92	119	366	52,369	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,880	5,062	1,179	168,332	銀行
BHP GROUP PLC	1,695	2,189	3,816	544,949	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	763	990	2,143	306,049	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	1,008	1,336	1,286	183,650	メディア・娯楽
CENTRICA PLC	4,515	5,907	546	78,093	公益事業
BT GROUP PLC	6,753	8,750	1,827	260,859	電気通信サービス
SSE PLC	824	1,039	1,156	165,092	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	2,639	2,919	1,984	283,380	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,327	1,767	1,624	231,864	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT	86,184	125,524	12	1,792	資本財
COMPASS GROUP PLC	1,269	1,645	2,809	401,141	消費者サービス
KINGFISHER PLC	1,819	2,231	542	77,425	小売
PEARSON PLC	662	815	654	93,414	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC	191	255	500	71,500	公益事業
RIO TINTO PLC	971	1,198	5,286	754,772	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,939	5,148	7,732	1,103,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC	782	1,004	1,047	149,568	各種金融
VODAFONE GROUP PLC	21,368	27,677	3,847	549,259	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,697	2,401	517	73,862	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	1,421	1,772	375	53,579	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	3,220	3,963	1,645	234,867	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	155	201	635	90,671	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC	840	1,102	611	87,260	保険
WHITBREAD PLC	148	194	879	125,559	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	2,727	3,526	2,946	420,713	公益事業
FERGUSON PLC	200	—	—	—	資本財
BUNZL PLC	262	343	730	104,349	資本財
COBHAM PLC	1,705	—	—	—	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	1,070	1,092	2,068	295,350	素材
INTERTEK GROUP PLC	132	172	883	126,090	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	346	425	817	116,648	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	146	172	836	119,417	消費者サービス
CARNIVAL PLC	149	174	689	98,394	消費者サービス
PERSIMMON PLC	250	321	672	96,048	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	565	810	433	61,849	資本財
ITV PLC	2,817	3,763	449	64,129	メディア・娯楽
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	250	324	1,646	235,037	各種金融
G4S PLC	1,159	1,704	358	51,174	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	99	122	453	64,715	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	781	1,064	640	91,465	耐久消費財・アパレル
IMI PLC	192	—	—	—	資本財
SMITH & NEPHEW PLC	702	907	1,463	208,893	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	2,655	3,313	587	83,818	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,638	4,669	11,331	1,617,803	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
TRAVIS PERKINS PLC	179	—	—	—	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,999	3,884	9,451	1,349,334	エネルギー
OLD MUTUAL PLC	3,961	—	—	—	保険
INVESTEC PLC	491	745	355	50,825	各種金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2,145	2,689	715	102,128	各種金融
EXPERIAN PLC	743	942	2,056	293,668	商業・専門サービス
MONDI PLC	299	384	636	90,874	素材
WEIR GROUP PLC/THE	198	247	397	56,732	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	286	377	946	135,113	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	286	408	341	48,689	素材
SHIRE PLC	726	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADMIRAL GROUP PLC	148	209	430	61,440	保険
FRESNILLO PLC	155	211	153	21,914	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD	72	—	—	—	素材
BABCOCK INTL GROUP PLC	227	227	118	16,898	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC	422	543	598	85,399	各種金融
GLENCORE PLC	9,805	11,709	3,288	469,501	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	196	302	695	99,249	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	107	132	674	96,242	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,769	5,084	926	132,338	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	139	209	572	81,675	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC	118	192	199	28,430	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,067	1,489	466	66,594	保険
ROYAL MAIL PLC	686	980	239	34,139	運輸
ASHTEAD GROUP PLC	400	508	1,032	147,351	資本財
MERLIN ENTERTAINMENT	651	681	251	35,944	消費者サービス
TUI AG-DI	358	469	388	55,473	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	330	368	657	93,820	ソフトウェア・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	339	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NMC HEALTH PLC	—	116	307	43,948	ヘルスケア機器・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	695	959	549	78,391	メディア・娯楽
DCC PLC	71	104	689	98,385	資本財
GVC HOLDINGS PLC	413	618	369	52,761	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC	1,236	1,236	181	25,875	ヘルスケア機器・サービス
JOHN WOOD GROUP PLC	525	695	311	44,423	エネルギー
INFORMA PLC	—	1,275	956	136,608	メディア・娯楽
FERGUSON PLC	—	242	1,338	191,101	資本財
小計 株数・金額	332,787	435,994	180,925	25,830,778	
小計 銘柄数<比率>	99	93	—	<5.9%>	
(スイス)			千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	2,489	3,177	30,978	3,361,774	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	418	540	3,845	417,367	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,941	2,648	3,283	356,374	各種金融
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	364	503	2,602	282,420	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	562	729	18,812	2,041,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG	7	9	2,462	267,254	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	40	55	1,147	124,502	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	121	156	4,952	537,455	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8	11	913	99,186	ヘルスケア機器・サービス
LONZA GROUP AG-REG	59	77	2,429	263,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	39	62	343	37,231	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	34	40	852	92,514	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
GEBERIT AG-REG	29	38	1,760	191,053	資本財
SWISS RE AG	251	315	2,862	310,656	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	25	31	909	98,717	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR	26	36	282	30,696	各種金融
NOVARTIS AG-REG	1,779	2,249	18,475	2,004,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	133	165	937	101,719	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	21	27	1,280	138,981	電気通信サービス
ABB LTD-REG	1,473	1,907	3,690	400,493	資本財
CLARIANT AG-REG	191	191	371	40,356	素材
SGS SA-REG	4	5	1,475	160,147	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	14	22	458	49,706	資本財
TEMENOS AG - REG	—	60	992	107,689	ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	43	56	774	84,003	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	39	49	809	87,864	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	26	35	1,616	175,388	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.08	0.09	678	73,641	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	179	237	1,082	117,428	各種金融
SIKA AG-REG	1	133	2,058	223,407	素材
SWISS PRIME SITE-REG	56	82	677	73,574	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.88	1	693	75,261	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	14	18	1,344	145,940	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	2	393	42,673	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	7	8	529	57,416	素材
UBS GROUP AG-REG	2,926	3,997	4,853	526,699	各種金融
DUFRY AG-REG	25	36	344	37,373	小売
VIFOR PHARMA AG	38	45	621	67,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALCON INC	—	449	2,824	306,527	ヘルスケア機器・サービス
小計 株数・金額	13,398	18,221	125,424	13,611,088	
銘柄数<比率>	37	39	—	<3.1%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	187	261	5,916	67,447	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	2,457	3,187	28,193	321,407	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	314	389	9,947	113,397	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,217	1,671	14,926	170,162	銀行
INVESTOR AB-B SHS	363	459	19,793	225,646	各種金融
NORDEA BANK AB	2,432	—	—	—	銀行
GETINGE AB-B SHS	143	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,225	1,586	16,049	182,962	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	535	708	19,759	225,262	資本財
SKF AB-B SHARES	297	403	6,512	74,242	資本財
ASSA ABLOY AB-B	802	1,046	20,465	233,304	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	758	928	14,765	168,331	小売
SANDVIK AB	903	1,169	18,977	216,344	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES	726	958	14,058	160,263	銀行
SECURITAS AB-B SHS	230	333	5,430	61,912	商業・専門サービス
SKANSKA AB-B SHS	250	363	5,816	66,309	資本財
SWEDISH MATCH AB	145	173	8,122	92,597	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	256	518	6,572	74,928	電気通信サービス
TELIA CO AB	2,270	2,919	11,793	134,444	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS	1,249	1,625	22,763	259,503	資本財
ALFA LAVAL AB	226	302	6,337	72,250	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	164	201	5,698	64,959	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	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円	
BOLIDEN AB		222	283	6,750	76,959	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		381	470	4,045	46,113	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		46	73	4,012	45,737	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS		208	262	12,637	144,071	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B		185	262	6,924	78,933	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		150	150	3,060	34,889	各種金融
ICA GRUPPEN AB		72	72	2,648	30,188	食品・生活必需品小売り
LUNDBERGS AB-B SHS		33	66	2,061	23,504	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B		484	636	17,836	203,339	家庭用品・パーソナル用品
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION		289	—	—	—	資本財
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION		494	—	—	—	資本財
EPIROC AB-B		—	440	3,956	45,101	資本財
EPIROC AB-A		—	643	6,020	68,637	資本財
NORDEA BANK ABP		—	3,152	23,226	264,785	銀行
小計	株数・金額	19,728	25,723	355,082	4,047,937	
	銘柄数<比率>	33	32	—	<0.9%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		785	1,002	15,470	194,468	銀行
NORSK HYDRO ASA		1,047	1,415	4,680	58,835	素材
ORKLA ASA		665	802	6,002	75,455	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA		931	1,200	21,970	276,166	エネルギー
TELENOR ASA		602	777	13,477	169,414	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		139	182	6,643	83,511	素材
MOWI ASA		334	430	8,552	107,503	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		137	193	3,254	40,903	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		80	109	2,334	29,340	メディア・娯楽
AKER BP ASA		—	117	3,021	37,985	エネルギー
小計	株数・金額	4,723	6,233	85,408	1,073,583	
	銘柄数<比率>	9	10	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B		1,491	1,884	60,294	995,460	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		185	226	7,341	121,213	素材
DANSKE BANK A/S		598	742	8,321	137,391	銀行
DEMANT A/S		82	104	2,326	38,410	ヘルスケア機器・サービス
H LUNDBECK A/S		62	62	1,701	28,084	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		172	202	11,557	190,820	資本財
CARLSBERG AS-B		87	108	9,514	157,081	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B		96	123	8,840	145,960	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S		152	189	11,472	189,414	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		5	7	5,993	98,949	運輸
TRYG A/S		87	121	2,484	41,016	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		2	3	2,807	46,357	運輸
PANDORA A/S		86	122	3,385	55,890	耐久消費財・アパレル
ISS A/S		127	183	3,940	65,052	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		79	99	7,058	116,535	素材
GENMAB A/S		47	62	6,795	112,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S		153	193	10,126	167,187	公益事業
小計	株数・金額	3,518	4,439	163,962	2,707,014	
	銘柄数<比率>	17	17	—	<0.6%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BHP GROUP LTD		2,576	3,059	11,259	862,579	素材
CSL LTD		362	470	9,279	710,897	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
ALUMINA LTD	2,184	2,703	608	46,604	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	749	976	3,488	267,270	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,355	2,979	8,194	627,802	銀行
RIO TINTO LTD	332	386	3,684	282,252	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,123	1,364	1,726	132,275	保険
LENDLEASE GROUP	424	627	799	61,274	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,404	1,838	13,865	1,062,197	銀行
WESTPAC BANKING CORP	2,720	3,570	9,718	744,550	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,154	2,846	7,382	565,593	銀行
BRAMBLES LTD	1,296	1,640	2,012	154,199	商業・専門サービス
BORAL LTD	920	1,267	607	46,522	素材
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,047	1,372	4,528	346,900	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	3,433	4,389	1,496	114,666	電気通信サービス
AMP LTD	2,446	3,147	698	53,531	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	1,472	2,062	950	72,853	消費者サービス
AMCOR LIMITED	947	1,197	1,922	147,309	素材
COMPUTERSHARE LTD	359	462	828	63,507	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	442	599	1,560	119,547	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	260	336	4,199	321,707	各種金融
CIMIC GROUP LTD	91	94	427	32,746	資本財
ASX LTD	160	198	1,498	114,798	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	393	584	516	39,588	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	46	63	1,244	95,313	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	363	441	812	62,246	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	521	552	219	16,849	小売
NEWCREST MINING LTD	624	789	2,010	154,030	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,917	2,355	1,865	142,922	保険
ORIGIN ENERGY LTD	1,418	1,780	1,337	102,465	エネルギー
ORICA LTD	277	399	776	59,497	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	318	476	1,254	96,094	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	1,469	1,881	1,315	100,775	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	1,053	1,343	1,836	140,663	保険
TRANSURBAN GROUP	1,793	2,794	3,795	290,742	運輸
WESFARMERS LTD	908	1,179	4,315	330,641	小売
BLUESCOPE STEEL LTD	432	583	775	59,419	素材
CHALLENGER LTD	432	610	490	37,557	各種金融
SYDNEY AIRPORT	851	1,232	950	72,823	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	204	291	760	58,262	エネルギー
OIL SEARCH LTD	1,098	1,406	1,066	81,678	エネルギー
WORLEYPARSONS LTD	—	363	500	38,338	エネルギー
AGL ENERGY LTD	539	667	1,532	117,384	公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,146	1,590	1,199	91,895	素材
AUSNET SERVICES	1,869	1,869	346	26,561	公益事業
CROWN RESORTS LTD	266	379	501	38,393	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,244	1,623	531	40,680	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	438	545	576	44,167	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	1,595	2,121	1,054	80,792	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	596	773	1,167	89,436	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD	115	150	956	73,304	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	51	51	206	15,812	消費者サービス
SEEK LTD	300	372	748	57,333	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	382	376	336	25,766	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
REA GROUP LTD	49	50	417	31,953	メディア・娯楽
TPG TELECOM LTD	341	341	216	16,614	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD	1,606	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,135	3,016	868	66,560	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	58	63	259	19,914	消費者サービス
SOUTH32 LTD	4,168	5,138	1,690	129,511	素材
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	—	135	311	23,849	エネルギー
COLES GROUP LTD	—	1,184	1,504	115,275	食品・生活必需品小売り
小計 株数・金額	60,303	77,180	131,010	10,036,709	
小計 銘柄数<比率>	59	61	—	<2.3%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,288	1,923	696	50,319	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	863	993	836	60,459	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	458	576	920	66,483	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	629	862	441	31,899	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	360	360	422	30,511	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	851	1,237	520	37,631	公益事業
MERCURY NZ LTD	643	—	—	—	公益事業
A2 MILK CO LTD	—	738	1,178	85,168	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	5,095	6,693	5,016	362,474	
小計 銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	920	1,170	2,638	36,884	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	365	510	4,926	68,873	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,163	2,808	22,399	313,141	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,160	1,660	22,244	310,971	不動産
MTR CORP	1,180	1,635	7,553	105,600	運輸
HONG KONG & CHINA GAS	6,831	9,704	18,167	253,981	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,940	6,570	8,251	115,361	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,155	1,435	8,000	111,841	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	943	1,239	31,222	436,494	各種金融
HANG LUNG GROUP LTD	850	880	1,905	26,634	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,490	2,180	3,723	52,053	不動産
CLP HOLDINGS LTD	1,335	1,725	15,102	211,131	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	935	1,369	6,511	91,035	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	908	1,366	3,299	46,125	銀行
HANG SENG BANK LTD	613	795	16,138	225,616	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	570	710	3,028	42,333	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,220	1,220	1,288	18,010	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	244	334	2,904	40,599	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	2,294	3,334	4,340	60,685	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	480	765	1,897	26,522	耐久消費財・アパレル
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	505	710	4,451	62,234	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,965	3,870	12,751	178,268	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	1,105	1,385	7,243	101,264	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD	4,060	4,060	1,940	27,130	電気通信サービス
LI & FUNG LTD	5,420	—	—	—	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD	605	605	1,948	27,234	不動産
MINTH GROUP LTD	540	840	2,032	28,418	自動車・自動車部品
NWS HOLDINGS LTD	1,465	1,785	2,898	40,525	資本財
SANDS CHINA LTD	1,948	2,464	10,213	142,781	消費者サービス
WHEELOCK & CO LTD	620	840	4,582	64,059	不動産

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
WYNN MACAU LTD	1,176	1,508	2,967	41,489	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	1,750	2,400	2,280	31,874	消費者サービス
FIRST PACIFIC CO	2,000	—	—	—	各種金融
AIA GROUP LTD	9,666	12,538	97,733	1,366,317	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	834	1,230	3,905	54,595	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,890	2,490	13,533	189,193	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	884	884	1,264	17,672	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	2,760	3,950	4,890	68,363	電気通信サービス
WH GROUP LTD	6,945	8,910	6,860	95,912	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,068	2,683	16,652	232,798	不動産
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	4,160	—	—	—	各種金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,020	1,260	7,339	102,606	不動産
小計 株数・金額	84,985	95,823	391,032	5,466,639	
小計 銘柄数<比率>	42	39	—	<1.2%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,498	3,311	3,771	303,244	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,061	1,528	365	29,374	メディア・娯楽
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	926	926	234	18,838	資本財
CAPITALAND LTD	2,012	2,614	888	71,465	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	378	378	330	26,565	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	63	109	379	30,509	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,428	1,862	4,943	397,515	銀行
KEPPEL CORP LTD	1,218	1,476	963	77,501	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,061	1,392	3,564	286,654	銀行
VENTURE CORP LTD	—	300	480	38,669	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,445	1,748	702	56,503	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,468	8,473	2,686	215,991	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	439	583	556	44,753	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	615	812	599	48,186	各種金融
UOL GROUP LTD	443	443	321	25,861	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	2,010	2,383	612	49,245	運輸
STARHUB LTD	582	—	—	—	電気通信サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,395	6,395	179	14,399	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,469	2,112	741	59,608	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE LTD	4,435	6,480	605	48,718	消費者サービス
SATS LTD	650	650	342	27,544	運輸
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	2,085	2,745	409	32,888	資本財
小計 株数・金額	37,683	46,722	23,679	1,904,040	
小計 銘柄数<比率>	21	21	—	<0.4%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
ISRAEL CHEMICALS LTD	483	710	1,399	43,135	素材
BANK HAPOALIM BM	846	1,078	2,940	90,612	銀行
NICE LTD	46	62	3,001	92,508	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,192	1,504	3,684	113,551	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	22	22	1,094	33,718	資本財
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	1,865	1,865	484	14,945	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	125	159	1,249	38,513	銀行
AZRIELI GROUP LTD	37	37	741	22,859	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	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエルシェケル	千円	
FRUTAROM		26	－	－	－	素材
小計	株数・金額	4,644	5,441	14,595	449,845	
	銘柄数＜比率＞	9	8	－	＜0.1%＞	
合計	株数・金額	1,002,429	1,284,294	－	410,232,624	
	銘柄数＜比率＞	1,262	1,253	－	＜93.8%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の＜　＞内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
HCP INC	37	47	1,444	158,512	0.0
MACERICH CO/THE	9	11	486	53,440	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7	11	1,617	177,542	0.0
PROLOGIS INC	42	65	4,935	541,597	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	7	9	953	104,654	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11	16	865	95,033	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	16	21	2,517	276,283	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	6	1,948	213,835	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	10	12	1,369	150,341	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5	7	957	105,121	0.0
WELLTOWER INC	29	39	3,026	332,149	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	12	16	2,122	232,966	0.1
MID-AMERICA APARTMENT COMM	8	11	1,285	141,095	0.0
REALTY INCOME CORP	22	30	2,092	229,669	0.1
REGENCY CENTERS CORP	12	15	1,004	110,237	0.0
SL GREEN REALTY CORP	8	8	711	78,106	0.0
UDR INC	20	27	1,207	132,486	0.0
VENTAS INC	28	37	2,340	256,866	0.1
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	93	141	1,364	149,794	0.0
WEYERHAEUSER CO	60	77	1,987	218,078	0.0
AMERICAN TOWER CORP	34	45	8,949	982,073	0.2
AGNC INVESTMENT CORP	31	56	994	109,082	0.0
WP CAREY INC	—	17	1,364	149,690	0.0
VEREIT INC	83	95	805	88,406	0.0
DUKE REALTY CORP	29	38	1,172	128,706	0.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	22	—	—	—	—
IRON MOUNTAIN INC	22	27	871	95,641	0.0
EQUINIX INC	6	8	4,002	439,251	0.1
CROWN CASTLE INTL CORP	32	43	5,412	594,012	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	29	38	2,904	318,749	0.1
COLONY CAPITAL INC	47	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	25	36	921	101,095	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	12	251	27,603	0.0
GGP INC	46	—	—	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	59	75	1,454	159,587	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	11	15	729	80,053	0.0
PUBLIC STORAGE	12	16	3,676	403,408	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	24	32	5,628	617,704	0.1
VORNADO REALTY TRUST	13	18	1,219	133,869	0.0
KIMCO REALTY CORP	33	42	775	85,108	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11	14	2,884	316,556	0.1
小計 口数・金額	1,027	1,250	78,261	8,588,416	
小計 銘柄数<比率>	39	38	—	<2.0%>	

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		5	5	192	15,713	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		12	12	283	23,178	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		13	13	360	29,485	0.0
小計	口数・金額	31	31	837	68,376	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		3	4	664	81,883	0.0
KLEPIERRE		17	21	657	80,991	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		7	—	—	—	—
COVIVIO		3	4	484	59,675	0.0
ICADE		3	3	241	29,770	0.0
小計	口数・金額	35	34	2,047	252,321	
	銘柄数<比率>	5	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	14	2,108	259,844	0.1
小計	口数・金額	—	14	2,108	259,844	
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.1%>	
ユーロ計	口数・金額	35	48	4,155	512,166	
	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		79	94	537	76,791	0.0
HAMMERSON PLC		59	75	226	32,308	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		60	75	679	96,992	0.0
SEGRO PLC		79	112	770	110,021	0.0
小計	口数・金額	277	357	2,214	316,113	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		258	364	918	70,404	0.0
SCENTRE GROUP		427	564	2,101	160,960	0.0
GPT GROUP		137	199	1,146	87,846	0.0
MIRVAC GROUP		283	389	1,117	85,622	0.0
STOCKLAND		199	264	1,012	77,570	0.0
WESTFIELD CORP		158	—	—	—	—
DEXUS		80	104	1,313	100,654	0.0
GOODMAN GROUP		145	174	2,292	175,630	0.0
小計	口数・金額	1,691	2,061	9,903	758,688	
	銘柄数<比率>	8	7	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		176	220	20,561	287,451	0.1
小計	口数・金額	176	220	20,561	287,451	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		239	249	446	35,868	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		204	278	529	42,579	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		176	244	596	47,931	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		182	278	817	65,767	0.0
小計	口数・金額	802	1,050	2,389	192,147	
	銘柄数＜比率＞	4	4	－	＜0.0%＞	
合計	口数・金額	4,041	5,021	－	10,723,360	
	銘柄数＜比率＞	64	62	－	＜2.5%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率および合計欄の＜　＞内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	SP EMINI	11,500	－
		SP/TSE60	654	－
		SWISS IX	532	－
		EURO ST	2,303	－
		SPI 200	747	－
		FTSE100	1,024	－

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

○投資信託財産の構成

(2019年５月13日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	410,232,624	93.2
投資証券	10,723,360	2.4
コール・ローン等、その他	19,225,132	4.4
投資信託財産総額	440,181,116	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（437,136,138千円）の投資信託財産総額（440,181,116千円）に対する比率は99.3%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

１アメリカドル＝109.74円	１カナダドル＝81.68円	１ユーロ＝123.25円	１イギリスポンド＝142.77円
１スイスフラン＝108.52円	１スウェーデンクローネ＝11.40円	１ノルウェークローネ＝12.57円	１デンマーククローネ＝16.51円
１オーストラリアドル＝76.61円	１ニュージーランドドル＝72.25円	１香港ドル＝13.98円	１シンガポールドル＝80.41円
１イスラエルシェケル＝30.82円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年５月13日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	440,971,113,180
コール・ローン等	15,173,443,879
株式(評価額)	410,232,624,351
投資証券(評価額)	10,723,360,397
未収入金	849,774,577
未収配当金	646,527,745
差入委託証拠金	3,345,382,231
(B) 負債	3,602,222,022
未払金	941,654,593
未払解約金	2,660,564,803
未払利息	2,626
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	437,368,891,158
元本	157,760,668,644
次期繰越損益金	279,608,222,514
(D) 受益権総口数	157,760,668,644口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	27,724円

＜注記事項＞

①期首元本額　125,901,148,704円
　期中追加設定元本額　111,735,158,704円
　期中一部解約元本額　79,875,638,764円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.7724円です。

○損益の状況 (2018年５月15日～2019年５月13日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	7,946,864,936
受取配当金	7,829,819,040
受取利息	114,604,357
その他収益金	12,266,553
支払利息	△ 9,825,014
(B) 有価証券売買損益	323,388,189
売買益	34,675,324,699
売買損	△ 34,351,936,510
(C) 先物取引等取引損益	1,331,486,860
取引益	3,352,805,866
取引損	△ 2,021,319,006
(D) 保管費用等	△ 100,385,803
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	9,501,354,182
(F) 前期繰越損益金	211,325,433,143
(G) 追加信託差損益金	197,426,010,611
(H) 解約差損益金	△138,644,575,422
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	279,608,222,514
次期繰越損益金(Ｉ)	279,608,222,514

(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。

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）

ファンド・マネジャー（海外株式）	9,349,912,709円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国株式インデックス	13,690,894,348円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,274,367,717円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	331,931,001円
コアバランス	313,507円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	10,429,401円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	19,052,977円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	15,355,803円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国株式インデックス	15,231,120,679円
海外株式セレクション（ラップ向け）	1,530,020,796円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	1,104,197,638円
つみたて先進国株式	1,415,936,754円
つみたて８資産均等バランス	372,329,195円
つみたて４資産均等バランス	94,626,260円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	1,099,902円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	1,571,935円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	1,750,687円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	2,625,827円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	2,510,057円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	2,498,124円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（除く日本）	1,698,697,563円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（３地域均等型）	116,731,351円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（オール・カントリー）	975,998,442円

三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	842,063円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド	13,107,918,002円
ｅＭＡＸＩＳ 全世界株式インデックス	2,549,571,626円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	1,063,250,682円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,754,943,655円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	495,042,880円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	233,164,654円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	783,651,042円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	140,698,803円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	35,813,470円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	49,241,049円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	192,167,657円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	143,039,532円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	358,884,041円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	39,600,227円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,653,512,982円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	148,055,322円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,669,476,870円
ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	48,657,702,765円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	46,877,761円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	10,356,452円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,326,764,577円
ＭＳＣＩコクサイインデックスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	3,068,732,867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）	9,010,377,349円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	22,754,930円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	146,920,789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）	1,675,907,858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）	563,712,560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）	450,848,009円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	42,190,265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）	1,562,400,166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）	54,277,812円
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）	2,179,995,355円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	2,287,052,619円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,431,400円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	5,934,923円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	7,022,855円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	6,171,330円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	52,130,192円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	13,586,828円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	90,172,276円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	18,144,698円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	117,022,383円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国株式インデックスファンド	4,721,775,708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）	161,535,508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）	629,757,314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）	613,910,292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）	552,353,573円
合計	157,760,668,644円

新興国株式インデックスマザーファンド

《第10期》決算日2019年５月13日

［計算期間：2018年５月15日～2019年５月13日］

「新興国株式インデックスマザーファンド」は、５月13日に第10期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	新興国の株式等（ＤＲ（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（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（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	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
6期(2015年5月12日)	23,973	23.1	124,478.28	21.2	94.8	5.0	0.4	39,530
7期(2016年5月12日)	17,338	△27.7	87,559.17	△29.7	92.8	6.4	0.5	35,618
8期(2017年5月12日)	23,115	33.3	113,979.54	30.2	92.6	6.5	0.4	49,734
9期(2018年5月14日)	26,349	14.0	127,289.86	11.7	94.0	5.6	0.4	71,556
10期(2019年5月13日)	23,990	△ 9.0	113,409.38	△10.9	95.6	3.6	0.3	85,987

(注) ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックスとは、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（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（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) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。
(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(円換算ベース)	騰落率			
(期　首)	円	%		%	%	%	%
2018年５月14日	26,349	－	127,289.86	－	94.0	5.6	0.4
５月末	25,099	△ 4.7	120,955.82	△ 5.0	94.7	4.5	0.4
６月末	24,089	△ 8.6	115,703.10	△ 9.1	95.4	4.4	0.4
７月末	25,300	△ 4.0	121,016.89	△ 4.9	94.7	4.9	0.4
８月末	24,608	△ 6.6	117,484.15	△ 7.7	95.4	4.1	0.3
９月末	25,050	△ 4.9	119,396.48	△ 6.2	96.2	3.4	0.3
10月末	22,305	△15.3	106,045.68	△16.7	94.3	5.5	0.3
11月末	23,822	△ 9.6	113,248.96	△11.0	94.3	5.3	0.3
12月末	22,290	△15.4	105,708.96	△17.0	94.3	5.9	0.3
2019年１月末	23,866	△ 9.4	112,951.64	△11.3	94.4	5.2	0.3
２月末	24,836	△ 5.7	117,662.23	△ 7.6	95.0	4.7	0.3
３月末	24,520	△ 6.9	116,008.41	△ 8.9	96.0	3.8	0.3
４月末	25,461	△ 3.4	120,430.46	△ 5.4	96.1	3.6	0.3
(期　末)							
2019年５月13日	23,990	△ 9.0	113,409.38	△10.9	95.6	3.6	0.3

(注) 騰落率は期首比。
(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
(注) 「株式先物比率」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

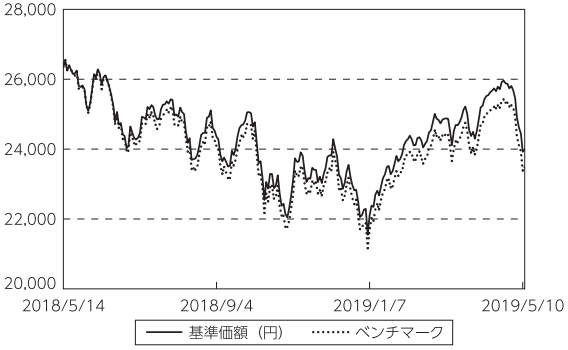
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ9.0%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－10.9%）を1.9%上回りました。

基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎新興国株式市況

・新興国株式市況は、米中貿易摩擦や世界経済の減速懸念などを背景に、下落しました。

◎為替市況

・為替市況は、期首に比べて0.4%の円安・香港ドル高、8.6%の円高・ブラジルレアル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・ＭＳＣＩ エマージング・マーケット・インデックス（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1.9%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

・配当要因※　2.3%

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

（主なマイナス要因）

・取引要因

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2018年５月15日～2019年５月13日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	9	0.038	(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）	(8)	(0.033)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(1)	(0.004)	
(b) 有価証券取引税	6	0.026	(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）	(6)	(0.026)	
（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	26	0.108	(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）	(23)	(0.094)	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)	(0.014)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	41	0.172	
期中の平均基準価額は、24,338円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2018年５月15日～2019年５月13日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 3,007,774 (426)	千アメリカドル 31,804 (－)	百株 3,278,684	千アメリカドル 2,499
	メキシコ	34,939 (－)	千メキシコペソ 120,150 (△304)	7,963 (－)	千メキシコペソ 23,288 (44)
	ブラジル	19,476 (4,840)	千ブラジルレアル 53,489 (677)	2,519 (330)	千ブラジルレアル 5,816 (2,331)
	チリ	102,680 (756)	千チリペソ 1,382,649 (2,390)	14,381 (－)	千チリペソ 396,808 (2,390)
	コロンビア	6,077	千コロンビアペソ 3,223,502	2,017	千コロンビアペソ 959,930
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ギリシャ	2,357 (△6,668)	468 (△3)	3,070	211
	イギリス	294	千イギリスポンド 235	－	千イギリスポンド －
	トルコ	6,831 (4,550)	千トルコリラ 6,737 (555)	5,715 (2,879)	千トルコリラ 3,173 (339)
	チェコ	394 (－)	千チェココルナ 10,709 (△37)	193	千チェココルナ 6,074
	ハンガリー	287	千ハンガリーフォリント 187,483	75	千ハンガリーフォリント 59,086
	ポーランド	2,628	千ポーランドズロチ 7,997	1,351	千ポーランドズロチ 1,471
	香港	577,238 (10,667)	千香港ドル 462,299 (180)	68,686 (1,111)	千香港ドル 37,897 (81)
	マレーシア	40,727 (999)	千マレーシアリンギット 21,622 (－)	22,954	千マレーシアリンギット 5,939
	タイ	38,790 (260)	千タイバーツ 169,535 (－)	5,184 (－)	千タイバーツ 29,948 (28)
	フィリピン	29,573 (3)	千フィリピンペソ 131,064 (－)	3,388	千フィリピンペソ 21,790

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	インドネシア	百株 112,784	千インドネシアルピア 67,637,531	百株 34,906	千インドネシアルピア 13,858,532
	韓国	6,407 (143)	千韓国ウォン 32,515,714 (182,591)	1,422 (13)	千韓国ウォン 4,969,548 (182,591)
	台湾	138,580 (△ 877)	千ニュー台湾ドル 735,212 (△ 7,702)	28,053 (－)	千ニュー台湾ドル 94,773 (1)
	インド	31,584 (16,639)	千インドルピー 1,393,829 (19,192)	7,069 (5,670)	千インドルピー 167,572 (12,103)
	中国オフショア	31,018 (24)	千オフショア元 31,798 (－)	388	千オフショア元 309
	アラブ首長国連邦	12,672 (920)	千アラブディルハム 8,404 (211)	5,484 (460)	千アラブディルハム 501 (68)
	カタール	1,364	千カタールリアル 11,828	450	千カタールリアル 800
	南アフリカ	16,857 (867)	千南アフリカランド 186,927 (－)	3,619	千南アフリカランド 25,762

(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 － (80,311)	千タイバーツ － (28)	証券 80,311	千タイバーツ 48

(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	メキシコ	千口	千メキシコペソ	千口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	96 (－)	2,553 (△ 309)	－	－
	小計	96 (－)	2,553 (△ 309)	－	－
	トルコ		千トルコリラ		千トルコリラ
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	－	－	264	428
	小計	－	－	264	428
	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	114	2,822	－	－
	REDEFINE PROPERTIES LTD	277	2,743	－	－
	HYPROP INVESTMENTS LTD	10	933	－	－
	RESILIENT REIT LTD	14	923	－	－
	FORTRESS REIT LTD-A	152	2,585	65	1,100
	FORTRESS REIT LTD-B	－	－	－ (12)	－ (190)
	小計	569	10,007	65 (12)	1,100 (190)

(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 36,474	百万円 37,101	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2018年５月15日～2019年５月13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	29,180,461千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	72,889,606千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.40

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2018年５月15日～2019年５月13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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	41,010	5,154	12.6	20,564	2,842	13.8

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

○組入資産の明細

（2019年５月13日現在）

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SINA CORP	64	94	524	57,610	メディア・娯楽
NETEASE INC-ADR	89	113	3,012	330,571	メディア・娯楽
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	450	601	2,407	264,179	小売
51JOB INC-ADR	—	33	249	27,368	商業・専門サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	206	247	372	40,829	素材
BAIDU INC - SPON ADR	309	401	6,288	690,151	メディア・娯楽
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	547	701	545	59,914	電気通信サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	148	209	1,846	202,600	消費者サービス
SOUTHERN COPPER CORP	100	144	514	56,469	素材
CREDICORP LTD	78	97	2,187	240,027	銀行
HUAZHU GROUP LTD-ADR	—	196	734	80,603	消費者サービス
YY INC-ADR	48	71	514	56,431	メディア・娯楽
TAL EDUCATION GROUP- ADR	354	510	1,817	199,401	消費者サービス
TRANSNEFT PJSC	0.62	0.62	151	16,663	エネルギー
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	1,591	2,104	294	32,370	各種金融
AUTOHOME INC-ADR	64	86	912	100,105	メディア・娯楽
RUSHYDRO PJSC	104,640	—	—	—	公益事業
MMC NORILSK NICKEL PJSC	70	90	1,923	211,041	素材
TATNEFT PJSC	1,708	2,248	2,424	266,011	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC	1,368	1,810	1,145	125,738	エネルギー
VTB BANK PJSC	5,581,900	5,388,800	290	31,827	銀行
SURGUTNEFTEGAS PJSC	8,709	10,396	384	42,219	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	7,234	10,843	649	71,238	エネルギー
SEVERSTAL PJSC	227	316	483	53,056	素材
DP WORLD PLC	173	247	441	48,443	運輸
ALROSA PJSC	3,318	4,066	594	65,191	素材
JD.COM INC-ADR	744	1,062	2,992	328,375	小売
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	452	620	527	57,847	小売
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	1,299	1,881	33,488	3,674,995	小売
MOMO INC-SPON ADR	109	216	627	68,898	メディア・娯楽
WEIBO CORP-SPON ADR	51	77	476	52,292	メディア・娯楽
58.COM INC-ADR	109	130	856	93,982	メディア・娯楽
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	—	445	846	92,888	運輸
YUM CHINA HOLDINGS INC	441	521	2,338	256,639	消費者サービス
INTER RAO UES PJSC	31,930	41,700	241	26,518	公益事業
NOVOLIPETSK STEEL PJSC	1,287	1,821	452	49,683	素材
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	—	70	179	19,725	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	294	32,346	ソフトウェア・サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	—	44	214	23,546	各種金融
BAOZUN INC-SPN ADR	—	62	265	29,111	小売
IQIYI INC-ADR	—	173	362	39,792	メディア・娯楽
PINDUODUO INC-ADR	—	264	591	64,895	小売
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	—	124	205	22,575	メディア・娯楽
LUKOIL PJSC-SPON ADR	482	686	5,554	609,508	エネルギー
GAZPROM PJSC-SPON ADR	6,085	7,693	3,831	420,454	エネルギー

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	107	133	2,464	270,490	エネルギー
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	—	178	524	57,541	食品・生活必需品小売り
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	395	531	738	81,013	食品・生活必需品小売り
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	2,960	3,808	5,368	589,161	銀行
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	1,425	2,337	986	108,251	銀行
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	177	290	248	27,243	素材
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	141	141	167	18,345	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	54	72	277	30,474	素材
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	—	1,569	182	19,973	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	1,058	1,058	157	17,311	不動産
小計 株数・金額	5,762,717	5,492,233	96,172	10,553,951	
小計 銘柄数<比率>	43	54	—	<12.3%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S.A.B.-A	3,529	4,732	8,829	50,683	資本財
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	503	727	4,958	28,463	資本財
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	37,829	48,785	65,957	378,595	電気通信サービス
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,723	2,147	7,426	42,627	家庭用品・パーソナル用品
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	5,875	7,591	41,128	236,074	食品・生活必需品小売り
CEMEX SAB-CPO	16,533	22,875	19,650	112,792	素材
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	2,770	3,702	12,971	74,458	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,905	2,239	9,367	53,772	食品・飲料・タバコ
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	2,845	3,759	42,657	244,851	銀行
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	2,214	2,853	53,676	308,102	食品・飲料・タバコ
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	154	189	3,988	22,893	素材
MEXICHEM SAB DE CV-*	1,215	1,500	6,286	36,082	素材
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	522	—	—	—	食品・飲料・タバコ
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	4,362	5,121	26,243	150,638	素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	2,707	3,392	8,968	51,478	銀行
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	419	512	9,651	55,397	運輸
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	444	682	7,456	42,801	食品・飲料・タバコ
GENTERA SAB DE CV	901	—	—	—	各種金融
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	165	260	3,084	17,707	小売
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	239	318	9,980	57,288	運輸
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	242	300	5,752	33,018	運輸
GRUMA S.A.B.-B	226	277	5,325	30,565	食品・飲料・タバコ
GRUPO LALA SAB DE CV	552	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ALSEA SAB DE CV	—	614	2,625	15,070	消費者サービス
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	597	776	6,235	35,789	公益事業
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	—	507	4,078	23,409	メディア・娯楽
BANCO SANTANDER MEXICO SA IN	1,845	2,700	8,179	46,951	銀行
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	—	733	8,735	50,144	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	90,320	117,296	383,215	2,199,659	
小計 銘柄数<比率>	25	25	—	<2.6%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,011	1,209	1,667	46,242	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	201	373	1,228	34,083	公益事業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	4,420	5,669	15,124	419,564	エネルギー
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	444	516	2,363	65,557	公益事業
GERDAU SA-PREF	1,131	1,466	2,074	57,543	素材
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	502	673	3,054	84,720	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		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	3,634	7,036	22,804	632,600	銀行
COSAN SA	192	253	1,132	31,413	エネルギー
BRF SA	483	722	2,157	59,844	食品・飲料・タバコ
JBS SA	934	1,369	2,742	76,066	食品・飲料・タバコ
NATURA COSMETICOS SA	157	276	1,462	40,570	家庭用品・パーソナル用品
VALE SA	3,570	4,603	22,767	631,582	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	389	1,106	2,400	66,576	エネルギー
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	198	310	1,321	36,666	公益事業
PORTO SEGURO SA	152	154	800	22,214	保険
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	3,342	4,339	12,734	353,267	エネルギー
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	161	250	2,093	58,073	食品・生活必需品小売り
LOJAS RENNER S.A.	782	1,113	4,608	127,843	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	916	1,042	1,580	43,845	小売
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	4,444	6,349	7,269	201,661	銀行
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	401	—	—	—	公益事業
EMBRAER SA	777	1,043	2,011	55,811	資本財
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	294	294	931	25,853	公益事業
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	738	960	1,381	38,321	素材
CCR SA	1,524	1,746	2,156	59,816	運輸
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	2,356	2,946	9,812	272,203	各種金融
B2W CIA DIGITAL	—	240	811	22,502	小売
BRASKEM SA-PREF A	191	235	941	26,108	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	3,782	5,831	20,153	559,065	銀行
BANCO DO BRASIL S.A.	1,005	1,238	6,209	172,260	銀行
CIELO SA	1,341	1,655	1,248	34,620	ソフトウェア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	485	621	2,697	74,832	銀行
FIBRIA CELULOSE SA	266	—	—	—	素材
HYPERA SA	362	560	1,657	45,981	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO BRADESCO S.A.	1,152	1,776	5,341	148,171	銀行
WEG SA	856	1,284	2,367	65,666	資本財
BR MALLS PARTICIPACOES SA	829	1,310	1,598	44,352	不動産
LOCALIZA RENT A CAR	543	812	2,986	82,832	運輸
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	99	403	963	26,740	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	273	273	889	24,664	保険
TIM PARTICIPACOES SA	892	1,297	1,413	39,204	電気通信サービス
RAIA DROGASIL SA	249	325	2,212	61,368	食品・生活必需品小売り
M DIAS BRANCO SA	128	128	536	14,877	食品・飲料・タバコ
ODONTOPREV S.A.	245	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	201	237	1,920	53,272	公益事業
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	325	—	—	—	公益事業
MAGAZINE LUIZA SA	—	118	2,200	61,047	小売
QUALICORP CONS E CORR SEG SA	264	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
KROTON EDUCACIONAL SA	1,539	1,997	2,017	55,976	消費者サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	794	981	2,756	76,468	保険
AMBEV SA	5,361	6,890	11,919	330,652	食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	616	986	1,617	44,856	素材
RUMO SA	1,253	1,570	2,712	75,257	運輸
ATACADAO SA	428	578	1,156	32,067	食品・生活必需品小売り
SUZANO SA	532	798	3,217	89,256	素材
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	—	467	1,118	31,026	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	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA		—	204	2,062	57,200	保険
小計	株数・金額	57,173	78,641	212,410	5,892,276	
	銘柄数<比率>	53	52	—	<6.9%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION		51	71	320,772	51,259	銀行
CENCOSUD SA		1,466	1,825	224,591	35,889	食品・生活必需品小売り
EMPRESAS CMPC SA		1,478	1,837	396,060	63,290	素材
COLBUN SA		9,588	9,588	127,062	20,304	公益事業
EMPRESAS COPEC SA		451	546	434,761	69,474	エネルギー
ITAU CORPBANCA		141,923	198,652	112,139	17,919	銀行
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		175	251	172,911	27,631	電気通信サービス
S.A.C.I. FALABELLA		780	1,010	472,006	75,426	小売
AES GENER SA		2,601	—	—	—	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A		2,393	3,366	133,053	21,261	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA		352	422	279,942	44,734	運輸
ENEL GENERACION CHILE SA		3,727	—	—	—	公益事業
BANCO SANTANDER CHILE		74,672	90,457	440,076	70,324	銀行
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		108	166	398,194	63,631	素材
ENEL AMERICAS SA		31,370	38,665	444,271	70,994	公益事業
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		175	225	206,615	33,017	食品・飲料・タバコ
BANCO DE CHILE		31,170	37,338	364,830	58,299	銀行
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		220	570	137,073	21,904	食品・飲料・タバコ
ENEL CHILE SA		30,834	37,598	244,391	39,053	公益事業
小計	株数・金額	333,541	422,597	4,908,755	784,419	
	銘柄数<比率>	19	17	—	<0.9%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF		4,002	5,576	691,512	23,165	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		446	681	2,769,799	92,788	銀行
ECOPETROL SA		5,382	7,249	2,225,584	74,557	エネルギー
INTERCONEXION ELECTRICA SA		456	583	912,578	30,571	公益事業
GRUPO ARGOS SA		323	419	743,354	24,902	素材
BANCOLOMBIA SA		331	331	1,301,361	43,595	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA		318	304	1,060,665	35,532	各種金融
CEMENTOS ARGOS SA		509	618	485,812	16,274	素材
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		129	195	633,935	21,236	各種金融
小計	株数・金額	11,900	15,961	10,824,604	362,624	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.4%>	
(ユーロ…ギリシャ)				千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		255	306	347	42,857	電気通信サービス
ALPHA BANK AE		1,581	2,009	248	30,587	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		5,724	—	—	—	銀行
EUROBANK ERGASIAS SA		2,038	—	—	—	銀行
TITAN CEMENT CO. S.A.		74	74	132	16,352	素材
PIRAEUS BANK S.A		290	—	—	—	銀行
OPAP SA		231	290	258	31,895	消費者サービス
MOTOR OIL (HELLAS) SA		—	90	184	22,782	エネルギー
FF GROUP		58	58	28	3,483	耐久消費財・アパレル
JUMBO SA		123	166	251	31,040	小売
ユーロ計	株数・金額	10,378	2,996	1,452	179,001	
	銘柄数<比率>	9	7	—	<0.2%>	

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	
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		—	294	228	32,623	素材
小計	株数・金額	—	294	228	32,623	
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.0%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T.A.S.		2,437	3,742	2,099	38,508	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C		1,688	1,937	984	18,050	銀行
TURKIYE GARANTI BANKASI		2,545	3,306	2,499	45,848	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		1,297	1,558	1,823	33,446	電気通信サービス
YAPI VE KREDI BANKASI		745	—	—	—	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE		272	272	502	9,224	食品・飲料・タバコ
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		130	184	2,118	38,855	エネルギー
HACI OMER SABANCI HOLDING		946	1,367	973	17,859	各種金融
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		1,782	2,149	1,618	29,685	素材
KOC HOLDING AS		1,045	1,045	1,600	29,349	資本財
ARCELIK AS		296	296	495	9,080	耐久消費財・アパレル
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		1,128	1,128	646	11,859	資本財
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		64	67	344	6,326	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO		611	862	1,047	19,213	運輸
ULKER BISKUVI SANAYI		231	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA		165	—	—	—	自動車・自動車部品
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D		656	—	—	—	銀行
COCA-COLA ICECEK AS		64	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		140	269	631	11,588	運輸
TURKIYE HALK BANKASI		568	1,069	573	10,510	銀行
TURK TELEKOMUNIKASYON AS		766	—	—	—	電気通信サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		239	290	2,265	41,553	食品・生活必需品小売り
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS		627	1,317	632	11,596	素材
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		180	553	1,025	18,800	資本財
小計	株数・金額	18,631	21,419	21,884	401,358	
	銘柄数<比率>	24	18	—	<0.5%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
O2 CZECH REPUBLIC AS		94	—	—	—	電気通信サービス
CEZ AS		204	242	12,674	60,713	公益事業
KOMERCNI BANKA AS		88	122	10,439	50,003	銀行
MONETA MONEY BANK AS		571	795	5,733	27,465	銀行
小計	株数・金額	959	1,159	28,848	138,182	
	銘柄数<比率>	4	3	—	<0.2%>	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT		165	183	99,655	37,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OTP BANK PLC		255	326	412,470	157,192	銀行
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL		421	544	169,700	64,672	エネルギー
小計	株数・金額	842	1,054	681,826	259,844	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.3%>	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		334	434	3,817	109,439	エネルギー
ORANGE POLSKA SA		572	1,106	516	14,815	電気通信サービス
PKO BANK POLSKI SA		1,034	1,276	4,816	138,082	銀行
BANK PEKAO SA		193	235	2,506	71,866	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA		158	184	1,763	50,546	素材
SANTANDER BANK POLSKA SA		40	54	1,996	57,234	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	
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランドズロチ	千円	
MBANK SA	17	23	939	26,922	銀行
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	1,858	2,723	1,537	44,078	エネルギー
GRUPA LOTOS SA	88	124	924	26,506	エネルギー
BANK MILLENNIUM SA	760	760	688	19,733	銀行
CYFROWY POLSAT SA	269	371	960	27,530	メディア・娯楽
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	56	56	323	9,278	銀行
PGE SA	875	1,118	978	28,047	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	732	854	3,420	98,067	保険
TAURON POLSKA ENERGIA SA	959	—	—	—	公益事業
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	68	68	343	9,855	素材
GRUPA AZOTY SA	63	—	—	—	素材
ALIOR BANK SA	105	155	811	23,279	銀行
LPP SA	1	1	1,562	44,786	耐久消費財・アパレル
CCC SA	32	45	851	24,410	耐久消費財・アパレル
CD PROJEKT SA	67	98	2,080	59,659	メディア・娯楽
DINO POLSKA SA	45	68	867	24,868	食品・生活必需品小売り
PLAY COMMUNICATIONS SA	149	—	—	—	電気通信サービス
小計 株数・金額	8,485	9,762	31,705	909,010	
小計 銘柄数<比率>	23	20	—	<1.1%>	
(香港)			千香港ドル		
PETROCHINA CO LTD-H	23,590	30,810	14,172	198,132	エネルギー
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	28,760	37,080	21,283	297,549	エネルギー
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	6,760	8,980	7,938	110,977	電気通信サービス
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	980	1,430	2,614	36,544	ソフトウェア・サービス
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	3,400	4,460	3,487	48,758	自動車・自動車部品
CITIC LTD	6,750	8,530	9,314	130,220	資本財
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	—	2,420	1,207	16,881	運輸
CNOOC LTD	20,220	25,870	34,614	483,904	エネルギー
YANZHOU COAL MINING CO-H	2,120	2,880	2,263	31,646	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	3,850	5,310	1,805	25,239	素材
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,640	2,080	1,372	19,191	運輸
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	1,320	1,960	1,638	22,907	運輸
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	1,760	2,060	7,354	102,811	食品・飲料・タバコ
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,120	2,860	3,763	52,617	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	600	600	1,038	14,511	資本財
CHINA TRAVEL INTL INV HK	—	2,160	343	4,801	消費者サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,340	1,980	2,993	41,852	運輸
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,820	2,480	1,805	25,240	運輸
BYD CO LTD-H	715	945	4,658	65,130	自動車・自動車部品
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	—	2,360	1,057	14,780	運輸
CHINA TELECOM CORP LTD-H	15,580	19,720	7,828	109,447	電気通信サービス
DATANG INTL POWER GEN CO-H	—	5,580	1,054	14,743	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	535	775	3,100	43,338	公益事業
CHINA EVERBRIGHT LTD	1,060	1,400	1,853	25,913	各種金融
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	1,400	1,940	2,091	29,236	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	2,200	2,200	1,309	18,299	運輸
ANGANG STEEL CO LTD-H	—	1,080	544	7,609	素材
CHINA MOBILE LTD	6,935	8,920	64,313	899,098	電気通信サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	4,380	6,520	3,090	43,204	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-H	—	2,860	858	11,994	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,335	1,790	8,216	114,861	素材
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	5,160	6,640	9,189	128,472	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LENOVO GROUP LTD	8,260	10,200	6,691	93,542	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,998	2,348	4,989	69,753	保険
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	420	580	2,865	40,055	食品・飲料・タバコ
SINOTRANS LIMITED-H	—	3,580	1,084	15,164	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	4,220	5,660	1,545	21,601	素材
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,740	2,430	1,399	19,567	素材
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,880	2,850	1,254	17,530	資本財
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	5,200	9,780	7,872	110,063	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	8,480	10,850	21,222	296,691	保険
KINGBOARD HOLDINGS LTD	680	1,045	2,403	33,600	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	3,234	4,384	3,608	50,440	半導体・半導体製造装置
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	2,260	2,600	2,766	38,674	公益事業
CHINA MENGNIU DAIRY CO	3,190	4,090	12,126	169,533	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	5,885	7,550	67,081	937,802	保険
AIR CHINA LTD-H	2,140	2,800	2,329	32,567	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	5,200	9,720	7,173	100,283	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	2,180	2,880	2,188	30,599	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD	6,425	8,286	316,525	4,425,022	メディア・娯楽
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	9,919	12,119	7,477	104,534	銀行
ZTE CORP-H	811	1,119	2,580	36,068	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	6,660	8,560	2,439	34,105	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	94,935	139,255	90,098	1,259,574	銀行
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	1,108	1,464	2,178	30,454	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	820	1,077	11,071	154,780	耐久消費財・アパレル
CHINA POWER INTERNATIONAL	—	7,050	1,381	19,317	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,780	4,020	2,741	38,328	自動車・自動車部品
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	2,540	4,280	1,219	17,052	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	3,640	4,820	8,145	113,878	エネルギー
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,870	2,480	1,793	25,066	素材
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	1,680	2,480	2,728	38,137	不動産
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,490	1,490	1,461	20,434	素材
SHENZHEN INVESTMENT LTD	—	5,260	1,551	21,692	不動産
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,720	2,680	1,983	27,725	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF CHINA LTD-H	89,560	114,860	40,315	563,615	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	2,550	5,131	3,832	53,584	商業・専門サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,335	1,555	3,545	49,564	不動産
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	850	990	4,643	64,910	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS BANK-H	4,470	5,585	20,694	289,305	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	83,213	100,473	55,461	775,349	銀行
MAANSHAN IRON & STEEL-H	—	2,320	805	11,254	素材
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	850	1,138	8,535	119,319	公益事業
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	—	1,835	1,409	19,701	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	3,040	3,980	2,431	33,996	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	4,670	6,320	4,563	63,791	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	—	3,170	1,020	14,269	エネルギー
SHENZHEN INTL HOLDINGS	—	1,305	2,153	30,102	運輸
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	—	980	1,005	14,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	4,240	5,440	15,721	219,787	不動産

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	—	3,480	842	11,773	食品・飲料・タバコ
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	10,160	13,330	6,278	87,772	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,210	1,590	8,609	120,365	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	4,080	5,620	3,338	46,669	資本財
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	11,280	18,980	1,442	20,165	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	860	1,080	7,138	99,800	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	3,140	4,040	13,352	186,663	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	2,080	2,685	2,494	34,871	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	3,320	4,440	6,642	92,858	公益事業
FOSUN INTERNATIONAL LTD	2,870	3,650	4,088	57,150	資本財
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	3,460	4,975	1,641	22,951	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3,220	5,200	3,468	48,488	素材
SHUI ON LAND LTD	—	3,745	677	9,476	不動産
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,278	2,858	3,641	50,902	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	—	4,405	1,427	19,952	運輸
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,760	7,380	4,553	63,657	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	3,340	4,740	3,735	52,216	エネルギー
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	6,022	11,162	13,305	186,010	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	900	1,240	4,519	63,186	公益事業
SOHO CHINA LTD	1,930	3,175	831	11,629	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	5,740	8,120	3,540	49,493	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	5,620	7,270	10,018	140,052	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	3,470	4,240	2,145	29,993	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	6,146	9,048	5,085	71,089	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,904	3,900	11,583	161,930	保険
CRRC CORP LTD - H	4,865	5,545	3,709	51,864	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	580	839	3,288	45,978	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	29,160	41,760	14,281	199,661	銀行
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,710	3,810	8,705	121,707	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2,306	3,929	3,108	43,452	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	1,308	1,760	5,341	74,675	ヘルスケア機器・サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,930	2,530	6,287	87,892	公益事業
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	—	1,172	961	13,435	資本財
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	3,400	7,080	1,316	18,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,685	2,130	5,985	83,674	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	805	1,050	9,523	133,138	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES CEMENT	—	3,660	2,660	37,198	素材
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	15,070	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SSY GROUP LTD	—	2,240	1,532	21,419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	3,645	4,860	2,872	40,154	自動車・自動車部品
BBMG CORP-H	—	4,160	1,048	14,655	素材
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	5,940	7,220	3,436	48,045	不動産
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	—	1,555	1,088	15,217	素材
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	2,300	3,060	2,340	32,725	資本財
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	—	3,340	2,929	40,949	ソフトウェア・サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	2,515	3,205	5,031	70,345	各種金融
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,650	3,150	2,050	28,668	食品・生活必需品小売り
FAR EAST HORIZON LTD	2,260	2,870	2,327	32,539	各種金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3,020	3,020	1,253	17,521	銀行
YUEXIU PROPERTY CO LTD	—	10,560	1,869	26,130	不動産

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	—	2,040	1,689	23,613	食品・飲料・タバコ
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,560	1,830	3,806	53,213	耐久消費財・アパレル
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	—	2,300	717	10,032	不動産
MMG LTD	—	4,120	1,211	16,933	素材
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	—	935	1,780	24,887	小売
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	—	1,896	745	10,416	素材
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,159	1,159	1,814	25,373	ヘルスケア機器・サービス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	3,572	4,524	4,143	57,932	各種金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,680	3,550	13,365	186,853	不動産
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	3,600	4,620	2,346	32,810	不動産
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	—	2,860	2,519	35,224	不動産
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	—	905	546	7,641	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	851	1,150	4,427	61,896	保険
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	8,250	11,680	3,527	49,312	保険
HUANENG RENEWABLES CORP-H	5,120	7,220	1,465	20,489	公益事業
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	3,465	4,665	2,197	30,717	各種金融
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	1,390	2,430	1,613	22,557	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	1,673	23,392	素材
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	735	735	979	13,686	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	530	890	2,189	30,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	790	790	1,390	19,437	資本財
TOWNGAS CHINA CO LTD	—	1,040	616	8,621	公益事業
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	—	1,915	1,361	19,034	資本財
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	3,720	3,720	156	2,184	食品・飲料・タバコ
HANERGY THIN FILM POWER GROU	9,600	9,600	3,753	52,475	半導体・半導体製造装置
KINGSOFT CORP LTD	900	1,270	2,306	32,242	ソフトウェア・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	10,490	13,150	2,537	35,480	各種金融
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	1,720	2,325	5,986	83,696	資本財
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	—	4,640	2,009	28,087	半導体・半導体製造装置
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	4,180	4,900	4,052	56,651	ヘルスケア機器・サービス
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	2,880	4,390	1,580	22,093	銀行
CHINA VANKE CO LTD-H	1,284	1,824	5,318	74,351	不動産
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,100	19,500	3,237	45,253	メディア・娯楽
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	—	3,020	1,283	17,943	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	11,110	16,240	3,296	46,088	公益事業
BAIC MOTOR CORP LTD-H	—	2,620	1,296	18,130	自動車・自動車部品
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	—	510	873	12,206	半導体・半導体製造装置
LUYE PHARMA GROUP LTD	—	2,125	1,470	20,557	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	1,454	2,298	2,229	31,162	各種金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,692	2,410	3,205	44,810	各種金融
KWG GROUP HOLDINGS LTD	—	2,090	1,780	24,893	不動産
3SBIO INC	940	1,890	2,702	37,783	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	1,081	15,119	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	—	2,370	1,279	17,891	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	—	7,830	1,174	16,419	保険
CAR INC	—	760	467	6,534	運輸
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	596	796	2,017	28,209	自動車・自動車部品
SINOTRUK HONG KONG LTD	—	955	1,476	20,640	資本財
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	11,160	13,810	2,016	28,187	各種金融
FULLSHARE HOLDINGS LTD	7,400	8,750	656	9,174	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	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	—	23,560	468	6,554	耐久消費財・アパレル
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	—	675	5,335	74,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA LITERATURE LTD	—	392	1,354	18,933	メディア・娯楽
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	3,900	5,400	1,425	19,929	素材
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	2,285	2,350	2,519	35,218	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITU INC	1,380	2,090	501	7,012	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	990	1,510	1,661	23,220	自動車・自動車部品
DALI FOODS GROUP CO LTD	—	2,860	1,584	22,150	食品・飲料・タバコ
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	—	2,000	2,368	33,104	不動産
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	—	4,670	948	13,253	資本財
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	—	4,740	1,298	18,156	自動車・自動車部品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	—	1,220	2,249	31,450	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	655	9,161	不動産
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	—	11,110	5,110	71,446	銀行
BOC AVIATION LTD	—	310	2,019	28,234	資本財
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	—	874	1,324	18,523	各種金融
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	—	1,400	485	6,791	不動産
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	—	1,436	2,234	31,237	各種金融
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	—	316	775	10,845	保険
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	—	1,220	768	10,745	商業・専門サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	—	1,680	2,469	34,525	商業・専門サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	—	58,040	11,724	163,902	電気通信サービス
MEITUAN DIANPING-CLASS B	—	464	2,735	38,239	小売
XIAOMI CORP-CLASS B	—	4,772	5,077	70,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	—	1,200	2,772	38,752	各種金融
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	—	1,480	679	9,496	素材
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	—	610	2,217	30,998	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	836,898	1,355,005	1,393,790	19,485,184	
小計 銘柄数<比率>	139	206	—	<22.7%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
GENTING MALAYSIA BHD	3,738	4,635	1,473	38,882	消費者サービス
GENTING BHD	2,519	2,923	1,975	52,125	消費者サービス
TELEKOM MALAYSIA BHD	1,355	1,355	367	9,686	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	3,690	4,430	5,227	137,898	公益事業
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	592	593	1,452	38,326	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	4,800	5,556	4,983	131,470	銀行
IOI CORP BHD	2,419	2,419	1,025	27,056	食品・飲料・タバコ
AMMB HOLDINGS BHD	1,657	2,319	1,020	26,917	銀行
YTL CORP BHD	5,456	6,372	726	19,164	公益事業
GAMUDA BHD	2,057	2,862	933	24,612	資本財
MISC BHD	1,730	1,590	1,066	28,144	運輸
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	5,309	7,354	3,765	99,327	銀行
PETRONAS GAS BHD	735	1,039	1,766	46,594	公益事業
SP SETIA BHD	1,580	2,669	555	14,644	不動産
SIME DARBY BERHAD	2,485	3,509	771	20,364	資本財
PUBLIC BANK BERHAD	3,274	4,185	9,315	245,751	銀行
UMW HOLDINGS BHD	490	—	—	—	自動車・自動車部品
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	173	173	587	15,507	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	557	819	1,524	40,205	食品・飲料・タバコ
IJM CORP BHD	3,113	4,797	997	26,321	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	
(マレーシア)	百株	百株	ﾏﾚｰｼｱﾘﾝｷﾞｯﾄ	千円	
DIGI.COM BHD	3,636	4,856	2,277	60,079	電気通信サービス
MAXIS BHD	2,374	3,327	1,783	47,042	電気通信サービス
AXIATA GROUP BERHAD	3,393	4,065	1,784	47,076	電気通信サービス
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	1,948	—	—	—	公益事業
HONG LEONG BANK BERHAD	718	993	1,936	51,080	銀行
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,461	3,417	3,037	80,134	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	261	261	632	16,689	エネルギー
SAPURA ENERGY BHD	3,578	—	—	—	エネルギー
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	915	1,204	860	22,709	運輸
FGV HOLDINGS BHD	1,201	—	—	—	食品・飲料・タバコ
IHH HEALTHCARE BHD	2,322	3,539	1,935	51,067	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	333	333	630	16,637	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	703	970	950	25,076	資本財
TOP GLOVE CORP BHD	—	1,776	843	22,254	ヘルスケア機器・サービス
GENTING PLANTATIONS BHD	392	392	402	10,630	食品・飲料・タバコ
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	2,172	—	—	—	メディア・娯楽
WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,484	1,484	543	14,328	運輸
DIALOG GROUP BHD	3,865	5,613	1,762	46,500	エネルギー
IOI PROPERTIES GROUP BHD	1,728	1,728	221	5,834	不動産
QL RESOURCES BHD	—	808	542	14,323	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	—	157	524	13,824	食品・飲料・タバコ
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,636	2,300	1,124	29,669	ヘルスケア機器・サービス
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	73	93	1,339	35,328	食品・飲料・タバコ
RHB BANK BHD	915	1,379	791	20,888	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	1,462	1,462	546	14,424	銀行
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	1,193	1,691	750	19,806	素材
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,485	3,518	1,741	45,938	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY PROPERTY BHD	2,485	4,517	465	12,273	不動産
AIRASIA GROUP BHD	1,400	2,152	559	14,760	運輸
小計 株数・金額	92,864	111,636	67,527	1,781,384	
小計 銘柄数<比率>	46	44	—	<2.1%>	
(タイ)			千タイバーツ		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,436	1,961	14,413	50,014	不動産
KASIKORNBANK PCL-NVDR	1,940	2,527	47,254	163,974	銀行
TMB BANK PCL-NVDR	15,421	15,421	3,022	10,488	銀行
CP ALL PCL-NVDR	5,775	7,244	55,597	192,924	食品・生活必需品小売り
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	450	480	9,648	33,478	銀行
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,202	1,553	29,507	102,389	電気通信サービス
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	2,173	2,756	35,139	121,932	銀行
SIAM CEMENT PCL-NVDR	424	571	26,289	91,222	素材
PTT PCL-NVDR	12,100	15,509	74,055	256,972	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,582	2,090	27,065	93,917	エネルギー
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	4,731	6,405	43,393	150,576	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	2,706	2,706	4,302	14,929	エネルギー
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	2,985	4,665	12,945	44,920	食品・飲料・タバコ
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	1,599	2,309	11,025	38,258	素材
IRPC PCL - NVDR	11,617	15,255	8,085	28,055	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,426	3,037	20,276	70,357	素材
THAI OIL PCL-NVDR	1,171	1,623	10,833	37,592	エネルギー
KRUNG THAI BANK - NVDR	4,086	5,334	10,027	34,796	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	
GLOW ENERGY PCL - NVDR		669	669	6,037	20,950	公益事業
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR		4,220	6,006	14,954	51,893	ヘルスケア機器・サービス
LAND & HOUSES PUB - NVDR		—	3,759	4,022	13,956	不動産
THAI UNION GROUP PCL-NVDR		2,622	2,622	4,850	16,831	食品・飲料・タバコ
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR		5,007	5,007	8,011	27,798	小売
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR		127	211	6,097	21,159	公益事業
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR		7,228	7,818	9,068	31,469	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR		399	534	8,971	31,130	ヘルスケア機器・サービス
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR		606	606	4,408	15,298	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRUE CORP PCL-NVDR		12,270	16,580	8,290	28,767	電気通信サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		2,367	3,554	12,972	45,013	消費者サービス
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR		1,329	1,715	8,832	30,647	食品・生活必需品小売り
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR		1,330	1,775	9,585	33,259	公益事業
KCE ELECTRONICS - NVDR		260	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROBINSON PCL-NVDR		459	758	4,263	14,795	小売
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO		8,623	10,780	11,858	41,147	運輸
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR		—	824	3,996	13,867	各種金融
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR		—	542	5,691	19,747	公益事業
小計	株数・金額	121,341	155,207	574,794	1,994,537	
	銘柄数<比率>	33	35	—	<2.3%>	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
PLDT INC		88	112	13,906	29,203	電気通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC		10,696	14,919	57,438	120,620	不動産
AYALA LAND INC		9,020	10,397	48,865	102,618	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN		1,002	1,356	11,499	24,149	銀行
INTL CONTAINER TERM SVCS INC		450	1,231	16,377	34,393	運輸
MEGAWORLD CORP		9,990	17,930	9,556	20,069	不動産
JOLLIBEE FOODS CORP		485	637	19,303	40,537	消費者サービス
SM INVESTMENTS CORP		257	371	34,368	72,173	資本財
MANILA ELECTRIC COMPANY		248	340	12,628	26,519	公益事業
AYALA CORPORATION		273	385	34,313	72,059	各種金融
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		2,805	2,639	12,829	26,941	資本財
ABOITIZ POWER CORP		1,953	1,953	6,874	14,436	公益事業
METROPOLITAN BANK & TRUST		830	2,507	18,178	38,174	銀行
BDO UNIBANK INC		2,166	2,685	36,473	76,593	銀行
DMCI HOLDINGS INC		5,719	5,719	5,936	12,466	資本財
UNIVERSAL ROBINA CORP		902	1,164	18,625	39,113	食品・飲料・タバコ
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC		5,593	5,593	7,606	15,973	資本財
JG SUMMIT HOLDINGS INC		3,206	4,407	27,108	56,928	資本財
GLOBE TELECOM INC		42	42	8,398	17,637	電気通信サービス
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		15,385	22,665	9,723	20,418	各種金融
SECURITY BANK CORP		214	420	7,235	15,194	銀行
ROBINSONS LAND CO		3,047	3,047	7,251	15,228	不動産
GT CAPITAL HOLDINGS INC		101	139	11,848	24,881	各種金融
小計	株数・金額	74,476	100,665	436,348	916,332	
	銘柄数<比率>	23	23	—	<1.1%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
KALBE FARMA TBK PT		21,879	28,041	4,051,924	31,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER		58,751	73,487	27,851,573	214,457	電気通信サービス
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P		4,466	5,863	3,898,895	30,021	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	
(インドネシア)	百株	百株	ﾁｲﾝﾄﾞﾈｼｱﾙﾋﾟｱ	千円	
HM SAMPOERNA TBK PT	10,066	12,449	4,369,599	33,645	食品・飲料・タバコ
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	11,009	14,504	40,683,720	313,264	銀行
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	2,013	2,582	5,021,990	38,669	素材
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	24,085	29,629	21,258,807	163,692	自動車・自動車部品
GUDANG GARAM TBK PT	491	731	6,091,057	46,901	食品・飲料・タバコ
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	61,365	80,831	33,302,372	256,428	銀行
BANK DANAMON INDONESIA TBK	4,014	—	—	—	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	3,180	4,415	4,922,725	37,904	素材
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	13,144	17,073	3,448,746	26,555	公益事業
UNITED TRACTORS TBK PT	1,951	2,655	6,969,375	53,664	エネルギー
BUKIT ASAM TBK PT	—	3,873	1,192,884	9,185	エネルギー
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	20,573	27,466	20,530,835	158,087	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,629	2,229	9,852,180	75,861	家庭用品・パーソナル用品
ADARO ENERGY TBK PT	15,862	21,136	2,673,704	20,587	エネルギー
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	2,812	2,812	1,574,720	12,125	運輸
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	8,296	10,642	9,152,120	70,471	銀行
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	5,806	5,806	1,387,634	10,684	銀行
AKR CORPORINDO TBK PT	1,543	—	—	—	資本財
CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	8,774	10,072	4,995,712	38,466	食品・飲料・タバコ
XL AXIATA TBK PT	3,200	—	—	—	電気通信サービス
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	—	4,389	2,830,905	21,797	素材
PAKUWON JATI TBK PT	19,000	19,000	1,292,000	9,948	不動産
BUMI SERPONG DAMAI PT	7,017	9,750	1,218,750	9,384	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	2,838	3,833	3,765,922	28,997	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	2,126	2,126	782,368	6,024	電気通信サービス
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	5,000	8,664	1,429,560	11,007	メディア・娯楽
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	4,365	—	—	—	資本財
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	2,762	—	—	—	小売
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	—	1,837	1,428,267	10,997	素材
小計 株数・金額	328,017	405,895	225,978,346	1,740,033	
小計 銘柄数<比率>	29	27	—	<2.0%>	
(韓国)			千韓国ウォン		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5,449	6,928	29,722,664	2,767,180	ﾃｸﾉﾛｼﾞｰ・ﾊｰﾄﾞｳｪｱおよび機器
KOREA ELECTRIC POWER CORP	305	365	997,487	92,866	公益事業
SHINSEGAE INC	8	11	376,533	35,055	小売
CJ CORP	15	21	234,484	21,830	資本財
SK TELECOM	21	28	759,937	70,750	電気通信サービス
HYUNDAI MOTOR CO	176	198	2,575,040	239,736	自動車・自動車部品
POSCO	85	112	2,708,840	252,193	素材
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	60	76	762,921	71,028	ﾃｸﾉﾛｼﾞｰ・ﾊｰﾄﾞｳｪｱおよび機器
KT CORP	22	22	63,337	5,896	電気通信サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	74	98	338,287	31,494	各種金融
HYUNDAI MOBIS CO LTD	75	96	2,123,643	197,711	自動車・自動車部品
CHEIL WORLDWIDE INC	95	95	246,686	22,966	メディア・娯楽
KB FINANCIAL GROUP INC	455	570	2,646,353	246,375	銀行
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	33	44	1,305,720	121,562	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	60	81	1,801,016	167,674	ﾃｸﾉﾛｼﾞｰ・ﾊｰﾄﾞｳｪｱおよび機器
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	494	627	2,815,230	262,097	銀行
LG ELECTRONICS INC	124	157	1,140,879	106,215	耐久消費財・アパレル
AMOREPACIFIC GROUP	29	46	344,613	32,083	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
HYUNDAI DEPT STORE CO	13	20	189,800	17,670	小売
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	32	39	385,310	35,872	資本財
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	46	77	296,333	27,588	資本財
KT&G CORP	133	171	1,730,534	161,112	食品・飲料・タバコ
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	—	48	133,666	12,444	資本財
NCSOFT CORP	20	25	1,270,060	118,242	メディア・娯楽
LG DISPLAY CO LTD	262	338	603,829	56,216	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	42	53	623,238	58,023	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	444	643	521,627	48,563	資本財
AMOREPACIFIC CORP	34	48	980,666	91,300	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP	345	442	1,604,750	149,402	銀行
HDC HOLDINGS CO LTD	69	—	—	—	資本財
LG CHEM LTD	52	64	2,212,952	206,025	素材
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	49	—	—	—	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	10	13	1,809,864	168,498	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	74	92	1,580,535	147,147	エネルギー
KAKAO CORP	52	72	943,930	87,879	メディア・娯楽
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	42	62	412,624	38,415	各種金融
HANMI SCIENCE CO LTD	17	17	122,007	11,358	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WOONGJIN COWAY CO LTD	59	80	632,383	58,874	耐久消費財・アパレル
S-1 CORPORATION	16	23	224,622	20,912	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORP	288	380	1,610,401	149,928	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	655	842	6,271,548	583,881	半導体・半導体製造装置
LG CORP	105	141	1,019,952	94,957	資本財
HYUNDAI STEEL CO	89	118	510,796	47,555	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	988	1,195	4,196,626	390,705	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	18	25	230,524	21,461	素材
HANWHA AEROSPACE CO LTD	34	—	—	—	資本財
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	318	373	523,292	48,718	銀行
PAN OCEAN CO LTD	190	331	147,610	13,742	運輸
KANGWON LAND INC	139	162	526,949	49,058	消費者サービス
NAVER CORP	32	204	2,499,122	232,668	メディア・娯楽
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	426	623	456,211	42,473	各種金融
CELLTRION INC	92	119	2,401,880	223,615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA GAS CORPORATION	25	36	151,576	14,111	公益事業
LG UPLUS CORP	—	138	218,640	20,355	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO	11	15	252,590	23,516	小売
YUHAN CORP	9	13	305,694	28,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DB INSURANCE CO LTD	51	73	496,068	46,183	保険
S-OIL CORP	51	64	551,478	51,342	エネルギー
KCC CORP	6	8	255,168	23,756	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	41	75	132,169	12,304	資本財
SAMSUNG CARD CO	30	57	204,775	19,064	各種金融
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	—	204	337,208	31,394	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	44	52	433,131	40,324	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	80	113	539,030	50,183	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	57	57	186,341	17,348	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	76	99	803,277	74,785	保険
LOTTE CHEMICAL CORP	17	24	655,431	61,020	素材
GS HOLDINGS	52	77	390,656	36,370	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	157	208	274,401	25,546	各種金融
HANWHA CHEMICAL CORP	113	164	347,559	32,357	素材
HYOSUNG CORPORATION	21	—	—	—	資本財
HANWHA CORPORATION	54	54	153,445	14,285	資本財
CJ CHEILJEDANG CORP	8	13	391,500	36,448	食品・飲料・タバコ
BNK FINANCIAL GROUP INC	277	364	255,682	23,804	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	21	27	414,647	38,603	運輸
DGB FINANCIAL GROUP INC	200	304	259,482	24,157	銀行
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	26	35	267,799	24,932	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	9	11	498,383	46,399	素材
E-MART INC	23	29	479,574	44,648	食品・生活必需品小売り
HYUNDAI WIA CORP	13	—	—	—	自動車・自動車部品
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	21	30	274,995	25,602	素材
SK HOLDINGS CO LTD	37	45	1,124,214	104,664	資本財
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	67	86	314,215	29,253	保険
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	75	95	296,670	27,619	資本財
SK NETWORKS CO LTD	121	—	—	—	資本財
LOTTE CORP	28	39	183,175	17,053	資本財
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	275	398	147,068	13,692	保険
LG INNOTEK CO LTD	16	16	189,562	17,648	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD-PREFERENCE	9	13	262,860	24,472	素材
HANKOOK TIRE CO LTD	84	103	390,062	36,314	自動車・自動車部品
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	297	260	126,125	11,742	資本財
HANON SYSTEMS	230	296	342,411	31,878	自動車・自動車部品
CJ ENM CO LTD	—	16	326,583	30,404	小売
CJ E&M CORP	17	—	—	—	メディア・娯楽
DONGSUH COMPANIES INC	49	—	—	—	食品・生活必需品小売り
CJ LOGISTICS	7	11	177,684	16,542	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	36	46	503,253	46,852	小売
HANSSEM CO LTD	12	—	—	—	耐久消費財・アパレル
WOORI BANK	568	—	—	—	銀行
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	20	—	—	—	商業・専門サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	40	50	1,043,734	97,171	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG C&T CORP	84	107	1,060,306	98,714	資本財
AMOREPACIFIC CORP-PREF	12	12	136,864	12,742	家庭用品・パーソナル用品
HANMI PHARM CO LTD	6	8	347,316	32,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GS RETAIL CO LTD	23	40	142,697	13,285	食品・生活必需品小売り
OTTOGI CORPORATION	1	1	131,274	12,221	食品・飲料・タバコ
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	1	2	214,514	19,971	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	18	24	725,928	67,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETMARBLE CORP	27	38	507,625	47,259	メディア・娯楽
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	10	15	478,020	44,503	資本財
DOOSAN BOBCAT INC	32	55	179,354	16,697	資本財
MEDY-TOX INC	5	6	332,884	30,991	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	21	34	333,200	31,020	食品・飲料・タバコ
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	37	76	541,510	50,414	ヘルスケア機器・サービス
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	33	60	207,954	19,360	保険
SILLAJEN INC	60	80	464,825	43,275	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGF RETAIL CO LTD	9	13	273,416	25,455	食品・生活必需品小売り
POSCO CHEMICAL CO LTD	—	30	157,957	14,705	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
HLB INC	—	50	390,357	36,342	耐久消費財・アパレル
CELLTRION PHARM INC	—	16	88,110	8,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HELIXMITH CO LTD	—	20	460,020	42,827	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEARL ABYSS CORP	—	8	148,657	13,839	メディア・娯楽
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	—	40	181,089	16,859	資本財
FILA KOREA LTD	—	74	586,187	54,574	耐久消費財・アパレル
WOORI FINANCIAL GROUP INC	—	691	954,670	88,879	銀行
小計 株数・金額	16,676	21,792	111,640,390	10,393,720	
小計 銘柄数<比率>	113	114	—	<12.1%>	
(台湾)			千ニュー台湾ドル		
COMPAL ELECTRONICS	4,487	5,477	10,681	37,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	2,132	2,942	44,280	156,751	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	4,391	4,551	14,541	51,477	資本財
FORMOSA PLASTICS CORP	4,756	6,446	70,583	249,866	素材
HON HAI PRECISION INDUSTRY	17,548	19,052	159,471	564,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MACRONIX INTERNATIONAL	1,860	—	—	—	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	12,500	17,130	22,611	80,045	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	5,445	7,325	56,553	200,199	素材
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	680	880	26,312	93,144	食品・生活必需品小売り
TAIWAN CEMENT	4,137	6,612	28,104	99,488	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	27,740	35,690	913,664	3,234,370	半導体・半導体製造装置
ASUSTEK COMPUTER INC	837	977	21,510	76,146	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WINBOND ELECTRONICS CORP	3,030	4,030	6,045	21,399	半導体・半導体製造装置
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	417	577	13,012	46,062	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	260	359	10,084	35,699	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	3,121	3,891	22,882	81,002	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	9,433	12,163	52,547	186,016	保険
ACER INC	3,311	4,321	8,384	29,679	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	12,588	16,680	19,766	69,971	銀行
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	3,394	5,194	55,579	196,749	素材
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	7,750	10,030	44,737	158,371	保険
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	694	697	4,967	17,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC	1,672	2,142	63,949	226,381	半導体・半導体製造装置
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	10,562	14,137	19,580	69,315	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	20,049	25,249	53,529	189,492	銀行
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,914	2,324	26,493	93,787	電気通信サービス
CHINA STEEL CORP	13,659	18,729	45,980	162,772	素材
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	630	880	18,568	65,730	半導体・半導体製造装置
ADVANTECH CO LTD	366	466	11,762	41,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	970	1,230	8,145	28,834	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	710	990	23,562	83,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP	10,080	11,620	11,736	41,546	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HTC CORP	847	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TATUNG CO LTD	—	2,440	5,636	19,952	耐久消費財・アパレル
POWERTECH TECHNOLOGY INC	843	1,113	8,458	29,944	半導体・半導体製造装置
INVENTEC CORP	2,814	3,854	8,999	31,859	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	4,200	5,540	60,940	215,727	電気通信サービス
PHISON ELECTRONICS CORP	140	210	5,964	21,112	半導体・半導体製造装置
WPG HOLDINGS LTD	1,714	1,981	7,906	27,990	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	810	1,080	8,370	29,629	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	
GIANT MANUFACTURING	350	490	10,829	38,334	耐久消費財・アパレル
RUENTEX INDUSTRIES LTD	470	456	3,169	11,218	耐久消費財・アパレル
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,701	2,311	8,646	30,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	11,493	14,253	25,085	88,803	各種金融
INNOLUX CORP	10,041	11,951	10,767	38,118	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	8,572	11,468	23,051	81,601	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	9,062	15,858	13,907	49,234	保険
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,830	2,420	18,367	65,022	電気通信サービス
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	2,214	3,164	12,561	44,468	自動車・自動車部品
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,661	1,811	19,292	68,295	エネルギー
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	12,137	16,037	47,471	168,047	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	10,498	14,542	31,411	111,195	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	118	148	66,023	233,721	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	5,296	6,916	53,462	189,257	食品・飲料・タバコ
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,493	8,005	14,489	51,294	銀行
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	15,302	18,982	17,995	63,703	銀行
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	2,581	3,071	13,223	46,810	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA CEMENT CORP	2,592	3,172	13,230	46,836	素材
POU CHEN	2,285	3,155	11,373	40,263	耐久消費財・アパレル
WISTRON CORP	2,811	3,758	9,227	32,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEGATRON CORP	2,199	2,929	15,146	53,619	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	2,190	4,050	3,750	13,276	運輸
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	10,566	14,123	35,308	124,991	銀行
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	2,720	3,540	8,798	31,145	保険
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	247	353	9,189	32,531	資本財
EVA AIRWAYS CORP	1,831	3,256	4,819	17,061	運輸
EVERGREEN MARINE CORP LTD	2,513	2,638	3,298	11,676	運輸
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	130	190	7,144	25,289	資本財
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	8,783	13,531	27,062	95,802	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	330	410	17,835	63,135	小売
TECO ELECTRIC & MACHINERY	2,380	—	—	—	資本財
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	912	517	2,092	7,405	不動産
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	750	1,180	5,669	20,071	不動産
TAIWAN BUSINESS BANK	4,595	4,779	5,974	21,149	銀行
STANDARD FOODS CORP	790	610	3,234	11,449	食品・飲料・タバコ
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	400	670	6,968	24,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORMOSA TAFFETA CO.	1,110	1,110	4,129	14,617	耐久消費財・アパレル
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,364	1,761	21,671	76,717	各種金融
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	1,100	1,450	9,280	32,851	半導体・半導体製造装置
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	237	237	9,408	33,304	耐久消費財・アパレル
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	1,910	—	—	—	電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	439	439	11,091	39,263	耐久消費財・アパレル
GENERAL INTERFACE SOLUTION	170	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,180	1,520	9,697	34,329	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	190	280	6,692	23,689	耐久消費財・アパレル
TAIMED BIOLOGICS INC	150	210	3,013	10,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WIN SEMICONDUCTORS CORP	350	540	11,043	39,092	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	250	310	10,602	37,531	半導体・半導体製造装置
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	2,280	2,930	10,723	37,962	運輸
WALSIN TECHNOLOGY CORP	—	500	8,800	31,152	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	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	3,732	5,052	34,764	123,065	半導体・半導体製造装置
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	—	4,350	22,054	78,072	銀行
小計 株数・金額	364,820	474,469	2,748,753	9,730,586	
小計 銘柄数<比率>	89	87	—	<11.3%>	
(インド)			千インドルピー		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,710	2,368	457,613	723,030	銀行
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	524	1,305	278,779	440,471	ソフトウェア・サービス
ITC LTD	3,778	4,981	148,326	234,355	食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD	716	930	156,983	248,033	家庭用品・パーソナル用品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	807	—	—	—	資本財
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,512	3,656	60,808	96,077	エネルギー
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,478	1,720	33,681	53,216	素材
COAL INDIA LTD	729	1,798	43,391	68,558	エネルギー
GAIL INDIA LTD	716	1,176	40,191	63,502	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD	636	821	17,635	27,864	素材
HERO MOTOCORP LTD	68	68	17,079	26,985	自動車・自動車部品
BAJAJ AUTO LTD	96	112	33,470	52,883	自動車・自動車部品
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	1,157	1,276	55,866	88,269	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASIAN PAINTS LTD	311	424	56,885	89,879	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	—	2,574	47,773	75,482	公益事業
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	163	202	20,623	32,585	各種金融
VEDANTA LTD	1,652	1,957	30,531	48,240	素材
TATA POWER CO LTD	1,690	1,689	10,780	17,033	公益事業
BHARTI AIRTEL LTD	1,660	2,079	67,407	106,504	電気通信サービス
BHARTI AIRTEL LTD-RIGHT	—	589	5,396	8,526	電気通信サービス
CIPLA LTD	358	521	28,971	45,775	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NTPC LTD	1,835	3,494	44,385	70,128	公益事業
INFOSYS LTD	1,950	5,068	363,331	574,063	ソフトウェア・サービス
ULTRATECH CEMENT LTD	101	139	61,684	97,462	素材
ACC LTD	55	—	—	—	素材
DR. REDDY'S LABORATORIES	127	164	47,250	74,655	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ICICI BANK LTD	2,669	3,402	131,011	206,998	銀行
LUPIN LTD	266	320	26,768	42,293	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	119	155	103,234	163,109	自動車・自動車部品
RELIANCE INDUSTRIES LTD	3,208	4,137	517,614	817,830	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	1,863	2,543	78,352	123,796	銀行
TATA STEEL LTD	441	545	26,577	41,992	素材
LIC HOUSING FINANCE LTD	313	396	18,848	29,780	銀行
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	874	1,151	41,804	66,050	エネルギー
VODAFONE IDEA LTD	2,476	12,669	17,800	28,124	電気通信サービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	246	489	31,544	49,839	家庭用品・パーソナル用品
REC LTD	876	876	11,942	18,869	各種金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	575	669	24,870	39,294	メディア・娯楽
POWER FINANCE CORPORATION	545	—	—	—	各種金融
DABUR INDIA LTD	570	776	28,706	45,356	家庭用品・パーソナル用品
JSW STEEL LTD	893	1,168	33,567	53,036	素材
LARSEN & TOUBRO LTD	571	691	93,692	148,033	資本財
UNITED SPIRITS LTD	68	409	22,036	34,817	食品・飲料・タバコ
TITAN CO LTD	330	474	53,731	84,896	耐久消費財・アパレル
SIEMENS LTD	82	—	—	—	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	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
WIPRO LTD	1,296	2,097	60,889	96,204	ソフトウェア・サービス
AXIS BANK LTD	1,976	2,788	204,962	323,841	銀行
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	851	1,076	67,705	106,973	自動車・自動車部品
TATA MOTORS LTD	1,812	2,283	42,450	67,071	自動車・自動車部品
HCL TECHNOLOGIES LTD	665	804	87,438	138,152	ソフトウェア・サービス
DIVI'S LABORATORIES LTD	—	104	17,232	27,228	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	824	815	30,399	48,030	運輸
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	100	119	26,349	41,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	337	450	17,167	27,125	各種金融
YES BANK LTD	2,009	2,575	42,192	66,663	銀行
NESTLE INDIA LTD	24	33	34,458	54,444	食品・飲料・タバコ
TECH MAHINDRA LTD	581	714	57,753	91,250	ソフトウェア・サービス
AUROBINDO PHARMA LTD	273	408	30,580	48,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	662	1,514	19,341	30,558	自動車・自動車部品
BOSCH LTD	7	10	17,796	28,117	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	8	11	21,944	34,672	素材
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	37	273	13,003	20,545	運輸
MARICO LTD	530	649	23,192	36,644	家庭用品・パーソナル用品
BHARTI INFRATEL LTD	325	491	12,894	20,373	電気通信サービス
EICHER MOTORS LTD	15	19	39,893	63,032	自動車・自動車部品
BHARAT FORGE LTD	239	317	14,479	22,877	自動車・自動車部品
UPL LTD	404	535	51,398	81,209	素材
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	126	197	12,180	19,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAVELLS INDIA LTD	289	357	26,386	41,691	資本財
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	341	385	26,902	42,505	銀行
PETRONET LNG LTD	798	798	18,862	29,802	エネルギー
PIDILITE INDUSTRIES LTD	—	161	18,843	29,772	素材
ASHOK LEYLAND LTD	1,300	1,700	14,606	23,077	資本財
CADILA HEALTHCARE LTD	271	271	7,862	12,422	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TATA MOTORS LTD-A-DVR	350	—	—	—	自動車・自動車部品
INTERGLOBE AVIATION LTD	—	136	20,942	33,089	運輸
BAJAJ FINANCE LTD	193	251	73,395	115,965	各種金融
VAKRANGEE LTD	418	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BAJAJ FINSERV LTD	40	56	41,828	66,089	保険
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	637	997	27,155	42,905	エネルギー
IDFC FIRST BANK LTD	1,200	—	—	—	銀行
GRASIM INDUSTRIES LTD	370	468	40,160	63,453	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD	—	198	24,871	39,296	食品・生活必需品小売り
INDIAN OIL CORP LTD	1,391	2,915	43,029	67,985	エネルギー
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	30	91	24,629	38,915	食品・飲料・タバコ
PAGE INDUSTRIES LTD	—	8	17,334	27,388	耐久消費財・アパレル
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	26	—	—	—	素材
小計 株数・金額	61,609	97,092	4,763,471	7,526,284	
小計 銘柄数<比率>	80	79	—	<8.8%>	
(中国オフショア)			千オフショア元		
SAIC MOTOR CORP LTD-A	—	144	379	6,055	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	—	23	2,086	33,319	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	—	116	391	6,252	保険
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	—	271	447	7,153	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	—	35	65	1,045	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	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	—	36	277	4,435	消費者サービス
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	—	75	91	1,456	半導体・半導体製造装置
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	—	85	54	868	資本財
QINGDAO HAIER CO LTD-A	—	113	185	2,964	耐久消費財・アパレル
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	—	27	41	659	資本財
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	—	177	174	2,792	食品・生活必需品小売り
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	—	100	45	728	小売
MIDEA GROUP CO LTD-A	—	122	619	9,887	耐久消費財・アパレル
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	—	170	506	8,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	—	18	49	789	耐久消費財・アパレル
GOERTEK INC -A	—	60	54	865	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	—	13	50	805	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEICHAI POWER CO LTD-A	—	112	136	2,173	資本財
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	—	383	707	11,303	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	—	775	444	7,091	資本財
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	—	56	309	4,941	耐久消費財・アパレル
S F HOLDING CO LTD-A	—	24	75	1,198	運輸
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	—	72	714	11,406	食品・飲料・タバコ
PING AN BANK CO LTD-A	—	317	401	6,419	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	—	573	347	5,554	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	—	342	234	3,752	素材
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	—	81	523	8,355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	—	128	96	1,533	運輸
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	—	625	218	3,493	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	—	112	338	5,412	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	—	390	239	3,817	銀行
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	—	226	133	2,129	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	—	219	284	4,536	不動産
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	—	42	384	6,136	食品・飲料・タバコ
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	—	188	96	1,543	資本財
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	—	239	135	2,171	公益事業
SUNING.COM CO LTD-A	—	172	200	3,194	小売
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO-A	—	92	59	943	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	—	19	152	2,427	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	613	9,798	銀行
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	—	41	56	908	資本財
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	—	58	129	2,061	自動車・自動車部品
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	—	15	42	672	素材
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	—	130	52	830	素材
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	—	20	48	766	素材
TIANQI LITHIUM CORP-A	—	21	59	955	素材
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	—	67	68	1,091	素材
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	—	470	255	4,075	エネルギー
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	—	212	214	3,426	資本財
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	—	18	49	797	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	—	32	72	1,157	自動車・自動車部品
CHINA SPACESAT CO LTD -A	—	22	50	798	資本財
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	—	130	99	1,581	運輸
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	—	33	41	669	メディア・娯楽
CHINA VANKE CO LTD -A	—	179	501	8,012	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	
CHINESE UNIVERSE PUBLISHIN-A	—	25	34	544	メディア・娯楽
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	—	72	57	919	自動車・自動車部品
CITIC GUOAN INFORMATION-A	—	72	32	515	メディア・娯楽
CITIC SECURITIES CO-A	—	182	375	5,999	各種金融
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	—	146	43	687	運輸
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	—	141	74	1,188	運輸
CRRC CORP LTD-A	—	374	307	4,903	資本財
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	—	274	224	3,592	運輸
DHC SOFTWARE CO LTD -A	—	58	44	703	ソフトウェア・サービス
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	—	12	49	786	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	51	823	各種金融
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	—	101	58	938	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	—	72	83	1,330	各種金融
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	—	33	60	967	資本財
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	—	55	43	695	不動産
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	—	65	42	676	各種金融
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	—	152	101	1,626	各種金融
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	—	42	160	2,568	不動産
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	—	37	87	1,390	自動車・自動車部品
GEMDALE CORP-A	—	83	97	1,561	不動産
GF SECURITIES CO LTD-A	—	109	157	2,515	各種金融
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	—	25	46	743	メディア・娯楽
GREENLAND HOLDINGS GROUP C-A	—	150	107	1,710	不動産
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	—	104	34	543	運輸
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	—	39	46	741	自動車・自動車部品
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	—	26	112	1,792	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	38	613	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	—	76	92	1,474	各種金融
AECC AVIATION POWER CO-A	—	42	100	1,606	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	—	1,375	501	8,014	銀行
AIR CHINA LTD-A	—	86	78	1,252	運輸
AISINO CORP-A	—	34	82	1,315	ソフトウェア・サービス
ANGANG STEEL CO LTD-A	—	76	38	622	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	—	74	288	4,607	素材
ANXIN TRUST CO LTD-A	—	101	57	917	各種金融
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	—	51	80	1,284	資本財
AVIC CAPITAL CO LTD -A	—	166	91	1,458	各種金融
BANK OF CHINA LTD-A	—	907	340	5,431	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	—	724	438	6,995	銀行
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	—	42	55	881	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	—	95	80	1,291	銀行
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	—	213	158	2,523	銀行
BANK OF NANJING CO LTD -A	—	157	132	2,111	銀行
BANK OF NINGBO CO LTD -A	—	94	205	3,289	銀行
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	—	202	238	3,803	銀行
BBMG CORPORATION-A	—	154	56	905	素材
BEIJING CAPITAL CO LTD-A	—	89	31	500	公益事業
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	—	78	56	908	食品・飲料・タバコ
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	—	16	47	755	ソフトウェア・サービス
BEIJING TONGRENTANG CO-A	—	25	74	1,184	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	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア元	千円	
BYD CO LTD -A	—	33	172	2,754	自動車・自動車部品
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	—	102	83	1,330	各種金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	—	105	62	999	銀行
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	—	51	58	939	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	—	177	123	1,978	銀行
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	—	151	95	1,519	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	—	735	291	4,648	銀行
CHINA FILM CO LTD-A	—	34	54	863	メディア・娯楽
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	—	55	163	2,612	不動産
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	—	23	29	467	資本財
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	—	51	137	2,199	保険
CHINA MERCHANTS BANK-A	—	381	1,280	20,450	銀行
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	—	106	172	2,750	各種金融
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	—	122	257	4,110	不動産
CHINA MINSHENG BANKING-A	—	654	404	6,465	銀行
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	—	91	54	869	資本財
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	—	139	242	3,878	各種金融
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	—	62	56	908	各種金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	—	149	190	3,038	各種金融
HLA CORP LTD -A	—	41	37	605	耐久消費財・アパレル
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	—	51	129	2,065	食品・飲料・タバコ
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	—	35	63	1,007	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HESTEEL CO LTD-A	—	196	59	948	素材
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	—	67	43	690	各種金融
HUADIAN POWER INTL CORP-A	—	150	57	924	公益事業
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	—	27	97	1,560	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG POWER INTL INC-A	—	90	61	977	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	—	121	229	3,669	各種金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	—	237	180	2,880	銀行
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	—	76	49	790	保険
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	—	80	31	505	公益事業
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	—	11	91	1,466	ソフトウェア・サービス
IND & COMM BK OF CHINA-A	—	995	558	8,914	銀行
IFLYTEK CO LTD - A	—	38	115	1,852	ソフトウェア・サービス
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	—	124	78	1,253	各種金融
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	—	701	115	1,847	素材
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	—	28	320	5,124	食品・飲料・タバコ
JIANGXI COPPER CO LTD-A	—	38	54	867	素材
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	—	50	31	506	素材
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	—	99	66	1,060	不動産
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	—	35	52	836	ヘルスケア機器・サービス
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	—	28	37	598	小売
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	—	52	122	1,949	半導体・半導体製造装置
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	—	76	188	3,007	資本財
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	—	27	193	3,096	食品・飲料・タバコ
MAANSHAN IRON & STEEL-A	—	110	37	593	素材
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	—	58	83	1,336	ヘルスケア機器・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	—	329	101	1,628	資本財
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	—	32	196	3,145	食品・飲料・タバコ
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	—	38	202	3,230	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	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	—	78	137	2,194	食品・飲料・タバコ
NINESTAR CORP-A	—	13	32	516	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFILM GROUP CO LTD-A	—	50	48	780	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	—	82	44	707	エネルギー
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	—	110	119	1,913	各種金融
SHANGHAI ORIENTAL PEARL GR-A	—	63	66	1,057	メディア・娯楽
PERFECT WORLD CO LTD-A	—	16	44	704	メディア・娯楽
PETROCHINA CO LTD-A	—	299	217	3,476	エネルギー
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	—	200	1,627	25,992	保険
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	—	80	77	1,240	不動産
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	—	54	67	1,077	素材
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	—	142	176	2,823	資本財
SDIC CAPITAL CO LTD-A	—	72	89	1,433	各種金融
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	—	125	96	1,533	公益事業
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	—	123	107	1,708	エネルギー
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	—	16	43	691	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	104	1,661	素材
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	—	82	45	720	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	—	145	79	1,271	資本財
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	—	37	98	1,565	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	130	2,086	運輸
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	—	57	37	598	資本財
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	—	55	42	679	エネルギー
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	—	52	42	677	各種金融
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	—	16	89	1,428	食品・飲料・タバコ
SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	—	58	36	578	エネルギー
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	—	84	49	791	公益事業
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	—	346	167	2,668	各種金融
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	—	61	38	612	公益事業
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	—	151	112	1,796	消費者サービス
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	—	16	37	595	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	31	499	素材
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	—	81	70	1,120	公益事業
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	—	27	77	1,235	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	53	847	各種金融
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	—	90	45	727	素材
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	—	55	59	953	各種金融
SPRING AIRLINES CO LTD-A	—	14	55	892	運輸
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	—	49	50	809	資本財
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	—	28	57	912	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	50	806	資本財
TIANMA MICROELECTRONICS-A	—	38	52	834	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	—	38	54	877	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	46	746	素材
TONGWEI CO LTD-A	—	72	108	1,733	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	—	13	66	1,061	食品・飲料・タバコ
TUS-SOUND ENVIRONMEN-RES A	—	26	28	453	商業・専門サービス
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	—	51	33	533	自動車・自動車部品
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	—	15	29	469	自動車・自動車部品
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	—	65	65	1,046	各種金融

銘柄	期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア元	千円	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	—	33	47	761	メディア・娯楽
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	—	145	65	1,039	資本財
XIAMEN C & D INC-A	—	52	46	738	資本財
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	—	159	54	863	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	—	54	59	951	資本財
YOUNGOR GROUP CO-A	—	66	60	966	不動産
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	—	11	117	1,879	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	42	674	不動産
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	—	40	95	1,529	資本財
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	—	53	77	1,238	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	—	60	117	1,872	素材
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	—	167	77	1,240	公益事業
ZHONGJIN GOLD CORP-A	—	64	52	846	素材
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	—	319	103	1,655	素材
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	—	118	56	898	資本財
ZTE CORP-A	—	63	194	3,106	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	—	17	51	816	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	—	81	150	2,407	エネルギー
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	—	362	93	1,485	公益事業
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	—	40	66	1,063	素材
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	—	85	160	2,571	資本財
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	—	18	30	480	自動車・自動車部品
TCL CORP-A	—	250	88	1,417	耐久消費財・アパレル
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	—	45	109	1,745	ソフトウェア・サービス
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	—	19	40	646	ソフトウェア・サービス
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	—	407	214	3,431	資本財
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	—	54	60	970	資本財
OPPEIN HOME GROUP INC-A	—	4	50	798	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	—	49	52	845	耐久消費財・アパレル
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	—	225	86	1,383	素材
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	—	99	140	2,248	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	—	140	53	854	エネルギー
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	—	36	36	585	各種金融
小計 株数・金額	—	30,654	35,530	567,418	
小計 銘柄数<比率>	—	238	—	<0.7%>	
(アラブ首長国連邦)			千アラブディルハム		
EMAAR PROPERTIES PJSC	4,203	5,277	2,332	69,815	不動産
ALDAR PROPERTIES PJSC	3,536	6,240	1,048	31,377	不動産
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	2,208	4,115	3,559	106,549	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	1,538	3,929	6,248	187,022	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK	1,380	2,278	1,164	34,844	銀行
EMAAR MALLS PJSC	2,567	2,567	415	12,450	不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO	2,082	2,593	4,180	125,125	電気通信サービス
DXB ENTERTAINMENTS PJSC	2,600	—	—	—	消費者サービス
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	1,600	2,753	289	8,653	不動産
EMAAR DEVELOPMENT PJSC	—	1,138	412	12,335	不動産
DUBAI INVESTMENTS PJSC	1,530	—	—	—	資本財
小計 株数・金額	23,247	30,894	19,651	588,174	
小計 銘柄数<比率>	10	9	—	<0.7%>	

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	
(カタール)	百株	百株	千カタールリアル	千円	
MASRAF AL RAYAN	387	523	1,834	55,114	銀行
OOREDOO QPSC	89	128	811	24,399	電気通信サービス
QATAR NATIONAL BANK	277	662	11,997	360,520	銀行
INDUSTRIES QATAR	162	251	2,848	85,595	資本財
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34	69	1,121	33,706	公益事業
QATAR ISLAMIC BANK	71	181	2,837	85,262	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	83	249	844	25,391	不動産
COMMERCIAL BANK PQSC	216	271	1,275	38,336	銀行
DOHA BANK QPSC	215	—	—	—	銀行
QATAR INSURANCE CO	162	225	814	24,475	保険
EZDAN HOLDING GROUP	842	1,127	1,043	31,362	不動産
QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	234	—	—	—	エネルギー
小計 株数・金額	2,777	3,692	25,429	764,164	
小計 銘柄数<比率>	12	10	—	<0.9%>	
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
SAPPI LIMITED	655	782	4,690	36,164	素材
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	49	84	6,006	46,312	素材
NEDBANK GROUP LTD	256	578	15,849	122,201	銀行
SASOL LTD	631	804	35,380	272,782	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	499	562	9,219	71,085	素材
GOLD FIELDS LTD	854	1,207	6,366	49,085	素材
MONDI LTD	121	173	5,320	41,018	素材
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	1,098	1,458	7,005	54,013	小売
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	472	706	5,262	40,572	小売
TELKOM SA SOC LTD	244	412	3,410	26,296	電気通信サービス
TIGER BRANDS LTD	176	237	6,168	47,562	食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD	1,545	2,623	20,150	155,361	保険
SHOPRITE HOLDINGS LTD	511	656	11,464	88,388	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,467	1,874	38,155	294,178	銀行
RMB HOLDINGS LTD	823	1,075	9,077	69,988	各種金融
REMGRO LTD	597	794	15,285	117,853	各種金融
NETCARE LTD	1,202	1,498	3,482	26,847	ヘルスケア機器・サービス
NASPERS LTD-N SHS	494	636	218,024	1,680,970	小売
MTN GROUP LTD	1,952	2,470	24,005	185,085	電気通信サービス
KUMBA IRON ORE LTD	69	101	4,316	33,277	素材
IMPERIAL LOGISTICS LTD	169	—	—	—	運輸
INVESTEC LTD	302	390	3,449	26,593	各種金融
FIRSTRAND LTD	3,846	4,839	33,631	259,297	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD	229	317	6,075	46,843	小売
EXXARO RESOURCES LTD	251	378	6,181	47,662	エネルギー
BIDVEST GROUP LTD	371	467	10,110	77,949	資本財
ABSA GROUP LTD	824	1,032	17,263	133,104	銀行
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	460	548	5,606	43,227	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DISCOVERY LTD	402	512	7,675	59,177	保険
VODACOM GROUP LTD	646	940	10,468	80,714	電気通信サービス
PICK N PAY STORES LTD	421	557	3,981	30,701	食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD	966	1,441	2,580	19,898	保険
SPAR GROUP LIMITED/THE	211	260	5,080	39,169	食品・生活必需品小売り
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	785	1,026	3,560	27,451	保険
LIBERTY HOLDINGS LTD	174	174	1,772	13,664	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	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカランド	千円	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		1,429	1,788	4,580	35,313	ヘルスケア機器・サービス
MR PRICE GROUP LTD		293	383	8,220	63,377	小売
SIBANYE GOLD LTD		2,000	—	—	—	素材
CORONATION FUND MANAGERS LTD		305	—	—	—	各種金融
BRAIT SE		331	—	—	—	各種金融
PSG GROUP LTD		173	210	5,431	41,875	各種金融
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		43	60	8,185	63,109	銀行
CLICKS GROUP LTD		—	348	6,944	53,538	食品・生活必需品小売り
PIONEER FOODS GROUP LTD		171	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BID CORP LTD		403	479	13,947	107,534	食品・生活必需品小売り
NEPI ROCKCASTLE PLC		395	537	6,481	49,976	不動産
REINET INVESTMENTS SCA		—	223	5,089	39,241	各種金融
OLD MUTUAL LTD		—	7,178	16,697	128,734	保険
MULTICHOICE GROUP LTD		—	603	7,619	58,742	メディア・娯楽
小計	株数・金額	29,336	43,441	649,279	5,005,947	
	銘柄数<比率>	45	44	—	<5.8%>	
合計	株数・金額	8,247,017	8,993,865	—	82,206,718	
	銘柄数<比率>	831	1,125	—	<95.6%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)		千口	千口	千メキシコペソ	千円	%
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		384	481	12,499	71,746	0.1
小計	口数・金額	384	481	12,499	71,746	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI		264	—	—	—	—
小計	口数・金額	264	—	—	—	
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		330	444	10,886	83,936	0.1
REDEFINE PROPERTIES LTD		568	845	8,324	64,182	0.1
HYPROP INVESTMENTS LTD		28	39	2,659	20,507	0.0
RESILIENT REIT LTD		30	45	2,556	19,712	0.0
FORTRESS REIT LTD-A		93	180	3,456	26,646	0.0
FORTRESS REIT LTD-B		101	89	925	7,135	0.0
小計	口数・金額	1,153	1,644	28,809	222,119	
	銘柄数<比率>	6	6	—	<0.3%>	
合計	口数・金額	1,802	2,126	—	293,865	
	銘柄数<比率>	8	7	—	<0.3%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 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	当期末 売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	HANG IDX	19	－
		MINI MS	3,059	－

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

○投資信託財産の構成

(2019年５月13日現在)

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	82,206,718	94.3
投資証券	293,865	0.3
コール・ローン等、その他	4,648,407	5.4
投資信託財産総額	87,148,990	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（86,009,411千円）の投資信託財産総額（87,148,990千円）に対する比率は98.7%です。

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

1アメリカドル＝109.74円	1メキシコペソ＝5.74円	1ブラジルレアル＝27.74円	100チリペソ＝15.98円
100コロンビアペソ＝3.35円	1ユーロ＝123.25円	1イギリスポンド＝142.77円	1トルコリラ＝18.34円
1チェココルナ＝4.79円	100ハンガリーフォリント＝38.11円	1ポーランドズロチ＝28.67円	1香港ドル＝13.98円
1マレーシアリンギット＝26.38円	1タイバーツ＝3.47円	1フィリピンペソ＝2.10円	100インドネシアルピア＝0.77円
100韓国ウォン＝9.31円	1ニュー台湾ドル＝3.54円	1インドルピー＝1.58円	1オフショア元＝15.97円
1アラブディルハム＝29.93円	1カタールリアル＝30.05円	1南アフリカランド＝7.71円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年５月13日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	87,606,529,813
コール・ローン等	3,589,313,425
株式(評価額)	82,206,718,474
投資証券(評価額)	293,865,965
未収入金	462,502,847
未収配当金	121,210,596
差入委託証拠金	932,918,506
(B) 負債	1,619,445,527
未払金	578,802,868
未払解約金	1,040,641,735
未払利息	924
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	85,987,084,286
元本	35,842,976,285
次期繰越損益金	50,144,108,001
(D) 受益権総口数	35,842,976,285口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	23,990円

＜注記事項＞

①期首元本額　27,156,684,820円
　期中追加設定元本額　13,346,257,739円
　期中一部解約元本額　4,659,966,274円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.3990円です。

○損益の状況 (2018年５月15日～2019年５月13日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	1,739,923,324
受取配当金	1,705,065,960
受取利息	35,021,833
その他収益金	71,330
支払利息	△ 235,799
(B) 有価証券売買損益	△ 7,957,106,009
売買益	4,150,839,033
売買損	△12,107,945,042
(C) 先物取引等取引損益	△ 316,027,481
取引益	482,459,111
取引損	△ 798,486,592
(D) 保管費用等	△ 82,398,974
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	△ 6,615,609,140
(F) 前期繰越損益金	44,399,709,710
(G) 追加信託差損益金	19,156,467,552
(H) 解約差損益金	△ 6,796,460,121
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	50,144,108,001
次期繰越損益金(Ｉ)	50,144,108,001

(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。

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

ｅＭＡＸＩＳ 新興国株式インデックス	13,038,485,140円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,437,554,821円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	223,042,437円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	261,197,418円
コアバランス	132,575円
海外株式セレクション（ラップ向け）	56,981,504円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	1,256,583,520円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 新興国株式インデックス	6,428,788,306円
つみたて新興国株式	823,962,523円
つみたて８資産均等バランス	423,755,424円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	499,036円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	823,108円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	1,803,152円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（除く日本）	276,083,171円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（３地域均等型）	132,482,825円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（オール・カントリー）	158,410,900円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国株式インデックスファンド	8,033,044,026円
新興国株式インデックスオープン	358,348,795円
ｅＭＡＸＩＳ 全世界株式インデックス	413,812,575円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	493,151,173円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	2,612,866円

ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	14,943,181円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	87,443,834円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	75,119,613円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	371,491,691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）	1,454,975,559円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	1,397,806円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	6,537,849円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	9,511,457円
合計	35,842,976,285円

日本債券インデックスマザーファンド

《第18期》決算日2019年５月13日

［計算期間：2018年５月15日～2019年５月13日］

「日本債券インデックスマザーファンド」は、５月13日に第18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18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	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2015年５月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834
15期(2016年５月12日)	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

(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		NOMURA－BPI総合		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
（期　首） 2018年５月14日	13,283	－	381.82	－	98.4	0.3
５月末	13,306	0.2	382.50	0.2	99.3	0.4
６月末	13,312	0.2	382.67	0.2	100.9	0.4
７月末	13,288	0.0	381.98	0.0	99.4	0.3
８月末	13,216	△0.5	379.89	△0.5	98.6	0.4
９月末	13,184	△0.7	378.99	△0.7	98.6	0.1
10月末	13,208	△0.6	379.64	△0.6	99.2	0.4
11月末	13,263	△0.2	381.24	△0.2	98.8	0.4
12月末	13,360	0.6	384.13	0.6	99.6	0.1
2019年１月末	13,415	1.0	385.58	1.0	99.6	0.1
２月末	13,443	1.2	386.43	1.2	99.5	0.1
３月末	13,538	1.9	389.14	1.9	99.9	0.1
４月末	13,495	1.6	387.94	1.6	99.8	0.1
（期　末） 2019年５月13日	13,503	1.7	388.16	1.7	99.8	0.1

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

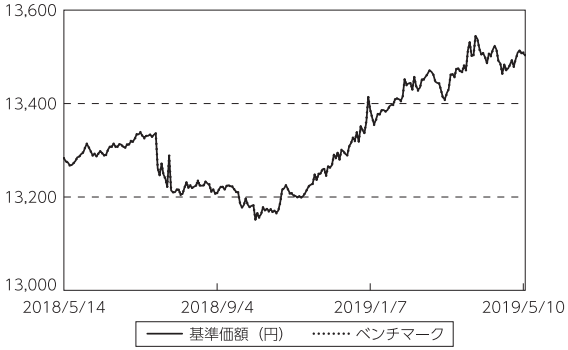
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.7%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（1.7%）とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



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

●投資環境について

・国内債券市況は、日本銀行による金融緩和策の柔軟化を受けて下落する局面もありましたが、期の後半にかけ世界的な景気の先行きに対する不透明感が高まったことなどから、期を通じて見ると上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは1.7%の上昇になったため、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）

・ポートフォリオ要因

（主なマイナス要因）

・評価時価差異要因※

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

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2018年５月15日～2019年５月13日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	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
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(b) その他費用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（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	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,322円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2018年５月15日～2019年５月13日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	213,627,146	155,720,266 (100,000)
	地方債証券	8,762,826	6,473,202
	特殊債券	14,732,314	13,122,127 (598,998)
	社債券	12,843,825	6,478,771 (400,000)

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）
（注）（　）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
（注）社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	債券先物取引	百万円 14,041	百万円 15,421	百万円 －	百万円 －

○利害関係人との取引状況等

（2018年５月15日～2019年５月13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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	249,966	70,625	28.3	181,794	26,887	14.8

（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
	百万円	百万円	百万円
公社債	1,000	802	1,741

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
	百万円
公社債	3,200

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

○組入資産の明細

（2019年５月13日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	463,721,000	506,833,740	83.2	－	54.4	18.2	10.6
地方債証券	30,807,350	32,542,061	5.3	－	3.2	1.6	0.5
	(30,807,350)	(32,542,061)	(5.3)	(－)	(3.2)	(1.6)	(0.5)
特殊債券（除く金融債）	33,348,097	35,968,864	5.9	－	4.0	1.2	0.8
	(33,348,097)	(35,968,864)	(5.9)	(－)	(4.0)	(1.2)	(0.8)
金融債券	3,200,000	3,214,444	0.5	－	0.1	0.3	0.2
	(3,200,000)	(3,214,444)	(0.5)	(－)	(0.1)	(0.3)	(0.2)
普通社債券	28,573,000	29,238,091	4.8	0.0	2.0	2.5	0.3
	(28,573,000)	(29,238,091)	(4.8)	(0.0)	(2.0)	(2.5)	(0.3)
合計	559,649,447	607,797,202	99.8	0.0	63.7	23.8	12.4
	(95,928,447)	(100,963,461)	(16.6)	(0.0)	(9.3)	(5.5)	(1.7)

（注）（　）内は非上場債で内書き。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
（注）現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第390回利付国債（２年）	0.1	4,750,000	4,764,250	2020/７/１
第391回利付国債（２年）	0.1	4,700,000	4,715,181	2020/８/１
第392回利付国債（２年）	0.1	2,500,000	2,508,625	2020/９/１
第393回利付国債（２年）	0.1	900,000	903,303	2020/10/１
第394回利付国債（２年）	0.1	2,850,000	2,860,887	2020/11/１
第395回利付国債（２年）	0.1	2,000,000	2,008,080	2020/12/１
第396回利付国債（２年）	0.1	2,700,000	2,711,502	2021/１/１
第397回利付国債（２年）	0.1	1,900,000	1,908,512	2021/２/１
第398回利付国債（２年）	0.1	4,950,000	4,973,166	2021/３/１
第399回利付国債（２年）	0.1	1,500,000	1,507,350	2021/４/１
第124回利付国債（５年）	0.1	2,430,000	2,437,095	2020/６/20
第125回利付国債（５年）	0.1	4,400,000	4,415,796	2020/９/20
第126回利付国債（５年）	0.1	2,960,000	2,972,580	2020/12/20
第127回利付国債（５年）	0.1	3,870,000	3,889,001	2021/３/20
第128回利付国債（５年）	0.1	3,850,000	3,871,483	2021/６/20
第129回利付国債（５年）	0.1	3,100,000	3,119,406	2021/９/20
第130回利付国債（５年）	0.1	4,950,000	4,984,254	2021/12/20
第131回利付国債（５年）	0.1	4,010,000	4,040,395	2022/３/20
第132回利付国債（５年）	0.1	3,650,000	3,680,149	2022/６/20
第133回利付国債（５年）	0.1	4,380,000	4,419,858	2022/９/20
第134回利付国債（５年）	0.1	4,610,000	4,655,085	2022/12/20
第135回利付国債（５年）	0.1	4,480,000	4,526,860	2023/３/20
第136回利付国債（５年）	0.1	1,450,000	1,466,167	2023/６/20
第137回利付国債（５年）	0.1	4,700,000	4,754,614	2023/９/20
第138回利付国債（５年）	0.1	8,000,000	8,098,320	2023/12/20
第139回利付国債（５年）	0.1	800,000	810,360	2024/３/20
第１回利付国債（40年）	2.4	475,000	713,331	2048/３/20
第２回利付国債（40年）	2.2	870,000	1,268,964	2049/３/20
第３回利付国債（40年）	2.2	733,000	1,077,561	2050/３/20
第４回利付国債（40年）	2.2	1,098,000	1,628,729	2051/３/20
第５回利付国債（40年）	2.0	1,175,000	1,686,559	2052/３/20
第６回利付国債（40年）	1.9	1,070,000	1,512,412	2053/３/20
第７回利付国債（40年）	1.7	1,190,000	1,618,602	2054/３/20
第８回利付国債（40年）	1.4	1,250,000	1,587,175	2055/３/20
第９回利付国債（40年）	0.4	1,570,000	1,479,693	2056/３/20
第10回利付国債（40年）	0.9	2,090,000	2,319,147	2057/３/20
第11回利付国債（40年）	0.8	2,030,000	2,181,965	2058/３/20
第308回利付国債（10年）	1.3	1,374,000	1,396,203	2020/６/20
第309回利付国債（10年）	1.1	3,700,000	3,751,615	2020/６/20
第310回利付国債（10年）	1.0	2,136,000	2,169,748	2020/９/20
第311回利付国債（10年）	0.8	2,100,000	2,127,468	2020/９/20
第312回利付国債（10年）	1.2	6,860,000	7,010,439	2020/12/20
第313回利付国債（10年）	1.3	3,469,000	3,562,940	2021/３/20
第314回利付国債（10年）	1.1	1,190,000	1,217,810	2021/３/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第315回利付国債（10年）	1.2	3,633,000	3,737,557	2021/6/20
第316回利付国債（10年）	1.1	2,280,000	2,340,807	2021/6/20
第317回利付国債（10年）	1.1	1,957,000	2,015,475	2021/9/20
第318回利付国債（10年）	1.0	2,480,000	2,548,249	2021/9/20
第319回利付国債（10年）	1.1	1,719,000	1,775,830	2021/12/20
第320回利付国債（10年）	1.0	1,980,000	2,040,291	2021/12/20
第321回利付国債（10年）	1.0	2,515,000	2,598,875	2022/3/20
第322回利付国債（10年）	0.9	1,470,000	1,514,805	2022/3/20
第323回利付国債（10年）	0.9	1,675,000	1,730,593	2022/6/20
第324回利付国債（10年）	0.8	2,800,000	2,884,224	2022/6/20
第325回利付国債（10年）	0.8	3,835,000	3,959,790	2022/9/20
第326回利付国債（10年）	0.7	730,000	752,885	2022/12/20
第327回利付国債（10年）	0.8	2,540,000	2,628,823	2022/12/20
第328回利付国債（10年）	0.6	3,700,000	3,809,631	2023/3/20
第329回利付国債（10年）	0.8	5,860,000	6,093,462	2023/6/20
第330回利付国債（10年）	0.8	3,330,000	3,470,892	2023/9/20
第331回利付国債（10年）	0.6	1,060,000	1,095,552	2023/9/20
第332回利付国債（10年）	0.6	5,040,000	5,218,819	2023/12/20
第333回利付国債（10年）	0.6	6,550,000	6,794,904	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	4,330,000	4,501,554	2024/6/20
第335回利付国債（10年）	0.5	4,970,000	5,149,864	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	4,080,000	4,234,591	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	940,000	964,985	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	3,730,000	3,854,470	2025/3/20
第339回利付国債（10年）	0.4	4,660,000	4,822,261	2025/6/20
第340回利付国債（10年）	0.4	4,850,000	5,025,909	2025/9/20
第341回利付国債（10年）	0.3	3,770,000	3,887,020	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	2,480,000	2,525,508	2026/3/20
第343回利付国債（10年）	0.1	4,760,000	4,848,869	2026/6/20
第344回利付国債（10年）	0.1	3,660,000	3,728,002	2026/9/20
第345回利付国債（10年）	0.1	4,190,000	4,268,897	2026/12/20
第346回利付国債（10年）	0.1	4,790,000	4,881,201	2027/3/20
第347回利付国債（10年）	0.1	3,600,000	3,667,788	2027/6/20
第348回利付国債（10年）	0.1	5,600,000	5,703,936	2027/9/20
第349回利付国債（10年）	0.1	4,190,000	4,266,383	2027/12/20
第350回利付国債（10年）	0.1	6,750,000	6,867,450	2028/3/20
第351回利付国債（10年）	0.1	7,750,000	7,881,440	2028/6/20
第352回利付国債（10年）	0.1	6,380,000	6,485,142	2028/9/20
第353回利付国債（10年）	0.1	5,400,000	5,486,076	2028/12/20
第354回利付国債（10年）	0.1	1,800,000	1,826,712	2029/3/20
第１回利付国債（30年）	2.8	76,000	98,031	2029/9/20
第２回利付国債（30年）	2.4	98,000	123,469	2030/2/20
第３回利付国債（30年）	2.3	117,000	146,644	2030/5/20
第４回利付国債（30年）	2.9	127,000	169,039	2030/11/20
第５回利付国債（30年）	2.2	108,000	135,897	2031/5/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第６回利付国債（30年）	2.4	169,000	218,143	2031/11/20
第７回利付国債（30年）	2.3	164,000	210,900	2032/５/20
第８回利付国債（30年）	1.8	142,000	174,215	2032/11/22
第９回利付国債（30年）	1.4	116,000	136,145	2032/12/20
第10回利付国債（30年）	1.1	185,000	209,697	2033/３/20
第11回利付国債（30年）	1.7	137,000	166,898	2033/６/20
第12回利付国債（30年）	2.1	220,000	281,067	2033/９/20
第13回利付国債（30年）	2.0	205,000	259,562	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	493,000	654,122	2034/３/20
第15回利付国債（30年）	2.5	346,000	465,722	2034/６/20
第16回利付国債（30年）	2.5	302,000	407,591	2034/９/20
第17回利付国債（30年）	2.4	327,000	437,503	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	427,000	566,056	2035/３/20
第19回利付国債（30年）	2.3	303,000	402,568	2035/６/20
第20回利付国債（30年）	2.5	495,000	675,283	2035/９/20
第21回利付国債（30年）	2.3	379,000	505,673	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	570,000	781,145	2036/３/20
第23回利付国債（30年）	2.5	554,000	760,919	2036/６/20
第24回利付国債（30年）	2.5	411,000	565,741	2036/９/20
第25回利付国債（30年）	2.3	742,000	998,464	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	884,000	1,207,711	2037/３/20
第27回利付国債（30年）	2.5	860,000	1,194,316	2037/９/20
第28回利付国債（30年）	2.5	911,000	1,270,817	2038/３/20
第29回利付国債（30年）	2.4	1,450,000	2,003,305	2038/９/20
第30回利付国債（30年）	2.3	1,496,000	2,046,916	2039/３/20
第31回利付国債（30年）	2.2	1,358,000	1,840,578	2039/９/20
第32回利付国債（30年）	2.3	1,739,000	2,402,585	2040/３/20
第33回利付国債（30年）	2.0	1,644,000	2,180,782	2040/９/20
第34回利付国債（30年）	2.2	2,116,000	2,904,654	2041/３/20
第35回利付国債（30年）	2.0	2,549,000	3,406,789	2041/９/20
第36回利付国債（30年）	2.0	1,829,000	2,454,499	2042/３/20
第37回利付国債（30年）	1.9	2,057,000	2,724,722	2042/９/20
第38回利付国債（30年）	1.8	1,185,000	1,547,882	2043/３/20
第39回利付国債（30年）	1.9	1,540,000	2,050,032	2043/６/20
第40回利付国債（30年）	1.8	1,220,000	1,599,029	2043/９/20
第41回利付国債（30年）	1.7	1,150,000	1,483,189	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	1,520,000	1,962,183	2044/３/20
第43回利付国債（30年）	1.7	1,320,000	1,705,598	2044/６/20
第44回利付国債（30年）	1.7	1,290,000	1,670,253	2044/９/20
第45回利付国債（30年）	1.5	1,190,000	1,485,381	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	1,550,000	1,935,810	2045/３/20
第47回利付国債（30年）	1.6	1,770,000	2,255,971	2045/６/20
第48回利付国債（30年）	1.4	1,310,000	1,606,977	2045/９/20
第49回利付国債（30年）	1.4	2,580,000	3,166,072	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	970,000	1,045,068	2046/３/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第51回利付国債（30年）	0.3	1,510,000	1,436,206	2046/6/20
第52回利付国債（30年）	0.5	1,660,000	1,661,992	2046/9/20
第53回利付国債（30年）	0.6	980,000	1,004,980	2046/12/20
第54回利付国債（30年）	0.8	1,870,000	2,014,513	2047/3/20
第55回利付国債（30年）	0.8	1,500,000	1,614,855	2047/6/20
第56回利付国債（30年）	0.8	1,490,000	1,602,986	2047/9/20
第57回利付国債（30年）	0.8	1,440,000	1,548,100	2047/12/20
第58回利付国債（30年）	0.8	2,320,000	2,492,329	2048/3/20
第59回利付国債（30年）	0.7	710,000	743,242	2048/6/20
第60回利付国債（30年）	0.9	3,050,000	3,357,958	2048/9/20
第61回利付国債（30年）	0.7	1,600,000	1,673,872	2048/12/20
第62回利付国債（30年）	0.5	500,000	494,855	2049/3/20
第47回利付国債（20年）	2.2	114,000	117,663	2020/9/21
第48回利付国債（20年）	2.5	209,000	217,947	2020/12/21
第49回利付国債（20年）	2.1	515,000	536,650	2021/3/22
第51回利付国債（20年）	2.0	200,000	209,142	2021/6/21
第52回利付国債（20年）	2.1	214,000	225,463	2021/9/21
第54回利付国債（20年）	2.2	480,000	509,673	2021/12/20
第55回利付国債（20年）	2.0	241,000	255,949	2022/3/21
第56回利付国債（20年）	2.0	449,000	479,303	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	147,000	157,235	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	589,000	628,810	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	289,000	302,042	2023/3/20
第63回利付国債（20年）	1.8	442,000	477,762	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	441,000	480,822	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	318,000	348,372	2023/12/20
第66回利付国債（20年）	1.8	500,000	545,440	2023/12/20
第68回利付国債（20年）	2.2	846,000	943,569	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	422,000	477,687	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	160,000	179,467	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	534,000	599,324	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	620,000	695,906	2024/12/20
第74回利付国債（20年）	2.1	318,000	358,729	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	575,000	651,728	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	200,000	224,326	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	210,000	236,781	2025/3/20
第78回利付国債（20年）	1.9	410,000	462,037	2025/6/20
第79回利付国債（20年）	2.0	50,000	56,654	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	315,000	358,863	2025/6/20
第81回利付国債（20年）	2.0	350,000	398,524	2025/9/20
第82回利付国債（20年）	2.1	662,000	758,029	2025/9/20
第83回利付国債（20年）	2.1	413,000	475,284	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	670,000	766,573	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	490,000	566,489	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	515,000	602,524	2026/3/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第87回利付国債（20年）	2.2	450,000	523,363	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	804,000	945,383	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	410,000	479,154	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	1,100,000	1,291,235	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	468,000	552,839	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	1,432,000	1,677,845	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	390,000	455,874	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	615,000	723,756	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	1,017,000	1,218,335	2027/6/20
第96回利付国債（20年）	2.1	320,000	378,115	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	343,000	409,799	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	470,000	557,570	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	1,345,000	1,601,760	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	1,060,000	1,276,526	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	573,000	700,269	2028/3/20
第102回利付国債（20年）	2.4	530,000	650,500	2028/6/20
第103回利付国債（20年）	2.3	640,000	779,648	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	300,000	359,958	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	870,000	1,047,741	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	711,000	862,954	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	567,000	685,287	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	800,000	951,440	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	800,000	954,408	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	1,096,000	1,329,228	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	711,000	872,084	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	1,340,000	1,630,002	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	1,382,000	1,686,841	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	1,320,000	1,616,472	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	1,154,000	1,425,443	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	1,346,000	1,668,165	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	1,210,000	1,486,485	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	776,000	947,759	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	660,000	791,439	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	810,000	953,337	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	989,000	1,200,289	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	760,000	913,755	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	1,368,000	1,696,402	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	750,000	921,367	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	1,454,000	1,825,453	2031/3/20
第126回利付国債（20年）	2.0	890,000	1,096,364	2031/3/20
第127回利付国債（20年）	1.9	440,000	536,830	2031/3/20
第128回利付国債（20年）	1.9	1,014,000	1,240,385	2031/6/20
第129回利付国債（20年）	1.8	450,000	545,049	2031/6/20
第130回利付国債（20年）	1.8	1,682,000	2,042,133	2031/9/20
第131回利付国債（20年）	1.7	480,000	576,883	2031/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第132回利付国債（20年）	1.7	1,187,000	1,429,599	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	1,740,000	2,117,371	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	1,885,000	2,298,814	2032/3/20
第135回利付国債（20年）	1.7	600,000	724,080	2032/3/20
第136回利付国債（20年）	1.6	650,000	776,152	2032/3/20
第137回利付国債（20年）	1.7	1,132,000	1,368,871	2032/6/20
第138回利付国債（20年）	1.5	400,000	473,336	2032/6/20
第139回利付国債（20年）	1.6	100,000	119,629	2032/6/20
第140回利付国債（20年）	1.7	2,397,000	2,904,277	2032/9/20
第141回利付国債（20年）	1.7	2,220,000	2,694,858	2032/12/20
第142回利付国債（20年）	1.8	1,090,000	1,337,767	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	1,980,000	2,380,811	2033/3/20
第144回利付国債（20年）	1.5	350,000	416,080	2033/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	2,410,000	2,935,958	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	2,260,000	2,758,013	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	2,160,000	2,609,409	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	4,820,000	5,760,960	2034/3/20
第149回利付国債（20年）	1.5	2,220,000	2,656,674	2034/6/20
第150回利付国債（20年）	1.4	2,620,000	3,099,853	2034/9/20
第151回利付国債（20年）	1.2	2,340,000	2,700,172	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	2,740,000	3,163,357	2035/3/20
第153回利付国債（20年）	1.3	3,490,000	4,085,638	2035/6/20
第154回利付国債（20年）	1.2	2,760,000	3,189,483	2035/9/20
第155回利付国債（20年）	1.0	3,330,000	3,740,022	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	2,330,000	2,386,502	2036/3/20
第157回利付国債（20年）	0.2	1,840,000	1,820,422	2036/6/20
第158回利付国債（20年）	0.5	2,420,000	2,512,250	2036/9/20
第159回利付国債（20年）	0.6	2,070,000	2,181,117	2036/12/20
第160回利付国債（20年）	0.7	3,530,000	3,778,794	2037/3/20
第161回利付国債（20年）	0.6	2,590,000	2,723,385	2037/6/20
第162回利付国債（20年）	0.6	2,710,000	2,846,448	2037/9/20
第163回利付国債（20年）	0.6	2,730,000	2,864,206	2037/12/20
第164回利付国債（20年）	0.5	2,800,000	2,884,448	2038/3/20
第165回利付国債（20年）	0.5	1,730,000	1,779,633	2038/6/20
第166回利付国債（20年）	0.7	2,500,000	2,661,000	2038/9/20
第167回利付国債（20年）	0.5	2,450,000	2,512,793	2038/12/20
第168回利付国債（20年）	0.4	200,000	201,108	2039/3/20
小計		463,721,000	506,833,740	
地方債証券				
第１回東京都公募公債（20年）	1.54	20,000	21,251	2023/6/20
第７回東京都公募公債（30年）	2.51	10,000	13,655	2038/9/17
第８回東京都公募公債（30年）	2.23	80,000	105,072	2038/9/17
第12回東京都公募公債（20年）	2.31	100,000	118,887	2027/9/17
第16回東京都公募公債（20年）	2.01	100,000	118,397	2028/12/20
第20回東京都公募公債（20年）	2.09	80,000	96,173	2029/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第21回東京都公募公債（20年）	2.19	80,000	97,294	2029/12/20
第22回東京都公募公債（20年）	1.92	120,000	143,282	2030/6/20
第24回東京都公募公債（20年）	1.98	70,000	84,870	2031/6/20
第28回東京都公募公債（20年）	1.59	100,000	117,852	2033/3/18
第686回東京都公募公債	1.08	100,000	101,177	2020/6/19
第687回東京都公募公債	1.12	100,000	101,499	2020/9/18
第693回東京都公募公債	1.38	100,000	102,533	2021/3/19
第705回東京都公募公債	1.06	170,000	175,079	2022/3/18
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	102,389	2022/6/20
第722回東京都公募公債	0.8	100,000	103,220	2023/6/20
第729回東京都公募公債	0.69	100,000	103,271	2024/3/19
第749回東京都公募公債	0.436	300,000	307,917	2025/9/19
第750回東京都公募公債	0.444	200,000	205,456	2025/12/19
第752回東京都公募公債	0.126	100,000	100,632	2025/12/19
第754回東京都公募公債	0.06	120,000	120,244	2026/3/19
第755回東京都公募公債	0.06	300,000	300,612	2026/3/19
第758回東京都公募公債	0.03	300,000	300,000	2026/6/19
第765回東京都公募公債	0.21	300,000	304,227	2027/3/19
平成22年度第８回北海道公募公債	0.96	100,000	101,358	2020/10/29
平成25年度第４回北海道公募公債	0.85	100,000	103,357	2023/6/28
平成25年度第７回北海道公募公債	0.8	150,000	154,923	2023/8/30
平成25年度第９回北海道公募公債	0.7	300,000	308,898	2023/10/31
平成27年度第９回北海道公募公債	0.486	200,000	205,884	2025/10/30
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	101,287	2026/2/26
平成28年度第12回北海道公募公債	0.165	300,000	302,850	2026/12/28
平成29年度第15回北海道公募公債	0.23	117,000	118,388	2028/2/28
第29回１号宮城県公募公債	0.68	100,000	102,957	2023/10/25
第２回神奈川県公募公債（20年）	2.23	80,000	89,459	2024/9/20
第２回神奈川県公募公債（30年）	2.87	80,000	112,272	2036/6/20
第27回神奈川県公募公債（20年）	1.398	100,000	115,766	2034/9/20
第189回神奈川県公募公債	0.89	400,000	410,016	2022/3/18
第191回神奈川県公募公債	0.83	100,000	102,544	2022/6/20
第226回神奈川県公募公債	0.195	300,000	303,876	2027/3/19
第228回神奈川県公募公債	0.205	200,000	202,662	2027/6/18
第５回大阪府公募公債（20年）	2.16	100,000	121,438	2030/5/28
第11回大阪府公募公債（20年）	1.693	200,000	238,236	2033/9/27
第343回大阪府公募公債	0.98	70,000	70,969	2020/10/28
第348回大阪府公募公債	1.32	10,000	10,242	2021/3/30
第351回大阪府公募公債	1.19	100,000	102,560	2021/7/28
第358回大阪府公募公債	0.97	56,000	57,471	2022/2/28
第359回大阪府公募公債	0.99	56,000	57,545	2022/3/29
第376回大阪府公募公債	0.82	106,000	109,632	2023/9/27
第380回大阪府公募公債	0.762	100,000	103,424	2024/1/30
第385回大阪府公募公債	0.65	200,000	206,342	2024/6/27
第388回大阪府公募公債	0.54	400,000	410,948	2024/9/27

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第393回大阪府公募公債	0.468	110,000	112,785	2025/2/26
第394回大阪府公募公債	0.489	200,000	205,382	2025/3/28
第414回大阪府公募公債	0.037	100,000	99,977	2026/11/27
第416回大阪府公募公債	0.185	108,000	109,162	2027/1/29
第429回大阪府公募公債	0.197	103,000	103,927	2028/2/25
第431回大阪府公募公債	0.165	300,000	301,782	2028/4/26
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	2.19	100,000	121,117	2029/9/20
平成23年度第9回京都府公募公債	1.01	140,000	143,976	2022/3/16
平成24年度第3回京都府公募公債（20年）	1.63	200,000	235,710	2032/8/13
平成24年度第10回京都府公募公債	0.67	100,000	102,521	2023/3/22
平成25年度第2回京都府公募公債（15年）	1.05	100,000	108,649	2028/4/28
第1回兵庫県公募公債（18年）	1.26	200,000	225,154	2032/8/6
第2回兵庫県公募公債（30年）	2.36	40,000	53,991	2040/3/19
第4回兵庫県公募公債（15年）	1.31	100,000	110,523	2027/12/24
第5回兵庫県公募公債（15年）	1.31	100,000	110,871	2028/5/26
第8回兵庫県公募公債（15年）	1.09	100,000	109,338	2029/4/16
第15回兵庫県公募公債（20年）	1.64	300,000	352,368	2032/7/23
第16回兵庫県公募公債（20年）	1.7	100,000	118,498	2032/11/19
平成27年度第6回兵庫県公募公債	0.56	200,000	206,628	2025/8/18
第3回静岡県公募公債（15年）	1.368	100,000	111,060	2027/10/29
平成22年度第6回静岡県公募公債	1.178	100,000	101,391	2020/7/22
平成22年度第8回静岡県公募公債	1.059	100,000	101,347	2020/8/25
平成25年度第1回静岡県公募公債	0.581	100,000	102,223	2023/4/19
平成25年度第5回静岡県公募公債	0.926	100,000	103,823	2023/7/25
平成25年度第8回静岡県公募公債	0.699	130,000	133,952	2023/10/24
平成27年度第3回静岡県公募公債	0.544	121,000	124,812	2025/5/21
平成27年度第5回静岡県公募公債	0.578	100,000	103,401	2025/6/20
平成30年度第9回静岡県公募公債	0.239	100,000	101,437	2028/6/20
平成23年度第7回愛知県公募公債	1.11	100,000	102,432	2021/7/29
平成23年度第9回愛知県公募公債	1.019	100,000	102,404	2021/9/30
平成23年度第13回愛知県公募公債	1.529	300,000	333,669	2026/11/13
平成23年度第14回愛知県公募公債	1.006	100,000	102,539	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	102,681	2022/1/31
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	102,705	2022/11/30
平成24年度第14回愛知県公募公債（15年）	1.314	300,000	332,136	2027/12/13
平成26年度第9回愛知県公募公債	0.576	100,000	102,937	2024/8/26
平成26年度第12回愛知県公募公債	0.515	100,000	102,695	2024/10/25
平成27年度第18回愛知県公募公債	0.22	100,000	101,282	2026/2/16
平成28年度第1回愛知県公募公債	0.08	100,000	100,347	2026/4/28
平成28年度第8回愛知県公募公債	0.065	108,000	108,274	2026/8/26
平成22年度第5回広島県公募公債	1.0	200,000	203,040	2020/11/25
平成22年度第8回広島県公募公債	1.33	26,650	27,306	2021/3/25
平成23年度第1回広島県公募公債	1.19	100,000	102,404	2021/5/27
平成27年度第4回広島県公募公債	0.476	100,000	102,909	2025/11/25
平成29年度第5回広島県公募公債	0.245	100,000	101,540	2028/1/25

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	
第４回埼玉県公募公債（20年）	2.18	200,000	235,460	2027/９/21
平成23年度第１回埼玉県公募公債	1.37	100,000	102,660	2021/４/27
平成23年度第４回埼玉県公募公債	1.2	100,000	102,624	2021/７/27
平成24年度第６回埼玉県公募公債	0.801	100,000	102,732	2022/10/26
平成26年度第８回埼玉県公募公債	0.335	100,000	101,797	2025/１/28
平成27年度第６回埼玉県公募公債	0.505	200,000	206,180	2025/９/29
平成29年度第８回埼玉県公募公債	0.245	200,000	203,080	2028/１/26
平成19年度第１回福岡県公募公債（30年）	2.62	70,000	96,492	2037/９/18
平成20年度第１回福岡県公募公債（30年）	2.28	80,000	105,876	2038/９/17
平成22年度第３回福岡県公募公債	1.11	100,000	101,410	2020/８/24
平成22年度第５回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,271	2020/10/28
平成23年度第１回福岡県公募公債（15年）	1.491	100,000	110,994	2026/11/27
平成26年度第８回福岡県公募公債	0.441	100,000	102,363	2024/12/25
平成26年度第１回福岡県公募公債	0.654	100,000	103,243	2024/６/26
平成27年度第７回福岡県公募公債	0.464	100,000	102,867	2025/12/25
第２回千葉県公募公債（20年）	2.26	100,000	116,356	2026/９/18
第９回千葉県公募公債（20年）	1.84	80,000	94,954	2030/10/11
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	81,703	2021/１/25
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	100,000	102,271	2021/２/25
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	100,000	102,463	2021/３/25
平成23年度第９回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,567	2022/３/25
平成24年度第１回千葉県公募公債	1.05	20,000	20,613	2022/４/25
平成24年度第６回千葉県公募公債	0.81	100,000	102,829	2022/11/25
平成25年度第１回千葉県公募公債	0.58	82,500	84,338	2023/４/25
平成25年度第８回千葉県公募公債	0.67	100,000	102,967	2023/11/24
平成28年度第５回千葉県公募公債	0.15	100,000	100,912	2026/12/25
平成28年度第８回千葉県公募公債	0.22	200,000	202,980	2027/３/25
第７回群馬県公募公債	1.08	400,000	406,572	2020/11/25
第15回群馬県公募公債	0.08	200,000	200,750	2026/11/25
平成28年度第１回岐阜県公募公債	0.06	100,000	100,223	2026/10/30
平成24年度第１回大分県公募公債	0.8	100,260	103,006	2022/10/31
平成27年度第１回大分県公募公債	0.476	203,400	209,388	2025/10/30
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	30,456	2020/９/25
第91回共同発行市場公募地方債	0.9	175,000	177,250	2020/10/23
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	102,095	2021/１/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	102,271	2021/２/25
第99回共同発行市場公募地方債	1.17	200,000	204,912	2021/６/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	102,633	2021/７/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	102,376	2021/８/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	102,426	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	300,000	308,364	2022/２/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	175,215	2022/４/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	102,668	2022/５/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	102,495	2022/８/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	102,722	2022/９/22

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	200,000	205,124	2022/12/22
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,563	2023/3/24
第126回共同発行市場公募地方債	0.81	210,000	217,287	2023/9/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,957	2023/10/25
第129回共同発行市場公募地方債	0.71	200,000	206,416	2023/12/25
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	103,502	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	200,000	206,276	2024/3/25
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	300,000	309,960	2024/6/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	205,364	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	203,700	2025/1/24
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	200,000	205,272	2025/3/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	102,294	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	206,416	2025/5/23
第150回共同発行市場公募地方債	0.51	300,000	309,351	2025/9/25
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	102,900	2025/12/25
第163回共同発行市場公募地方債	0.06	300,000	300,666	2026/10/23
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	303,456	2027/1/25
第172回共同発行市場公募地方債	0.225	200,000	202,856	2027/7/23
第178回共同発行市場公募地方債	0.23	200,000	202,732	2028/1/25
平成24年度第２回堺市公募公債	0.715	200,000	205,078	2022/12/19
平成25年度第１回長崎県公募公債	0.81	200,000	206,948	2023/9/27
平成23年度第１回滋賀県公募公債	1.02	100,000	102,575	2021/11/30
平成25年度第１回栃木県公募公債	0.65	100,000	102,885	2023/11/29
平成24年度第２回熊本県公募公債	0.8	50,000	51,364	2022/10/26
平成22年度第１回新潟市公募公債	1.21	54,980	56,045	2020/12/24
平成23年度第１回浜松市公募公債	1.045	38,200	39,202	2021/11/25
平成24年度第１回浜松市公募公債	0.844	100,000	103,079	2023/1/25
平成25年度第１回浜松市公募公債	0.761	161,000	166,643	2024/1/24
第１回大阪市公募公債（15年）	1.753	200,000	224,682	2026/7/17
第５回大阪市公募公債（20年）	2.47	100,000	122,088	2028/9/21
平成23年度第10回大阪市公募公債	0.956	10,000	10,256	2022/1/27
平成26年度第５回大阪市公募公債	0.593	100,000	103,076	2024/9/27
第１回名古屋市公募公債（20年）	1.99	200,000	218,182	2023/12/20
第９回名古屋市公募公債（20年）	2.07	400,000	475,876	2028/12/20
第10回名古屋市公募公債（20年）	2.26	80,000	97,360	2029/8/17
第477回名古屋市公募公債	1.034	100,000	102,666	2021/12/20
第１回京都市公募公債（20年）	2.14	200,000	223,740	2024/12/20
第５回京都市公募公債（20年）	2.36	50,000	58,834	2026/12/18
平成23年度第２回京都市公募公債	1.049	100,000	102,376	2021/8/26
平成24年度第４回京都市公募公債	0.801	100,000	102,721	2022/10/21
平成26年度第４回京都市公募公債	0.544	100,000	102,842	2024/10/17
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	2.08	300,000	356,511	2028/12/20
平成22年度第４回神戸市公募公債	1.895	100,000	119,246	2030/9/13
平成22年度第９回神戸市公募公債（20年）	2.09	80,000	97,513	2031/1/24
第７回横浜市公募公債（20年）	2.06	200,000	226,754	2025/12/19

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第17回横浜市公募公債（20年）	2.07	80,000	94,993	2028/12/20
第20回横浜市公募公債（20年）	2.1	80,000	96,229	2029/10/19
平成24年度第４回横浜市公募公債	0.81	100,000	103,003	2023/２/20
第25回横浜市公募公債（20年）	1.72	100,000	118,903	2032/７/16
平成27年度第２回横浜市公募公債	0.568	200,000	206,670	2025/６/16
第27回横浜市公募公債（20年）	1.599	60,000	70,724	2033/５/20
平成22年度第８回札幌市公募公債（30年）	2.277	80,000	107,232	2040/９/20
平成23年度第３回札幌市公募公債	1.944	300,000	363,213	2031/７/29
平成26年度第５回札幌市公募公債	0.961	100,000	108,493	2029/９/20
平成27年度第９回札幌市公募公債	0.19	100,000	101,054	2025/12/19
第３回川崎市公募公債（15年）	1.82	100,000	102,910	2020/12/21
第44回川崎市公募公債（５年）	0.162	130,400	130,616	2020/６/19
第17回北九州市公募公債（20年）	1.529	100,000	117,576	2034/６/20
平成22年度第２回北九州市公募公債	1.26	100,000	102,019	2020/12/24
平成25年度第３回北九州市公募公債	0.728	300,000	309,879	2023/12/26
平成22年度第９回福岡市公募公債	1.32	106,500	109,102	2021/３/25
平成23年度第６回福岡市公募公債	1.0	100,000	102,434	2021/10/28
平成24年度第４回福岡市公募公債	0.8	200,000	205,478	2022/10/31
平成25年度第４回福岡市公募公債	0.68	50,000	51,478	2023/10/24
平成26年度第６回福岡市公募公債（20年）	1.371	100,000	115,371	2034/９/20
平成25年度第２回広島市公募公債	0.72	100,000	103,258	2023/12/27
平成28年度第４回広島市公募公債	0.165	100,000	101,026	2026/12/25
平成29年度第６回広島市公募公債	0.23	300,000	304,092	2028/２/25
平成22年度第２回千葉市公募公債	0.92	100,000	101,312	2020/10/22
平成24年度第１回相模原市公募公債	0.71	200,000	205,046	2022/12/20
平成22年度第１回三重県公募公債	1.056	87,050	88,460	2020/11/30
平成23年度第１回三重県公募公債	1.021	98,410	100,946	2021/11/30
平成24年度第４回福井県公募公債	0.46	100,000	101,755	2023/４/26
平成26年度第４回福井県公募公債	0.425	100,000	102,406	2025/４/24
平成27年度第４回福井県公募公債	0.085	200,000	200,762	2026/４/27
平成23年度第１回徳島県公募公債	1.02	100,000	102,575	2021/11/30
平成27年度第１回徳島県公募公債	0.476	300,000	308,736	2025/11/27
平成29年度第２回徳島県公募公債	0.19	108,000	109,193	2027/11/30
平成24年度第１回山梨県公募公債	0.8	200,000	205,464	2022/10/28
平成24年度第２回岡山県公募公債	0.68	100,000	102,573	2023/３/29
平成26年度第１回岡山市公募公債	0.33	100,000	101,770	2025/１/30
第４回京都市保証京都市土地開発公社債券	0.06	200,000	200,186	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	120,509	2028/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券	0.704	100,000	102,741	2024/３/19
小計		30,807,350	32,542,061	
特殊債券（除く金融債）				
第６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	103,487	2021/２/26
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	240,668	2029/５/31
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	120,796	2029/９/28
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	120,913	2029/10/31

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	135,299	2040/2/29
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	121,561	2030/4/30
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	544,000	552,274	2020/6/30
第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	354,000	358,927	2020/7/31
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	101,445	2020/9/30
第120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	304,152	2020/10/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	400,000	405,856	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	571,000	582,562	2020/12/28
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	121,451	2031/1/31
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	400,000	410,576	2021/4/30
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	93,136	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	660,000	676,744	2021/7/30
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	124,936	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	100,000	102,575	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	239,654	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	139,627	2021/11/30
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	217,609	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	111,935	2022/3/18
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	119,496	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	255,464	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	12,000	12,353	2022/6/30
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	301,000	309,810	2022/9/30
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	100,000	103,022	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	207,562	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	100,000	102,722	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	115,745	2033/4/28
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	156,520	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	103,815	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	231,953	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	103,688	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	206,728	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	222,000	229,434	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	100,000	103,377	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	116,445	2034/8/31
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.391	200,000	205,214	2025/4/30
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.44	105,000	108,215	2025/8/29
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	130,000	133,196	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	101,294	2026/2/27
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	301,000	302,348	2026/3/31
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	100,000	100,454	2026/4/30
第344回政府保証道路債券	1.6	100,000	101,929	2020/7/15
第１回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	0.576	600,000	608,826	2021/9/24
第２回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	0.502	300,000	304,293	2021/12/24
第３回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	0.46	300,000	304,227	2022/2/25
第５回政府保証公営企業債券（15年）	2.2	300,000	321,396	2022/7/15

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14回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	101,348	2020/7/17
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	101,399	2020/9/14
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	30,000	30,738	2021/3/12
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	21,534	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	51,483	2021/12/14
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	102,759	2022/8/15
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	103,229	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,462	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,931	2023/5/16
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	165,404	2023/12/18
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.644	100,000	103,511	2024/6/14
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	103,350	2024/7/16
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	240,000	247,560	2024/9/13
第89回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.005	203,000	203,755	2026/10/16
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	200,000	202,676	2027/6/14
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	400,000	405,952	2027/8/13
第２回政府保証公営企業債券（15年）	2.1	100,000	104,134	2021/4/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	103,244	2023/2/24
第31回政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	103,150	2024/9/13
第37回政府保証日本政策金融公庫債券	0.425	100,000	102,990	2025/9/16
第41回政府保証日本政策金融公庫債券	0.01	300,000	301,215	2026/9/15
第211回政府保証預金保険機構債券	0.1	100,000	100,353	2021/10/19
第３回政府保証新関西国際空港債券	0.644	100,000	103,536	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	400,556	2022/5/20
第19回政府保証日本政策投資銀行	0.668	400,000	410,876	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,675	2023/12/18
第39回政府保証日本政策投資銀行	0.145	106,000	107,583	2027/3/15
第47回政府保証日本政策投資銀行	0.001	700,000	700,595	2021/3/26
第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.45	120,000	139,372	2026/3/19
第９回道路債券（財投機関債）	2.9	100,000	133,415	2032/5/20
第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.52	100,000	117,312	2026/6/19
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	233,262	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	46,298	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	151,690	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	194,474	2047/3/20
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	100,000	118,694	2027/10/20
第28回道路債券（財投機関債）	2.83	400,000	541,956	2033/12/20
第33回道路債券（財投機関債）	2.91	500,000	687,540	2034/6/20
第42回道路債券（財投機関債）	2.22	200,000	225,138	2025/3/21
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.41	150,000	183,432	2029/4/20
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	60,564	2030/5/10
第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.19	100,000	122,827	2031/3/20
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	60,231	2032/3/19
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	118,230	2032/6/18
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	240,178	2044/12/20

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	134,970	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	114,011	2035/９/20
第１回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	2.266	50,000	60,615	2029/６/28
第３回公営企業債券（20年）（財投機関債）	1.03	20,000	20,773	2023/３/22
第３回地方公共団体金融機構債券（15年）（財投機関債）	1.176	100,000	109,974	2029/１/26
第６回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.03	100,000	109,224	2023/12/20
第８回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	2.043	200,000	240,648	2030/６/28
第９回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.33	50,000	56,117	2024/９/24
第11回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.851	300,000	355,680	2030/10/28
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	2.092	250,000	303,920	2030/12/27
第13回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.278	100,000	101,403	2020/６/26
第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	2.187	80,000	98,448	2031/４/28
第16回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.164	100,000	101,568	2020/９/28
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.846	80,000	95,509	2031/８/28
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.39	150,000	173,650	2026/３/24
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.87	100,000	119,727	2031/９/26
第19回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.274	50,000	51,019	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.28	100,000	102,156	2021/１/28
第22回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.687	200,000	236,224	2032/６/28
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.68	300,000	354,177	2032/７/28
Ｆ24回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.681	70,000	74,449	2023/３/17
第27回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.785	50,000	59,975	2033/１/28
第30回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.035	300,000	307,725	2021/11/26
第44回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.298	100,000	114,212	2035/６/28
Ｆ63回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.579	100,000	109,338	2025/６/20
Ｆ77回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.519	200,000	221,444	2026/10/20
第77回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	0.491	100,000	102,839	2025/10/28
Ｆ89回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.602	300,000	337,377	2027/８/20
Ｆ104回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.314	100,000	107,361	2025/３/７
Ｆ123回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.6	100,000	115,169	2030/３/19
Ｆ124回地方公共団体金融機構債券	1.418	200,000	221,518	2027/６/４
Ｆ131回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.546	100,000	115,696	2031/７/30
Ｆ132回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.09	100,000	106,508	2025/７/30
Ｆ149回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.145	100,000	107,276	2025/12/19
Ｆ197回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.052	300,000	324,375	2027/10/29
Ｆ226回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.096	100,000	109,239	2029/２/28
Ｆ306回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	0.605	100,000	104,527	2028/３/22
第10回日本政策金融公庫（財投機関債）	2.167	80,000	96,966	2030/３/19
第15回日本政策金融公庫（財投機関債）	1.911	80,000	95,336	2030/10/29
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	14,814	15,475	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	15,066	15,808	2037/11/10
第２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	16,087	16,935	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	15,463	16,363	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	88,468	88,901	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	185,444	186,148	2033/１/10

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４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	15,482	16,320	2042/８/10
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	1.76	13,424	13,831	2036/11/10
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.26	13,795	14,416	2037/５/10
第６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	15,230	15,965	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	16,024	16,841	2038/11/10
第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.25	13,827	14,442	2037/５/10
第８回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	10,313	10,363	2037/10/10
第８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	16,474	17,308	2042/12/10
第９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.52	10,102	10,145	2037/12/10
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.19	14,537	15,257	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	17,123	18,251	2039/５/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	21,656	21,842	2038/２/10
第10回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.15	14,989	15,736	2037/５/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	17,481	18,465	2043/５/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	11,460	11,652	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	15,977	16,332	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	18,480	18,997	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	18,609	19,162	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	56,379	57,884	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	12,964	13,367	2039/６/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	13,009	13,495	2039/７/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	50,448	54,778	2044/６/10
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	13,237	13,590	2040/５/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	29,680	30,780	2040/６/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	15,892	16,538	2040/７/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	31,601	33,967	2045/２/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	33,133	35,485	2045/４/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	33,307	35,534	2045/５/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	15,585	16,318	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	36,164	38,414	2045/７/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	14,914	15,527	2041/２/10
第39回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	2.15	300,000	361,014	2029/９/20
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	37,597	39,596	2045/９/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	16,291	17,211	2041/４/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	14,731	15,517	2041/５/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	43,613	46,577	2045/12/10
第43回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	2.29	100,000	122,422	2030/２/18
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	42,917	46,143	2046/１/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	36,338	38,904	2046/２/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	32,515	34,844	2046/４/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	101,349	108,611	2046/５/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	33,471	35,716	2046/６/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	33,912	36,085	2046/７/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	14,619	15,392	2042/２/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	36,757	39,172	2046/８/10

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	39,787	42,232	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	41,395	43,929	2046/10/10
第54回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.09	300,000	303,516	2020/6/19
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	45,768	48,570	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	137,271	145,784	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	46,867	49,810	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	48,803	51,688	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	50,111	52,791	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	2.13	290,000	353,191	2030/12/13
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	50,054	52,446	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	52,441	54,994	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	47,725	50,239	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	53,046	56,204	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	97,321	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	322,035	338,606	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	33,527	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	48,601	50,804	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	105,676	110,524	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	52,341	54,751	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	55,458	57,956	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	111,082	115,886	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	113,650	118,644	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.863	100,000	119,649	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	60,612	63,098	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	186,129	192,946	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	125,628	130,062	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	64,257	66,182	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	134,486	137,481	2050/2/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	230,658	238,707	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	230,676	240,018	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	154,754	160,860	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.892	100,000	120,406	2032/4/16
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	331,977	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	400,755	416,372	2050/12/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	268,926	271,790	2051/12/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	272,931	276,896	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	174,556	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	119,884	2032/9/17
第124回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.428	200,000	222,376	2027/12/20
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	560,022	566,451	2052/10/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	94,339	95,443	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	95,061	96,434	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	95,185	96,317	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	191,334	193,283	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	191,634	193,582	2053/5/10

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	192,584	194,831	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	194,182	195,962	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	194,944	197,452	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	97,784	99,267	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	98,357	100,074	2053/11/10
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	200,962	2035/11/20
第177回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	0.484	200,000	205,238	2025/12/19
第６回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	2.04	50,000	56,020	2025/6/20
第25回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	0.22	300,000	303,378	2027/6/18
第７回国際協力機構債券（財投機関債）	1.991	70,000	84,538	2031/6/13
第11回国際協力機構債券（財投機関債）	1.14	30,000	30,874	2021/12/20
第33回中日本高速道路	1.084	50,000	51,212	2021/9/17
第27回西日本高速道路	0.58	600,000	619,020	2025/9/2
第29回西日本高速道路	0.31	200,000	202,816	2026/2/12
第30回西日本高速道路	0.17	300,000	301,464	2026/5/22
第17回韓国輸出入銀行	0.16	100,000	100,009	2019/12/27
第18回韓国輸出入銀行	0.27	100,000	100,195	2021/6/28
小計		33,348,097	35,968,864	
金融債券				
い第781号商工債券	0.24	100,000	100,212	2020/6/26
第310回信金中金債	0.225	200,000	200,504	2020/9/25
第311回信金中金債	0.225	200,000	200,550	2020/10/27
第315回信金中金債	0.075	400,000	400,284	2021/2/26
第322回信金中金債	0.03	300,000	299,892	2021/9/27
第327回信金中金債	0.06	200,000	200,082	2022/2/25
第332回信金中金債	0.09	300,000	300,405	2022/7/27
第336回信金中金債	0.1	300,000	300,555	2022/11/25
第338回信金中金債	0.11	200,000	200,444	2023/1/27
第11号商工債券（10年）	0.66	100,000	102,573	2024/9/20
第211号商工債券（３年）	0.07	300,000	300,075	2020/8/27
第223号商工債券（３年）	0.11	300,000	300,306	2021/8/27
第２回信金中金債（10年）	0.52	300,000	308,562	2025/9/26
小計		3,200,000	3,214,444	
普通社債券				
第567回東京電力	1.958	100,000	109,763	2030/7/29
第568回東京電力	1.155	100,000	101,179	2020/9/8
第499回中部電力	1.194	50,000	52,006	2023/6/23
第500回中部電力	0.875	100,000	103,122	2024/5/24
第518回中部電力	0.19	200,000	200,128	2023/1/25
第528回中部電力	0.13	200,000	199,144	2023/11/24
第496回関西電力	0.908	100,000	103,371	2025/2/25
第499回関西電力	0.68	200,000	204,252	2026/1/23
第508回関西電力	0.455	200,000	201,000	2027/4/23
第510回関西電力	0.49	100,000	100,714	2027/7/23
第512回関西電力	0.32	200,000	200,320	2024/10/25

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第381回中国電力	0.953	100,000	103,371	2024/4/25
第385回中国電力	0.728	100,000	102,605	2025/7/25
第402回中国電力	0.25	200,000	199,838	2024/10/25
第304回北陸電力	0.989	100,000	103,252	2023/10/25
第307回北陸電力	1.055	100,000	105,078	2026/6/25
第310回北陸電力	0.748	200,000	205,444	2025/6/25
第322回北陸電力	0.38	200,000	200,156	2027/6/25
第481回東北電力	0.803	200,000	206,060	2025/7/25
第490回東北電力	0.22	100,000	100,133	2023/2/24
第494回東北電力	0.425	100,000	100,552	2027/6/25
第253回四国電力	1.0	100,000	103,263	2023/6/23
第371回九州電力	1.43	100,000	104,540	2022/12/22
第429回九州電力	0.909	200,000	206,382	2024/9/25
第430回九州電力	0.54	100,000	101,063	2021/10/25
第437回九州電力	0.685	100,000	102,192	2026/1/23
第460回九州電力	0.18	200,000	199,890	2023/2/24
第310回北海道電力	1.286	50,000	50,941	2020/12/25
第316回北海道電力	1.164	400,000	404,840	2020/6/25
第333回北海道電力	0.25	300,000	299,448	2023/6/23
第344回北海道電力	0.18	200,000	199,798	2022/9/22
第12回新関西国際空港	1.067	300,000	327,558	2029/9/20
第38回関西国際空港	1.112	50,000	51,394	2021/12/20
第７回大和ハウス工業	0.06	200,000	199,792	2021/6/18
第５回日揮	0.2	500,000	500,850	2022/10/13
第７回明治ホールディングス	0.22	100,000	100,205	2024/9/13
第10回アサヒグループホールディングス	0.17	100,000	100,092	2022/6/13
第11回アサヒグループホールディングス	0.23	100,000	100,247	2024/6/13
第３回コカ・コーラウエスト	0.524	300,000	303,642	2022/6/17
第24回味の素	0.19	100,000	100,263	2024/3/8
第３回　キユーピー	0.23	100,000	100,015	2026/2/13
第６回ヒューリック	0.494	300,000	300,054	2028/10/20
第６回Ｊ．フロント　リテイリング	0.435	200,000	201,562	2027/8/4
第４回トヨタ紡織	0.21	300,000	302,151	2024/12/20
第22回森ビル	0.18	200,000	199,394	2023/3/8
第11回セブン＆アイ・ホールディングス	0.514	300,000	303,843	2022/6/20
第31回東レ	0.25	100,000	100,153	2024/7/19
第４回野村総合研究所	0.34	100,000	100,848	2028/3/23
第１回電通	0.11	300,000	300,126	2023/10/25
第２回電通	0.24	200,000	200,798	2025/10/24
第２回大塚ホールディングス	0.26	100,000	100,149	2026/3/6
第３回富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	102,734	2022/12/2
第13回ブリヂストン	0.23	200,000	199,824	2026/4/17
第23回ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	0.09	300,000	299,637	2022/5/23
第１回リクルートホールディングス	0.09	300,000	300,210	2022/3/9
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	102,399	2021/9/17

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第48回日本精工	0.16	200,000	200,266	2023/11/29
第15回パナソニック	0.19	300,000	300,600	2021/9/17
第17回パナソニック	0.47	100,000	101,167	2026/9/18
第18回デンソー	0.315	200,000	200,866	2028/3/17
第１回村田製作所	0.08	300,000	300,042	2022/1/24
第29回三菱重工業	0.662	300,000	306,876	2024/9/3
第34回三菱重工業	0.104	100,000	99,914	2022/8/29
第１回明治安田生命2014基金	0.51	100,000	100,062	2019/8/7
第７回ＪＡ三井リース	0.2	200,000	200,198	2022/9/15
第９回ＪＡ三井リース	0.22	100,000	100,147	2023/1/26
第１回日本生命2015基金	0.406	100,000	100,049	2019/8/5
第１回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,165	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	200,344	2022/10/31
第13回アイシン精機	0.827	100,000	103,107	2023/9/20
第１回明治安田生命2018基金	0.315	300,000	299,994	2023/9/25
第15回パン・パシフィック・インターナショナル	0.11	300,000	299,622	2022/3/7
第78回三菱商事	1.155	100,000	102,983	2022/3/9
第33回丸井	0.04	200,000	199,732	2021/10/25
第48回クレディセゾン	1.038	200,000	206,778	2023/10/20
第17回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	0.535	300,000	299,298	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	103,532	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	112,987	2026/10/30
第28回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	1.56	100,000	102,402	2021/1/20
第30回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	2.46	100,000	120,518	2031/1/20
第57回三菱東京ＵＦＪ銀行	2.22	200,000	214,756	2022/10/27
第６回住友信託銀行（劣後特約付）	2.78	100,000	116,165	2026/4/27
第13回住友信託銀行（劣後特約付）	2.341	100,000	113,362	2026/6/15
第22回三井住友銀行（劣後特約付）	1.43	100,000	101,816	2020/9/28
第23回三井住友銀行（劣後特約付）	1.61	100,000	102,400	2020/12/17
第25回三井住友銀行（劣後特約付）	2.21	200,000	224,788	2026/6/1
第５回みずほ銀行（劣後特約付）	2.49	100,000	113,692	2026/1/30
第９回みずほ銀行（劣後特約付）	2.52	100,000	115,924	2027/4/27
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	2.14	100,000	112,333	2026/9/11
第15回芙蓉総合リース	0.33	100,000	100,376	2024/12/6
第47回日産フィナンシャルサービス	0.23	200,000	199,358	2022/12/20
第20回東京センチュリーリース	0.19	100,000	100,102	2022/10/18
第23回東京センチュリーリース	0.2	200,000	200,154	2023/4/13
第26回東京センチュリーリース	0.04	100,000	99,843	2021/10/15
第29回ホンダファイナンス	0.428	200,000	201,324	2021/3/19
第38回ホンダファイナンス	0.01	300,000	299,670	2021/3/19
第42回ホンダファイナンス	0.05	100,000	99,814	2022/6/20
第77回トヨタファイナンス	0.145	200,000	199,844	2024/7/25
第87回トヨタファイナンス	0.04	300,000	299,955	2022/4/19
第23回リコーリース	0.05	200,000	199,742	2021/9/24
第27回リコーリース	0.16	100,000	100,031	2022/7/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第30回リコーリース	0.16	200,000	200,134	2022/1/21
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	102,615	2023/3/20
第52回日立キャピタル	0.508	200,000	201,754	2021/6/18
第70回日立キャピタル	0.2	200,000	200,142	2022/12/20
第194回オリックス	0.19	400,000	399,812	2023/11/8
第21回三井住友ファイナンス＆リース	0.18	200,000	200,176	2023/11/27
第63回三菱ＵＦＪリース	0.19	100,000	99,866	2023/10/18
第65回三菱ＵＦＪリース	0.1	100,000	99,958	2022/2/25
第66回三菱ＵＦＪリース	0.21	300,000	300,132	2024/4/11
第27回野村ホールディングス	2.107	100,000	110,997	2025/9/24
第50回野村ホールディングス	0.22	200,000	200,128	2022/8/10
第58回三井不動産	0.1	300,000	299,772	2023/2/24
第64回三井不動産	0.08	100,000	100,014	2022/4/14
第105回三菱地所	1.178	100,000	103,118	2022/3/23
第116回三菱地所	0.643	100,000	102,611	2024/9/19
第125回三菱地所	0.19	300,000	300,144	2025/3/14
第95回住友不動産	0.987	100,000	103,401	2024/1/26
第99回住友不動産	0.836	300,000	308,469	2024/7/29
第12回イオンモール	0.36	200,000	200,490	2023/7/3
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発	1.12	100,000	102,402	2021/9/17
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	0.61	100,000	102,492	2024/9/20
第36回京王電鉄	0.325	100,000	101,007	2027/9/17
第38回京王電鉄	0.295	100,000	100,694	2027/11/29
第19回東日本旅客鉄道	2.36	100,000	106,523	2022/2/25
第26回東日本旅客鉄道	1.19	100,000	104,159	2022/12/20
第39回東日本旅客鉄道	2.05	500,000	558,815	2025/6/20
第83回東日本旅客鉄道	1.633	100,000	111,453	2026/12/22
第100回東日本旅客鉄道	1.981	100,000	129,717	2044/1/29
第９回西日本旅客鉄道	2.28	123,000	130,961	2022/3/25
第９回東海旅客鉄道	1.74	100,000	105,769	2022/9/20
第11回東海旅客鉄道	1.15	100,000	104,015	2022/12/20
第34回東海旅客鉄道	2.3	200,000	236,230	2027/12/20
第53回東海旅客鉄道	1.797	100,000	116,829	2030/10/25
第56回東海旅客鉄道	2.083	100,000	120,775	2031/5/26
第74回東海旅客鉄道	1.685	100,000	122,882	2045/3/6
第８回東京地下鉄	2.31	200,000	236,500	2027/12/20
第11回東京地下鉄	1.16	100,000	102,933	2021/12/9
第50回阪急阪神ホールディングス	0.345	200,000	201,788	2028/9/13
第16回三菱倉庫	0.21	200,000	200,424	2024/12/6
第５回関西高速鉄道	1.238	100,000	101,496	2020/9/10
第８回関西高速鉄道	0.861	200,000	206,158	2023/8/30
第63回日本電信電話	0.69	100,000	102,358	2023/3/20
第21回ＫＤＤＩ	0.669	100,000	102,587	2024/9/20
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	0.73	100,000	102,775	2023/9/20
第38回電源開発	0.978	100,000	103,288	2023/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第39回電源開発	0.929	100,000	103,079	2024/２/20
第40回電源開発	0.889	200,000	206,170	2024/６/20
第50回電源開発	0.415	200,000	200,278	2027/７/20
第57回電源開発	0.355	200,000	198,462	2028/７/20
第４回東京電力パワーグリッド	0.69	400,000	401,364	2024/６/20
第６回東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	99,981	2027/８/31
第７回東京電力パワーグリッド	0.46	300,000	300,255	2022/10/24
第13回東京電力パワーグリッド	0.77	200,000	198,470	2028/４/19
第15回東京電力パワーグリッド	0.89	200,000	197,742	2030/７/24
第23回東京ガス	1.01	200,000	207,804	2023/６/９
第13回広島ガス	0.405	200,000	201,048	2028/９/13
第６回ＳＣＳＫ	0.14	100,000	99,873	2022/７/21
第３回ファーストリテイリング	0.491	100,000	101,183	2022/12/16
第４回ファーストリテイリング	0.749	100,000	103,090	2025/12/18
第７回ファーストリテイリング	0.405	200,000	200,928	2028/６/６
第14回フランス相互信用連合銀行	0.563	300,000	302,517	2021/10/15
第19回フランス相互信用連合銀行	0.999	200,000	207,768	2025/10/15
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.217	300,000	298,539	2023/１/25
第１回韓国石油公社債	0.24	100,000	100,065	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	211,156	2021/12/28
第11回ナショナル・オーストラリア銀行	0.284	100,000	100,075	2020/１/16
第17回ナショナル・オーストラリア銀行	0.44	100,000	100,096	2024/１/23
第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	0.32	300,000	300,501	2023/７/６
小計		28,573,000	29,238,091	
合計		559,649,447	607,797,202	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
国内	債券先物取引	１０年国債標準物	百万円 458	百万円 －

○投資信託財産の構成

（2019年５月13日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	607,797,202	99.3
コール・ローン等、その他	4,499,513	0.7
投資信託財産総額	612,296,715	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年５月13日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	612,296,656,365
コール・ローン等	3,267,518,129
公社債(評価額)	607,797,202,127
未収利息	1,202,986,944
前払費用	27,729,165
差入委託証拠金	1,220,000
(B) 負債	3,466,306,522
未払金	3,228,231,040
未払解約金	238,072,516
未払利息	2,966
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	608,830,349,843
元本	450,894,780,414
次期繰越損益金	157,935,569,429
(D) 受益権総口数	450,894,780,414口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	13,503円

＜注記事項＞

①期首元本額　409,751,145,196円
　期中追加設定元本額　169,094,607,153円
　期中一部解約元本額　127,950,971,935円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.3503円です。

○損益の状況 (2018年５月15日～2019年５月13日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	4,899,494,952
受取利息	4,902,112,559
支払利息	△ 2,617,607
(B) 有価証券売買損益	4,919,444,412
売買益	7,030,554,959
売買損	△ 2,111,110,547
(C) 先物取引等取引損益	28,949,400
取引益	36,985,800
取引損	△ 8,036,400
(D) 保管費用等	△ 38,290
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	9,847,850,474
(F) 前期繰越損益金	134,522,690,775
(G) 追加信託差損益金	55,556,167,569
(H) 解約差損益金	△ 41,991,139,389
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	157,935,569,429
次期繰越損益金(Ｉ)	157,935,569,429

(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。

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）

ファンド・マネジャー（国内債券）	109,979,356,450円
ｅＭＡＸＩＳ 国内債券インデックス	10,035,262,977円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	2,449,606,746円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	108,235,487円
コアバランス	2,083,543円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	160,406,340円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	100,595,546円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	45,856,226円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 国内債券インデックス	2,994,002,597円
国内債券セレクション（ラップ向け）	3,725,663,704円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	2,119,148,139円
つみたて８資産均等バランス	716,195,228円
つみたて４資産均等バランス	190,943,956円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	2,724,968円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	630,852円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	56,204円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	20,478,724円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	9,901,610円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	5,921,660円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	1,979,112円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	11,417,340,983円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	9,405,543,450円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	926,997,122円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	2,504,187,301円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	7,535,376,951円

三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	253,372,348円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	301,316,439円
ｅＭＡＸＩＳ 債券バランス（２資産均等型）	69,526,253円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	278,251,142円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	393,451,163円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	245,000,807円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	481,003,850円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	57,585,505円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	11,391,742円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	100,799,834円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,107,304,829円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	1,244,796,553円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	5,220,566,008円
ＭＵＡＭ 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	192,957,635,262円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	564,307,657円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	8,521,197円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,940,137円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	134,794,955円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	21,873,033円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,016,262,501円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,367,584,279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）	18,016,713,315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）	6,077,150,884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）	3,150,322,832円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	188,538,582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）	19,594,530,499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）	520,641,857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）	2,412,873,515円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	16,816,081円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	33,982,964円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	23,240,085円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	14,041,632円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	136,537,650円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	284,025,615円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	102,429,565円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	200,806,487円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞日本債券インデックスファンド	3,840,759,122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）	1,930,698,115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）	3,714,775,174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）	2,065,776,560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）	1,250,338,510円
合計	450,894,780,414円

外国債券インデックスマザーファンド

《第18期》決算日2019年５月13日

［計算期間：2018年５月15日～2019年５月13日］

「外国債券インデックスマザーファンド」は、５月13日に第18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18期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	ＦＴＳＥ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ＦＴＳＥ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	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。
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		ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2015年５月12日)	20,959	12.0	117,169.90	12.2	98.8	－	159,683
15期(2016年５月12日)	19,674	△ 6.1	109,931.94	△ 6.2	98.9	－	156,155
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

(注) ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、ＦＴＳＥ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		ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期　首）	円	%		%	%	%
2018年５月14日	20,178	－	112,563.85	－	98.9	－
５月末	19,795	△1.9	110,306.34	△2.0	98.8	－
６月末	20,090	△0.4	112,167.37	△0.4	98.8	－
７月末	20,241	0.3	113,026.89	0.4	98.7	－
８月末	20,229	0.3	112,887.86	0.3	99.2	－
９月末	20,567	1.9	115,005.76	2.2	99.0	－
10月末	20,195	0.1	112,853.40	0.3	98.5	－
11月末	20,377	1.0	113,725.26	1.0	98.6	－
12月末	20,249	0.4	112,822.19	0.2	98.7	－
2019年１月末	20,123	△0.3	111,997.50	△0.5	98.5	－
２月末	20,406	1.1	113,937.65	1.2	98.7	－
３月末	20,679	2.5	115,474.58	2.6	98.8	－
４月末	20,621	2.2	115,213.50	2.4	98.8	－
（期　末）						
2019年５月13日	20,412	1.2	113,996.81	1.3	98.7	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

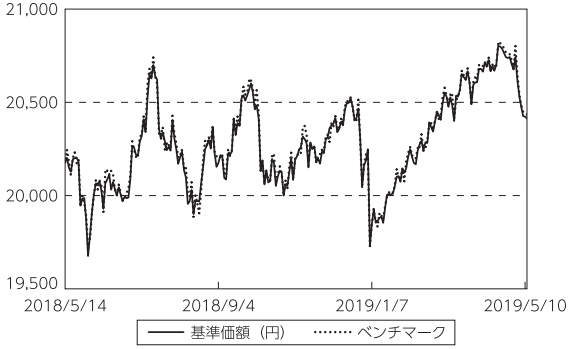
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（1.3%）を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎債券市況

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

◎為替市況

・円・米ドル相場は、米国の堅調な景気認識や利上げなどから、期首との比較では、米ドルは対円で上昇しました。
・円・ユーロ相場は、期の後半にかけて世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首との比較では、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1.3%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）

・ありません。

（主なマイナス要因）

・評価時価差異要因※

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

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2018年５月15日～2019年５月13日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	2	0.012	(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)	(0.012)	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	0.012	
期中の平均基準価額は、20,281円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2018年５月15日～2019年５月13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 233,001	千アメリカドル 133,212
	カナダ	国債証券	千カナダドル 11,053	千カナダドル 9,519
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 53,161	千メキシコペソ 24,160
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	19,233	12,706
	イタリア	国債証券	24,025	15,379
	フランス	国債証券	30,197	17,017
	オランダ	国債証券	4,460	3,091
	スペイン	国債証券	16,816	9,545
	ベルギー	国債証券	5,418	1,727
	オーストリア	国債証券	2,770	1,235
	フィンランド	国債証券	1,384	874
	アイルランド	国債証券	1,992	1,784
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 14,545	千イギリスポンド 9,510
	スイス	国債証券	千スイスフラン －	千スイスフラン 1,792
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 6,583	千スウェーデンクローネ 2,891
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 7,133	千ノルウェークローネ 7,688
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 6,273	千デンマーククローネ 6,977
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 9,591	千ポーランドズロチ 6,658
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 8,181	千オーストラリアドル 5,051
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 1,709	千シンガポールドル 1,019
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 5,965	千マレーシアリンギット 2,776
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 19,921	千南アフリカランド 5,091

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2018年５月15日～2019年５月13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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	28,576	2,349	8.2	13,102	1,596	12.2

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

○組入資産の明細

（2019年５月13日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	577,200	583,486	64,031,828	46.6	－	19.7	18.5	8.4
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	29,700	32,255	2,634,605	1.9	－	0.9	0.6	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	197,330	193,620	1,111,384	0.8	－	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	61,510	72,710	8,961,588	6.5	－	3.8	1.8	0.9
イタリア	89,750	95,809	11,808,567	8.6	－	4.9	2.8	0.9
フランス	92,660	109,183	13,456,904	9.8	－	6.5	2.3	1.0
オランダ	18,220	21,782	2,684,720	2.0	－	1.3	0.6	0.1
スペイン	54,440	64,067	7,896,267	5.7	－	3.7	1.4	0.7
ベルギー	22,850	27,285	3,362,978	2.4	－	1.8	0.5	0.1
オーストリア	13,520	16,085	1,982,554	1.4	－	0.9	0.4	0.1
フィンランド	5,810	6,386	787,177	0.6	－	0.4	0.1	0.1
アイルランド	7,340	8,211	1,012,068	0.7	－	0.5	0.2	0.1
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	50,095	62,110	8,867,481	6.5	－	4.9	1.0	0.6
	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ						
スウェーデン	35,790	40,739	464,432	0.3	－	0.2	0.1	0.1
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	25,210	26,013	326,994	0.2	－	0.1	0.1	－
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	32,030	41,321	682,215	0.5	－	0.4	0.1	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	27,280	28,173	807,726	0.6	－	0.2	0.3	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	31,850	35,736	2,737,737	2.0	－	1.3	0.6	0.1
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	6,550	6,745	542,369	0.4	－	0.2	0.1	0.0
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	23,000	23,366	616,397	0.4	－	0.3	0.1	0.0
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	109,550	100,430	774,317	0.6	0.6	0.5	0.0	0.0
合計	－	－	135,550,317	98.7	0.6	53.0	32.0	13.7

（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）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	償還年月日
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.125 T-NOTE 200430	1.125	1,500	1,482	162,674	2020/4/30
		1.125 T-NOTE 210228	1.125	2,600	2,547	279,595	2021/2/28
		1.125 T-NOTE 210630	1.125	2,000	1,954	214,507	2021/6/30
		1.125 T-NOTE 210731	1.125	1,600	1,561	171,372	2021/7/31
		1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,200	2,145	235,430	2021/8/31
		1.125 T-NOTE 210930	1.125	2,100	2,047	224,692	2021/9/30
		1.25 T-NOTE 210331	1.25	1,000	981	107,716	2021/3/31
		1.25 T-NOTE 211031	1.25	2,000	1,953	214,353	2021/10/31
		1.25 T-NOTE 230731	1.25	2,000	1,920	210,752	2023/7/31
		1.375 T-NOTE 200430	1.375	2,000	1,981	217,405	2020/4/30
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	1,700	1,682	184,641	2020/5/31
		1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,600	2,569	281,935	2020/8/31
		1.375 T-NOTE 200915	1.375	800	790	86,711	2020/9/15
		1.375 T-NOTE 200930	1.375	1,900	1,875	205,867	2020/9/30
		1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,550	2,515	276,011	2020/10/31
		1.375 T-NOTE 210131	1.375	3,800	3,741	410,626	2021/1/31
		1.375 T-NOTE 210430	1.375	2,400	2,359	258,890	2021/4/30
		1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,400	2,358	258,766	2021/5/31
		1.375 T-NOTE 230630	1.375	1,850	1,786	196,103	2023/6/30
		1.375 T-NOTE 230831	1.375	2,150	2,073	227,572	2023/8/31
		1.375 T-NOTE 230930	1.375	2,100	2,023	222,064	2023/9/30
		1.5 T-NOTE 200531	1.5	2,500	2,477	271,895	2020/5/31
		1.5 T-NOTE 200615	1.5	3,800	3,765	413,183	2020/6/15
		1.5 T-NOTE 200815	1.5	2,000	1,979	217,190	2020/8/15
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	2,300	2,256	247,669	2022/1/31
		1.5 T-NOTE 230228	1.5	2,300	2,238	245,677	2023/2/28
		1.5 T-NOTE 230331	1.5	3,250	3,161	346,930	2023/3/31
		1.5 T-NOTE 260815	1.5	4,250	4,006	439,650	2026/8/15
		1.625 T-NOTE 200630	1.625	1,900	1,884	206,828	2020/6/30
		1.625 T-NOTE 200731	1.625	2,600	2,577	282,905	2020/7/31
		1.625 T-NOTE 201015	1.625	1,200	1,188	130,448	2020/10/15
		1.625 T-NOTE 201130	1.625	1,900	1,880	206,355	2020/11/30
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,668	183,089	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 220831	1.625	7,640	7,495	822,562	2022/8/31
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	1,300	1,273	139,775	2022/11/15
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	2,450	2,393	262,645	2023/4/30
		1.625 T-NOTE 230531	1.625	1,500	1,464	160,713	2023/5/31
		1.625 T-NOTE 231031	1.625	3,100	3,018	331,237	2023/10/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	4,720	4,508	494,785	2026/2/15
		1.625 T-NOTE 260515	1.625	3,150	3,002	329,450	2026/5/15
		1.75 T-NOTE 201031	1.75	2,200	2,182	239,485	2020/10/31
		1.75 T-NOTE 201115	1.75	2,600	2,578	282,994	2020/11/15
		1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,600	1,586	174,061	2020/12/31
		1.75 T-NOTE 211130	1.75	3,700	3,656	401,279	2021/11/30
		1.75 T-NOTE 220228	1.75	1,900	1,876	205,883	2022/2/28
		1.75 T-NOTE 220331	1.75	2,100	2,073	227,519	2022/3/31

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	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	1.75 T-NOTE 220430	1.75	1,100	1,085	119,101	2022/4/30
		1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,400	1,381	151,553	2022/5/15
		1.75 T-NOTE 220531	1.75	1,700	1,676	184,007	2022/5/31
		1.75 T-NOTE 220630	1.75	4,900	4,833	530,416	2022/6/30
		1.75 T-NOTE 220930	1.75	1,800	1,772	194,507	2022/9/30
		1.75 T-NOTE 230131	1.75	2,700	2,654	291,274	2023/1/31
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	3,500	3,434	376,918	2023/5/15
		1.875 T-NOTE 200630	1.875	5,700	5,670	622,243	2020/6/30
		1.875 T-NOTE 201215	1.875	3,200	3,179	348,877	2020/12/15
		1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,300	2,280	250,223	2021/11/30
		1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,550	2,526	277,279	2022/1/31
		1.875 T-NOTE 220228	1.875	2,100	2,080	228,311	2022/2/28
		1.875 T-NOTE 220331	1.875	2,450	2,427	266,405	2022/3/31
		1.875 T-NOTE 220430	1.875	8,900	8,811	966,995	2022/4/30
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	2,000	1,980	217,302	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220731	1.875	3,000	2,967	325,670	2022/7/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,500	1,483	162,835	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 220930	1.875	2,000	1,978	217,079	2022/9/30
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,700	2,668	292,895	2022/10/31
		1.875 T-NOTE 240831	1.875	2,200	2,157	236,769	2024/8/31
		2 T-NOTE 200731	2.0	2,000	1,991	218,554	2020/7/31
		2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,593	174,870	2020/9/30
		2 T-NOTE 201130	2.0	1,100	1,094	120,157	2020/11/30
		2 T-NOTE 210115	2.0	2,900	2,886	316,741	2021/1/15
		2 T-NOTE 210228	2.0	1,300	1,293	141,982	2021/2/28
		2 T-NOTE 210531	2.0	1,700	1,691	185,617	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	1,850	1,840	201,924	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	1,700	1,690	185,566	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	2,650	2,636	289,277	2021/11/15
		2 T-NOTE 211231	2.0	5,850	5,818	638,568	2021/12/31
		2 T-NOTE 220215	2.0	2,200	2,187	240,060	2022/2/15
		2 T-NOTE 220731	2.0	1,200	1,191	130,803	2022/7/31
		2 T-NOTE 221031	2.0	2,000	1,984	217,816	2022/10/31
		2 T-NOTE 221130	2.0	2,700	2,678	293,983	2022/11/30
		2 T-NOTE 230215	2.0	3,050	3,024	331,882	2023/2/15
		2 T-NOTE 240430	2.0	2,000	1,975	216,805	2024/4/30
		2 T-NOTE 240531	2.0	1,400	1,382	151,727	2024/5/31
		2 T-NOTE 240630	2.0	1,600	1,579	173,320	2024/6/30
		2 T-NOTE 250215	2.0	3,600	3,542	388,798	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	4,700	4,611	506,066	2025/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	5,150	5,017	550,634	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 200831	2.125	1,900	1,894	207,952	2020/8/31
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	1,610	1,605	176,198	2021/1/31
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,650	1,646	180,646	2021/6/30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	4,500	4,488	492,576	2021/8/15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,200	2,194	240,843	2021/9/30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,560	2,554	280,275	2021/12/31

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,800	1,795	197,038	2022/6/30
		2.125 T-NOTE 221231	2.125	2,650	2,640	289,788	2022/12/31
		2.125 T-NOTE 231130	2.125	4,500	4,476	491,206	2023/11/30
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	4,550	4,521	496,235	2024/2/29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	2,700	2,683	294,515	2024/3/31
		2.125 T-NOTE 240731	2.125	1,750	1,737	190,709	2024/7/31
		2.125 T-NOTE 240930	2.125	2,250	2,232	244,966	2024/9/30
		2.125 T-NOTE 241130	2.125	1,900	1,884	206,844	2024/11/30
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	4,900	4,848	532,096	2025/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	4,750	4,195	460,423	2046/8/15
		2.25 T-NOTE 210215	2.25	1,700	1,699	186,463	2021/2/15
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,600	1,599	175,535	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,800	1,799	197,524	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	1,400	1,400	153,696	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 220415	2.25	1,200	1,200	131,796	2022/4/15
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	4,900	4,898	537,599	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 240131	2.25	2,300	2,299	252,323	2024/1/31
		2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,000	1,997	219,154	2024/10/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	9,250	9,231	1,013,033	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 241231	2.25	2,500	2,496	273,921	2024/12/31
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,570	6,536	717,330	2025/11/15
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,750	4,707	516,622	2027/2/15
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	6,070	6,000	658,471	2027/8/15
		2.25 T-NOTE 271115	2.25	4,100	4,047	444,204	2027/11/15
		2.375 T-NOTE 200430	2.375	2,500	2,500	274,360	2020/4/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	800	801	87,908	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 210415	2.375	3,300	3,306	362,891	2021/4/15
		2.375 T-NOTE 220315	2.375	6,000	6,027	661,500	2022/3/15
		2.375 T-NOTE 230131	2.375	5,000	5,025	551,443	2023/1/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	3,800	3,819	419,097	2024/8/15
		2.375 T-NOTE 270515	2.375	3,650	3,647	400,300	2027/5/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	2,800	2,619	287,467	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	1,870	1,742	191,249	2046/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	3,050	2,840	311,748	2046/5/15
		2.5 T-NOTE 210131	2.5	7,000	7,024	770,910	2021/1/31
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,400	3,435	377,022	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240131	2.5	6,400	6,471	710,127	2024/1/31
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	4,350	4,398	482,739	2024/5/15
		2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,200	2,225	244,238	2025/1/31
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,300	2,308	253,299	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	3,200	3,215	352,910	2020/11/15
		2.625 T-NOTE 210515	2.625	2,300	2,316	254,186	2021/5/15
		2.625 T-NOTE 210615	2.625	3,100	3,124	342,918	2021/6/15
		2.625 T-NOTE 210715	2.625	4,600	4,637	508,925	2021/7/15
		2.625 T-NOTE 230228	2.625	2,200	2,231	244,841	2023/2/28
		2.625 T-NOTE 230630	2.625	2,500	2,537	278,508	2023/6/30
		2.625 T-NOTE 250331	2.625	3,700	3,765	413,175	2025/3/31

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	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	2.625 T-NOTE 251231	2.625	1,900	1,933	212,138	2025/12/31
		2.625 T-NOTE 260131	2.625	2,800	2,848	312,625	2026/1/31
		2.625 T-NOTE 290215	2.625	3,820	3,876	425,429	2029/2/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	1,350	1,333	146,366	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	1,550	1,529	167,877	2042/11/15
		2.75 T-BOND 470815	2.75	3,340	3,260	357,769	2047/8/15
		2.75 T-BOND 471115	2.75	1,460	1,424	156,352	2047/11/15
		2.75 T-NOTE 200930	2.75	6,000	6,033	662,169	2020/9/30
		2.75 T-NOTE 210815	2.75	12,560	12,699	1,393,679	2021/8/15
		2.75 T-NOTE 230531	2.75	1,800	1,835	201,405	2023/5/31
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	6,850	6,996	767,751	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	5,960	6,091	668,511	2024/2/15
		2.75 T-NOTE 250228	2.75	2,150	2,202	241,728	2025/2/28
		2.75 T-NOTE 250831	2.75	5,840	5,984	656,753	2025/8/31
		2.75 T-NOTE 280215	2.75	6,860	7,037	772,342	2028/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	2,800	2,820	309,552	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	4,200	4,218	462,924	2045/8/15
		2.875 T-BOND 461115	2.875	3,080	3,088	338,923	2046/11/15
		2.875 T-NOTE 201031	2.875	2,800	2,822	309,732	2020/10/31
		2.875 T-NOTE 211015	2.875	4,700	4,770	523,534	2021/10/15
		2.875 T-NOTE 250430	2.875	2,600	2,681	294,307	2025/4/30
		2.875 T-NOTE 250531	2.875	2,400	2,475	271,709	2025/5/31
		2.875 T-NOTE 251130	2.875	900	929	101,983	2025/11/30
		2.875 T-NOTE 280515	2.875	3,600	3,727	409,076	2028/5/15
		2.875 T-NOTE 280815	2.875	5,060	5,241	575,239	2028/8/15
		3 T-BOND 420515	3.0	950	980	107,641	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	2,500	2,570	282,108	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	2,750	2,828	310,414	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	2,950	3,032	332,837	2045/11/15
		3 T-BOND 470215	3.0	3,150	3,238	355,349	2047/2/15
		3 T-BOND 470515	3.0	1,950	2,002	219,744	2047/5/15
		3 T-BOND 480215	3.0	3,050	3,124	342,917	2048/2/15
		3 T-BOND 480815	3.0	3,710	3,801	417,122	2048/8/15
		3 T-BOND 490215	3.0	3,700	3,795	416,474	2049/2/15
		3.125 T-BOND 411115	3.125	800	844	92,716	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	900	949	104,167	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	1,700	1,787	196,162	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	4,800	5,043	553,501	2044/8/15
		3.125 T-BOND 480515	3.125	2,600	2,728	299,456	2048/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,100	1,118	122,769	2021/5/15
		3.125 T-NOTE 281115	3.125	4,900	5,180	568,519	2028/11/15
		3.375 T-BOND 440515	3.375	2,200	2,410	264,533	2044/5/15
		3.375 T-BOND 481115	3.375	2,050	2,256	247,657	2048/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,124	123,440	2039/2/15
		3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,100	2,123	233,028	2020/5/15
		3.625 T-BOND 430815	3.625	2,350	2,677	293,832	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	2,950	3,363	369,106	2044/2/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,900	2,966	325,593	2021/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,161	127,418	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	2,900	3,370	369,886	2043/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	1,000	1,182	129,724	2040/8/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	1,350	1,675	183,901	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	900	1,119	122,847	2040/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	450	564	61,979	2038/2/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	500	631	69,260	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,250	1,579	173,290	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,300	1,645	180,567	2041/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	1,150	1,445	158,628	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	510	650	71,393	2038/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	400	512	56,269	2039/8/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	3,600	4,692	514,941	2040/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,000	1,327	145,671	2041/2/15
		5 T-BOND 370515	5.0	240	321	35,335	2037/5/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	550	680	74,672	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	300	372	40,874	2029/2/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	990	1,280	140,471	2031/2/15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	600	751	82,500	2028/8/15
		6 T-BOND 260215	6.0	3,000	3,680	403,937	2026/2/15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	600	770	84,522	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	130	151	16,579	2023/8/15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	550	749	82,217	2030/5/15
		6.5 T-BOND 261115	6.5	900	1,154	126,651	2026/11/15
		8 T-BOND 211115	8.0	600	683	75,028	2021/11/15
		8.75 T-BOND 200815	8.75	800	863	94,770	2020/8/15
小計						64,031,828	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,100	1,066	87,106	2022/3/1
		0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,650	1,629	133,099	2020/9/1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	1,450	1,427	116,583	2021/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	2,120	2,078	169,779	2021/9/1
		1 CAN GOVT 220901	1.0	1,050	1,029	84,061	2022/9/1
		1 CAN GOVT 270601	1.0	950	900	73,533	2027/6/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	850	846	69,106	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	800	790	64,598	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 200501	1.75	700	700	57,186	2020/5/1
		1.75 CAN GOVT 210501	1.75	1,100	1,102	90,054	2021/5/1
		1.75 CAN GOVT 230301	1.75	800	803	65,662	2023/3/1
		2 CAN GOVT 230901	2.0	2,400	2,438	199,201	2023/9/1
		2 CAN GOVT 280601	2.0	900	922	75,323	2028/6/1
		2 CAN GOVT 511201	2.0	250	253	20,672	2051/12/1
		2.25 CAN GOVT 240301	2.25	800	823	67,291	2024/3/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,300	1,344	109,854	2025/6/1
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	440	461	37,682	2029/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,000	1,042	85,177	2024/6/1

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	850	878	71,755	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	980	1,154	94,326	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	310	388	31,747	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	826	67,475	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,600	1,629	133,078	2020/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,250	1,646	134,470	2045/12/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	950	1,295	105,788	2041/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	850	1,246	101,810	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	850	1,162	94,926	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,100	1,631	133,224	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	500	734	60,024	2027/6/1
小計						2,634,605	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	19,300	21,108	121,162	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,100	4,680	26,867	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	11,700	10,308	59,171	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	26,740	26,008	149,286	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	23,400	22,503	129,167	2022/6/9
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	6,500	6,395	36,712	2021/12/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	24,150	23,286	133,665	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,450	9,074	52,088	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	9,500	8,985	51,575	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	13,240	12,186	69,950	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	15,000	15,008	86,146	2020/6/11
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	8,350	8,380	48,106	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	6,800	6,385	36,653	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	10,500	10,723	61,554	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	8,600	8,584	49,275	2038/11/18
小計						1,111,384	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	1,900	1,941	239,289	2026/8/15
		0 OBL 210409	—	1,250	1,265	155,929	2021/4/9
		0 OBL 211008	—	1,000	1,015	125,156	2021/10/8
		0 OBL 220408	—	1,000	1,018	125,533	2022/4/8
		0 OBL 221007	—	900	918	113,230	2022/10/7
		0 OBL 230414	—	700	715	88,226	2023/4/14
		0 OBL 231013	—	2,150	2,201	271,283	2023/10/13
		0 SCHATS 200612	—	1,700	1,710	210,877	2020/6/12
		0 SCHATS 201211	—	1,700	1,717	211,629	2020/12/11
		0.25 BUND 270215	0.25	1,650	1,715	211,419	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	1,990	2,054	253,254	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	600	617	76,107	2029/2/15
		0.25 OBL 201016	0.25	1,350	1,366	168,472	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	1,250	1,317	162,407	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,600	2,750	338,959	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	2,300	2,435	300,215	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	1,200	1,269	156,465	2028/2/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	1 BUND 240815	1.0	1,150	1,239	152,807	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	2,050	2,230	274,900	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	1,300	1,524	187,851	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,392	171,574	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,200	1,295	159,609	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,200	1,300	160,284	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,150	1,265	156,009	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,600	1,720	212,050	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,150	1,275	157,182	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,300	1,391	171,520	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,450	1,609	198,369	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,300	1,349	166,327	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	800	853	105,229	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,500	1,579	194,660	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,780	2,602	320,710	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	1,640	2,438	300,599	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,500	1,562	192,537	2020/7/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,800	1,950	240,402	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,030	1,658	204,372	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	1,650	2,694	332,133	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	930	1,623	200,150	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	650	943	116,308	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,300	2,182	268,995	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,250	2,349	289,514	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,090	1,788	220,440	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	950	1,433	176,668	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	700	922	113,696	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	750	1,256	154,903	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	800	1,243	153,319	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 210415	0.05	1,300	1,286	158,562	2021/4/15
		0.2 ITALY GOVT 201015	0.2	900	898	110,780	2020/10/15
		0.35 ITALY GOVT 200615	0.35	550	551	67,969	2020/6/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	395	48,730	2021/11/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,300	1,294	159,602	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 201101	0.65	600	602	74,282	2020/11/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	2,700	2,602	320,780	2023/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,050	1,055	130,128	2020/5/1
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	3,200	3,169	390,637	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,980	1,947	240,020	2023/3/15
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	900	902	111,282	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,221	150,561	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,150	1,157	142,668	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	900	906	111,715	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	900	880	108,562	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	700	680	83,882	2025/5/15
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,550	1,509	185,995	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	1,200	1,161	143,118	2026/6/1

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	2,860	2,514	309,962	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	850	854	105,364	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,200	1,197	147,586	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	1,530	1,488	183,458	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,300	1,273	157,018	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,000	1,030	127,023	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,400	1,390	171,404	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,170	1,047	129,043	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	1,200	1,133	139,683	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,800	1,859	229,184	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,360	1,394	171,827	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,750	1,543	190,193	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,550	1,585	195,463	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	410	345	42,591	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,550	1,480	182,511	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,150	1,119	138,001	2046/9/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,020	1,015	125,133	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,500	184,878	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	1,900	2,009	247,636	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,800	1,908	235,232	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,100	2,236	275,657	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,200	1,314	161,983	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	600	625	77,139	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,450	1,519	187,310	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	1,600	1,777	219,031	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,300	1,452	178,973	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,120	2,390	294,660	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,450	1,667	205,495	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	3,000	3,265	402,482	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,700	1,924	237,234	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,300	1,550	191,043	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,220	1,470	181,255	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,500	1,662	204,883	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,350	1,574	194,107	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,930	2,377	293,001	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,450	1,794	221,228	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,400	1,724	212,594	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	1,750	2,157	265,914	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,150	1,307	161,154	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,700	1,940	239,202	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,450	1,894	233,446	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	1,950	2,572	317,057	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,000	2,628	323,955	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,100	1,478	182,195	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,200	1,582	195,072	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 200525	－	1,550	1,559	192,180	2020/5/25
		0 O.A.T 210225	－	3,140	3,171	390,932	2021/2/25

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	0 O.A.T 210525	－	2,300	2,326	286,688	2021/5/25
		0 O.A.T 220525	－	3,150	3,195	393,886	2022/5/25
		0 O.A.T 230325	－	2,100	2,132	262,777	2023/3/25
		0 O.A.T 240325	－	700	709	87,409	2024/3/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	1,200	1,215	149,787	2020/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	2,000	2,032	250,496	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	3,750	3,898	480,540	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	3,250	3,369	415,311	2026/5/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	3,190	3,341	411,828	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	2,100	2,192	270,183	2028/11/25
		1 O.A.T 251125	1.0	1,920	2,058	253,667	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	2,050	2,197	270,836	2027/5/25
		1.25 O.A.T 340525	1.25	380	406	50,126	2034/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	2,980	3,151	388,426	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	4,310	4,802	591,879	2031/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	2,550	2,771	341,602	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,500	2,774	341,909	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	940	1,065	131,322	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,020	1,075	132,581	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	2,220	2,580	318,016	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	2,350	2,570	316,799	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	2,300	2,594	319,812	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	2,400	2,507	309,066	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	2,150	2,631	324,362	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	2,450	2,994	369,061	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,000	3,311	408,153	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	2,600	2,843	350,485	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,640	2,382	293,686	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,550	3,186	392,689	2026/4/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	2,500	2,711	334,207	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,700	2,627	323,780	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,240	2,128	262,392	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	980	1,731	213,354	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,240	3,911	482,098	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,490	4,176	514,781	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	1,730	2,772	341,706	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	2,600	3,934	484,913	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,140	3,574	440,545	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	2,300	3,209	395,601	2025/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	1,000	1,355	167,014	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	－	800	812	100,112	2022/1/15
		0 NETH GOVT 240115	－	650	661	81,578	2024/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	2,150	2,219	273,533	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	400	404	49,871	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,350	1,415	174,454	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	880	938	115,633	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	880	937	115,536	2028/7/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,092	134,696	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	950	1,067	131,517	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	900	981	120,913	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,010	1,304	160,770	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,030	1,577	194,458	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,600	1,735	213,898	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	750	786	96,895	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	300	347	42,874	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,020	1,712	211,075	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,050	1,683	207,474	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	850	1,260	155,395	2028/1/15
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	650	844	104,027	2023/1/15
スペイン	国債証券	0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	1,100	1,118	137,837	2023/7/30
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	1,500	1,529	188,450	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	1,450	1,482	182,657	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	2,600	2,661	328,007	2021/7/30
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,300	1,324	163,196	2020/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,400	1,474	181,789	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	1,300	1,367	168,557	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,650	1,728	212,997	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,500	2,647	326,258	2027/10/31
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,050	1,117	137,699	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,500	1,618	199,509	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	550	568	70,069	2035/7/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,400	1,540	189,841	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,550	1,686	207,827	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	2,200	2,449	301,844	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	1,930	2,154	265,550	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	610	682	84,087	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	1,550	1,768	217,927	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,260	1,472	181,506	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	750	948	116,870	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,300	1,539	189,744	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,300	2,397	295,483	2020/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,470	2,054	253,166	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,350	1,616	199,183	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,550	1,963	241,985	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,470	2,225	274,286	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,100	1,346	165,985	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,650	1,776	218,933	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,100	1,695	209,010	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	950	1,318	162,500	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,100	1,788	220,479	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,750	2,111	260,247	2023/1/31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	1,700	1,894	233,472	2021/4/30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,500	2,316	285,477	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,850	2,158	265,999	2022/1/31

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,300	1,794	221,129	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,850	2,731	336,693	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	1,620	1,655	204,072	2023/10/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	300	310	38,278	2024/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,300	1,368	168,716	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,080	1,132	139,552	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	900	938	115,704	2028/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,100	1,172	144,565	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	650	677	83,548	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	940	998	123,048	2033/4/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	370	392	48,343	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	800	833	102,690	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	350	366	45,124	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	530	600	73,976	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	310	349	43,034	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	820	908	112,031	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	290	336	41,524	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,180	1,350	166,421	2024/6/22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	200	260	32,147	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,200	1,271	156,687	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	670	1,026	126,518	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	750	847	104,424	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	620	875	107,865	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	950	1,058	130,464	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,100	1,275	157,252	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,200	1,897	233,865	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	800	1,047	129,052	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,520	2,438	300,486	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,300	1,895	233,580	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 220920	—	400	406	50,091	2022/9/20
		0 AUSTRIA GOVT 230715	—	950	965	118,994	2023/7/15
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	500	518	63,846	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	800	845	104,251	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	600	631	77,831	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	1,250	1,360	167,732	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	430	477	58,804	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	150	157	19,455	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	700	773	95,346	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	800	876	108,062	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	350	461	56,880	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	450	563	69,456	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	450	671	82,818	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	650	739	91,144	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,050	1,150	141,830	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	673	83,040	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	250	468	57,770	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	820	863	106,365	2020/7/15

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,100	1,730	213,333	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	550	737	90,957	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	670	1,010	124,538	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	－	250	253	31,255	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	－	350	355	43,830	2023/9/15
		0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	405	49,930	2020/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	416	51,329	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	350	362	44,683	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	250	257	31,732	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	200	204	25,254	2029/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	350	364	44,901	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	500	533	65,738	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	280	302	37,261	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	180	201	24,883	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	250	269	33,157	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	321	39,587	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	200	223	27,496	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	300	419	51,674	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	300	371	45,788	2028/7/4
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	400	431	53,170	2021/4/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	550	693	85,501	2025/7/4
アイルランド	国債証券	0 IRISH GOVT 221018	－	250	252	31,144	2022/10/18
		0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	500	516	63,660	2022/3/15
		0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	900	940	115,970	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	600	635	78,381	2026/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	300	315	38,860	2033/5/15
		1.35 IRISH GOVT 310318	1.35	100	107	13,203	2031/3/18
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	450	490	60,438	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	590	670	82,629	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	800	950	117,178	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	704	86,826	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	400	465	57,343	2023/3/20
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	1,150	1,240	152,908	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	700	921	113,522	2025/3/13
小計						51,952,826	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.5 GILT 220722	0.5	1,500	1,488	212,495	2022/7/22
		0.75 GILT 230722	0.75	2,250	2,244	320,486	2023/7/22
		1.25 GILT 270722	1.25	1,350	1,373	196,109	2027/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	1,720	1,742	248,779	2021/1/22
		1.5 GILT 260722	1.5	1,660	1,724	246,151	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	1,570	1,510	215,703	2047/7/22
		1.625 GILT 281022	1.625	1,650	1,723	246,094	2028/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	1,180	1,216	173,628	2071/10/22
		1.75 GILT 220907	1.75	1,700	1,755	250,606	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	800	821	117,253	2037/9/7
		1.75 GILT 570722	1.75	1,070	1,120	159,989	2057/7/22

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	2 GILT 200722	2.0	2,350	2,385	340,554	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	980	1,047	149,526	2025/9/7
		2.25 GILT 230907	2.25	1,700	1,804	257,611	2023/9/7
		2.5 GILT 650722	2.5	1,350	1,766	252,244	2065/7/22
		2.75 GILT 240907	2.75	1,150	1,263	180,379	2024/9/7
		3.25 GILT 440122	3.25	1,790	2,359	336,899	2044/1/22
		3.5 GILT 450122	3.5	1,820	2,512	358,743	2045/1/22
		3.5 GILT 680722	3.5	1,290	2,145	306,283	2068/7/22
		3.75 GILT 200907	3.75	1,200	1,247	178,094	2020/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	900	962	137,450	2021/9/7
		3.75 GILT 520722	3.75	1,250	1,932	275,907	2052/7/22
		4 GILT 220307	4.0	450	491	70,126	2022/3/7
		4 GILT 600122	4.0	910	1,573	224,645	2060/1/22
		4.25 GILT 271207	4.25	750	949	135,517	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	1,220	1,644	234,821	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	1,275	1,793	256,091	2036/3/7
		4.25 GILT 390907	4.25	1,150	1,679	239,761	2039/9/7
		4.25 GILT 401207	4.25	1,450	2,144	306,210	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,100	1,725	246,294	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	820	1,330	189,967	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,020	1,768	252,433	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,210	1,716	245,051	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,100	1,715	244,887	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,060	1,462	208,814	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,600	2,458	351,042	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	950	1,172	167,327	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	900	1,300	185,682	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	900	1,035	147,811	2021/6/7
小計						8,867,481	
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	3,550	3,767	42,948	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	2,200	2,323	26,489	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	3,960	4,275	48,740	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	4,720	5,135	58,540	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,630	5,395	61,512	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	7,900	8,875	101,178	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,130	4,766	54,334	2039/3/30
		5 SWD GOVT 201201	5.0	5,700	6,200	70,688	2020/12/1
小計						464,432	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	2,560	2,556	32,135	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,300	2,335	29,355	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	2,250	2,277	28,623	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	1,200	1,206	15,169	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	5,150	5,269	66,237	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	2,850	2,934	36,887	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,150	4,453	55,982	2024/3/14

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ノルウェー			%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
	国債証券	3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,750	4,980	62,603	2021/5/25
小計						326,994	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.25 DMK GOVT 201115	0.25	1,900	1,926	31,803	2020/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	6,550	6,911	114,116	2027/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,150	3,435	56,727	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,350	6,082	100,418	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	6,020	6,574	108,544	2021/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,060	16,390	270,605	2039/11/15
小計						682,215	
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	1,905	54,630	2021/7/25
		2 POLAND 210425	2.0	3,100	3,124	89,588	2021/4/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	1,250	1,264	36,259	2022/4/25
		2.5 POLAND 230125	2.5	2,500	2,539	72,798	2023/1/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	1,000	1,011	29,003	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	2,650	2,627	75,331	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	2,050	2,012	57,692	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	2,660	2,649	75,960	2028/4/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	2,850	2,974	85,280	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	1,800	1,939	55,602	2023/10/25
		5.25 POLAND 201025	5.25	700	737	21,137	2020/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,700	1,866	53,512	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,550	1,739	49,867	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	870	1,093	31,347	2029/4/25
		POLAND 200725	—	700	687	19,713	2020/7/25
小計						807,726	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	1,650	1,659	127,170	2020/11/21
		2 AUST GOVT 211221	2.0	1,150	1,171	89,734	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 221121	2.25	1,000	1,033	79,155	2022/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	1,800	1,882	144,232	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	1,400	1,502	115,076	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,700	1,813	138,954	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,950	2,117	162,254	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,400	1,525	116,897	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	930	1,019	78,076	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	552	42,291	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	890	1,007	77,191	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,800	1,984	152,067	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	1,850	2,105	161,338	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	900	1,060	81,229	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	800	999	76,578	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	3,500	4,124	315,965	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	1,270	1,676	128,424	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,950	2,404	184,209	2027/4/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,750	2,032	155,704	2023/4/21

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	
オーストラリア			%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	国債証券	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	2,060	2,240	171,611	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,600	1,821	139,572	2022/7/15
小計						2,737,737	
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 SINGAPORGOVT 211001	1.25	200	196	15,827	2021/10/1
		1.75 SINGAPORGOVT 220401	1.75	350	348	28,008	2022/4/1
		1.75 SINGAPORGOVT 230201	1.75	250	248	19,961	2023/2/1
		2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	450	450	36,220	2020/7/1
		2 SINGAPORGOVT 240201	2.0	350	350	28,187	2024/2/1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	230	231	18,577	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	420	422	33,995	2021/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	260	251	20,250	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	300	306	24,617	2025/6/1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	100	103	8,347	2028/5/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	450	464	37,320	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	290	297	23,948	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	520	531	42,773	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	100	105	8,519	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	300	318	25,570	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	350	367	29,545	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	300	311	25,042	2022/9/1
		3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	370	376	30,256	2020/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	310	346	27,854	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	650	715	57,545	2027/3/1
小計						542,369	
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	3.418MALAYSIAGOVT 220815	3.418	900	897	23,688	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOVT 230315	3.48	1,200	1,195	31,531	2023/3/15
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3.502	300	291	7,698	2027/5/31
		3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	1,004	26,511	2020/10/15
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	600	592	15,629	2028/6/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	500	504	13,304	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	3.8	200	201	5,308	2023/8/17
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	600	579	15,297	2033/4/15
		3.882 MALAYSIAGOV 220310	3.882	500	506	13,352	2022/3/10
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	1,000	1,006	26,546	2025/3/14
		3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	700	705	18,600	2020/7/31
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	499	13,183	2027/3/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,100	1,100	29,036	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3.9	1,000	1,001	26,415	2026/11/30
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	800	805	21,262	2025/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	913	24,085	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	600	600	15,828	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4.16	2,250	2,286	60,326	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,000	1,022	26,983	2024/7/15
		4.232MALAYSIAGOVT 310630	4.232	800	810	21,373	2031/6/30
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	350	350	9,238	2035/5/31

銘柄			当期末 利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
マレーシア			%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
	国債証券	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	500	516	13,612	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	900	938	24,752	2030/4/15
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	1,200	1,263	33,338	2033/11/7
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,050	1,070	28,231	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	1,600	1,689	44,566	2037/4/7
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	750	791	20,868	2043/9/30
		5.248 MALAYSIA 280915	5.248	200	220	5,822	2028/9/15
小計						616,397	
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	13,100	14,551	112,191	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	6,950	5,086	39,218	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	7,200	5,139	39,624	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	3,000	3,007	23,186	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	9,500	8,027	61,895	2031/2/28
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	5,000	5,026	38,756	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	11,500	10,672	82,281	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	7,800	7,192	55,451	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	11,200	10,168	78,397	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	10,050	9,141	70,479	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	14,300	13,029	100,460	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	4,950	4,692	36,180	2035/2/28
		9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	5,000	4,694	36,192	2040/1/31
小計						774,317	
合計						135,550,317	

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

○投資信託財産の構成

(2019年５月13日現在)

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	135,550,317	98.7
コール・ローン等、その他	1,850,013	1.3
投資信託財産総額	137,400,330	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (137,343,859千円) の投資信託財産総額 (137,400,330千円) 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＝109.74円	1カナダドル＝81.68円	1メキシコペソ＝5.74円	1ユーロ＝123.25円
1イギリスポンド＝142.77円	1スウェーデンクローネ＝11.40円	1ノルウェークローネ＝12.57円	1デンマーククローネ＝16.51円
1ポーランドズロチ＝28.67円	1オーストラリアドル＝76.61円	1シンガポールドル＝80.41円	1マレーシアリンギット＝26.38円
1南アフリカランド＝7.71円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年５月13日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	137,511,884,400
コール・ローン等	682,585,613
公社債(評価額)	135,550,317,982
未収入金	167,834,527
未収利息	1,038,543,151
前払費用	72,603,127
(B) 負債	150,210,082
未払金	111,554,300
未払解約金	38,655,731
未払利息	51
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	137,361,674,318
元本	67,295,786,020
次期繰越損益金	70,065,888,298
(D) 受益権総口数	67,295,786,020口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	20,412円

＜注記事項＞

①期首元本額　59,625,812,717円
　期中追加設定元本額　15,032,471,063円
　期中一部解約元本額　7,362,497,760円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.0412円です。

○損益の状況 (2018年５月15日～2019年５月13日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	2,987,847,067
受取利息	2,987,986,994
支払利息	△ 139,927
(B) 有価証券売買損益	△ 1,540,620,961
売買益	3,450,358,310
売買損	△ 4,990,979,271
(C) 保管費用等	△ 14,701,307
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	1,432,524,799
(E) 前期繰越損益金	60,688,635,116
(F) 追加信託差損益金	15,526,301,172
(G) 解約差損益金	△ 7,581,572,789
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	70,065,888,298
次期繰越損益金(Ｈ)	70,065,888,298

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

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）

ファンド・マネジャー（海外債券）	807,059,881円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国債券インデックス	6,014,543,662円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,751,222,617円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	240,891,076円
コアバランス	1,691,097円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	7,996,307円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	7,749,255円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	5,066,340円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国債券インデックス	1,870,915,291円
海外債券セレクション（ラップ向け）	1,624,420,167円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	1,515,730,853円
つみたて８資産均等バランス	512,309,963円
つみたて４資産均等バランス	130,934,740円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	524,610円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	165,557円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	36,681円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	1,277,725円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	912,836円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	751,949円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国債券）	486,340円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	245,624円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	9,010,333,146円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	191,692,318円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	151,791,631円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	76,146,235円

ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	91,899,589円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	15,054,232円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	7,495,758円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	55,166,484円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,667,563,849円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,727,396,810円
ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	28,127,319,075円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	747,497,174円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	8,379,499円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,525,954円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	51,161,853円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	9,613,636円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,218,332,903円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	99,358,385円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	138,503,938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）	435,951,383円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	14,691,728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）	1,680,577,813円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,935,491円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	5,294,769円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	4,756,617円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	1,692,464円
三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドＶＡ	48,000,330円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	35,919,353円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	62,467,833円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	50,027,477円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	79,732,424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）	1,623,676,206円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国債券インデックスファンド	1,977,544,261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）	221,572,383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）	579,408,946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）	422,631,646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）	151,739,856円
合計	67,295,786,020円

新興国債券インデックスマザーファンド

《第10期》決算日2020年１月27日

［計算期間：2019年１月29日～2020年１月27日］

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、１月27日に第10期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として対象インデックス（ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建の公社債に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
6期(2016年1月26日)	11,515	△18.9	26,826.64	△18.3	95.9	－	9,861
7期(2017年1月26日)	12,647	9.8	29,442.31	9.8	96.1	－	12,443
8期(2018年1月26日)	14,464	14.4	34,033.56	15.6	96.7	－	16,676
9期(2019年1月28日)	13,254	△ 8.4	31,268.09	△ 8.1	96.7	－	20,421
10期(2020年1月27日)	14,424	8.8	34,193.00	9.4	97.4	－	30,520

(注) ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイドとは、Ｊ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はＪ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、Ｊ.Ｐ.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。
(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年　月　日	基準価額		ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期　首）	円	%		%	%	%
2019年１月28日	13,254	－	31,268.09	－	96.7	－
１月末	13,299	0.3	31,235.67	△0.1	96.5	－
２月末	13,591	2.5	32,082.90	2.6	96.4	－
３月末	13,363	0.8	31,500.96	0.7	95.5	－
４月末	13,413	1.2	31,730.84	1.5	95.9	－
５月末	13,078	△1.3	31,075.08	△0.6	96.4	－
６月末	13,669	3.1	32,298.63	3.3	95.5	－
７月末	13,911	5.0	32,890.36	5.2	97.0	－
８月末	13,249	△0.0	31,345.95	0.2	97.5	－
９月末	13,609	2.7	32,274.60	3.2	97.3	－
10月末	14,133	6.6	33,390.89	6.8	97.1	－
11月末	13,930	5.1	32,946.41	5.4	97.0	－
12月末	14,468	9.2	34,229.09	9.5	96.7	－
（期　末）						
2020年１月27日	14,424	8.8	34,193.00	9.4	97.4	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

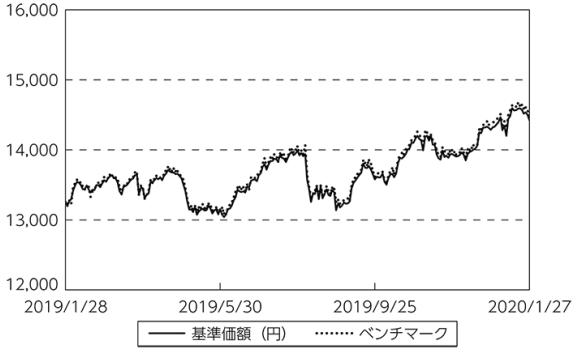
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ8.8%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（9.4%）を0.6%下回りました。

基準価額等の推移



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

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

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

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

●当該投資信託のポートフォリオについて
・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは9.4%の上昇になったため、カイ離は△0.6%程度となりました。

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
（主なプラス要因）
・ありません。

（主なマイナス要因）
・ポートフォリオ要因によるものです。

〇今後の運用方針
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月29日～2020年１月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	13	0.095	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(12)	(0.090)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(1)	(0.005)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	13	0.095	
期中の平均基準価額は、13,689円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年１月29日～2020年１月27日）

公社債

			買　付　額	売　付　額
外国	アルゼンチン	国債証券	千アルゼンチンペソ 1,935	千アルゼンチンペソ 15,150
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 196,974	千メキシコペソ 62,472
	ブラジル	国債証券	千ブラジルレアル 71,946	千ブラジルレアル 36,251
	チリ	国債証券	千チリペソ 5,840,314	千チリペソ 3,416,055
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 19,182,860	千コロンビアペソ 5,199,951
	ペルー	国債証券	千ペルーヌエボソル 12,082	千ペルーヌエボソル 1,448
	ウルグアイ	国債証券	千ウルグアイペソ 1,697	千ウルグアイペソ －
	ドミニカ	国債証券	千ドミニカペソ 16,604	千ドミニカペソ －
	トルコ	国債証券	千トルコリラ 14,069	千トルコリラ 9,378
	チェコ	国債証券	千チェココルナ 115,915	千チェココルナ 45,824
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント 1,498,490	千ハンガリーフォリント 875,089
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 41,255	千ポーランドズロチ 10,136
	ロシア	国債証券	千ロシアルーブル 573,337	千ロシアルーブル 56,172
	ルーマニア	国債証券	千ルーマニアレイ 13,159	千ルーマニアレイ 5,360
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 32,453	千マレーシアリンギット 6,423
	タイ	国債証券	千タイバーツ 308,008	千タイバーツ 47,084
	フィリピン	国債証券	千フィリピンペソ －	千フィリピンペソ 10,100
	インドネシア	国債証券	千インドネシアルピア 134,678,927	千インドネシアルピア 8,926,004
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 154,120	千南アフリカランド 11,865

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月29日～2020年１月27日）

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

（2020年１月27日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

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

（注）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	45,900	52,150	301,949	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	14,700	19,082	110,485	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	28,200	26,820	155,290	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	26,900	26,821	155,294	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	54,200	53,968	312,474	2022/6/9
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	38,000	38,391	222,288	2021/12/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	46,200	48,154	278,815	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	24,300	26,007	150,582	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	15,400	16,594	96,082	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	31,900	34,279	198,479	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	57,300	59,767	346,052	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	21,000	22,070	127,789	2024/9/5
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	23,300	25,888	149,893	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	40,200	44,901	259,981	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	25,700	29,583	171,287	2038/11/18
小計						3,036,748	
ブラジル				千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	10.0	16,170	19,286	502,794	2027/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	13,100	15,224	396,894	2025/1/1
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	10.0	6,100	7,440	193,973	2029/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	20,100	22,575	588,546	2023/1/1
		BRAZIL-LTN 210701	—	9,800	9,189	239,570	2021/7/1
		BRAZIL-LTN 220101	—	17,800	16,209	422,570	2022/1/1
		BRAZIL-LTN 220701	—	11,500	10,154	264,719	2022/7/1
		BRAZIL-LTN 230701	—	15,600	12,861	335,292	2023/7/1
小計						2,944,361	
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券	4.5 BONOS TESORER 210301	4.5	870,000	910,585	127,664	2021/3/1
		4.5 BONOS TESORER 260301	4.5	1,200,000	1,329,932	186,456	2026/3/1
		4.7 BONOS TESORER 300901	4.7	1,000,000	1,140,850	159,947	2030/9/1
		5 BONOS TESORERIA 350301	5.0	1,000,000	1,193,185	167,284	2035/3/1
		6 BONOS TESORERIA 430101	6.0	890,000	1,210,177	169,666	2043/1/1
小計						811,019	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	10.0	6,200,000	7,401,790	239,817	2024/7/24
		4.375 COLOMBI(GL) 230321	4.375	1,680,000	1,646,884	53,359	2023/3/21
		6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	7,280,000	7,414,307	240,223	2028/4/28
		6.25 TITULOS DE T 251126	6.25	5,190,000	5,408,641	175,239	2025/11/26
		7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	8,010,000	8,396,023	272,031	2022/5/4
		7 TITULOS DE TESO 320630	7.0	6,000,000	6,484,364	210,093	2032/6/30
		7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	2,300,000	2,520,991	81,680	2034/10/18
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	7,770,000	8,619,619	279,275	2026/8/26
		7.75 COLOMBI (GL) 210414	7.75	1,000,000	1,030,514	33,388	2021/4/14
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	4,860,000	5,536,317	179,376	2030/9/18

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

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

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ロシア			%	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル	千円	
	国債証券	7.6 RUSSIA GOVT 210414	7.6	30,400	31,190	54,583	2021/4/14
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	55,000	57,657	100,900	2022/7/20
		7.7 RUSSIA OFZ 330323	7.7	95,700	108,421	189,738	2033/3/23
		7.75 RUSSIA OFZ 260916	7.75	149,600	164,709	288,241	2026/9/16
		7.95 RUSSIA OFZ 261007	7.95	25,800	28,644	50,127	2026/10/7
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	111,000	124,929	218,627	2027/2/3
		8.5 RUSSIA OFZ 310917	8.5	111,200	132,886	232,550	2031/9/17
小計						2,643,313	
ルーマニア				千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ		
	国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 210322	3.25	1,600	1,597	40,181	2021/3/22
		3.25 ROMANIA GOVE 240429	3.25	2,300	2,250	56,633	2024/4/29
		3.4 ROMANIA GOVER 220308	3.4	3,300	3,287	82,707	2022/3/8
		3.5 ROMANIA GOVER 221219	3.5	3,200	3,186	80,159	2022/12/19
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	6,300	6,541	164,594	2025/2/24
		5 ROMANIA GOVERNM 290212	5.0	2,760	2,916	73,390	2029/2/12
		5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	2,600	2,888	72,669	2027/7/26
		5.85 ROMANIA GOVE 230426	5.85	4,000	4,258	107,151	2023/4/26
		5.95 ROMANIA 210611	5.95	3,600	3,718	93,569	2021/6/11
小計						771,059	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.62 MALAYSIAGOVT 211130	3.62	4,400	4,466	120,006	2021/11/30
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	5,900	6,138	164,952	2028/6/15
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	3.8	7,100	7,318	196,646	2023/8/17
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	3,300	3,495	93,933	2029/8/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	5,000	5,261	141,368	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3.9	8,620	9,030	242,654	2026/11/30
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	8,800	9,213	247,569	2025/9/15
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	6,700	7,016	188,524	2024/9/30
		4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4.16	4,000	4,075	109,500	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	5,500	5,779	155,301	2024/7/15
		4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	3,400	3,699	99,406	2028/10/31
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	3,500	4,119	110,680	2037/4/7
小計						1,870,544	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	1.45 THAILAND 241217	1.45	44,000	44,517	158,035	2024/12/17
		1.875 THAILAND 220617	1.875	44,000	44,762	158,907	2022/6/17
		2 THAILAND 221217	2.0	39,100	40,040	142,144	2022/12/17
		2.125 THAILAND 261217	2.125	53,500	56,556	200,775	2026/12/17
		2.4 THAILAND 231217	2.4	48,100	50,311	178,605	2023/12/17
		2.875 THAILAND 281217	2.875	66,800	75,203	266,973	2028/12/17
		2.875 THAILAND 460617	2.875	42,200	50,113	177,903	2046/6/17
		3.3 THAILAND 380617	3.3	29,700	36,948	131,167	2038/6/17
		3.4 THAILAND 360617	3.4	43,300	54,067	191,940	2036/6/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	42,400	45,870	162,839	2023/6/16
		3.65 THAILAND 211217	3.65	43,700	45,767	162,476	2021/12/17

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

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
南アフリカ			%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
	国債証券	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	22,100	20,097	151,936	2040/1/31
小計						2,688,755	
合計						29,739,673	

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

○投資信託財産の構成

(2020年1月27日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	29,739,673	97.2
コール・ローン等、その他	850,478	2.8
投資信託財産総額	30,590,151	100.0

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月27日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　15,407,521,844円
　期中追加設定元本額　7,011,221,547円
　期中一部解約元本額　1,259,429,041円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.4424円です。

○損益の状況 (2019年１月29日～2020年１月27日)

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

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

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

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

東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

《第11期》決算日2020年１月27日

［計算期間：2019年１月29日～2020年１月27日］

「東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド」は、１月27日に第11期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
主要運用対象	東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
7期(2016年1月26日)	23,985	△10.1	2,998.39	△10.1	98.1	2.2	15,494
8期(2017年1月26日)	27,236	13.6	3,399.04	13.4	97.9	2.3	16,983
9期(2018年1月26日)	26,965	△ 1.0	3,362.92	△ 1.1	98.4	1.9	21,644
10期(2019年1月28日)	29,481	9.3	3,670.43	9.1	98.2	2.0	23,792
11期(2020年1月27日)	36,432	23.6	4,533.90	23.5	98.4	1.6	35,177

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

（注）「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）	騰落率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
（期　首）	円	%		%	%	%
2019年１月28日	29,481	－	3,670.43	－	98.2	2.0
１月末	29,791	1.1	3,709.11	1.1	98.1	1.9
２月末	29,943	1.6	3,728.00	1.6	97.7	2.4
３月末	30,934	4.9	3,851.10	4.9	98.5	1.4
４月末	30,708	4.2	3,822.76	4.2	98.6	1.4
５月末	31,243	6.0	3,889.57	6.0	98.6	1.3
６月末	31,713	7.6	3,947.76	7.6	98.8	1.3
７月末	33,102	12.3	4,120.33	12.3	98.6	1.4
８月末	34,357	16.5	4,275.94	16.5	98.2	1.7
９月末	35,980	22.0	4,477.77	22.0	98.5	1.5
10月末	37,170	26.1	4,625.77	26.0	98.7	1.3
11月末	36,834	24.9	4,584.30	24.9	98.9	1.1
12月末	35,758	21.3	4,450.34	21.2	98.6	1.5
（期　末）						
2020年１月27日	36,432	23.6	4,533.90	23.5	98.4	1.6

（注）騰落率は期首比。
（注）「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

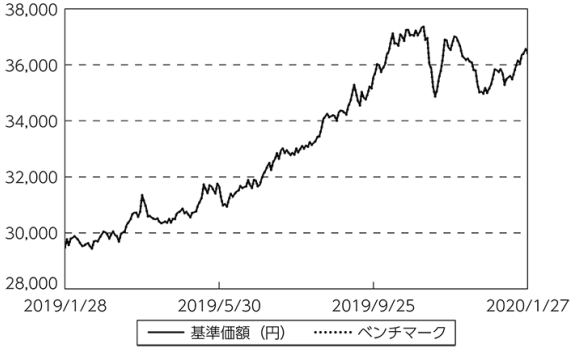
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ23.6%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（23.5%）を0.1%上回りました。

基準価額等の推移



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

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

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

●当該投資信託のポートフォリオについて
・資産のほぼ全額を不動産投資信託証券（ＲＥＩＴ）（先物を含む）に投資しました。
・ポートフォリオはベンチマークである東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは23.5%の上昇となったため、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：その他の要因※によるものです。
※留保金等が含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

○今後の運用方針
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月29日～2020年１月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.003	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(1)	(0.003)	
(b) その他費用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（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	1	0.003	
期中の平均基準価額は、33,243円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年１月29日～2020年１月27日）

投資信託証券

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
		千口	千円	千口	千円
国内	エスコンジャパンリート投資法人	0.36	39,397	0.042	4,795
	サンケイリアルエステート投資法人	0.473 (0.026)	54,751 (3,087)	0.05	5,927
	日本アコモデーションファンド投資法人	0.311	202,798	0.144	92,427
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	1	178,574	0.51	56,438
	森ヒルズリート投資法人	1	181,578	0.496	80,989
	産業ファンド投資法人	1	226,311	0.526	78,232
	アドバンス・レジデンス投資法人	0.948	324,126	0.539	180,847
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.652	130,981	0.264	51,951
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.474	250,615	0.285	144,752
	ＧＬＰ投資法人	2	315,703	1	139,619
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.466 (0.008)	151,490 (2,344)	0.177	57,595
	日本プロロジスリート投資法人	1	429,014	0.609	163,323
	星野リゾート・リート投資法人	0.139	79,330	0.062	34,379
	Ｏｎｅリート投資法人	0.168	52,954	0.064	19,824
	イオンリート投資法人	1	161,239	0.446	62,543
	ヒューリックリート投資法人	0.889	173,796	0.353	67,329
	日本リート投資法人	0.308	139,008	0.14	62,673
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6	136,817	2	45,416
	日本ヘルスケア投資法人	0.052	10,218	0.021	3,937
	積水ハウス・リート投資法人	3	314,617	1	106,478
	トーセイ・リート投資法人	0.249 (0.033)	33,097 (4,530)	0.107	13,327
	ケネディクス商業リート投資法人	0.408	112,820	0.163	44,021
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	0.288 (0.119)	36,940 (13,815)	0.09	11,442
	サムティ・レジデンシャル投資法人	0.19	21,918	0.089	10,005
	野村不動産マスターファンド投資法人	3 (0.067)	625,655 (10,064)	1	215,594
	いちごホテルリート投資法人	0.158	20,565	0.098	12,380
	ラサールロジポート投資法人	1	187,764	0.363	51,706
	スターアジア不動産投資法人	0.363	41,952	0.141	16,032
	マリモ地方創生リート投資法人	0.119	14,974	0.037	4,484
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.381 (0.045)	151,019 (15,841)	0.107	44,129
	大江戸温泉リート投資法人	0.182	16,539	0.074	6,629
	さくら総合リート投資法人	0.201	19,097	0.092	8,600
	投資法人みらい	1 (2)	69,879 (－)	0.465	25,961
	森トラスト・ホテルリート投資法人	0.217	30,939	0.099	13,975
	三菱地所物流リート投資法人	0.401	133,131	0.066	21,189
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.369	49,456	0.047	6,052
	ザイマックス・リート投資法人	0.264	34,481	0.054	7,106
	タカラレーベン不動産投資法人	0.456 (0.125)	54,933 (14,625)	0.091	10,420
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.143	16,122	0.066	7,112

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
国内	日本ビルファンド投資法人	0.905	715,353	0.419	323,988
	ジャパンリアルエステイト投資法人	0.935	655,488	0.433	296,525
	日本リテールファンド投資法人	1	407,310	0.816	184,117
	オリックス不動産投資法人	1	414,611	0.86	186,498
	日本プライムリアルティ投資法人	0.588	288,581	0.27	128,752
	プレミア投資法人	0.854	130,109	0.523	77,142
	東急リアル・エステート投資法人	0.629	124,769	0.292	57,010
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.79	108,110	0.299	40,889
	ユナイテッド・アーバン投資法人	2	436,967	0.964	188,782
	森トラスト総合リート投資法人	0.666	125,061	0.307	56,274
	インヴィンシブル投資法人	6	384,553	1	97,492
	フロンティア不動産投資法人	0.365	170,663	0.148	68,728
	平和不動産リート投資法人	0.581	78,408	0.268	35,231
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.61	161,334	0.299	77,568
	福岡リート投資法人	0.485	87,725	0.225	40,333
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.29	235,825	0.134	105,548
	いちごオフィスリート投資法人	0.736	79,686	0.49	51,338
	大和証券オフィス投資法人	0.217	176,856	0.101	81,072
	阪急阪神リート投資法人	0.426	69,421	0.194	30,966
	スターツプロシード投資法人	0.144	28,022	0.071	13,224
	大和ハウスリート投資法人	1 (0.035)	412,185 (8,602)	0.581	159,938
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	3	258,213	1	121,016
	日本賃貸住宅投資法人	1	102,406	0.485	45,406
	ジャパンエクセレント投資法人	0.923	160,134	0.382	64,396
	エスコンジャパンリート投資法人（新）	0.014	1,736	—	—
	サンケイリアルエステート投資法人（新）	0.026 (△0.026)	3,087 (△ 3,087)	—	—
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）	0.009 (△0.008)	2,990 (△ 2,344)	—	—
	トーセイ・リート投資法人（新）	0.033 (△0.033)	4,530 (△ 4,530)	—	—
	ヘルスケア＆メディカル投資法人（新）	— (△0.119)	— (△ 13,815)	—	—
	野村不動産マスターファンド投資法人（新）	0.067 (△0.067)	10,064 (△ 10,064)	—	—
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人（新）	0.03 (△0.045)	14,872 (△ 15,841)	—	—
	タカラレーベン不動産投資法人（新）	0.125 (△0.125)	14,625 (△ 14,625)	—	—
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人（新）	0.044	5,119	—	—
	大和ハウスリート投資法人（新）	0.035 (△0.035)	8,602 (△ 8,602)	—	—
合計		63 (2)	11,102,052 (—)	24	4,521,897

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		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 8,603	百万円 8,616	百万円 4	百万円 4

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月29日～2020年１月27日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	11,102	4,523	40.7	4,521	2,708	59.9
不動産投信指数先物取引	8,607	3,237	37.6	8,620	3,792	44.0

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	買付額
	百万円
投資信託証券	697

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	754千円
うち利害関係人への支払額（B）	288千円
（B）／（A）	38.2%

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

○組入資産の明細

（2020年１月27日現在）

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	口数	口数	評価額	比率
	千口	千口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	－	0.318	44,806	0.1
サンケイリアルエステート投資法人	－	0.449	60,839	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	0.862	1	719,271	2.0
ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	2	3	492,801	1.4
森ヒルズリート投資法人	2	3	655,224	1.9
産業ファンド投資法人	3	3	670,613	1.9
アドバンス・レジデンス投資法人	2	2	1,011,452	2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1	1	415,630	1.2
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	1	879,417	2.5
ＧＬＰ投資法人	6	7	1,052,278	3.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.989	1	461,031	1.3
日本プロロジスリート投資法人	3	4	1,328,763	3.8
星野リゾート・リート投資法人	0.394	0.471	262,347	0.7
Ｏｎｅリート投資法人	0.378	0.482	173,279	0.5
イオンリート投資法人	2	3	502,670	1.4
ヒューリックリート投資法人	2	2	518,240	1.5
日本リート投資法人	0.837	1	504,510	1.4
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	15	19	463,940	1.3
日本ヘルスケア投資法人	0.119	0.15	32,250	0.1
積水ハウス・リート投資法人	6	9	828,166	2.4
トーセイ・リート投資法人	0.499	0.674	91,327	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	0.95	1	323,725	0.9
ヘルスケア＆メディカル投資法人	0.343	0.66	93,720	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.519	0.62	74,028	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人	7	9	1,861,695	5.3
いちごホテルリート投資法人	0.453	0.513	67,818	0.2
ラサールロジポート投資法人	1	2	482,640	1.4
スターアジア不動産投資法人	0.805	1	118,926	0.3
マリモ地方創生リート投資法人	0.223	0.305	38,796	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.443	0.762	406,908	1.2
大江戸温泉リート投資法人	0.418	0.526	48,392	0.1
さくら総合リート投資法人	0.561	0.67	64,320	0.2
投資法人みらい	0.698	3	212,608	0.6
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.608	0.726	107,302	0.3
三菱地所物流リート投資法人	0.274	0.609	225,634	0.6
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.26	0.582	84,099	0.2
ザイマックス・リート投資法人	0.239	0.449	62,276	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	0.388	0.878	113,086	0.3
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.401	0.478	61,231	0.2
日本ビルファンド投資法人	2	2	2,571,426	7.3
ジャパンリアルエステイト投資法人	2	3	2,423,385	6.9
日本リテールファンド投資法人	4	5	1,344,330	3.8
オリックス不動産投資法人	5	6	1,431,977	4.1
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	952,074	2.7
プレミア投資法人	2	2	436,735	1.2
東急リアル・エステート投資法人	1	2	442,390	1.3

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	口数	口数	評価額	比率
	千口	千口	千円	%
グローバル・ワン不動産投資法人	1	2	308,381	0.9
ユナイテッド・アーバン投資法人	5	6	1,355,250	3.9
森トラスト総合リート投資法人	1	2	433,330	1.2
インヴィンシブル投資法人	9	13	737,285	2.1
フロンティア不動産投資法人	0.882	1	493,451	1.4
平和不動産リート投資法人	1	1	267,799	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	1	2	588,402	1.7
福岡リート投資法人	1	1	297,625	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	0.802	0.958	820,048	2.3
いちごオフィスリート投資法人	2	2	278,771	0.8
大和証券オフィス投資法人	0.598	0.714	612,612	1.7
阪急阪神リート投資法人	1	1	237,380	0.7
スターツプロシード投資法人	0.409	0.482	98,906	0.3
大和ハウスリート投資法人	3	4	1,180,541	3.4
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8	9	720,903	2.0
日本賃貸住宅投資法人	2	3	368,395	1.0
ジャパンエクセレント投資法人	2	2	556,280	1.6
エスコンジャパンリート投資法人（新）	－	0.014	1,920	0.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）	0.008	0.009	3,180	0.0
ヘルスケア＆メディカル投資法人（新）	0.119	－	－	－
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人（新）	0.045	0.03	15,823	0.0
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人（新）	－	0.044	5,532	0.0
合計 口数・金額	139	180	34,600,208	
合計 銘柄数<比率>	64	67	<98.4%>	

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) エスコンジャパンリート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、ＧＬＰ投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、Ｏｎｅリート投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、日本ヘルスケア投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、ヘルスケア＆メディカル投資法人、サムティ・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、ラサールロジポート投資法人、スターアジア不動産投資法人、マリモ地方創生リート投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、さくら総合リート投資法人、投資法人みらい、森トラスト・ホテルリート投資法人、三菱地所物流リート投資法人、ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、タカラレーベン不動産投資法人、伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本リ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、日本賃貸住宅投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係人である三菱ＵＦＪ信託銀行、三菱ＵＦＪ銀行、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。（各ファンドで開示されている2019年７月31日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載）

純資産総額の10％を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容

当期末において10％を超える銘柄の組入れはございません。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	不動産投信指数先物取引	東証ＲＥＩＴ指数	576	－

○有価証券の貸付及び借入の状況

（2020年１月27日現在）

区分	当期末
	数量
	口
貸付有価証券＜投資証券＞総口数	48,131

○投資信託財産の構成

（2020年１月27日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	34,600,208	77.3
コール・ローン等、その他	10,155,506	22.7
投資信託財産総額	44,755,714	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月27日現在)

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

＜注記事項＞
①期首元本額　8,070,576,759円
　期中追加設定元本額　4,019,694,773円
　期中一部解約元本額　2,434,617,378円
　また、１口当たり純資産額は、期末3.6432円です。

○損益の状況 (2019年１月29日～2020年１月27日)

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

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

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

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

［お知らせ］

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

ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド

《第14期》決算日2020年１月６日

［計算期間：2019年１月８日～2020年１月６日］

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

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）		投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
10期(2016年１月５日)	15,105	△ 1.8	39,610.16	△ 2.5	98.7	16,191
11期(2017年１月５日)	16,039	6.2	41,801.16	5.5	98.8	18,949
12期(2018年１月５日)	16,420	2.4	42,522.26	1.7	98.0	18,551
13期(2019年１月７日)	15,011	△ 8.6	38,602.62	△ 9.2	98.8	19,712
14期(2020年１月６日)	18,377	22.4	47,161.24	22.2	99.0	30,217

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

（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		ＳＡＰ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）		投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率	
	円	%		%	%
（期　首） 2019年１月７日	15,011	－	38,602.62	－	98.8
１月末	16,718	11.4	42,993.79	11.4	98.7
２月末	17,116	14.0	44,060.75	14.1	98.8
３月末	17,744	18.2	45,609.74	18.2	99.2
４月末	17,691	17.9	45,466.50	17.8	99.2
５月末	17,198	14.6	44,158.46	14.4	99.1
６月末	17,246	14.9	44,255.14	14.6	98.9
７月末	17,674	17.7	45,346.95	17.5	99.2
８月末	17,534	16.8	45,002.08	16.6	98.8
９月末	18,234	21.5	46,866.47	21.4	99.0
10月末	18,854	25.6	48,408.12	25.4	99.4
11月末	18,794	25.2	48,267.58	25.0	99.0
12月末	18,596	23.9	47,729.52	23.6	99.4
（期　末） 2020年１月６日	18,377	22.4	47,161.24	22.2	99.0

（注）騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

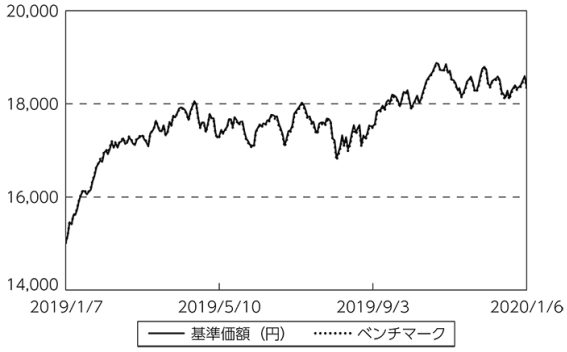
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ22.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

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

●投資環境について
◎外国ＲＥＩＴ市況（現地通貨ベース）
・外国ＲＥＩＴ市況は上昇しました。
・外国ＲＥＩＴ市況は、米国の堅調な企業決算内容などを受けて上昇しました。

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは22.2%の上昇になったため、カイ離は0.2%程度となりました。

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

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

（主なマイナス要因）
・取引要因によるものです。

○今後の運用方針
・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月８日～2020年１月６日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	3	0.016	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(3)	(0.016)	
(b) 有価証券取引税	2	0.012	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(2)	(0.012)	
(c) その他費用	5	0.030	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(5)	(0.027)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(1)	(0.003)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	10	0.058	
期中の平均基準価額は、17,648円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年１月８日～2020年１月６日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 － (33)	千アメリカドル － (17)	百株 0.54	千アメリカドル 1

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

投資信託証券

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

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

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

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	PARK HOTELS & RESORTS INC	8 (7)	217 (164)	－	－
	EQUITY RESIDENTIAL	16	1,314	6	587
	COLONY CAPITAL INC	19	101	－	－
	INVITATION HOMES INC	63	1,778	3	104
	JBG SMITH PROPERTIES	7	310	1	75
	GLADSTONE LAND CORP	1	18	－	－
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	4	52	－	－
	INFRAREIT INC	1	22	－ (7)	－ (157)
	VICI PROPERTIES INC	32	724	－	－
	AMERICOLD REALTY TRUST	32	1,030	2	76
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2	50	－	－
	SPIRIT MTA REIT	2	24	9	85
	RETAIL VALUE INC	0.697 (0.064)	22 (1)	－	－
	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	19	390	5	94
	FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	2	26	－	－
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.58	58	－	－
	SAFEHOLD INC	0.795	32	－	－
	AMERICAN FINANCE TRUST INC	12	173	－	－
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	10	236	－	－
	ARA US HOSPITALITY TRUST	97	85	－	－
	COREPOINT LODGING INC	7	75	－	－
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4	79	－	－
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	202	114	－	－
	PRIME US REIT	111	108	－	－
	HOST HOTELS & RESORTS INC	31	567	10	181
	LIBERTY PROPERTY TRUST	6	360	－	－
	PUBLIC STORAGE	6	1,491	1	303
	SIMON PROPERTY GROUP INC	13	2,162	3	500
	VORNADO REALTY TRUST	7	474	4	276
	KIMCO REALTY CORP	17	349	3	75
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	1,246	0.983	204
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	6 (0.823)	320 (41)	2 (0.811)	134 (－)
	小計	1,667 (△ 33)	56,999 (249)	168 (31)	7,899 (615)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.8	32	－	－
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6	215	3	100
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5	256	－	－
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	4	54	－	－
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	0.8	24	－	－
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5	127	－	－
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1	53	－	－

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

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

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

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

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

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

○株式売買比率

（2019年１月８日～2020年１月６日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月８日～2020年１月６日）

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

（2020年１月６日現在）

外国株式

銘　　柄		期首(前期末)	当期末			業　種　等
		株　数	株　数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
FIVE STAR SENIOR LIVING INC		－	32	11	1,276	ヘルスケア機器・サービス
合　計	株数・金額	－	32	11	1,276	
	銘柄数＜比率＞	－	1	－	＜0.0%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の＜　＞内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		442	619	1,846	147,976	0.5
小計	口数・金額	6,786	9,120	14,011	1,122,753	
	銘柄数＜比率＞	30	30	－	＜3.7%＞	
(韓国)				千韓国ウォン		
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		－	5	39,300	3,643	0.0
小計	口数・金額	－	5	39,300	3,643	
	銘柄数＜比率＞	－	1	－	＜0.0%＞	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD		28	34	710	22,074	0.1
小計	口数・金額	28	34	710	22,074	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.1%＞	
合計	口数・金額	21,385	27,814	－	29,909,549	
	銘柄数＜比率＞	306	305	－	＜99.0%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率および合計欄の＜　＞内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2020年１月６日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	1,276	0.0
投資証券	29,909,549	98.3
コール・ローン等、その他	505,182	1.7
投資信託財産総額	30,416,007	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（29,993,436千円）の投資信託財産総額（30,416,007千円）に対する比率は98.6%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月６日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　13,131,720,547円
　期中追加設定元本額　4,475,915,257円
　期中一部解約元本額　1,164,873,706円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.8377円です。

○損益の状況 (2019年１月８日～2020年１月６日)

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

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

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

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

ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	404,395円
合計	16,442,762,098円

［お知らせ］

①より適正な水準となるように信託財産留保額を引き下げるため、信託財産留保額を変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（2019年10月26日）

②当期末付で設定来のベンチマークを「課税前配当込み指数」から「税引き後配当込み指数」に変更しました。