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４期（決算日：2021年１月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s」は、去る１月26日に第４期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG
三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先
お客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
4期(2021年1月26日)	12,476	0	12.4	126.00	13.2	87.7	2.9	2.9	0.0	5.6	17

(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	%		%	%	%	%	%	%
2020年１月27日	11,102	－	111.30	－	85.7	3.6	3.0	0.0	7.0
１月末	10,907	△ 1.8	109.40	△ 1.7	86.1	2.8	2.9	0.0	5.9
２月末	10,146	△ 8.6	101.80	△ 8.5	87.4	2.3	3.1	0.0	5.8
３月末	8,730	△21.4	87.80	△21.1	86.9	3.3	2.9	0.0	6.0
４月末	9,366	△15.6	94.40	△15.2	87.3	2.8	2.8	0.0	5.8
５月末	9,736	△12.3	98.10	△11.9	85.1	5.0	2.9	0.0	5.9
６月末	10,025	△ 9.7	101.10	△ 9.2	87.4	2.5	2.9	0.0	5.7
７月末	10,212	△ 8.0	103.00	△ 7.5	87.5	2.4	2.9	0.0	5.9
８月末	10,857	△ 2.2	109.50	△ 1.6	87.6	3.4	2.9	0.0	5.7
９月末	10,581	△ 4.7	106.80	△ 4.0	86.7	3.1	2.9	0.0	5.7
10月末	10,488	△ 5.5	105.90	△ 4.9	87.6	2.1	3.0	0.0	5.7
11月末	11,551	4.0	116.70	4.9	87.3	2.9	3.3	0.0	5.6
12月末	11,870	6.9	119.90	7.7	87.3	3.3	2.9	0.0	5.7
（期末）									
2021年１月26日	12,476	12.4	126.00	13.2	87.7	2.9	2.9	0.0	5.6

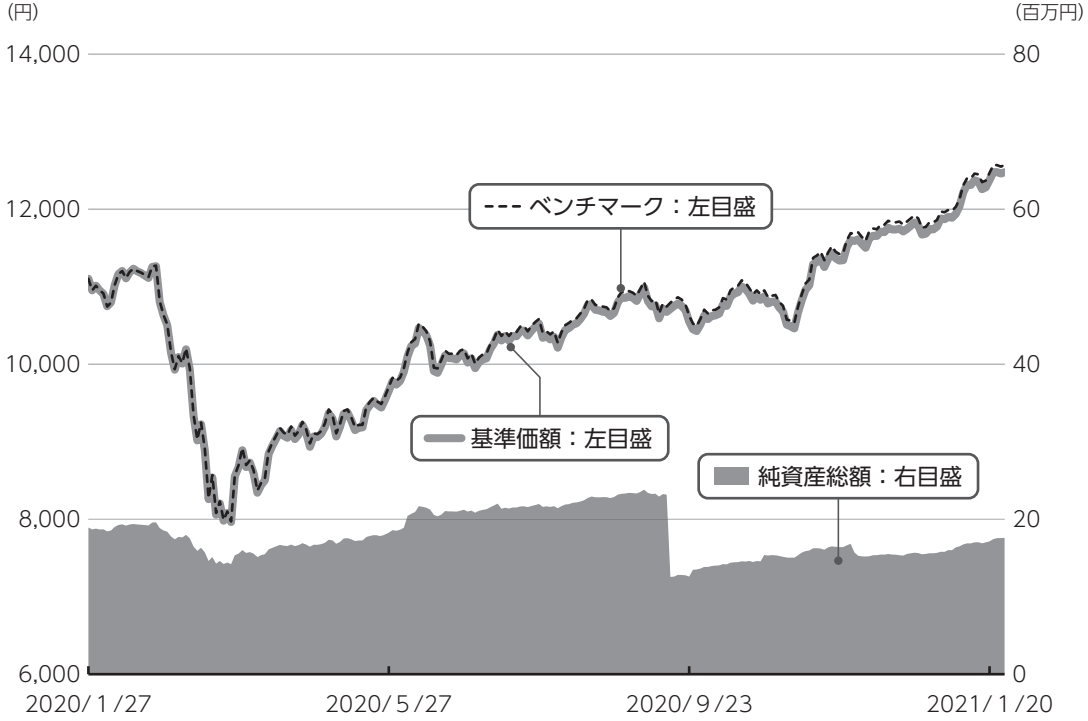
（注）騰落率は期首比。
（注）株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
（注）株式先物比率には、不動産投信指数先物を含めて表示しております。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
（注）「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第４期：2020年１月28日～2021年１月26日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第４期首	11,102円
第４期末	12,476円
既払分配金	0円
騰落率	12.4%

※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12.4％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（13.2％）を0.8％下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

主に新興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	－13.9％	3.0％
新興国株式インデックスマザーファンド	22.3％	30.4％
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	－14.8％	2.0％
新興国債券インデックスマザーファンド	－4.2％	2.0％
ＴＯＰＩＸマザーファンド	11.2％	27.7％
外国株式インデックスマザーファンド	11.5％	32.9％
日本債券インデックスマザーファンド	－1.1％	0.5％
外国債券インデックスマザーファンド	4.3％	0.5％

第４期：2020年１月28日～2021年１月26日

投資環境について

▶ 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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

▶ 外国株式市況

外国株式市況は上昇しました。

新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念などを受けて外国株式市況は下落する局面もありましたが、感染拡大後の潤沢な政府支援などが好感され外国株式市況は上昇しました。

▶ 新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念などを受けて新興国株式市況は下落する局面もありましたが、感染拡大後の潤沢な政府支援などが好感され新興国株式市況は上昇しました。

▶ 国内債券市況

国内債券市況は下落しました。

国内債券市況は、期の序盤に新型コロナウイルスによる景気後退懸念などから上昇しましたが、すぐに財政拡張による国債増発懸念などから下落しました。その後はもみ合いで推移し、期を通して見ると国内債券市況は下落しました。

▶ 外国債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

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

▶ 新興国債券市況

新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、新型コロナウイルスの感染拡大とそれにともなう影響が警戒されるなど、市場参加者のリスク回避姿勢が強まり下落しましたが、その後は各国での金融および財政支援策等を受け、経済回復期待や投資家心理の改善等を背景に上昇し、期を通じてみると上昇しました。

▶ 国内ＲＥＩＴ市況

国内ＲＥＩＴ市況は下落しました。

新型コロナウイルスの世界的流行を受け、国内ＲＥＩＴ市況は下落しました。

▶外国ＲＥＩＴ市況

外国ＲＥＩＴ市況は下落しました。

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

▶為替市況

米ドル、香港ドルは円に対して下落、ユーロは円に対して上昇しました。

為替市況は、期首に比べて4.9％の円高・米ドル安、4.6％の円高・香港ドル安、4.7％の円安・ユーロ高となりました。
世界景気の減速懸念が高まったことなどから、多くの新興国通貨は対円で売られました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 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	27.0%	28.0%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	33.0%	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	2.0%	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%	3.0%

▶ ＴＯＰＩＸマザーファンド

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

▶ 外国株式インデックスマザーファンド

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

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

▶ 新興国株式インデックスマザーファンド

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

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

▶ 日本債券インデックスマザーファンド

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

▶ 外国債券インデックスマザーファンド

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

▶新興国債券インデックスマザーファンド

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークである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。

▶MUAM G－ＲＥＩＴマザーファンド

ベンチマークであるＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

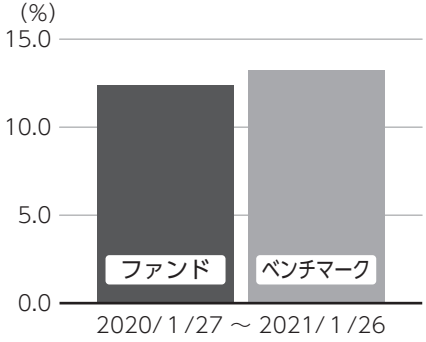
▶ ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s

基準価額の騰落率は12.4％の上昇となり、ベンチマークの騰落率（13.2％）を0.8％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	△1.0％程度
その他	0.2％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：組入要因によるものです。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶ 外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因※によるものです。

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

主なマイナス要因：組入要因によるものです。

▶ 新興国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：銘柄選択要因によるものです。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：ありません。

▶外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：評価時価差異要因※によるものです。

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

▶新興国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因※によるものです。

※留保金等が含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶MUAM G－ＲＥＩＴマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因※によるものです。

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

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきました。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項　目	第４期 2020年１月28日～2021年１月26日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	2,952

（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。

2020年１月28日～2021年１月26日

１万口当たりの費用明細

項目	当期 金額（円）	当期 比率（%）	項目の概要
(a)信託報酬	57	0.542	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（期中の日数÷年間日数）
（投信会社）	(25)	(0.238)	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	0.018	(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)	(0.015)	
(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	0.018	(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)	(0.017)	
(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	5	0.045	(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）	(1)	(0.005)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	66	0.623	

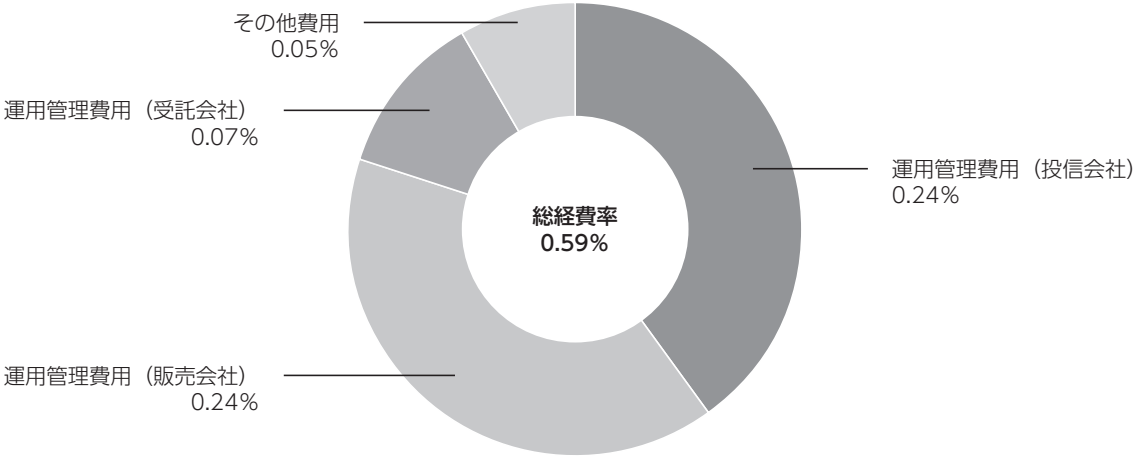
期中の平均基準価額は、10,482円です。

（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0.59％**です。



（注）費用は、１万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
（注）各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
（注）各比率は、年率換算した値です。
（注）前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

（2020年１月28日～2021年１月26日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		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	331	469	417	673
新興国株式インデックスマザーファンド	1,409	3,352	1,881	4,756
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	108	304	102	299
新興国債券インデックスマザーファンド	207	274	220	294
ＴＯＰＩＸマザーファンド	2,268	3,969	2,653	4,709
外国株式インデックスマザーファンド	1,245	3,641	1,588	4,842
日本債券インデックスマザーファンド	102	137	108	146
外国債券インデックスマザーファンド	33	74	39	87

○株式売買比率

（2020年１月28日～2021年１月26日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	新興国株式インデックスマザーファンド	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	65,183,873千円	564,091,408千円	635,291,979千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	123,157,670千円	327,925,976千円	523,370,020千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.52	1.72	1.21

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2020年１月28日～2021年１月26日）

利害関係人との取引状況

＜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	17,212	778	4.5	3,611	21	0.6

平均保有割合　0.0%

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

＜新興国株式インデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	85,927	2,713	3.2	45,084	1,205	2.7

平均保有割合　0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該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	19,708	7,595	38.5	7,821	3,853	49.3
不動産投信指数先物取引	14,004	11,154	79.6	13,572	10,223	75.3

平均保有割合　0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該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	%
為替先物取引	1,194	268	22.4	1,188	291	24.5
為替直物取引	20,352	4,411	21.7	12,151	2,733	22.5

平均保有割合　0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該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	340,894	27,112	8.0	223,196	7,861	3.5
貸付有価証券(株式)	563,098	246,699	43.8	539,549	242,116	44.9

平均保有割合　0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該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	482,630	439,205	91.0	363,666	333,455	91.7

平均保有割合　0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該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	364,188	128,992	35.4	659,555	143,082	21.7

平均保有割合　0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該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	49,019	26,037	53.1	25,077	15,758	62.8

平均保有割合　0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該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	5,134	3,607	6,883

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	2,718	3,331	1,847

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド＞

種　　類	買　　付　　額
	百万円
投資信託証券	732

＜ＴＯＰＩＸマザーファンド＞

種　　類	買　　付　　額
	百万円
株式	266

＜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	11,300

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項　　目	当　　期
売買委託手数料総額（A）	3千円
うち利害関係人への支払額（B）	0.025千円
（B）／（A）	0.8%

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

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

（2020年１月28日～2021年１月26日）

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

○組入資産の明細

（2021年１月26日現在）

親投資信託残高

銘　　柄	期首(前期末)	当　期　末	
	口　数	口　数	評　価　額
	千口	千口	千円
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	406	320	526
新興国株式インデックスマザーファンド	2,135	1,663	5,347
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	106	112	350
新興国債券インデックスマザーファンド	264	250	346
ＴＯＰＩＸマザーファンド	2,723	2,338	4,873
外国株式インデックスマザーファンド	1,993	1,650	5,790
日本債券インデックスマザーファンド	70	64	87
外国債券インデックスマザーファンド	44	39	87

○有価証券の貸付及び借入の状況

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

○投資信託財産の構成

（2021年１月26日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド	526	3.0
新興国株式インデックスマザーファンド	5,347	30.3
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	350	2.0
新興国債券インデックスマザーファンド	346	2.0
ＴＯＰＩＸマザーファンド	4,873	27.6
外国株式インデックスマザーファンド	5,790	32.8
日本債券インデックスマザーファンド	87	0.5
外国債券インデックスマザーファンド	87	0.5
コール・ローン等、その他	228	1.3
投資信託財産総額	17,634	100.0

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

（注）新興国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（196,611,579千円）の投資信託財産総額（197,189,115千円）に対する比率は99.7%です。

（注）新興国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（37,764,052千円）の投資信託財産総額（37,807,817千円）に対する比率は99.9%です。

（注）外国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（807,295,099千円）の投資信託財産総額（809,447,745千円）に対する比率は99.7%です。

（注）外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（176,879,184千円）の投資信託財産総額（177,090,000千円）に対する比率は99.9%です。

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年１月26日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	17,634,677
コール・ローン等	224,823
MUAM G-REITマザーファンド(評価額)	526,586
新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	5,347,882
東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド(評価額)	350,083
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	346,290
ＴＯＰＩＸマザーファンド(評価額)	4,873,431
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	5,790,636
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	87,421
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	87,525
(B) 負債	49,901
未払解約金	2,097
未払信託報酬	47,533
その他未払費用	271
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	17,584,776
元本	14,095,199
次期繰越損益金	3,489,577
(D) 受益権総口数	14,095,199口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	12,476円

＜注記事項＞

①期首元本額　17,045,492円
　期中追加設定元本額　10,821,952円
　期中一部解約元本額　13,772,245円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.2476円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月26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	2,255,743
売買益	2,725,836
売買損	△ 470,093
(C) 信託報酬等	△ 98,550
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	2,157,185
(E) 前期繰越損益金	682,942
(F) 追加信託差損益金	649,450
(配当等相当額)	(1,310,099)
(売買損益相当額)	(△ 660,649)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	3,489,577
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	3,489,577
追加信託差損益金	649,450
(配当等相当額)	(1,321,652)
(売買損益相当額)	(△ 672,202)
分配準備積立金	2,840,127

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

②分配金の計算過程

項　　目	2020年１月28日～ 2021年１月26日
費用控除後の配当等収益額	290,721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	1,866,464円
収益調整金額	1,321,652円
分配準備積立金額	682,942円
当ファンドの分配対象収益額	4,161,779円
１万口当たり収益分配対象額	2,952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。

ＴＯＰＩＸマザーファンド

《第19期》決算日2020年３月25日

［計算期間：2019年３月26日～2020年３月25日］

「ＴＯＰＩＸマザーファンド」は、３月25日に第19期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指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）（配当込み）	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
15期(2016年３月25日)	13,743	△12.5	1,905.92	△12.5	98.2	1.9	220,801
16期(2017年３月27日)	15,678	14.1	2,174.27	14.1	98.8	1.0	296,391
17期(2018年３月26日)	17,551	11.9	2,433.96	11.9	98.1	1.1	275,958
18期(2019年３月25日)	16,939	△ 3.5	2,348.27	△ 3.5	99.3	1.4	245,020
19期(2020年３月25日)	15,695	△ 7.3	2,174.58	△ 7.4	95.4	4.2	244,088

(注) 東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）（ＴＯＰＩＸといいます）の指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、東京証券取引所の知的財産権であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利およびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。
(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
	円	%		%	%	%
（期　首） 2019年３月25日	16,939	－	2,348.27	－	99.3	1.4
３月末	17,277	2.0	2,395.21	2.0	98.2	1.8
４月末	17,564	3.7	2,434.82	3.7	98.4	1.6
５月末	16,424	△ 3.0	2,275.96	△ 3.1	98.2	1.4
６月末	16,872	△ 0.4	2,338.89	△ 0.4	97.0	3.1
７月末	17,025	0.5	2,360.18	0.5	99.4	0.7
８月末	16,451	△ 2.9	2,280.58	△ 2.9	99.4	0.6
９月末	17,444	3.0	2,418.29	3.0	98.2	1.8
10月末	18,316	8.1	2,539.02	8.1	98.8	1.4
11月末	18,674	10.2	2,588.40	10.2	98.9	1.2
12月末	18,945	11.8	2,625.91	11.8	97.0	3.1
2020年１月末	18,539	9.4	2,569.77	9.4	99.5	0.5
２月末	16,635	△ 1.8	2,305.76	△ 1.8	98.4	0.7
（期　末） 2020年３月25日	15,695	△ 7.3	2,174.58	△ 7.4	95.4	4.2

（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

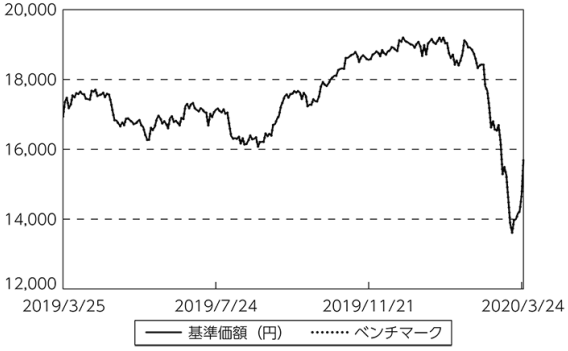
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ7.3%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－7.4%）を0.1%上回りました。

基準価額等の推移



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

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

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは7.4%の下落になったため、カイ離は0.1%程度となりました。

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
（主なプラス要因）
・組入要因によるものです。

（主なマイナス要因）
・取引要因によるものです。

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３月26日～2020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)	(0.001)	
（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、17,480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３月26日～2020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	184,176 (3,018)	357,845,063 (－)	174,898	331,603,466

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

新株予約権証券

	買付		売付	
	証券数	金額	証券数	金額
	証券	千円	証券	千円
国内	－	－	176,300	705
	(176,300)	(－)		

(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
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	71,009	64,308	－	－

○株式売買比率

(2019年３月26日～2020年３月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	689,448,530千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	285,158,518千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	2.41

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年３月26日～2020年３月25日)

利害関係人との取引状況

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

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　　付　　額	売　　付　　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	6,260	5,730	3,861

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　　付　　額
	百万円
株式	30

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項　　目	当　　期
売買委託手数料総額（A）	6,392千円
うち利害関係人への支払額（B）	119千円
（B）／（A）	1.9%

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

○組入資産の明細

（2020年３月25日現在）

国内株式

銘柄	期首(前期末) 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	4.7	5.5	14,646
日本水産	146	157.6	77,696
マルハニチロ	21.1	22.8	51,596
カネコ種苗	4.4	4.8	5,716
サカタのタネ	17.8	18.8	57,340
ホクト	12.2	12	22,416
ホクリヨウ	2	2.4	1,500
鉱業（0.2%）			
住石ホールディングス	31.4	31.8	3,943
日鉄鉱業	3.3	3.6	15,516
三井松島ホールディングス	6.1	6.1	5,746
国際石油開発帝石	585.6	632.2	397,148
石油資源開発	21	20.6	37,347
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7.1	7.7	11,342
建設業（2.7%）			
ヒノキヤグループ	3.1	3.9	5,534
ショーボンドホールディングス	10.4	24.5	98,122
ミライト・ホールディングス	41.1	46.8	62,010
タマホーム	7	8.5	9,877
サンヨーホームズ	2.1	1.4	957
日本アクア	3.5	6.3	3,817
ファーストコーポレーション	4.5	4.8	2,208
ベステラ	2.8	2.7	2,419
ＴＡＴＥＲＵ	17.8	32.5	3,802
キャンディル	－	1.4	610
スペースバリューホールディングス	17.8	19.2	8,064
ダイセキ環境ソリューション	2.8	3	2,583
第一カッター興業	1.8	1.9	3,030
明豊ファシリティワークス	－	3.8	1,926
安藤・間	93.4	93.8	65,191
東急建設	42.8	46.2	26,657
コムシスホールディングス	51.8	55.9	149,420
ミサワホーム	11.5	－	－
ビーアールホールディングス	11.9	17.2	8,531
高松コンストラクショングループ	9.1	9.8	23,637
東建コーポレーション	4.5	4.9	38,808
ソネック	1.5	1.6	1,073
ヤマウラ	5.6	6.8	6,167
大成建設	119.9	121.4	404,262
大林組	361.2	363.9	341,338
清水建設	368.4	369.3	320,183
飛島建設	10.3	10.4	10,868
長谷工コーポレーション	150.6	140.9	172,602
松井建設	13.3	14.3	9,266
錢高組	1.5	1.6	4,952
鹿島建設	282.3	285.7	326,269
不動テトラ	8.3	9.5	12,160
大末建設	4.3	4.2	3,397
鉄建建設	7.3	7.9	17,585
西松建設	26	28	61,208
三井住友建設	86.9	87.9	43,510
大豊建設	8.1	8.2	18,802
前田建設工業	85.9	91.2	72,321
佐田建設	7.8	7.8	2,480
ナカノフドー建設	9.2	9.9	3,672
奥村組	19.8	19.7	47,398
東鉄工業	14.5	15.6	44,709
イチケン	2.2	2.6	3,694
富士ピー・エス	3.7	5.4	2,592
淺沼組	4.3	4.1	17,609
戸田建設	140	151.1	95,041
熊谷組	17.2	16.9	43,872
青木あすなろ建設	5.9	－	－
北野建設	2.5	2.2	5,482
植木組	1.5	1.6	3,843
矢作建設工業	16.4	16.1	13,105
ピーエス三菱	12.7	12	6,624

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	23	24.8	7,291
大東建託	42.9	43.6	454,312
新日本建設	14.3	15.5	12,725
ＮＩＰＰＯ	31.9	30.1	65,226
東亜道路工業	2.3	2.3	7,003
前田道路	37.7	38.5	88,781
日本道路	3.3	3.5	22,890
東亜建設工業	10.5	11.3	16,385
日本国土開発	－	26.6	13,805
若築建設	6.1	6.5	8,333
東洋建設	44.1	40.8	17,707
五洋建設	143.2	144.3	77,922
世紀東急工業	17.5	17.5	14,560
福田組	3.9	4.2	16,464
住友林業	85.4	92.2	126,129
日本基礎技術	12.4	12.2	4,623
巴コーポレーション	15	16.2	5,378
大和ハウス工業	333.5	360.1	974,970
ライト工業	23.1	20.8	25,979
積水ハウス	368.8	398.2	735,873
日特建設	10.3	9.5	6,973
北陸電気工事	5.8	6.3	6,224
ユアテック	19.3	20.8	12,188
日本リーテック	－	6.8	10,744
四電工	1.8	2	4,630
中電工	15.5	14.7	32,251
関電工	54.8	51.8	44,030
きんでん	80.1	86.5	134,075
東京エネシス	12.4	12.1	8,978
トーエネック	3.4	3.7	11,858
住友電設	8.3	10.3	21,630
日本電設工業	20.5	20	41,700
協和エクシオ	47.2	55.2	124,089
新日本空調	10.1	9.6	19,104
九電工	23.8	25.5	71,247
三機工業	27.2	26.2	31,544
日揮ホールディングス	103.7	112	100,688
中外炉工業	3.4	3.9	5,814
ヤマト	10.8	11.6	6,786

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
太平電業	8.1	8.8	20,169
高砂熱学工業	30.4	31.6	50,718
三晃金属工業	1.5	1.6	3,360
朝日工業社	2.5	2.4	7,560
明星工業	21.8	23.5	17,484
大氣社	16.4	17.7	55,047
ダイダン	8.1	8.7	24,499
日比谷総合設備	11.5	11.7	21,481
東芝プラントシステム	26.1	－	－
フィル・カンパニー	－	1.6	4,395
ＯＳＪＢホールディングス	53.2	57.4	13,833
東洋エンジニアリング	14.2	15.3	5,263
千代田化工建設	86.9	－	－
レイズネクスト	21.6	19.5	23,088
食料品（4.1%）			
日本製粉	35.8	34.1	55,037
日清製粉グループ本社	121.9	131.6	231,089
日東富士製粉	0.8	0.8	4,584
昭和産業	9.9	10.7	33,651
鳥越製粉	9.6	10.3	8,106
中部飼料	13.2	14.2	18,332
フィード・ワン	72.5	78.2	12,042
東洋精糖	1.6	2	2,200
日本甜菜製糖	6.1	6.1	10,888
三井製糖	8.5	10.2	20,665
塩水港精糖	11.7	12.6	2,658
日新製糖	5.1	5.5	11,088
森永製菓	27.1	27.3	115,069
中村屋	2.8	3	11,865
江崎グリコ	32.4	34.5	149,040
名糖産業	5.2	5.6	7,784
井村屋グループ	4.6	5	9,100
不二家	6	6.5	12,668
山崎製パン	88.2	87.3	172,766
第一屋製パン	1.9	2	1,800
モロゾフ	1.8	2	10,160
亀田製菓	6.7	6.6	30,393
寿スピリッツ	11.4	11.2	55,440
カルビー	49.2	53.1	146,821

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
森永乳業	21.6	21.5	78,367
六甲バター	7.9	7.7	9,748
ヤクルト本社	79.9	80.1	496,620
明治ホールディングス	76.4	77	549,780
雪印メグミルク	26	28	63,280
プリマハム	15.2	18.2	41,459
日本ハム	46.6	44.5	167,765
林兼産業	3.6	3.9	2,074
丸大食品	11.5	12.4	23,684
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	9.7	9.3	20,311
柿安本店	－	4	8,924
伊藤ハム米久ホールディングス	69.5	75	47,325
サッポロホールディングス	39.4	39.7	78,447
アサヒグループホールディングス	225.9	243.9	890,235
キリンホールディングス	488	494	1,123,109
宝ホールディングス	80.8	86.3	69,298
オエノンホールディングス	30.6	30.7	11,635
養命酒製造	3.3	3.6	6,976
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールデ	82.6	81.7	179,740
サントリー食品インターナショナル	72.2	77.9	318,611
ダイドーグループホールディングス	6.1	6	21,000
伊藤園	32.8	35.4	177,000
キーコーヒー	10.6	11.4	26,790
ユニカフェ	3	3	2,682
ジャパンフーズ	1.5	1.7	2,080
日清オイリオグループ	13.9	15	49,950
不二製油グループ本社	26.3	28.4	72,618
かどや製油	1.2	1.3	5,174
Ｊ－オイルミルズ	5.6	6	25,740
キッコーマン	71.2	83.8	387,994
味の素	238.3	257.2	480,835
キユーピー	60.1	64.9	135,705
ハウス食品グループ本社	41.2	43.6	145,188
カゴメ	43.2	44.2	119,251
焼津水産化学工業	5.2	5.6	5,342
アリアケジャパン	9.9	10.6	69,430
ピエトロ	1.4	1.5	2,472
エバラ食品工業	2.6	2.8	6,300
やまみ	－	0.7	1,169

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ニチレイ	56	55.5	143,911
東洋水産	55.5	59.9	283,027
イートアンド	3.7	4	7,172
大冷	1.2	1.5	2,787
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2.9	6.4	5,977
日清食品ホールディングス	45.9	49.5	412,335
永谷園ホールディングス	5.7	5.7	12,540
一正蒲鉾	4.2	4.5	4,153
フジッコ	11.7	12.6	24,544
ロック・フィールド	11.6	12.5	17,375
日本たばこ産業	623	672.5	1,387,367
ケンコーマヨネーズ	6	6.5	13,325
わらべや日洋ホールディングス	7.1	7.6	12,129
なとり	6	6.5	11,485
イフジ産業	1.9	2	1,552
ピックルスコーポレーション	2.6	2.5	5,440
北の達人コーポレーション	42.4	40.7	22,995
ユーグレナ	46	49.7	35,038
ミヨシ油脂	4.1	4.5	4,405
理研ビタミン	5.1	5.5	23,045
繊維製品（0.5%）			
片倉工業	12.9	16.5	15,196
グンゼ	7.1	8.3	30,502
東洋紡	44.6	44.9	52,712
ユニチカ	30.8	33.3	8,957
富士紡ホールディングス	5.5	5.5	15,114
倉敷紡績	10	11.3	26,069
シキボウ	5.5	6	6,090
日本毛織	34.6	37.4	32,425
ダイトウボウ	17	18.4	2,042
トーア紡コーポレーション	4.5	4.5	1,912
ダイドーリミテッド	12.6	14.9	3,203
帝国繊維	11.8	12.7	24,701
帝人	85.9	92.7	162,595
東レ	816.7	822.9	404,043
サカイオーベックス	2.6	3	5,262
住江織物	3.1	2.5	4,377
日本フエルト	6	6.4	2,848
イチカワ	1.5	1.6	2,110

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日東製網	1.2	1.3	1,623
アツギ	8.7	9.4	5,931
ダイニック	4.3	4.4	3,000
セーレン	25.9	27.9	34,763
ソトー	4.2	4.5	4,275
東海染工	1.4	1.6	1,822
小松マテーレ	17.3	18.7	12,884
ワコールホールディングス	30.7	29.7	71,131
ホギメディカル	13.1	13	40,690
レナウン	30.4	29.2	2,277
クラウディアホールディングス	2.6	2.8	1,041
ＴＳＩホールディングス	38.8	38.1	15,316
マツオカコーポレーション	3.3	3.3	5,520
ワールド	10.3	16.1	27,031
三陽商会	6.3	5.9	8,602
ナイガイ	3.8	4.1	1,693
オンワードホールディングス	63.2	68.3	32,032
ルックホールディングス	3.8	3.9	3,088
キムラタン	51.9	59.3	1,304
ゴールドウイン	9.5	20.6	132,252
デサント	23.3	22.2	28,438
キング	5.6	5.4	2,797
ヤマトインターナショナル	6.9	6.9	1,849
パルプ・紙（0.2%）			
特種東海製紙	6.7	7.2	25,380
王子ホールディングス	473.9	475.1	254,653
日本製紙	50.4	50.3	77,763
三菱製紙	17.1	12.9	4,515
北越コーポレーション	69.8	75.4	30,310
中越パルプ工業	4.5	4.8	6,220
巴川製紙所	3.5	3.4	2,278
大王製紙	51.3	49.8	72,210
阿波製紙	2.7	2.9	1,284
レンゴー	108.6	107.4	83,879
トーモク	6.5	7	10,227
ザ・パック	8	8.6	29,369
化学（7.3%）			
クラレ	177.6	179	194,752
旭化成	749	753.3	567,762

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
共和レザー	6.5	6.2	4,265
昭和電工	69.9	80.9	180,487
住友化学	828.7	835	274,715
住友精化	5.1	5	13,370
日産化学	64.6	63.6	230,232
ラサ工業	3.7	4	5,120
クレハ	9.7	9.7	44,911
多木化学	3.1	3.3	12,078
テイカ	8.6	8.3	11,777
石原産業	20.2	20.4	11,424
片倉コープアグリ	3.1	2.9	3,335
日東エフシー	6.6	－	－
日本曹達	16.6	16.8	43,663
東ソー	162.7	175.7	222,611
トクヤマ	30.3	32.8	71,012
セントラル硝子	22.9	23.2	45,773
東亜合成	66.1	71.3	65,382
大阪ソーダ	11.3	11.6	29,000
関東電化工業	25	27	21,762
デンカ	41.4	41.5	96,902
信越化学工業	185.5	195.2	2,119,872
日本カーバイド工業	3.6	3.8	3,845
堺化学工業	7	7.3	12,745
第一稀元素化学工業	8.6	12.3	9,655
エア・ウォーター	86.2	105.7	145,654
大陽日酸	86.7	109.2	168,604
日本化学工業	3.6	3.5	8,141
東邦アセチレン	1.6	1.7	2,176
日本パーカライジング	57.5	57.3	60,967
高圧ガス工業	16.7	18	12,420
チタン工業	1.3	1.4	2,398
四国化成工業	17.7	17.5	17,587
戸田工業	2.2	2.6	3,393
ステラ　ケミファ	6.2	6.2	15,376
保土谷化学工業	3.7	4.2	12,339
日本触媒	17.7	17.6	91,520
大日精化工業	8.7	10.1	21,199
カネカ	28	29.4	79,497
三菱瓦斯化学	108.3	105.7	133,287

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井化学	95.6	103.2	224,150
ＪＳＲ	105.7	105.9	194,008
東京応化工業	18.1	19.5	75,952
大阪有機化学工業	9.7	10.5	15,267
三菱ケミカルホールディングス	703.8	759.8	516,360
ＫＨネオケム	16	20	31,340
ダイセル	163.5	155.5	123,622
住友ベークライト	18.2	17.9	44,087
積水化学工業	230.1	244.4	344,604
日本ゼオン	94.9	102.5	84,460
アイカ工業	31.6	34.1	99,640
宇部興産	53.2	57.4	100,564
積水樹脂	17.4	20.5	41,451
タキロンシーアイ	22.8	24.6	14,784
旭有機材	7.3	6.4	8,742
日立化成	48.7	48.9	224,206
ニチバン	5.5	6	9,282
リケンテクノス	28.7	28.6	10,839
大倉工業	5.4	5.4	8,375
積水化成品工業	15.7	15.2	8,542
群栄化学工業	2.7	2.6	6,237
タイガースポリマー	5.5	6	2,706
ミライアル	3	4	3,664
ダイキアクシス	3.7	4	3,112
ダイキョーニシカワ	22.2	24	12,504
竹本容器	3.8	4.1	2,722
森六ホールディングス	5.7	6.1	9,363
日本化薬	67	70.3	72,479
カーリットホールディングス	11.2	12.1	5,687
日本精化	8.5	9.1	12,476
扶桑化学工業	10.7	11.5	34,419
トリケミカル研究所	2.3	2.5	19,950
ＡＤＥＫＡ	51.9	52.3	67,467
日油	40.6	42.8	150,014
新日本理化	19	18.8	2,970
ハリマ化成グループ	8.7	9.4	9,691
花王	261	277.9	2,382,158
第一工業製薬	3.9	4.2	15,834
石原ケミカル	2.7	3.1	5,707

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日華化学	3.5	3.8	2,751
ニイタカ	1.6	1.8	4,300
三洋化成工業	7.1	6.8	27,132
有機合成薬品工業	8.1	8.7	2,053
大日本塗料	11.9	12.8	10,496
日本ペイントホールディングス	86.9	93.8	483,070
関西ペイント	118.3	127.7	261,529
神東塗料	8.3	8.9	1,370
中国塗料	34.6	32.4	27,313
日本特殊塗料	7.9	8.5	6,647
藤倉化成	14.2	15.3	7,344
太陽ホールディングス	8.7	8.3	33,366
ＤＩＣ	47.6	48	111,840
サカタインクス	23	24.8	21,204
東洋インキＳＣホールディングス	22.3	24	47,136
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8.2	8.8	6,476
富士フイルムホールディングス	223.3	222.5	1,092,030
資生堂	213.6	230.6	1,497,285
ライオン	149.7	150.9	307,081
高砂香料工業	7.4	7.3	13,519
マンダム	24.2	26.1	52,539
ミルボン	13.3	15.5	82,150
ファンケル	47.9	47	117,970
コーセー	18.2	21.8	296,698
コタ	5.1	6.1	8,826
シーズ・ホールディングス	2.9	－	－
シーボン	1.3	1.5	3,480
ポーラ・オルビスホールディングス	45.9	49.5	102,217
ノエビアホールディングス	6.8	11.1	59,052
アジュバンコスメジャパン	2.4	2.6	2,407
エステー	7.7	7.5	11,580
アグロ　カネショウ	4.4	3.6	5,032
コニシ	19	19.1	25,574
長谷川香料	12.8	15.4	29,044
星光ＰＭＣ	7.2	6.6	4,224
小林製薬	30.1	32.5	293,800
荒川化学工業	9.6	10.4	12,168
メック	7.4	8	11,336
日本高純度化学	3	3.2	7,792

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
タカラバイオ	28.1	30.4	62,897
ＪＣＵ	13.9	14.1	33,219
新田ゼラチン	6.7	7.3	4,066
ＯＡＴアグリオ	1.5	2	1,990
デクセリアルズ	27.7	29.9	21,258
アース製薬	8.1	8.7	45,849
北興化学工業	11	11.9	6,283
大成ラミック	3.5	3.8	9,450
クミアイ化学工業	44.4	48	36,240
日本農薬	25.7	20.7	8,217
アキレス	7.8	8	11,456
有沢製作所	16.9	18.3	14,969
日東電工	81.2	80.1	406,107
レック	11.5	12.4	13,106
三光合成	9.2	13.3	3,551
きもと	18.3	19.7	2,679
藤森工業	9.6	10.4	27,934
前澤化成工業	7.4	7.4	7,274
未来工業	5.8	6.2	11,891
ウェーブロックホールディングス	2.2	4	2,132
ＪＳＰ	6.3	6.8	9,649
エフピコ	8.9	12.8	87,040
天馬	7.4	7.7	13,598
信越ポリマー	19.3	20.8	16,868
東リ	26.8	28.9	7,571
ニフコ	43.1	42.6	86,307
バルカー	8.7	9.4	16,299
ユニ・チャーム	227.9	223.7	821,426
ショーエイコーポレーション	0.6	1.3	967
医薬品（6.3%）			
協和キリン	134.7	116.7	273,078
武田薬品工業	938.4	965.5	3,229,597
アステラス製薬	991.1	1,020.8	1,691,465
大日本住友製薬	79.7	86	122,464
塩野義製薬	140.6	148.4	747,490
田辺三菱製薬	112.4	－	－
わかもと製薬	12.8	13.8	3,312
あすか製薬	13.3	13.2	14,190
日本新薬	28.1	30.4	228,000

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビオフェルミン製薬	1.8	2	4,558
中外製薬	112.1	121	1,395,130
科研製薬	19.4	19.9	97,410
エーザイ	128.7	138.9	1,054,667
ロート製薬	55.1	59.6	183,270
小野薬品工業	253.9	266.5	609,219
久光製薬	31.8	30.7	152,732
持田製薬	8.1	16.1	66,895
参天製薬	203.8	216.2	394,565
扶桑薬品工業	3.8	4.1	7,974
日本ケミファ	1.4	1.5	3,487
ツムラ	33.3	36	93,996
日医工	27.6	32.9	42,770
キッセイ薬品工業	19	20.5	50,922
生化学工業	20.9	22.5	24,030
栄研化学	18.9	20.4	37,332
日水製薬	4.5	4.9	6,125
鳥居薬品	5.8	7.3	18,257
ＪＣＲファーマ	7.6	8.2	71,750
東和薬品	5.2	14.8	32,412
富士製薬工業	7.3	7.9	9,061
沢井製薬	22.1	23.8	135,660
ゼリア新薬工業	21.3	21.1	41,166
第一三共	307.6	332.1	2,399,090
キョーリン製薬ホールディングス	23.7	25.6	49,792
大幸薬品	4.8	4.7	20,492
ダイト	6.3	6.9	19,389
大塚ホールディングス	204.8	221.1	873,345
大正製薬ホールディングス	24.1	24.5	155,330
ペプチドリーム	53.6	58.7	238,028
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	90.8	98	6,076
昭和シェル石油	51.5	－	－
ニチレキ	13.7	13.7	18,851
ユシロ化学工業	5.6	6.5	7,559
ビーピー・カストロール	3.8	4.1	4,879
富士石油	26.1	31	6,231
ＭＯＲＥＳＣＯ	3.9	4.2	3,603
出光興産	103.9	130.5	346,347

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シンニッタン	16.5	17.8	4,165
新家工業	2.4	2.6	3,049
非鉄金属（0.7%）			
大紀アルミニウム工業所	17.5	18.9	10,962
日本軽金属ホールディングス	289.6	290.4	51,400
三井金属鉱業	28.7	31	59,055
東邦亜鉛	5.9	5.9	7,864
三菱マテリアル	70.2	75.8	170,777
住友金属鉱山	145.6	146.7	350,759
ＤＯＷＡホールディングス	24.8	29	86,072
古河機械金属	17.5	20.4	22,970
エス・サイエンス	47	50.7	1,723
大阪チタニウムテクノロジーズ	12.3	11.9	11,888
東邦チタニウム	19	20.5	13,940
ＵＡＣＪ	16.1	17.4	28,918
ＣＫサンエツ	2	2.4	6,624
古河電気工業	30.7	35.6	71,627
住友電気工業	397.4	429.1	502,261
フジクラ	128.4	138.6	43,104
昭和電線ホールディングス	12.3	13.3	14,191
東京特殊電線	1.4	1.7	4,309
タツタ電線	21.1	22.7	10,669
カナレ電気	1.8	1.9	2,831
平河ヒューテック	4.4	4.3	3,870
リョービ	13.1	14.1	18,033
アーレスティ	13.1	15	5,535
アサヒホールディングス	20	20.1	47,817
金属製品（0.5%）			
稲葉製作所	6	6.5	7,865
宮地エンジニアリンググループ	3.2	3.5	5,943
トーカロ	27.4	31.9	30,655
アルファＣｏ	3.7	4	3,884
ＳＵＭＣＯ	117.5	137.4	194,970
川田テクノロジーズ	2.4	2.3	12,604
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2.1	3.2	6,896
信和	4.3	4.9	3,934
東洋製罐グループホールディングス	67.7	73.1	95,687
ホッカンホールディングス	5.4	6.3	10,508
コロナ	5.9	6.3	6,111

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
横河ブリッジホールディングス	19.8	21.3	38,318
駒井ハルテック	2	2.1	3,103
高田機工	1	1	2,360
三和ホールディングス	109.8	110.1	93,034
文化シヤッター	31.3	33.8	26,735
三協立山	14.7	14.8	15,332
アルインコ	8.4	8.3	7,669
東洋シヤッター	2.6	2.8	1,708
ＬＩＸＩＬグループ	156.8	169.3	224,999
日本フイルコン	8.1	8.8	3,986
ノーリツ	23.7	23.8	26,037
長府製作所	10.8	11.7	26,617
リンナイ	18.9	22.3	163,013
ダイニチ工業	5.7	6.2	3,862
日東精工	14.7	15.8	7,236
三洋工業	1.4	1.5	2,550
岡部	21.5	23.3	16,426
ジーテクト	11.7	14.2	16,159
中国工業	1.6	－	－
東プレ	19.8	21.4	26,578
高周波熱錬	20.5	22.1	14,563
東京製綱	6.5	8.2	4,920
サンコール	6	6.4	2,822
モリテック　スチール	8.3	8.9	2,429
パイオラックス	17	17	25,483
エイチワン	10.4	11.3	5,898
日本発條	105.9	123.1	89,863
中央発條	1.3	1.4	3,547
アドバネクス	1.4	1.6	2,188
立川ブラインド工業	4.7	5	5,155
三益半導体工業	9.5	9	15,426
機械（5.0%）			
日本ドライケミカル	2.9	2.8	3,987
日本製鋼所	32.2	34.8	43,813
三浦工業	46	49.7	174,695
タクマ	38.8	38.9	44,501
ツガミ	23.9	23.8	18,183
オークマ	13.5	13.4	50,451
東芝機械	12	13	29,055

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アマダホールディングス	164	145.9	132,623
アイダエンジニアリング	29.5	30	21,210
滝澤鉄工所	3.3	3.6	3,938
ＦＵＪＩ	31.8	49.3	81,838
牧野フライス製作所	12.5	13.5	41,580
オーエスジー	52.4	53	79,341
ダイジェット工業	1.2	1.3	1,560
旭ダイヤモンド工業	27.9	30.1	14,508
ＤＭＧ森精機	67.3	72.6	74,560
ソディック	23.2	27	17,820
ディスコ	14.4	15.5	345,340
日東工器	5.8	6.3	10,514
日進工具	3.1	3.4	8,330
パンチ工業	7.4	10.4	4,409
冨士ダイス	4.7	5	3,100
豊和工業	5.9	6.3	3,937
ＯＫＫ	4.4	4.7	2,185
石川製作所	2.6	2.8	3,455
東洋機械金属	7.6	8.2	3,304
津田駒工業	2.3	2.2	1,782
エンシュウ	2.8	2.9	2,734
島精機製作所	14.7	18.5	28,786
オプトラン	10.4	12.8	33,510
ＮＣホールディングス	3.4	3.5	1,897
イワキポンプ	3.5	5.5	4,647
フリュー	8.5	11.2	9,968
ヤマシンフィルタ	18.5	24.9	18,550
日阪製作所	13.1	14.2	10,706
やまびこ	20.6	22.2	17,271
平田機工	5	5.4	25,191
ペガサスミシン製造	9.9	11.6	4,152
マルマエ	2.9	4.4	3,058
タツモ	3.3	5.4	5,842
ナブテスコ	58.5	67.6	172,650
三井海洋開発	11.3	12.2	16,775
レオン自動機	10.4	11.3	13,119
ＳＭＣ	31.5	36.4	1,668,576
ヤマハモーターロボティクスホールディング	8	9.3	6,909
ホソカワミクロン	3.7	4	18,480

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユニオンツール	4.6	4.3	10,805
オイレス工業	14.9	14.8	19,654
日精エー・エス・ビー機械	3.1	3.9	12,577
サトーホールディングス	12.8	16.4	34,702
技研製作所	7.4	10.1	36,713
日本エアーテック	3.3	3.6	2,829
カワタ	2.2	3.4	2,482
日精樹脂工業	8.9	9.6	9,254
オカダアイヨン	3.6	3.6	3,279
ワイエイシイホールディングス	4.2	4.9	2,077
小松製作所	486.7	525.6	1,000,479
住友重機械工業	61.5	66.4	138,975
日立建機	43.1	46.5	114,111
日工	2.9	15.9	9,810
巴工業	4.6	4.9	9,172
井関農機	10.7	11.6	13,061
ＴＯＷＡ	9.2	11.7	8,927
丸山製作所	2.3	2.5	2,697
北川鉄工所	4.8	5.2	8,320
ローツェ	4.7	5.1	16,243
タカキタ	3.7	4	1,872
クボタ	575.9	615.7	809,953
荏原実業	3.1	2.9	6,107
三菱化工機	3.7	4	6,560
月島機械	21.3	21.4	27,220
帝国電機製作所	7.5	9.6	12,163
東京機械製作所	4.2	4.7	1,132
新東工業	25.5	27.5	20,295
澁谷工業	9.4	10.1	23,745
アイチ　コーポレーション	18.6	20	12,980
小森コーポレーション	29.1	29.4	22,285
鶴見製作所	8.4	9	17,604
住友精密工業	1.8	1.7	3,665
日本ギア工業	—	3.5	850
酒井重工業	2	2.2	5,381
荏原製作所	47.6	48	100,512
石井鐵工所	1.6	1.5	3,399
西島製作所	11	11.7	9,231
北越工業	11.1	12	12,336

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	146.7	147.8	2,075,112
オルガノ	3.9	4.2	22,848
トーヨーカネツ	4	5	10,165
栗田工業	58.2	62.8	158,130
椿本チエイン	14.1	16.6	41,599
大同工業	5.1	5.5	3,668
木村化工機	8.9	9.6	4,406
アネスト岩田	16.7	18	16,092
ダイフク	59.2	59.3	380,113
サムコ	3	3.2	5,344
加藤製作所	5.5	6.3	7,534
油研工業	1.8	2	3,092
タダノ	51.9	56	43,512
フジテック	39.1	42.2	60,303
ＣＫＤ	29.9	32.3	47,739
キトー	8.1	8.8	8,984
平和	30	32.4	66,128
理想科学工業	9.5	10.2	16,258
ＳＡＮＫＹＯ	26.9	25.8	81,915
日本金銭機械	11.9	12.8	7,296
マースグループホールディングス	6.8	7.4	12,535
フクシマガリレイ	6.6	7.2	24,264
オーイズミ	4.5	4.9	1,857
ダイコク電機	4.9	5.3	6,312
竹内製作所	18	19.4	26,675
アマノ	30.7	30.4	76,334
ＪＵＫＩ	15	16.1	9,257
サンデンホールディングス	13.1	15.2	5,988
蛇の目ミシン工業	9.8	10.6	3,243
マックス	16.5	17.7	28,408
グローリー	29.8	29.8	72,563
新晃工業	10	10.8	15,087
大和冷機工業	15.5	16.8	15,405
セガサミーホールディングス	106.6	115.1	150,090
日本ピストンリング	3.9	4.2	5,329
リケン	5	5.4	14,558
ＴＰＲ	14.5	15.6	19,921
ツバキ・ナカシマ	16.3	23.7	16,590
ホシザキ	31.4	33.9	308,829

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	8.8	9.5	5,101
日本精工	220.8	218.5	162,564
ＮＴＮ	231	268.6	56,674
ジェイテクト	103.1	111.3	91,377
不二越	10	10.8	31,568
日本トムソン	31.9	34.4	13,209
ＴＨＫ	67	67.5	155,452
ユーシン精機	8.3	9	6,075
前澤給装工業	4.2	4.2	8,295
イーグル工業	13.3	14.3	10,796
前澤工業	7.2	7.7	2,340
日本ピラー工業	10.9	11.7	14,274
キッツ	43.6	47	28,764
マキタ	130.8	151.3	500,046
日立造船	85.2	92	32,752
三菱重工業	180.1	194.5	576,011
ＩＨＩ	82.6	83.6	127,322
スター精密	18.3	17.9	19,922
電気機器（14.2%）			
日清紡ホールディングス	59.7	77.3	55,192
イビデン	65.8	71.1	162,108
コニカミノルタ	234.9	253.5	121,680
ブラザー工業	140	141.7	236,213
ミネベアミツミ	199.5	215.4	354,763
日立製作所	483.9	557.6	1,788,223
三菱電機	1,074.9	1,160.4	1,544,492
富士電機	69.8	69.9	172,583
東洋電機製造	4.2	4.2	4,872
安川電機	124.6	124.9	384,067
シンフォニアテクノロジー	14.9	15	14,325
明電舎	21.3	21.3	34,506
オリジン	2.9	3.1	4,333
山洋電気	5.2	5.6	23,016
デンヨー	9.9	9.9	18,582
東芝テック	13.5	14.5	50,387
芝浦メカトロニクス	1.9	2.1	5,420
マブチモーター	29.7	32.1	103,522
日本電産	129.3	139.6	1,563,520
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5.8	7	1,694

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	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	6.6	6,652
東光高岳	5.4	6.5	6,233
ダブル・スコープ	15.7	18.3	8,967
宮越ホールディングス	4	4.3	2,377
ダイヘン	11.8	12.7	36,156
田淵電機	14.9	－	－
ヤーマン	15.6	18.9	11,793
ＪＶＣケンウッド	82.1	94.5	18,994
ミマキエンジニアリング	9.6	10.4	4,232
第一精工	4.5	4.7	8,638
日新電機	25.2	27.2	23,963
大崎電気工業	21.4	23.1	12,104
オムロン	114.2	104	612,560
日東工業	17.2	17	29,427
ＩＤＥＣ	14.4	16.8	22,646
正興電機製作所	1.9	2.7	2,546
不二電機工業	1.2	1.4	1,538
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	38.6	38.7	60,642
サクサホールディングス	2.7	2.7	3,960
メルコホールディングス	4.5	4	8,404
テクノメディカ	2.4	2.6	4,737
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	－	1.9	921
日本電気	139.1	140.8	558,272
富士通	103.6	111.9	1,066,183
沖電気工業	46.6	47.1	50,302
岩崎通信機	5	5.1	4,131
電気興業	5.6	5.6	14,134
サンケン電気	12.6	12.7	27,635
ナカヨ	2.1	2.2	3,229
アイホン	6.1	6.6	9,893
ルネサスエレクトロニクス	111.4	554.6	240,141
セイコーエプソン	133.4	144	181,440
ワコム	77.8	78	24,024
アルパック	21.4	21.3	59,448
アクセル	4.5	4.8	2,812
ＥＩＺＯ	9.9	9	27,810
ジャパンディスプレイ	254.2	335.4	16,434
日本信号	27.4	29.5	32,922
京三製作所	23.1	27.2	12,403

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
能美防災	14.2	15.3	28,978
ホーチキ	6.8	8.4	10,458
星和電機	4.3	5.7	3,117
エレコム	10	12.8	47,744
パナソニック	1,228	1,325.9	1,117,601
シャープ	106.6	134.3	155,922
アンリツ	69.2	74.7	149,400
富士通ゼネラル	32.8	31.5	59,346
ソニー	721	733.9	4,770,350
ＴＤＫ	56.2	56	501,200
帝国通信工業	4.7	5.1	5,865
タムラ製作所	41.4	38.8	15,636
アルプスアルパイン	111.9	102.7	114,715
池上通信機	3.4	3.7	3,189
日本電波工業	9.7	10.5	3,612
鈴木	5.8	5.7	3,534
日本トリム	2	1.6	4,681
ローランド　ディー．ジー．	5.5	6.4	7,692
フォスター電機	12.6	12.2	13,432
ＳＭＫ	3	3	6,876
ヨコオ	7.7	7.5	17,992
ティアック	7.7	8.3	1,369
ホシデン	31.6	31.7	23,870
ヒロセ電機	15.4	18	199,980
日本航空電子工業	24.6	26.6	34,260
ＴＯＡ	11.5	12.4	9,647
マクセルホールディングス	23.1	25	29,675
古野電気	13.8	14.9	12,083
ユニデンホールディングス	3.2	3.2	5,884
スミダコーポレーション	9.2	8.9	6,141
アイコム	5.9	6.4	16,083
リオン	4.9	4.9	11,000
本多通信工業	9.2	9.9	3,920
船井電機	10.9	11.7	5,370
横河電機	107.6	106.5	141,112
新電元工業	3.8	4.1	10,389
アズビル	69.4	73.2	198,079
東亜ディーケーケー	5.3	5.7	5,158
日本光電工業	47.4	48	159,600

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
チノー	3.7	4	4,880
共和電業	11.2	12.1	4,598
日本電子材料	4.2	4.6	4,025
堀場製作所	21.3	23	125,350
アドバンテスト	73.3	86.3	394,391
小野測器	5	4.8	2,328
エスペック	9.5	10.3	17,314
キーエンス	52.8	105.2	3,634,660
日置電機	5.6	6.1	18,208
シスメックス	83.8	82.9	597,957
日本マイクロニクス	17.4	20.2	15,816
メガチップス	8.5	10.8	17,031
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6.3	6	14,160
澤藤電機	1.3	1.4	1,960
原田工業	3.3	5.5	4,999
コーセル	13.7	15.4	14,322
イリソ電子工業	9.8	9.7	31,185
オプテックスグループ	18.9	19	19,570
千代田インテグレ	4.5	5.4	8,969
アイ・オー・データ機器	4	3.7	3,034
レーザーテック	22	51	270,300
スタンレー電気	76	81.6	178,622
岩崎電気	4.2	4.5	5,566
ウシオ電機	65.2	67.4	75,151
岡谷電機産業	7.6	9.1	2,857
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9.9	10.7	2,931
エノモト	2.2	3.5	2,926
日本セラミック	10.9	11.8	22,384
遠藤照明	5.4	5.9	3,315
古河電池	7.7	8.3	4,681
双信電機	5.2	5.6	1,993
山一電機	7.8	8.4	12,339
図研	7	7.5	15,727
日本電子	21.2	22.9	59,173
カシオ計算機	95.1	102.7	153,331
ファナック	102.1	110.3	1,694,759
日本シイエムケイ	27.4	27.3	12,312
エンプラス	4.9	5.9	13,457
大真空	3.9	4.2	6,274

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ローム	52	51.5	336,810
浜松ホトニクス	77.1	83.2	348,192
三井ハイテック	11.9	12.8	14,681
新光電気工業	36.1	39	40,404
京セラ	163.8	163.3	1,050,508
太陽誘電	47.8	51.6	150,052
村田製作所	112.8	340.9	1,878,359
ユーシン	15	－	－
双葉電子工業	17.6	18.3	18,318
北陸電気工業	4	4.7	4,230
ニチコン	33.8	39.3	26,291
日本ケミコン	7.6	8.8	11,325
ＫＯＡ	16.2	17.5	15,697
市光工業	16.1	17.3	8,131
小糸製作所	64.4	69.5	243,597
ミツバ	19.8	21.3	9,734
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	18.6	20.1	85,123
キヤノン電子	9.9	12.2	19,032
キヤノン	578.7	624.7	1,548,631
リコー	323.2	295.2	260,956
象印マホービン	20	34	52,258
ＭＵＴＯＨホールディングス	1.5	1.6	2,638
東京エレクトロン	71.7	77.4	1,638,558
輸送用機器（7.6%）			
トヨタ紡織	37.6	33.8	44,379
芦森工業	2.2	2.4	2,311
ユニプレス	20.8	22.5	22,725
豊田自動織機	87	93.9	487,341
モリタホールディングス	18.8	20.3	33,312
三櫻工業	13.6	14.7	10,907
デンソー	236.7	255.5	928,231
東海理化電機製作所	28.3	30.6	42,962
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	38.8	41.9	24,218
川崎重工業	83.6	90.3	156,489
名村造船所	32.3	37.3	7,609
サノヤスホールディングス	14.1	14.1	2,115
日本車輌製造	3.9	4.2	10,697
三菱ロジスネクスト	12.8	15.4	13,952
近畿車輛	1.6	1.7	1,973

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日産自動車	1,267.7	1,368.6	548,945
いすゞ自動車	339.8	336.2	258,874
トヨタ自動車	1,197.9	1,294.8	8,958,721
日野自動車	134.2	144.9	91,576
三菱自動車工業	397.9	429.5	143,023
エフテック	7.5	8.1	3,912
レシップホールディングス	3.8	4.5	1,930
ＧＭＢ	2.1	2.1	1,266
ファルテック	1.9	2	1,392
武蔵精密工業	26.1	25.8	20,923
日産車体	21	22.7	19,136
新明和工業	48.3	31.3	37,528
極東開発工業	21.4	21.6	25,488
日信工業	19.7	21.9	47,544
トピー工業	8.8	9.5	12,549
ティラド	3.9	4.2	5,724
曙ブレーキ工業	59	63.7	10,255
タチエス	18.2	19	19,076
ＮＯＫ	57.8	62.4	72,696
フタバ産業	29.9	32.3	14,954
ＫＹＢ	11.2	13	29,341
大同メタル工業	17.4	22.3	12,599
プレス工業	53.3	57.5	14,202
ミクニ	13.6	14.7	3,998
太平洋工業	22.5	24.3	23,498
ケーヒン	24.7	28.1	71,205
河西工業	13.2	15.7	8,964
アイシン精機	88.5	95.6	272,460
マツダ	337.4	341.4	223,617
今仙電機製作所	10	10.8	7,214
本田技研工業	906.8	913.7	2,370,137
スズキ	196.7	230	669,645
ＳＵＢＡＲＵ	333.7	360.3	811,215
安永	5.2	5.6	5,320
ヤマハ発動機	151.8	151.3	213,786
ショーワ	25.4	25.5	56,763
ＴＢＫ	12.8	13.8	6,872
エクセディ	14.6	15.8	26,164
豊田合成	34.7	37.5	73,875

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
愛三工業	16.8	18.2	8,845
盟和産業	1.6	1.8	1,580
日本プラスト	8.4	9.1	4,322
ヨロズ	10	10.8	11,804
エフ・シー・シー	19.3	19	30,875
シマノ	43.3	43.4	636,678
テイ・エス　テック	25	26.9	69,402
ジャムコ	5.4	5.8	4,239
精密機器（2.5%）			
テルモ	152.1	328.4	1,168,447
クリエートメディック	3.5	3.8	4,149
日機装	34.7	34.8	28,640
日本エム・ディ・エム	－	6.7	10,733
島津製作所	138.3	138.7	383,228
ＪＭＳ	9.9	9.8	7,193
クボテック	2.3	3	807
長野計器	8.4	8.4	6,526
ブイ・テクノロジー	2.5	5.4	18,603
東京計器	6.8	7.4	5,298
愛知時計電機	1.4	1.5	6,067
インターアクション	5	6.2	13,534
オーバル	10.5	10.4	2,444
東京精密	19.4	21	63,840
マニー	13.1	46.2	118,595
ニコン	187.3	187.8	193,997
トプコン	57.7	58.4	48,238
オリンパス	160.1	642.1	1,028,323
理研計器	9.5	10.2	22,083
タムロン	9.5	9.3	17,279
ＨＯＹＡ	216.4	231.7	2,080,434
シード	4.6	4.9	3,959
ノーリツ鋼機	8.5	7.8	7,269
エー・アンド・デイ	9.8	10.6	7,049
朝日インテック	45.6	98.5	262,207
シチズン時計	117.6	135.9	50,826
リズム時計工業	3.6	3.6	2,404
大研医器	8.5	8	4,408
メニコン	14.7	16.4	66,174
シンシア	1.6	1.2	384

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キムラユニティー	2.7	2.9	2,766
キユーソー流通システム	2.5	2.7	4,449
近鉄エクスプレス	19.2	23.3	37,163
東海運	5.8	6.3	1,656
エーアイテイー	6.6	7.8	5,467
内外トランスライン	3.2	3.9	4,208
日本コンセプト	2.8	3.5	4,637
情報・通信業（9.5%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	11.6	10.8	40,068
クロスキャット	2.1	3	2,391
システナ	37.6	40.6	58,545
デジタルアーツ	5.7	5.6	26,404
日鉄ソリューションズ	15.8	17.1	47,349
キューブシステム	5.6	6.1	3,531
エイジア	2.1	2.1	2,589
コア	4.5	4.8	5,644
ソリトンシステムズ	5.9	5	4,700
ソフトクリエイトホールディングス	4.6	5	8,210
ＴＩＳ	35.2	38	200,260
ネオス	3.8	4.6	2,364
電算システム	4	4.3	8,754
グリー	72.8	69.8	28,269
コーエーテクモホールディングス	21.6	23.3	59,018
三菱総合研究所	4.1	4.9	15,925
ボルテージ	1.9	2.7	837
電算	1.2	1.3	2,823
ＡＧＳ	6	6.4	4,736
ファインデックス	8.9	9.6	6,614
ブレインパッド	2	2.9	12,963
ＫＬａｂ	18.9	22	14,322
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	14	13.7	10,165
イーブックイニシアティブジャパン	1.7	1.6	1,896
ネクソン	268.7	324.4	545,640
アイスタイル	27	31.9	7,145
エムアップ	3.6	3.3	6,996
エイチーム	6.6	7.8	4,992
エニグモ	－	8.1	6,642
テクノスジャパン	8.9	8.8	3,176
ｅｎｉｓｈ	3.7	5.1	2,045

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コロプラ	30.2	37.3	31,182
オルトプラス	6.5	8.4	8,500
ブロードリーフ	52.3	56.4	26,169
クロス・マーケティンググループ	2.9	5	1,345
デジタルハーツホールディングス	4.8	6	4,392
システム情報	2.1	5.8	3,636
メディアドゥホールディングス	3.2	3.6	10,281
じげん	11.2	28.2	8,093
ブイキューブ	5.6	7	5,390
エンカレッジ・テクノロジ	1	1.9	1,187
サイバーリンクス	1.6	1.7	1,558
ディー・エル・イー	7.4	9.2	1,085
フィックスターズ	10.1	12.1	12,644
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5.6	5.5	4,680
オプティム	2.3	3	11,100
セレス	3.4	3.7	2,719
ＳＨＩＦＴ	－	3	20,670
ベリサーブ	0.9	－	－
ティーガイア	10.6	10.1	20,351
セック	1.7	1.7	4,681
日本アジアグループ	11.1	12	3,108
豆蔵ホールディングス	7.2	7.2	13,572
テクマトリックス	7.4	8	17,192
プロシップ	3	3.3	3,623
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	254.2	27.4	42,497
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	17.4	18.7	140,063
ザッパラス	5.5	4.9	1,582
システムリサーチ	1.4	3	4,410
インターネットイニシアティブ	17.2	16.8	52,080
さくらインターネット	12.6	12.2	5,416
ヴィンクス	3.5	3.2	2,304
ＧＭＯクラウド	2.3	2.1	3,666
ＳＲＡホールディングス	5.6	6	12,672
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	2.1	－	－
システムインテグレータ	3	3.6	2,217
朝日ネット	8.5	8.1	5,151
ｅＢＡＳＥ	3.1	6.8	10,234
アバント	3.8	8.1	6,698
アドソル日進	3.7	4	8,716

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フリービット	6.3	5.9	3,622
コムチュア	5.9	12.8	26,112
サイバーコム	1.9	2	3,038
アステリア	5.3	6.9	2,249
アイル	－	4.1	6,092
マークラインズ	3.6	5.7	8,943
メディカル・データ・ビジョン	9.4	8.7	5,550
ｇｕｍｉ	13.5	14.6	8,701
ショーケース	2.3	2.7	1,204
モバイルファクトリー	2.9	2.5	2,782
テラスカイ	0.6	4.1	10,606
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4.7	4.5	5,166
ＰＣＩホールディングス	1.8	2.3	4,103
パイプドHD	1.6	1.5	1,866
アイビーシー	1.7	2.1	1,696
ネオジャパン	2	2.1	1,890
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	0.7	1	1,860
ランドコンピュータ	1.2	1.7	1,723
ダブルスタンダード	0.7	1.5	5,257
オープンドア	5.2	5.6	4,732
マイネット	3.4	3.7	2,475
アカツキ	3.7	4	14,940
ベネフィットジャパン	0.6	0.8	1,114
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1.9	2.5	3,465
ＬＩＮＥ	32.1	24.2	122,694
カナミックネットワーク	1.6	6.9	3,450
ノムラシステムコーポレーション	0.9	2.5	847
チェンジ	1.4	2.3	7,084
シンクロ・フード	4.5	4.8	1,084
オークネット	5.5	7	7,560
セグエグループ	－	1.9	1,130
エイトレッド	0.8	1.4	1,769
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	11.5	11.5	5,175
マクロミル	18.7	21.7	14,604
ビーグリー	2	2.2	2,521
オロ	1	3	8,682
ユーザーローカル	－	0.8	1,902
テモナ	－	1.5	835
ニーズウェル	－	1.4	735

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サインポスト	－	1.8	2,626
ソルクシーズ	4.5	4.8	2,764
フェイス	4.2	4	2,344
プロトコーポレーション	3.3	10.2	9,241
ハイマックス	1.3	1.3	2,471
野村総合研究所	67.1	161.4	374,932
サイバネットシステム	8.7	8.1	4,584
ＣＥホールディングス	2.8	6.5	2,697
日本システム技術	1.7	1.8	1,737
インテージホールディングス	13.5	14.2	10,990
東邦システムサイエンス	3.1	3	2,595
ソースネクスト	40.9	54	15,822
インフォコム	8.7	12.5	28,362
ＨＥＲＯＺ	－	1.1	3,498
ラクスル	－	6.1	14,017
ＦＩＧ	9.3	12.3	2,829
システムサポート	－	1	2,124
イーソル	－	4.1	4,182
アルテリア・ネットワークス	8.8	12.6	22,604
東海ソフト	－	0.7	781
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	2.4	2.6	1,963
フォーカスシステムズ	7.1	7	5,096
クレスコ	3.2	6.9	9,549
フジ・メディア・ホールディングス	109.4	109.7	120,560
オービック	36.6	39.5	505,995
ジャストシステム	15	18.5	91,852
ＴＤＣソフト	9.2	10	7,490
Ｚホールディングス	687.7	1,563.7	537,912
トレンドマイクロ	56.2	50.6	267,168
ＩＤホールディングス	3	4.3	5,869
日本オラクル	21.4	23.1	210,210
アルファシステムズ	3.3	3.5	9,765
フューチャー	14.3	13.7	18,741
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7.5	7.4	6,948
ＳＢテクノロジー	4.5	4.1	8,200
トーセ	2.8	3.1	2,256
オービックビジネスコンサルタント	10.8	11.6	51,214
伊藤忠テクノソリューションズ	48.1	51.9	152,222
アイティフォー	12.8	13.8	7,935

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東計電算	1.6	1.7	6,443
エックスネット	1.9	1.8	1,693
大塚商会	57.1	61.6	264,572
サイボウズ	12.3	13.3	20,894
ソフトブレーン	8.3	6.7	2,633
電通国際情報サービス	6.5	7	26,145
ＡＣＣＥＳＳ	－	10.6	9,805
デジタルガレージ	20.5	20.5	67,650
ＥＭシステムズ	8.6	16	14,448
ウェザーニューズ	3.6	3.8	12,882
ＣＩＪ	8.2	7.8	6,068
ビジネスエンジニアリング	1.1	1.3	3,250
日本エンタープライズ	10.8	11.6	2,343
WOWOW	5.1	5.5	13,145
スカラ	7.4	7.6	3,435
インテリジェント　ウェイブ	－	5	2,505
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	8.9	9.7	3,453
ネットワンシステムズ	37.3	43.4	96,131
システムソフト	25	27	1,863
アルゴグラフィックス	4.5	9.7	33,319
マーベラス	16.1	17.4	9,831
エイベックス	18.1	19.6	18,639
日本ユニシス	32.9	35.6	98,825
兼松エレクトロニクス	5.7	6.2	20,770
東京放送ホールディングス	70	69.2	104,838
日本テレビホールディングス	96.8	95.1	123,630
朝日放送グループホールディングス	10.5	11.3	7,774
テレビ朝日ホールディングス	29	31.3	49,266
スカパーＪＳＡＴホールディングス	80.5	74.9	29,136
テレビ東京ホールディングス	8.6	9.3	20,525
日本ＢＳ放送	3.6	3.8	3,750
ビジョン	3.3	9.9	7,524
スマートバリュー	2.3	3	2,523
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4	4.3	5,878
ワイヤレスゲート	4.6	5.4	2,160
コネクシオ	7.5	6.4	8,448
日本通信	91	88.8	14,918
クロップス	1.9	2.1	1,134
日本電信電話	721.4	1,522.2	3,810,066
ＫＤＤＩ	929.5	848.6	2,751,161
ソフトバンク	838.7	1,034.9	1,468,523
光通信	12.4	11.7	218,790
ＮＴＴドコモ	757.4	841.2	2,676,698
エムティーアイ	12.2	11	5,643
ＧＭＯインターネット	38.4	44.9	77,632
ファイバーゲート	－	2.7	2,789
アイドママーケティングコミュニケーション	2.3	3.4	1,315
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	30.8	30.7	38,989
学研ホールディングス	3.5	3.8	27,550
ゼンリン	21	22.7	23,176
昭文社	4.9	5.2	2,012
インプレスホールディングス	8.7	9.4	1,269
アイネット	6	5.9	7,835
松竹	7	7.5	91,200
東宝	69.4	67.2	230,832
東映	4.4	4.3	58,222
エヌ・ティ・ティ・データ	280.8	303.2	331,397
ピー・シー・エー	1.3	1.5	4,447
ビジネスブレイン太田昭和	1.8	1.9	4,628
ＤＴＳ	11.8	25.4	48,285
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49.1	48.6	222,102
シーイーシー	11.3	12.2	16,006
カプコン	45.2	53.7	167,544
アイ・エス・ビー	2	2.2	3,293
ジャステック	6.1	7.2	7,142
ＳＣＳＫ	27.8	26.3	120,848
日本システムウエア	3.5	3.8	6,703
アイネス	13.4	11.2	14,772
ＴＫＣ	8.9	9.6	43,536
富士ソフト	15.7	14.6	50,662
ＮＳＤ	17.3	36.6	53,582
コナミホールディングス	43.1	41.4	140,139
福井コンピュータホールディングス	3.5	4.5	10,989
ＪＢＣＣホールディングス	8.3	7.7	12,304
ミロク情報サービス	10.5	10	24,200
ソフトバンクグループ	440.8	903.5	3,767,595
卸売業（5.1%）			
ホウスイ	0.8	0.9	637

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
高千穂交易	4.1	4.4	4,408
カワニシホールディングス	－	1	1,038
伊藤忠食品	2.6	2.8	12,012
エレマテック	4.9	10.7	7,960
ＪＡＬＵＸ	3	3.2	5,321
あらた	5.9	9.1	40,677
トーメンデバイス	1.6	1.7	5,822
東京エレクトロン　デバイス	3.8	4.1	9,364
フィールズ	9.3	8.8	2,772
双日	584.7	631.3	175,501
アルフレッサ　ホールディングス	117.6	127	247,142
横浜冷凍	27.7	32	28,512
神栄	1.5	1.6	713
ラサ商事	5.6	6	5,262
ラクーンホールディングス	5	4.6	2,267
アルコニックス	11.2	12.1	12,426
神戸物産	16	39.4	154,251
ハイパー	－	1.2	486
あい　ホールディングス	15.1	16.3	21,108
ディーブイエックス	4.1	4.1	3,763
ダイワボウホールディングス	9.6	9.7	52,089
マクニカ・富士エレホールディングス	29.3	27.3	38,356
ラクト・ジャパン	2.3	4.3	12,943
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19.9	21.5	23,499
八洲電機	8.2	8.8	7,198
メディアスホールディングス	6	6.5	4,933
レスターホールディングス	6.8	11.9	18,766
ジューテックホールディングス	2.4	2.6	2,810
大光	3.4	4.8	2,784
ＯＣＨＩホールディングス	3.1	3.3	4,867
ＴＯＫＡＩホールディングス	55.9	60.4	55,386
黒谷	1.8	2.6	860
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1.8	2	1,454
三洋貿易	5.3	11.5	9,947
ビューティガレージ	1.7	1.8	2,442
ウイン・パートナーズ	6.9	8.2	7,806
ミタチ産業	3.2	3.4	1,676
シップヘルスケアホールディングス	22.1	18.3	76,768
明治電機工業	3.3	3.6	4,899

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デリカフーズホールディングス	1.9	4	2,608
スターティアホールディングス	2.1	2.6	1,287
コメダホールディングス	24.5	24.9	42,255
ピーバンドットコム	－	0.9	757
アセンテック	－	0.9	2,473
富士興産	4.1	3.5	1,379
協栄産業	1.3	1.3	1,401
小野建	9.5	10.2	11,505
南陽	2.2	2.5	3,360
佐鳥電機	7.8	7.8	6,536
エコートレーディング	2.4	2.6	1,214
伯東	7.2	7	7,343
コンドーテック	8.2	8.8	8,104
中山福	6.1	6.6	3,399
ナガイレーベン	15.3	16.5	38,824
三菱食品	11.6	12.6	33,894
松田産業	7.7	8.3	10,366
第一興商	15.8	17	56,525
メディパルホールディングス	114.2	123.3	237,599
ＳＰＫ	2.3	2.4	6,220
萩原電気ホールディングス	3.9	4.2	9,219
アズワン	7.6	7.5	69,150
スズデン	3.7	4	4,936
尾家産業	3.4	3.3	4,167
シモジマ	6.5	7	8,743
ドウシシャ	10	10.8	13,197
小津産業	2.3	2.5	3,987
高速	6.3	6.8	8,799
たけびし	3.7	4	5,320
リックス	2.4	2.6	4,160
丸文	9.4	10.1	5,080
ハピネット	8.8	9.5	10,925
橋本総業ホールディングス	1.9	2.3	4,413
日本ライフライン	33.2	33.9	43,798
タカショー	5.1	5.6	2,324
エクセル	3.9	－	－
マルカ	3.4	4	7,524
ＩＤＯＭ	35.7	30.8	13,090
日本エム・ディ・エム	6.2	－	－

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
進和	6.3	6.8	11,777
エスケイジャパン	2.6	2.4	722
ダイトロン	4.8	4.8	6,835
シークス	13.5	14.5	12,078
田中商事	3.5	3.5	2,369
オーハシテクニカ	6	6.4	8,582
白銅	3.4	4.1	4,944
伊藤忠商事	740.5	799.4	1,839,019
丸紅	1,044	1,189.7	741,896
高島	1.7	1.8	2,799
長瀬産業	59.5	64.3	82,561
蝶理	6.8	7.3	11,636
豊田通商	118.2	127.6	348,092
三共生興	18	17.3	8,494
兼松	42.3	42.6	47,158
ツカモトコーポレーション	1.9	2.1	2,389
三井物産	872.2	1,004.6	1,658,594
日本紙パルプ商事	6	6.5	22,230
日立ハイテク	32.2	36.9	292,986
カメイ	13.8	14.9	13,857
東都水産	1.5	1.5	3,972
ＯＵＧホールディングス	1.7	1.8	4,626
スターゼン	3.9	4.2	18,837
山善	41.3	44.6	40,095
椿本興業	2.4	2.1	7,423
住友商事	626.1	721.1	971,321
内田洋行	4.9	4.9	16,831
三菱商事	742.9	802	1,976,128
第一実業	4.8	5.6	19,040
キヤノンマーケティングジャパン	30.3	32.7	68,016
西華産業	6	6.5	6,701
佐藤商事	9.5	9.4	8,290
菱洋エレクトロ	10.7	11.6	23,640
東京産業	10.5	10.3	5,098
ユアサ商事	10.8	10.8	30,834
神鋼商事	2.4	2.9	5,678
小林産業	6.3	6.8	1,761
阪和興業	18.4	21.4	38,605
正栄食品工業	5.6	7.4	24,827

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
カナデン	10.1	9.3	11,160
菱電商事	8.4	8.2	10,627
フルサト工業	5.8	6.3	9,273
岩谷産業	23.5	25.4	92,710
すてきナイスグループ	4.5	4.9	4,601
昭光通商	3.8	3.7	2,168
ニチモウ	1.6	1.8	2,973
極東貿易	3.3	3.3	4,669
イワキ	12.7	15	6,285
三愛石油	28.4	28.1	27,566
稲畑産業	25.4	25.2	29,358
ＧＳＩクレオス	2.8	2.8	2,895
明和産業	9.8	10.5	6,121
クワザワ	2.9	4.1	2,316
ヤマエ久野	－	6.1	7,472
ワキタ	22.6	24.4	22,936
東邦ホールディングス	31.3	36.7	81,290
サンゲツ	32	31.1	48,453
ミツウロコグループホールディングス	15.3	16.8	17,572
シナネンホールディングス	4.4	4.7	12,220
伊藤忠エネクス	23.4	25.3	21,353
サンリオ	32.7	32.1	51,263
サンワテクノス	6.4	8.1	7,047
リョーサン	11.7	12.6	30,265
新光商事	10	17.9	14,534
トーホー	4.8	5.2	7,982
三信電気	8.8	6.1	8,289
東陽テクニカ	12.2	13.2	12,144
モスフードサービス	13.9	15	39,540
加賀電子	10.5	11.4	19,551
ソーダニッカ	10.9	11.8	7,445
立花エレテック	7.8	8.4	12,247
フォーバル	4.6	5	5,835
ＰＡＬＴＡＣ	19.1	18.3	93,513
三谷産業	12.4	15	4,800
太平洋興発	4.2	4.5	3,141
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2.4	2.1	4,491
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	1	1,479
国際紙パルプ商事	18.5	27	6,210

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シュッピン	7.2	7.8	5,265
ネクステージ	16.3	16.3	11,703
ジョイフル本田	31	33.5	38,424
鳥貴族	3.5	3.8	7,068
キリン堂ホールディングス	4.2	4.5	7,488
ホットランド	5.5	7.6	7,584
すかいらーくホールディングス	98.7	128.1	229,811
ＳＦＰホールディングス	3.2	4.9	7,580
綿半ホールディングス	3.9	4.3	6,222
ヨシックス	1.7	1.9	4,111
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	30.8	33.2	31,174
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.3	5.3	2,554
ＢＥＥＮＯＳ	2.5	4.3	3,650
あさひ	8.8	8.5	9,826
日本調剤	3.7	3.5	11,620
コスモス薬品	4.7	5	114,500
トーエル	5.1	5.5	4,086
オンリー	1.8	1.9	1,187
セブン＆アイ・ホールディングス	443.7	447.1	1,609,560
薬王堂	4.6	－	－
クリエイト・レストランツ・ホールディング	28.5	61.4	47,646
ツルハホールディングス	23	24.8	322,400
サンマルクホールディングス	8.4	9	17,199
フェリシモ	2.3	2.5	2,415
トリドールホールディングス	13.1	14.1	35,687
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	9.5	10.3	2,904
ウイルプラスホールディングス	1.2	1.4	726
ＪＭホールディングス	4	5.8	11,484
サツドラホールディングス	1.6	1.7	3,148
デファクトスタンダード	0.7	－	－
アレンザホールディングス	5.7	5.7	3,961
串カツ田中ホールディングス	－	1.8	2,514
バロックジャパンリミテッド	8.6	7.9	5,269
クスリのアオキホールディングス	10.5	10.2	82,314
力の源ホールディングス	3	5.2	3,686
スシローグローバルホールディングス	11.6	12.5	90,750
ＬＩＸＩＬビバ	9	11.3	19,221
メディカルシステムネットワーク	11.2	11	4,620
はるやまホールディングス	5	5.3	4,409

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ノジマ	18.8	20.3	37,839
カッパ・クリエイト	14.8	16	23,008
ライトオン	8.9	8.5	4,522
ジーンズメイト	3.2	3.5	826
良品計画	15	151.7	186,287
三城ホールディングス	13.1	12.1	3,025
アドヴァン	16.2	17.4	17,904
アルビス	4	4.3	8,544
コナカ	13.5	13.5	4,171
ハウス　オブ　ローゼ	1.3	1.4	2,349
Ｇ－７ホールディングス	3.1	6.7	13,252
イオン北海道	10.6	15.1	9,784
コジマ	15.6	19.6	7,487
ヒマラヤ	3.3	4	2,880
コーナン商事	13.9	16.2	33,922
エコス	3.9	4.2	6,984
ワタミ	13.9	13.5	14,107
マルシェ	2.8	3	1,806
パン・パシフィック・インターナショナルホ	63.4	251.2	467,232
西松屋チェーン	23.2	25.1	19,301
ゼンショーホールディングス	49.9	54.8	121,930
幸楽苑ホールディングス	6.7	7.3	11,293
ハークスレイ	2.2	2.4	2,937
サイゼリヤ	17.4	18.8	40,664
ＶＴホールディングス	35.9	47.3	15,088
魚力	2.9	3.2	4,956
ポプラ	2.8	3	1,326
フジ・コーポレーション	2.1	3	5,397
ユナイテッドアローズ	12.1	12	22,440
ハイデイ日高	15.3	16.5	26,119
京都きもの友禅	6.7	7.3	1,846
コロワイド	35.2	38	66,500
ピーシーデポコーポレーション	14	15.2	5,821
壱番屋	7.5	8.1	37,138
トップカルチャー	3.8	4.1	1,184
ＰＬＡＮＴ	2.4	2.9	1,174
スギホールディングス	23.2	22.8	123,804
薬王堂ホールディングス	－	5	11,625
ヴィア・ホールディングス	13	14	7,700

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スクロール	16.3	17.6	5,420
ヨンドシーホールディングス	11.7	11.6	22,167
ファミリーマート	118.4	91.3	182,508
木曽路	13	14.9	38,039
ＳＲＳホールディングス	12.5	13.5	13,770
千趣会	19.2	20.6	7,374
タカキュー	8.2	8.8	1,258
ケーヨー	19.6	23.5	11,327
上新電機	12.5	13.4	25,888
日本瓦斯	17.2	18.1	59,458
ロイヤルホールディングス	18.5	20	37,980
東天紅	0.8	0.8	668
いなげや	11.8	14.2	20,661
島忠	24	21.5	57,598
チヨダ	11.1	12	13,704
ライフコーポレーション	8	8.7	22,019
リンガーハット	13	14.1	30,202
ＭｒＭａｘＨＤ	14.5	15.7	5,228
テンアライド	9.8	10.5	4,389
ＡＯＫＩホールディングス	21.2	22.9	18,640
オークワ	15.1	17.9	27,476
コメリ	16.3	17.6	33,334
青山商事	18.5	23.6	24,803
しまむら	12.3	13.3	96,558
はせがわ	5.6	6	2,394
高島屋	83.1	83.3	84,382
松屋	21.3	23	15,686
エイチ・ツー・オー　リテイリング	54.3	54.1	47,283
近鉄百貨店	4	4.4	11,440
パルコ	10.2	－	－
丸井グループ	89.6	104.8	219,765
アクシアル　リテイリング	8.8	9.5	34,342
井筒屋	5.4	6.2	1,035
イオン	407.4	439.8	1,022,095
イズミ	21.5	23.2	63,985
平和堂	21.5	23.2	41,249
フジ	12.8	13.8	24,370
ヤオコー	12	13	80,340
ゼビオホールディングス	12.8	13.8	12,571

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ケーズホールディングス	110	110.3	122,984
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6.2	5.9	3,404
日産東京販売ホールディングス	15.6	16.8	3,813
シルバーライフ	－	1.1	2,072
一家ダイニングプロジェクト	－	0.8	548
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	5.2	5	9,585
ナルミヤ・インターナショナル	－	1.9	1,121
総合メディカルホールディングス	9.2	9.3	23,715
ブックオフグループホールディングス	5.5	6.7	6,097
アインホールディングス	14.2	14	83,720
元気寿司	3	2.9	7,183
ヤマダ電機	322.5	348.2	164,698
アークランドサカモト	18	17.9	17,040
ニトリホールディングス	45.8	49.5	721,710
グルメ杵屋	7.5	8.1	8,829
愛眼	8.4	9.1	1,965
ケーユーホールディングス	5.5	6	4,776
吉野家ホールディングス	37	37.5	83,287
松屋フーズホールディングス	5.1	5.5	23,375
サガミホールディングス	14.2	15.3	19,890
関西スーパーマーケット	8	9.5	9,671
王将フードサービス	7.8	8.4	49,980
プレナス	11.9	12.8	23,833
ミニストップ	7.8	8.5	12,554
アークス	19.9	23.4	41,886
バローホールディングス	22.8	25.3	43,490
藤久	0.8	0.9	539
ベルク	5.2	5.6	29,736
大庄	5.7	6.1	7,698
ファーストリテイリング	14.2	15.3	771,732
サンドラッグ	39.8	43	144,050
サックスバー　ホールディングス	9	9.7	6,586
ヤマザワ	2.2	2.7	4,266
やまや	1.8	2.3	5,032
ベルーナ	26	24.5	12,054
銀行業（5.5%）			
島根銀行	2.2	2.3	1,051
じもとホールディングス	71.6	77.3	7,498
めぶきフィナンシャルグループ	550.9	594.7	127,265

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14.3	15.5	18,290
九州フィナンシャルグループ	174	187.8	77,373
ゆうちょ銀行	300.4	324.3	331,110
富山第一銀行	25.3	27.3	7,261
コンコルディア・フィナンシャルグループ	675.3	673.2	224,175
西日本フィナンシャルホールディングス	67.9	78	46,800
関西みらいフィナンシャルグループ	49.8	67.2	28,560
三十三フィナンシャルグループ	9.2	10.6	14,850
第四北越フィナンシャルグループ	18.4	19.9	44,993
新生銀行	77.8	84	118,692
あおぞら銀行	59.2	68.2	162,111
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,298.2	7,829.5	3,513,096
りそなホールディングス	1,163.4	1,256	448,266
三井住友トラスト・ホールディングス	208.4	216.3	721,576
三井住友フィナンシャルグループ	747.2	791.6	2,335,615
千葉銀行	375.5	393.7	197,637
群馬銀行	212.1	224.9	74,217
武蔵野銀行	15.8	17.1	23,187
千葉興業銀行	29.1	6.8	1,516
筑波銀行	44.1	47.6	8,044
七十七銀行	33.3	38.7	51,935
青森銀行	8.2	8.9	21,564
秋田銀行	6.8	7.3	11,519
山形銀行	11.9	12.9	15,170
岩手銀行	7.4	7.5	18,427
東邦銀行	94.8	102.3	24,961
東北銀行	5.4	5.5	5,104
みちのく銀行	6.8	7.4	8,465
ふくおかフィナンシャルグループ	86.1	96.4	152,504
静岡銀行	266.9	283.4	194,979
十六銀行	14.2	14.3	26,841
スルガ銀行	108.5	117.1	46,840
八十二銀行	191.9	276.2	102,746
山梨中央銀行	13.1	13.3	9,788
大垣共立銀行	16.8	22.6	46,217
福井銀行	9.1	9.8	14,112
北國銀行	11.3	11.8	36,226
清水銀行	4.4	4.7	8,474
富山銀行	2	2.2	3,443

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
滋賀銀行	21.3	23	57,086
南都銀行	12.4	19	38,798
百五銀行	95.4	103	29,664
京都銀行	38	41	144,320
紀陽銀行	37.5	40.5	63,099
ほくほくフィナンシャルグループ	70.6	76.2	73,609
広島銀行	156.5	169	77,571
山陰合同銀行	62.9	67.9	36,733
中国銀行	68.4	98.5	91,506
鳥取銀行	3.6	3.9	4,816
伊予銀行	140.5	163.3	85,079
百十四銀行	11.3	12.2	22,570
四国銀行	15.2	17.4	14,041
阿波銀行	17	18.7	40,579
大分銀行	6.5	6.6	13,160
宮崎銀行	7.1	7.6	17,069
佐賀銀行	6.4	6.9	8,093
十八銀行	6.5	—	—
沖縄銀行	9.7	10.5	32,287
琉球銀行	24.5	26.4	25,951
セブン銀行	358.2	382.3	108,573
みずほフィナンシャルグループ	14,406.2	15,552.7	2,096,503
高知銀行	3.8	4.2	2,595
山口フィナンシャルグループ	132.3	142.9	84,168
長野銀行	3.5	3.8	4,446
名古屋銀行	8.6	9.3	22,422
北洋銀行	159.8	172.5	34,845
愛知銀行	3.8	4.1	12,025
中京銀行	4.4	4.7	9,865
大光銀行	3.6	3.9	4,917
愛媛銀行	14.8	16	17,744
トマト銀行	4.1	4.4	4,378
京葉銀行	46.8	48.8	25,473
栃木銀行	54.9	55.3	8,682
北日本銀行	3.3	3.6	6,944
東和銀行	18.6	20.1	12,984
福島銀行	9.2	10.8	1,695
大東銀行	5.1	5.9	3,451
トモニホールディングス	82	88.5	30,798

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フィデアホールディングス	102.9	111.1	11,776
池田泉州ホールディングス	112.5	131.6	21,319
証券、商品先物取引業（0.8%）			
ＦＰＧ	33.3	35.3	20,368
マーキュリアインベストメント	4.1	5.1	2,937
ＳＢＩホールディングス	126.3	127.8	218,410
日本アジア投資	9	9.7	1,872
ジャフコ	17.4	17.6	54,032
大和証券グループ本社	850.7	918.4	416,310
野村ホールディングス	1,865.5	2,013.9	986,811
岡三証券グループ	90.3	97.5	34,125
丸三証券	31.5	34	15,300
東洋証券	37.9	40.9	5,603
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	126.4	131.4	34,952
光世証券	2.5	2.7	1,417
水戸証券	30.7	33.1	6,156
いちよし証券	22.2	21.4	10,999
松井証券	51.9	65.4	54,870
だいこう証券ビジネス	4.3	5.5	3,025
マネックスグループ	99	86.4	15,811
カブドットコム証券	72.2	－	－
極東証券	14.2	15.4	10,040
岩井コスモホールディングス	10.9	10.8	11,631
藍澤證券	19.8	20.5	15,580
マネーパートナーズグループ	12.4	12.2	2,257
スパークス・グループ	25	39.6	7,603
小林洋行	3	3.3	801
保険業（2.2%）			
かんぽ生命保険	40	40.5	56,416
ＳＯＭＰＯホールディングス	186.9	215.2	697,893
アニコム　ホールディングス	8.7	9.5	33,250
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	277.2	299.3	900,893
ソニーフィナンシャルホールディングス	87.1	94.1	172,579
第一生命ホールディングス	599.8	647.7	882,167
東京海上ホールディングス	384.3	409.3	2,055,504
Ｔ＆Ｄホールディングス	327.9	342.1	309,600
アドバンスクリエイト	2.5	2.7	4,147
その他金融業（1.1%）			
全国保証	29.9	32.3	115,957

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ジェイリース	2.2	3.2	841
イントラスト	3	4	2,052
日本モーゲージサービス	1.4	2.3	4,459
Ｃａｓａ	3.6	4	4,092
アルヒ	9.6	18.2	20,893
プレミアグループ	2.3	6.2	9,436
クレディセゾン	74.3	80.2	104,099
芙蓉総合リース	12.1	12	67,080
みずほリース	19.9	17.7	39,878
東京センチュリー	21.4	23	84,295
日本証券金融	46.7	50.4	24,897
アイフル	161.7	174.6	40,507
リコーリース	8.3	9	26,946
イオンフィナンシャルサービス	67.7	70	81,900
アコム	213.1	230.1	99,403
ジャックス	11.7	12.6	23,070
オリエントコーポレーション	286.7	309.6	38,390
日立キャピタル	25	27	55,593
アプラスフィナンシャル	50.9	54.9	3,403
オリックス	707.3	715.9	1,000,470
三菱ＵＦＪリース	239.2	290.5	160,356
九州リースサービス	5.2	5.6	2,710
日本取引所グループ	286.4	328.5	592,285
イー・ギャランティ	9.9	12.3	16,629
アサックス	4.4	5.9	3,746
ＮＥＣキャピタルソリューション	4.3	4.7	9,038
不動産業（2.2%）			
いちご	134.8	145.7	37,736
日本駐車場開発	127.9	125.5	16,691
スター・マイカ・ホールディングス	－	5.9	7,422
ヒューリック	221.3	244.4	259,552
三栄建築設計	4.2	4.6	5,566
スター・マイカ	4.9	－	－
野村不動産ホールディングス	70.6	69.5	135,108
三重交通グループホールディングス	21.5	23.2	12,180
サムティ	14.6	16.2	19,488
ディア・ライフ	13.6	14.7	6,159
コーセーアールイー	3.1	3.4	1,451
エー・ディー・ワークス	163.4	212.3	4,458

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本商業開発	6.6	7.2	10,857
プレサンスコーポレーション	16.8	18.8	19,533
ユニゾホールディングス	16	17.3	103,108
ＴＨＥグローバル社	5.4	5.4	1,684
ハウスコム	－	1.5	1,813
日本管理センター	7	7.5	8,355
サンセイランディック	2.8	3.4	2,301
エストラスト	1.4	1.6	848
フージャースホールディングス	23	22.8	14,728
オープンハウス	17.3	33.2	74,832
東急不動産ホールディングス	285.2	311.2	188,587
飯田グループホールディングス	88.4	95.5	142,868
イーグランド	1.5	1.8	1,164
ムゲンエステート	7.3	7.9	3,476
ビーロット	1.6	2.7	3,385
ファーストブラザーズ	2.9	2.6	1,804
ハウスドゥ	5.8	5.6	3,936
シーアールイー	3.5	2.8	2,912
プロパティエージェント	1.1	1.8	1,537
ケイアイスター不動産	2.8	3.6	4,536
アグレ都市デザイン	1.3	1.8	871
グッドコムアセット	1.8	2.6	3,159
ジェイ・エス・ビー	0.4	1.2	4,932
テンポイノベーション	0.9	2.6	1,866
グローバル・リンク・マネジメント	0.8	1.9	1,054
パーク２４	62	61.4	111,318
パラカ	2.7	2.9	4,872
三井不動産	562.5	564.5	1,092,307
三菱地所	742.8	802	1,359,390
平和不動産	20.1	21	55,440
東京建物	115.9	120.6	149,182
ダイビル	31.2	29.5	27,228
京阪神ビルディング	18.9	18.6	21,966
住友不動産	238.3	257.3	780,648
テーオーシー	24.3	22.5	13,050
東京楽天地	1.5	1.9	7,714
レオパレス２１	130.8	150	42,750
スターツコーポレーション	14.4	15.6	30,591
フジ住宅	13.5	13.3	7,328

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
空港施設	12.4	11.5	4,611
明和地所	5.8	6.3	3,546
ゴールドクレスト	8.4	9	14,922
エスリード	4.1	4.5	7,096
日神グループホールディングス	15.7	16.9	7,267
日本エスコン	19.1	20.7	12,958
タカラレーベン	49.7	52.3	19,612
ＡＶＡＮＴＩＡ	6	6.4	3,948
イオンモール	53.1	57.4	83,976
毎日コムネット	2.3	2.9	2,114
ファースト住建	3.9	4.9	4,405
ランド	432.8	623	4,984
カチタス	11.8	14.2	47,002
トーセイ	14.6	15.8	15,104
穴吹興産	1.2	2.5	3,342
サンフロンティア不動産	14.6	15.8	14,378
エフ・ジェー・ネクスト	9.3	10	8,840
インテリックス	3	3.2	1,612
ランドビジネス	5.4	4.8	1,876
日本社宅サービス	－	2.6	2,337
グランディハウス	9.3	8.9	3,649
日本空港ビルデング	33.8	36.5	157,862
サービス業（5.0%）			
日本工営	6.9	7.5	21,810
ＬＩＦＵＬＬ	39.8	38.7	12,267
ジェイエイシーリクルートメント	8.3	7.4	7,969
日本M＆Aセンター	76.6	83.8	248,634
メンバーズ	3.4	3.3	4,507
中広	1.1	1.1	447
ＵＴグループ	－	13.1	18,222
アイティメディア	－	3.3	2,475
タケエイ	10.7	10.6	8,511
Ｅ・Ｊホールディングス	1.3	2	2,598
ビーネックスグループ	5.7	13.8	7,245
コシダカホールディングス	27.5	26.7	11,053
アルトナー	1.9	2.7	1,717
パソナグループ	12.5	12	11,256
ＣＤＳ	2.5	2.7	3,083
リンクアンドモチベーション	18.9	24.4	8,027

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＧＣＡ	10.4	13.4	7,852
エス・エム・エス	37.7	34.5	74,071
サニーサイドアップグループ	1.1	2.9	1,827
パーソルホールディングス	102.7	110.9	121,546
リニカル	5.8	5.3	4,293
クックパッド	32.3	38.7	10,410
エスクリ	2.8	3.5	1,519
アイ・ケイ・ケイ	5	5.4	3,245
学情	4.2	3.9	5,467
スタジオアリス	5.2	5.6	8,965
シミックホールディングス	5.7	6.1	8,668
エプコ	－	1.8	1,413
ＮＪＳ	2.3	2.4	4,051
綜合警備保障	40.9	44.1	226,674
カカクコム	76.9	83	182,849
アイロムグループ	3.9	3.9	5,011
セントケア・ホールディング	5.6	7.2	2,865
サイネックス	1.7	1.9	1,176
ルネサンス	5.7	6.2	7,285
ディップ	16.6	15.6	30,669
オプトホールディング	6.3	6	8,016
新日本科学	13.9	12	6,372
ツクイ	24.2	26.1	10,283
キャリアデザインセンター	2.6	2.8	2,178
ベネフィット・ワン	28.5	30.3	44,389
エムスリー	216.2	244.5	733,500
ツカダ・グローバルホールディング	6.5	7.1	2,477
ブラス	0.8	1.2	513
アウトソーシング	54.1	63.5	32,829
ウェルネット	9.7	11.2	5,140
ワールドホールディングス	2.8	3.7	4,665
ディー・エヌ・エー	55.4	54.3	68,200
博報堂ＤＹホールディングス	142.8	154.2	179,334
ぐるなび	14.6	19.3	11,425
タカミヤ	10.6	11.7	5,218
ジャパンベストレスキューシステム	8.1	7.5	4,980
ファンコミュニケーションズ	28.2	30.5	11,864
ライク	4	3.7	5,198
ビジネス・ブレークスルー	4.3	4.6	1,619

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エスプール	－	19.9	10,765
ＷＤＢホールディングス	4.7	5.1	10,710
手間いらず	－	0.5	2,087
ティア	5.2	6.5	3,380
ＣＤＧ	0.9	1.2	1,674
バリューコマース	6.9	6.2	10,409
インフォマート	56.3	121.5	82,377
ＪＰホールディングス	29.3	34.8	9,152
エコナックホールディングス	18.5	20	1,800
ＥＰＳホールディングス	15.5	16.7	17,835
レッグス	2.5	2.7	2,273
プレステージ・インターナショナル	19.2	41.5	32,494
アミューズ	6.2	6	13,494
ドリームインキュベータ	3.1	3.4	3,046
クイック	6.4	6.9	7,307
ＴＡＣ	5.6	6.7	1,132
ケネディクス	90.2	103.3	44,212
電通グループ	125.1	114.3	281,178
テイクアンドギヴ・ニーズ	3.9	4.2	2,583
ぴあ	2.9	3.2	9,280
イオンファンタジー	3.3	4.3	7,335
シーティーエス	11.6	12.5	6,562
ネクシィーズグループ	3	3.9	4,122
みらかホールディングス	28.7	31	69,874
アルプス技研	9	9.8	15,356
サニックス	18	19.4	5,567
ダイオーズ	2.4	2.2	2,404
日本空調サービス	11.6	11.6	7,725
オリエンタルランド	121.4	117.9	1,749,046
ダスキン	27.6	28.5	80,541
明光ネットワークジャパン	13	13	9,477
ファルコホールディングス	5.6	6.1	10,766
秀英予備校	2.2	2.4	957
田谷	1.9	2	1,170
ラウンドワン	31.9	31	20,801
リゾートトラスト	43.5	50.8	59,588
ビー・エム・エル	13.2	14.3	38,009
ワタベウェディング	1.7	1.8	680
りらいあコミュニケーションズ	18.6	20	20,000

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リソー教育	52.1	50.7	14,956
早稲田アカデミー	1.5	3.6	3,124
ユー・エス・エス	125.4	124.1	192,230
東京個別指導学院	3.6	3.9	1,833
サイバーエージェント	63.3	63.8	244,354
楽天	478.8	516.9	429,027
クリーク・アンド・リバー社	6	5.7	4,178
テー・オー・ダブリュー	9	8.8	5,218
山田コンサルティンググループ	2.9	5.4	4,995
セントラルスポーツ	3.8	4.1	9,909
フルキャストホールディングス	10.3	11.1	14,763
エン・ジャパン	11.2	19.7	44,029
リソルホールディングス	1.1	1.2	4,560
テクノプロ・ホールディングス	20.6	22.1	119,561
アトラ	2	2.5	537
インターワークス	2	2.1	974
アイ・アールジャパンホールディングス	3.1	4.5	25,470
ＫｅｅＰｅｒ技研	3.8	4.1	5,592
ファーストロジック	2	2.6	1,534
三機サービス	2.1	2.1	1,927
Ｇｕｎｏｓｙ	7.1	6.9	6,499
デザインワン・ジャパン	2	2.2	404
イー・ガーディアン	4.9	5.6	8,237
リブセンス	5.6	7.1	1,696
ジャパンマテリアル	28.1	34.1	45,591
ベクトル	12.5	13.8	9,936
ウチヤマホールディングス	5.1	5.5	1,919
チャーム・ケア・コーポレーション	2.5	9.4	7,416
ライクキッズ	2.4	1.9	957
キャリアリンク	3.8	3.6	1,382
ＩＢＪ	6.9	7.6	4,324
アサンテ	4.1	4.4	6,820
Ｎ・フィールド	6.6	7.6	2,880
バリューＨＲ	2.2	2.2	5,854
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	2.6	7.4	19,447
ライドオンエクスプレスホールディングス	4.2	4.2	5,199
ＥＲＩホールディングス	2.9	3.1	1,847
アビスト	1.6	1.7	3,468
シグマクシス	4.9	7.6	9,750

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ウィルグループ	6.7	7.2	4,564
エスクロー・エージェント・ジャパン	14.1	15.3	2,356
日本ビューホテル	3.2	－	－
リクルートホールディングス	735.8	794.3	2,467,890
エラン	7.1	6.6	8,659
土木管理総合試験所	4.5	4.8	1,636
ネットマーケティング	－	3.2	1,980
日本郵政	841.9	908.9	793,469
ベルシステム２４ホールディングス	17.2	18.6	20,850
鎌倉新書	7.5	8.3	9,918
ＳＭＮ	1	1.8	1,162
一蔵	1.1	1.2	621
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2.3	3.8	7,942
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1.2	1.7	901
エアトリ	3	4.6	3,928
アトラエ	2	2.9	7,023
ストライク	2.6	4.2	13,650
ソラスト	25	30.5	30,103
セラク	2.3	3.5	2,457
インソース	3.4	5.4	11,799
ベイカレント・コンサルティング	5.4	6.7	37,386
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1.3	2.3	1,796
アイモバイル	2.4	3.5	1,963
キャリアインデックス	3.5	4.5	1,314
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4.1	3.6	2,721
船場	1.6	1.8	1,591
グレイステクノロジー	2.8	5	12,740
ジャパンエレベーターサービスホールディン	6.1	11.7	27,612
フルテック	1.1	1.5	1,849
グリーンズ	2.9	2.8	1,282
ツナグループ・ホールディングス	0.9	1.3	470
ＧａｍｅＷｉｔｈ	－	2.5	1,167
ソウルドアウト	0.8	1.7	3,527
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1.1	1.5	796
ミダック	－	1.1	1,096
日総工産	2.5	7.3	3,825
キュービーネットホールディングス	4.7	4.6	8,169
ＲＰＡホールディングス	－	6.3	5,657
スプリックス	2.9	3.7	2,556

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
乃村工藝社	24	47.5	40,090
藤田観光	4.1	4.8	8,668
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	5.5	6.9	5,547
日本管財	11	11.9	20,920
トーカイ	9.9	10.7	28,141
白洋舎	1.2	1.3	3,208
セコム	109	117.7	1,040,468
セントラル警備保障	4.9	5.3	21,703
丹青社	19.4	20.9	14,713
メイテック	13	13.7	60,828
応用地質	11	11.9	14,149
船井総研ホールディングス	21.2	22.9	51,273
進学会ホールディングス	4.7	4.3	2,038
オオバ	8.1	8	4,176
いであ	2.1	2	3,082
学究社	3.4	3.2	3,884
ベネッセホールディングス	37.6	36.9	98,855
イオンディライト	12.7	13.7	43,292
ナック	6.5	6.1	4,800
ニチイ学館	14.6	15.8	16,969
ダイセキ	17.2	18.6	41,161
ステップ	3.8	4.1	5,740
合計　株数・金額	125,044	137,340	232,815,716
合計　銘柄数＜比率＞	2,137	2,165	＜95.4％＞

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

先物取引の銘柄別期末残高

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

○有価証券の貸付及び借入の状況

（2020年３月25日現在）

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

（注）（　）内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

（2020年３月25日現在）

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
株式	232,815,716	83.1
コール・ローン等、その他	47,464,184	16.9
投資信託財産総額	280,279,900	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2020年３月25日現在）

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

○損益の状況 （2019年３月26日～2020年３月25日）

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

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

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

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

＜注記事項＞

①期首元本額　144,648,237,224円
　期中追加設定元本額　243,091,402,690円
　期中一部解約元本額　232,217,962,774円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.5695円です。

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

三菱ＵＦＪ ＤＣ国内株式インデックスファンド	50,790,692,412円
ＭＵＡＭ 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	31,979,987,647円
ｅＭＡＸＩＳ ＴＯＰＩＸインデックス	10,654,280,427円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,924,809,163円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 国内株式（ＴＯＰＩＸ）	8,988,945,317円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンド	7,724,777,644円
つみたて日本株式（ＴＯＰＩＸ）	3,566,921,468円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	3,404,533,401円
ＭＵＫＡＭ 日本株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	3,193,400,465円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	2,885,466,020円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	2,291,088,282円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	2,187,156,516円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,915,137,116円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞ＴＯＰＩＸ・ファンド	1,704,856,116円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,533,370,129円
国内株式セレクション（ラップ向け）	1,418,965,813円
つみたて８資産均等バランス	1,339,622,487円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ１	1,278,905,086円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	968,589,616円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）	882,732,804円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	624,564,692円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	537,084,578円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	446,401,997円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	443,083,780円
つみたて４資産均等バランス	397,776,772円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	380,713,319円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	339,997,505円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（３地域均等型）	280,568,775円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	267,655,808円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	261,441,477円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	245,849,929円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ	230,875,003円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	200,062,658円
ファンド・マネジャー（国内株式）	199,069,822円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	199,009,336円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	195,305,481円
ＭＵＫＡＭ 米国国債プラス日本株式ファンド2019-04（適格機関投資家限定）	158,613,947円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	147,450,253円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	142,731,821円
ＭＵＡＭトピックスリスクコントロール（10%）インデックスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	136,741,102円
ＭＵＫＡＭ 米国国債プラス日本株式ファンド2019-11（適格機関投資家限定）	120,109,106円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	115,644,940円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	111,059,861円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	99,593,659円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	97,539,899円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	96,621,074円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	66,522,945円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	46,177,528円

三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	41,629,367円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	37,554,127円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	31,970,541円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	31,378,773円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	25,671,793円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	23,742,169円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	22,985,649円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	18,216,295円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	15,735,143円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	15,354,118円
ＭＵＡＭ インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）	8,726,654円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	5,624,448円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,551,065円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	5,015,892円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	2,881,881円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	2,717,502円
ＭＵＡＭトピックスリスクコントロール（５％）インデックスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	2,067,782円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	1,883,966円
コアバランス	464,979円
合計	155,521,677,140円

［お知らせ］

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

外国株式インデックスマザーファンド

《第19期》決算日2020年５月12日

［計算期間：2019年５月14日～2020年５月12日］

「外国株式インデックスマザーファンド」は、５月12日に第19期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主要運用対象	ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
15期(2016年５月12日)	19,726	△14.5	550,129.14	△14.8	94.4	2.8	2.7	270,065
16期(2017年５月12日)	24,302	23.2	675,952.24	22.9	92.9	1.9	2.4	332,985
17期(2018年５月14日)	26,785	10.2	742,711.39	9.9	94.4	3.4	2.2	337,226
18期(2019年５月13日)	27,724	3.5	767,126.93	3.3	93.8	3.8	2.5	437,368
19期(2020年５月12日)	26,834	△ 3.2	740,810.97	△ 3.4	93.7	4.0	2.4	449,841

(注) ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、ＭＳＣＩコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
（期首）	円	%		%	%	%	%
2019年５月13日	27,724	－	767,126.93	－	93.8	3.8	2.5
５月末	26,891	△ 3.0	743,484.51	△ 3.1	92.8	4.7	2.5
６月末	27,859	0.5	770,156.42	0.4	93.8	3.7	2.5
７月末	28,618	3.2	790,836.41	3.1	95.2	2.6	2.5
８月末	27,204	△ 1.9	751,785.28	△ 2.0	88.9	8.6	2.5
９月末	28,077	1.3	775,713.31	1.1	95.5	1.8	2.7
10月末	29,192	5.3	805,459.07	5.0	92.6	4.8	2.6
11月末	30,277	9.2	835,911.03	9.0	91.8	5.6	2.6
12月末	31,190	12.5	860,793.53	12.2	93.3	4.6	2.5
2020年１月末	31,228	12.6	861,985.05	12.4	94.5	3.2	2.6
２月末	28,777	3.8	794,123.11	3.5	95.5	2.2	2.7
３月末	24,454	△11.8	675,468.96	△11.9	92.7	5.0	2.5
４月末	26,849	△ 3.2	740,391.09	△ 3.5	94.6	2.8	2.5
（期末） 2020年５月12日	26,834	△ 3.2	740,810.97	△ 3.4	93.7	4.0	2.4

（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

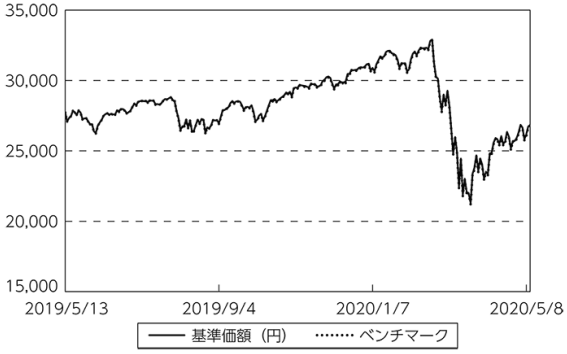
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.2%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－3.4%）を0.2%上回りました。

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

（下落要因）

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

●投資環境について

◎外国株式市況

外国株式市況は下落しました。

・外国株式市況は、新型肺炎の世界的な感染拡大懸念などを受けて下落しました。

◎為替市況

米ドル、ユーロは円に対して下落しました。

・為替市況は、期首に比べて2.0%の円高・米ドル安、5.9%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは3.4%の下落になったため、カイ離は0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

・その他の要因によるものです。

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

（主なマイナス要因）

・組入要因によるものです。

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2019年５月14日～2020年５月12日）

項目	当期 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)	(0.005)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(1)	(0.003)	
(b) 有価証券取引税	10	0.036	(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）	(10)	(0.035)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	7	0.025	(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)	(0.024)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	19	0.069	
期中の平均基準価額は、28,248円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年５月14日～2020年５月12日）

株式

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

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

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

投資信託証券

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

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	LIBERTY PROPERTY TRUST	9 (△ 20)	505 (△ 1,046)	3	191
	PUBLIC STORAGE	12	2,843	11	2,630
	SIMON PROPERTY GROUP INC	24	3,510	23	3,195
	VORNADO REALTY TRUST	13	862	13	798
	KIMCO REALTY CORP	38	677	30	521
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11	2,433	10	2,176
	小計	1,202 (16)	76,996 (3,282)	863 (253)	61,474 (2,920)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	4	142	—	—
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12	653	3	208
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12	262	9	201
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8	234	6	142
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	2 (25)	43 (553)	12	273
	小計	39 (25)	1,335 (553)	32	824
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	5	748	4	690
	KLEPIERRE	18	592	19	555
	COVIVIO	2	257	2	244
	ICADE	1	137	1	120
	小計	27	1,735	27	1,611
	オランダ				
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12	1,527	10	1,272
	小計	12	1,527	10	1,272
	ユーロ計	40	3,263	38	2,883
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	93	491	81	417
	HAMMERSON PLC	—	—	75	209
	LAND SECURITIES GROUP PLC	50	433	44	378
	SEGRO PLC	95	813	81	667
	小計	239	1,738	283	1,673
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	VICINITY CENTRES	271	691	287	694
	SCENTRE GROUP	526	1,890	470	1,725
	GPT GROUP	175	947	142	859
	MIRVAC GROUP	289	937	278	881
	STOCKLAND	273	1,134	243	1,147
	DEXUS	86	1,090	74	951
	GOODMAN GROUP	143	2,063	131	1,945
	小計	1,767	8,755	1,629	8,206

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	LINK REIT	181	14,948	161	13,243
	小計	181	14,948	161	13,243
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	269 (－)	494 (△ 1)	324	588
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	245	446	160	326
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	400 (－)	963 (△0.06294)	184	422
	CAPITALAND MALL TRUST	122	308	104	242
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	245 (－)	752 (△ 4)	204	635
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	－ (40)	－ (－)	40	10
	小計	1,283 (40)	2,964 (△ 5)	1,018	2,225

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 371,227	百万円 371,693	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2019年５月14日～2020年５月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	651,373,227千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	436,549,910千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	1.49

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2019年５月14日～2020年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	427,884	378,738	88.5	389,771	362,161	92.9

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

○組入資産の明細

（2020年５月12日現在）

外国株式

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
DANAHER CORP	654	705	11,408	1,226,604	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	1,865	2,031	21,889	2,353,592	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	131	144	1,068	114,854	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	740	823	6,726	723,276	公益事業
DR HORTON INC	377	412	2,002	215,302	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	513	573	6,894	741,321	小売
DAVITA INC	132	101	826	88,818	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	147	171	1,559	167,626	資本財
DTE ENERGY COMPANY	192	217	2,143	230,450	公益事業
EXXON MOBIL CORP	4,390	4,763	21,789	2,342,785	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	216	232	5,238	563,290	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	600	658	3,280	352,673	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	648	683	3,829	411,738	資本財
EXELON CORP	1,005	1,088	4,058	436,332	公益事業
ECOLAB INC	269	295	5,794	623,051	素材
EQUIFAX INC	123	136	2,018	217,076	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	228	250	4,255	457,538	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	449	464	3,769	405,260	資本財
EDISON INTERNATIONAL	338	406	2,308	248,214	公益事業
ENTERGY CORP	190	227	2,186	235,072	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	42	46	824	88,623	保険
NEXTERA ENERGY INC	496	550	12,506	1,344,707	公益事業
MACY'S INC	305	—	—	—	小売
FEDEX CORP	259	279	3,280	352,733	運輸
FORD MOTOR CO	3,848	4,380	2,242	241,137	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	321	339	663	71,379	各種金融
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	42	1,207	129,819	各種金融
FIRSTENERGY CORP	531	609	2,465	265,042	公益事業
FLUOR CORP	143	—	—	—	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	1,434	1,651	1,483	159,494	素材
GENERAL MILLS INC	619	682	4,148	445,996	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	261	277	3,710	398,944	資本財
WW GRAINGER INC	48	50	1,449	155,888	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	9,024	9,845	6,094	655,242	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	166	338	5,838	627,771	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	153	162	1,235	132,867	小売
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	246	—	—	—	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	232	220	168	18,161	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	347	358	6,565	705,869	各種金融
HALLIBURTON CO	900	902	954	102,617	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	767	805	10,815	1,162,905	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	166	169	340	36,581	自動車・自動車部品
HP INC	1,642	1,675	2,582	277,708	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	372	410	1,434	154,196	保険
HERSHEY CO/THE	149	167	2,228	239,623	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	1,171	1,230	29,100	3,128,852	小売
HASBRO INC	122	142	974	104,789	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	254	271	2,196	236,202	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	943	997	12,231	1,315,108	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	401	412	1,364	146,725	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	309	364	5,893	633,715	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	403	397	663	71,378	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
IDEX CORP	81	92	1,413	151,981	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	89	111	1,474	158,518	素材
JOHNSON & JOHNSON	2,783	2,968	44,256	4,758,420	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	103	115	1,545	166,180	運輸
KELLOGG CO	274	297	1,882	202,412	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	359	390	5,408	581,509	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,508	1,621	8,237	885,649	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	827	907	3,061	329,129	食品・生活必需品小売り
KOHLS CORP	177	149	263	28,280	小売
ELI LILLY & CO	927	974	15,456	1,661,889	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	102	108	1,835	197,347	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	143	146	381	41,028	運輸
LENNAR CORP-A	309	333	1,766	189,978	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	836	865	9,815	1,055,361	小売
LEGGETT & PLATT INC	135	137	392	42,169	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	247	—	—	—	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	407	383	1,859	199,890	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	265	286	10,789	1,160,135	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	220	217	767	82,542	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	37	41	777	83,588	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	81	—	—	—	資本財
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	300	318	2,621	281,818	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	800	848	15,347	1,650,181	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	260	274	8,265	888,759	各種金融
MEDTRONIC PLC	1,394	1,510	14,915	1,603,711	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	2,698	2,871	22,371	2,405,422	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	1,174	1,252	6,039	649,316	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	368	—	—	—	耐久消費財・アパレル
3M CO	604	648	9,443	1,015,406	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	169	192	2,509	269,820	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	508	579	849	91,309	消費者サービス
MASCO CORP	311	315	1,309	140,744	資本財
M & T BANK CORP	140	145	1,449	155,847	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	522	562	5,858	629,950	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	63	73	594	63,880	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	1,339	1,379	5,494	590,726	各種金融
MCKESSON CORP	204	182	2,557	274,982	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	869	883	3,001	322,774	保険
MANPOWERGROUP INC	66	63	443	47,689	商業・専門サービス
MOODY'S CORP	178	189	4,804	516,617	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	282	293	5,106	549,002	運輸
BANK OF AMERICA CORP	9,673	9,627	21,739	2,337,441	銀行
NISOURCE INC	386	413	971	104,470	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	171	181	5,927	637,363	資本財
NEWMONT CORP	850	934	5,884	632,735	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	126	139	2,291	246,426	食品・飲料・タバコ
MARKEL CORP	14	15	1,354	145,595	保険
NUCOR CORP	327	343	1,397	150,229	素材
NEWELL BRANDS INC	474	440	529	56,983	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	483	588	564	60,745	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	782	953	1,433	154,088	エネルギー
OMNICOM GROUP	235	242	1,298	139,570	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
PEPSICO INC	1,464	1,572	21,126	2,271,555	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	95	111	1,087	116,950	素材
ALTRIA GROUP INC	1,949	2,106	7,672	824,942	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	114	127	941	101,187	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,585	2,811	32,424	3,486,304	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	478	491	5,014	539,203	銀行
PFIZER INC	5,998	6,241	23,778	2,556,678	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	428	449	2,561	275,460	保険
PULTEGROUP INC	266	260	767	82,547	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	137	146	2,315	249,015	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	176	198	1,676	180,227	エネルギー
CITIGROUP INC	2,533	2,454	10,818	1,163,198	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	299	336	1,231	132,362	保険
PPG INDUSTRIES INC	248	267	2,414	259,586	素材
PENTAIR PLC	174	173	600	64,529	資本財
PPL CORP	758	825	2,084	224,162	公益事業
PROGRESSIVE CORP	604	665	4,865	523,171	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	525	567	2,735	294,078	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	173	182	696	74,874	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	295	—	—	—	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	236	247	2,029	218,256	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,094	1,026	1,007	108,308	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	42	51	833	89,620	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	107	117	4,267	458,879	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	532	578	1,050	113,000	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	127	157	730	78,536	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	125	130	2,525	271,497	資本財
SCHLUMBERGER LTD	1,422	1,520	2,638	283,726	エネルギー
STRYKER CORP	349	379	7,356	790,958	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,261	1,287	4,614	496,113	各種金融
SEMPRA ENERGY	284	316	3,950	424,735	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	87	93	5,227	562,108	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	159	170	1,934	207,996	資本財
SUNTRUST BANKS INC	464	—	—	—	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	274	289	2,764	297,191	保険
SOUTHERN CO/THE	1,068	1,179	6,584	707,925	公益事業
AT&T INC	7,550	8,235	24,197	2,601,697	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	306	338	1,434	154,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	394	408	2,398	257,908	各種金融
SYSCO CORP	512	553	2,862	307,784	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	158	165	486	52,258	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	995	1,051	12,084	1,299,333	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	113	119	1,539	165,498	小売
TERADYNE INC	—	187	1,182	127,168	半導体・半導体製造装置
GLOBE LIFE INC	106	115	863	92,872	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	958	875	2,499	268,710	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	417	452	15,392	1,654,958	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	253	248	642	69,107	資本財
UNION PACIFIC CORP	764	781	12,265	1,318,771	運輸
UNUM GROUP	223	244	362	39,021	保険
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	850	1,706	9,789	1,052,537	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	998	1,068	30,842	3,316,215	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
US BANCORP	1,592	1,676	5,592	601,326	銀行
MARATHON OIL CORP	855	944	542	58,382	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	721	790	7,420	797,880	運輸
VALERO ENERGY CORP	442	471	3,091	332,432	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	93	102	1,239	133,304	ヘルスケア機器・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	350	649	1,171	125,969	メディア・娯楽
VF CORP	349	383	2,196	236,122	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	138	149	1,448	155,783	素材
WILLIAMS COS INC	1,278	1,363	2,662	286,224	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	836	857	3,578	384,756	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	329	358	3,062	329,286	公益事業
WALMART INC	1,507	1,605	19,857	2,135,085	食品・生活必需品小売り
WELLCARE HEALTH PLANS INC	50	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	4,639	4,528	11,222	1,206,599	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	442	474	4,766	512,473	商業・専門サービス
WATERS CORP	78	73	1,398	150,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	64	75	825	88,776	耐久消費財・アパレル
XEROX CORP	219	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	534	587	3,534	380,049	公益事業
KEYCORP	1,080	1,112	1,189	127,939	銀行
CARMAX INC	185	188	1,435	154,352	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	211	231	2,728	293,370	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC	324	339	2,931	315,174	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	1,282	1,365	6,601	709,742	小売
CLOROX COMPANY	132	141	2,913	313,298	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	142	140	1,124	120,919	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	292	313	2,604	280,022	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	440	523	725	78,013	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	339	691	8,872	953,920	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	512	532	1,779	191,312	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	323	378	2,751	295,875	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	805	835	1,435	154,395	銀行
INTEL CORP	4,734	4,902	29,476	3,169,314	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	4,664	4,778	20,699	2,225,573	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	93	100	2,155	231,792	商業・専門サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	118	—	—	—	不動産
COSTCO WHOLESALE CORP	454	498	15,467	1,663,062	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	1,019	1,052	5,684	611,232	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	313	328	3,856	414,680	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	306	333	2,026	217,853	食品・飲料・タバコ
NORTONLIFELOCK INC	647	701	1,508	162,143	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	386	407	3,698	397,683	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	248	269	2,380	255,920	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	1,320	1,403	12,764	1,372,388	耐久消費財・アパレル
EXACT SCIENCES CORP	—	166	1,394	149,963	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMGEN INC	661	670	16,277	1,750,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	162	152	490	52,757	銀行
NORTHERN TRUST CORP	218	231	1,731	186,181	各種金融
MICROSOFT CORP	7,566	8,170	152,573	16,404,661	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	88	96	2,555	274,808	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	428	658	4,448	478,305	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	1,287	1,329	10,090	1,084,912	消費者サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ORACLE CORP	2,751	2,589	13,860	1,490,294	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	452	493	21,759	2,339,579	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	83	85	3,396	365,206	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	751	873	6,590	708,572	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	187	195	2,158	232,036	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	159	157	873	93,941	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	129	132	1,446	155,505	小売
LAM RESEARCH CORP	160	162	4,270	459,183	半導体・半導体製造装置
COPART INC	212	235	1,953	210,049	商業・専門サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	100	1,137	122,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WYNN RESORTS LTD	99	108	894	96,139	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	4,710	5,117	18,503	1,989,477	メディア・娯楽
XILINX INC	262	275	2,378	255,764	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	362	397	2,735	294,085	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	238	256	1,035	111,300	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	78	83	1,783	191,728	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,342	1,428	11,540	1,240,800	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	139	149	2,305	247,939	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	118	129	7,007	753,416	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	255	292	8,427	906,173	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	54	57	1,022	109,978	銀行
PAYCHEX INC	334	365	2,421	260,324	ソフトウェア・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	451	534	837	90,022	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	56	67	684	73,639	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	126	134	1,447	155,646	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	64	105	1,645	176,890	運輸
AUTODESK INC	226	246	4,552	489,481	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	181	139	300	32,261	メディア・娯楽
SALESFORCE.COM INC	793	938	17,136	1,842,511	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	119	100	172	18,525	小売
ALPHABET INC-CL A	309	485	68,089	7,320,988	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	61	1,454	156,399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EAST WEST BANCORP INC	154	163	553	59,511	銀行
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	41	2,112	227,095	各種金融
UNITED THERAPEUTICS CORP	41	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	115	146	1,187	127,685	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	257	277	1,030	110,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	1,257	1,286	10,351	1,113,010	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	293	304	1,610	173,148	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	155	165	2,676	287,767	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	292	317	1,732	186,226	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	431	475	114,458	12,306,612	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	249	262	2,954	317,696	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	139	152	1,690	181,806	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	169	177	2,992	321,804	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	231	231	561	60,401	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	267	331	1,359	146,126	各種金融
CERNER CORP	307	354	2,426	260,938	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	158	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	112	118	2,516	270,576	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	273	298	2,792	300,251	商業・専門サービス
EBAY INC	948	870	3,666	394,216	小売

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ADVANCE AUTO PARTS INC	77	76	967	104,049	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	389	545	702	75,509	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	172	188	3,077	330,863	食品・飲料・タバコ
NVR INC	3	4	1,289	138,653	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	49	55	1,720	185,011	ヘルスケア機器・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	312	333	2,905	312,416	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	153	160	817	87,871	保険
DISCOVERY INC - A	161	202	411	44,288	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	434	454	3,016	324,318	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	129	162	1,095	117,782	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	242	223	613	65,964	素材
LIBERTY GLOBAL PLC- C	540	504	1,062	114,246	メディア・娯楽
AMERIPRISE FINANCIAL INC	144	145	1,799	193,464	各種金融
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	290	323	820	88,247	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	591	632	5,947	639,495	各種金融
NASDAQ INC	117	128	1,401	150,671	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	175	142	128	13,832	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	150	160	652	70,159	メディア・娯楽
VIACOM INC-CLASS B	361	—	—	—	メディア・娯楽
AUTOLIV INC	89	87	530	57,022	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC - A	337	375	1,532	164,801	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	25	29	2,751	295,825	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	272	348	2,324	249,943	食品・飲料・タバコ
QURATE RETAIL INC-SERIES A	419	—	—	—	小売
ARROW ELECTRONICS INC	90	87	560	60,222	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN & BROWN INC	—	264	1,004	107,962	保険
CUMMINS INC	157	168	2,721	292,665	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	133	146	1,154	124,098	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	311	276	382	41,137	各種金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	63	74	1,264	136,011	素材
CIMAREX ENERGY CO	109	—	—	—	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	57	52	365	39,314	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	247	281	1,326	142,602	公益事業
HANESBRANDS INC	372	388	348	37,431	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	953	1,011	28,444	3,058,316	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	479	460	889	95,624	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	151	155	1,591	171,071	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	134	135	387	41,666	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	106	110	210	22,579	資本財
IPG PHOTONICS CORP	37	39	610	65,620	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	374	425	477	51,374	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	253	222	362	39,010	消費者サービス
HEICO CORP	—	45	408	43,914	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	49	55	1,926	207,111	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	121	125	1,492	160,464	ソフトウェア・サービス
INSULET CORP	—	69	1,562	168,029	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	135	142	2,841	305,550	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	388	501	580	62,378	銀行
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	741	3,941	423,766	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	356	379	2,827	304,044	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	348	331	1,342	144,311	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	103	124	3,053	328,264	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WABCO HOLDINGS INC	54	60	822	88,397	資本財
MERCADOLIBRE INC	44	50	3,935	423,116	小売
VMWARE INC-CLASS A	87	91	1,286	138,334	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	272	300	902	97,080	保険
SEATTLE GENETICS INC	116	131	2,108	226,748	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	58	63	1,462	157,204	小売
LKQ CORP	323	331	840	90,368	小売
HORMEL FOODS CORP	307	342	1,638	176,184	食品・飲料・タバコ
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	237	955	102,746	公益事業
EASTMAN CHEMICAL CO	148	142	879	94,513	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	122	247	4,437	477,096	資本財
HUMANA INC	142	147	5,623	604,633	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	303	267	868	93,391	公益事業
INVESCO LTD	426	428	335	36,051	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	185	199	1,925	206,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	136	150	779	83,854	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	172	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	210	246	1,388	149,248	エネルギー
MSCI INC	91	95	3,305	355,441	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	90	130	182	19,591	エネルギー
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	201	205	791	85,147	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,613	1,754	12,504	1,344,477	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,825	1,929	35,418	3,808,192	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	455	451	873	93,876	エネルギー
FLOWSERVE CORP	139	145	363	39,064	資本財
HELMERICH & PAYNE	116	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	352	482	4,670	502,152	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C	306	397	735	79,061	メディア・娯楽
RESMED INC	151	162	2,747	295,401	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	96	101	1,204	129,551	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	240	251	2,092	224,939	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	410	468	1,183	127,280	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	256	279	2,065	222,114	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	91	98	1,011	108,763	運輸
PERRIGO CO PLC	136	145	777	83,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FMC CORP	135	155	1,421	152,873	素材
WABTEC CORP	142	205	1,125	121,003	資本財
EVERSOURCE ENERGY	329	362	2,791	300,151	公益事業
INGREDION INC	73	71	586	63,017	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	350	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC	138	147	898	96,587	素材
EATON VANCE CORP	126	121	457	49,185	各種金融
DELTA AIR LINES INC	182	218	481	51,781	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	188	203	2,430	261,358	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	164	175	2,818	303,031	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	274	288	5,279	567,682	小売
FORTINET INC	146	168	2,368	254,699	ソフトウェア・サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	71	62	150	16,226	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	26	27	1,991	214,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	108	—	—	—	銀行
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	20	—	—	—	運輸
GENERAL MOTORS CO	1,317	1,440	3,283	353,026	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NXP SEMICONDUCTORS NV	356	315	3,237	348,119	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	338	297	1,667	179,338	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	44	48	867	93,319	資本財
HCA HEALTHCARE INC	286	305	3,180	341,971	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	173	161	488	52,526	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	720	714	2,336	251,172	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	124	131	1,269	136,544	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	142	146	793	85,304	資本財
DEXCOM INC	91	103	4,342	466,909	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	60	60	371	39,896	資本財
XYLEM INC	190	199	1,249	134,303	資本財
ABIOMED INC	44	53	1,048	112,741	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC	114	99	165	17,821	メディア・娯楽
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	63	61	706	75,913	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	172	187	1,930	207,521	銀行
ALLEGHANY CORP	15	16	831	89,407	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	82	90	5,207	559,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	456	498	3,823	411,122	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	2,492	2,710	57,792	6,213,890	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	300	322	1,790	192,479	公益事業
ALBEMARLE CORP	110	110	711	76,539	素材
PVH CORP	78	77	337	36,263	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	2,097	2,293	3,522	378,703	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	372	409	570	61,341	商業・専門サービス
APTIV PLC	274	299	1,995	214,541	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	163	160	577	62,089	資本財
SPLUNK INC	151	174	2,768	297,673	ソフトウェア・サービス
HEICO CORP-CLASS A	—	94	689	74,093	資本財
OGE ENERGY CORP	204	205	626	67,329	公益事業
POLARIS INC	62	62	460	49,497	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	1,561	1,988	17,481	1,879,644	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	41	1,403	150,870	資本財
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	86	1,178	126,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	133	152	12,355	1,328,511	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	234	287	1,275	137,183	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	129	137	916	98,562	各種金融
ZOETIS INC	498	536	6,786	729,658	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	82	1,737	186,839	ヘルスケア機器・サービス
NEWS CORP - CLASS A	417	413	442	47,559	メディア・娯楽
SPRINT CORP	850	—	—	—	電気通信サービス
SNAP-ON INC	59	66	826	88,912	資本財
PERKINELMER INC	—	119	1,120	120,465	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAPRI HOLDINGS LTD	156	151	217	23,368	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	712	839	2,491	267,917	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	79	83	1,561	167,843	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	312	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	154	184	3,076	330,756	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	185	212	8,168	878,254	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	86	99	981	105,504	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	92	98	2,328	250,410	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	97	107	1,096	117,908	資本財
ALPHABET INC-CL C	326	201	28,333	3,046,388	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
UNITED RENTALS INC	85	87	1,021	109,872	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	119	89	90	9,743	運輸
VOYA FINANCIAL INC	164	140	601	64,720	各種金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	40	54	231	24,917	素材
IQVIA HOLDINGS INC	166	188	2,606	280,293	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	429	426	645	69,425	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	292	303	2,069	222,533	消費者サービス
CDK GLOBAL INC	128	136	555	59,702	ソフトウェア・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	163	169	697	74,947	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	194	210	2,131	229,218	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY BROADBAND-C	109	119	1,498	161,114	メディア・娯楽
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	121	123	1,640	176,404	メディア・娯楽
OWENS CORNING	117	117	495	53,245	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	228	214	251	27,083	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	98	109	2,396	257,671	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	670	683	1,212	130,368	各種金融
QORVO INC	130	134	1,368	147,175	半導体・半導体製造装置
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	151	852	91,694	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	193	209	1,817	195,431	保険
ACUITY BRANDS INC	40	40	330	35,580	資本財
JONES LANG LASALLE INC	46	61	617	66,410	不動産
ARAMARK	266	260	634	68,193	消費者サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	491	461	973	104,690	銀行
LEAR CORP	64	69	719	77,387	自動車・自動車部品
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	93	126	1,802	193,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	223	232	456	49,080	素材
TARGA RESOURCES CORP	253	236	316	34,065	エネルギー
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	38	439	47,287	ソフトウェア・サービス
GRUBHUB INC	94	95	445	47,868	小売
CHEMOURS CO/THE	176	—	—	—	素材
WESTROCK CO	264	273	709	76,327	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	632	758	2,224	239,219	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	1,161	1,255	18,077	1,943,645	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	—	63	1,443	155,246	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	56	1,542	165,861	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	73	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	118	157	875	94,174	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,529	1,530	1,488	160,073	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	9	9	274	29,528	運輸
CDW CORP/DE	155	158	1,663	178,877	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SABRE CORP	277	270	180	19,428	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS A	547	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	55	59	1,326	142,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNEX CORP	172	191	1,116	120,082	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSUNION	187	223	1,740	187,139	商業・専門サービス
GODADDY INC - CLASS A	179	196	1,485	159,710	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	—	53	430	46,319	メディア・娯楽
WAYFAIR INC- CLASS A	63	76	1,454	156,359	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	211	286	229	24,633	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	171	183	597	64,189	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	98	93	305	32,889	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	217	264	790	84,965	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
VAIL RESORTS INC	41	48	856	92,060	消費者サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	25	1,182	127,138	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC	39	42	1,616	173,796	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	166	169	8,643	929,377	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	89	96	2,891	310,860	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	146	142	627	67,445	資本財
UGI CORP	176	275	835	89,886	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	224	261	1,001	107,666	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP	311	342	2,012	216,424	資本財
IHS MARKIT LTD	413	428	2,895	311,361	商業・専門サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	238	258	1,484	159,601	ソフトウェア・サービス
COTY INC-CL A	503	280	134	14,427	家庭用品・パーソナル用品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	98	957	103,000	ソフトウェア・サービス
HOWMET AEROSPACE INC	467	397	467	50,305	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	153	169	1,010	108,676	食品・飲料・タバコ
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	256	—	—	—	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	66	63	586	63,067	保険
TELEFLEX INC	46	54	1,888	203,077	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	206	—	—	—	電気通信サービス
BEIGENE LTD-ADR	33	41	680	73,146	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TECHNIPFMC PLC	441	465	349	37,543	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	130	148	2,928	314,896	ヘルスケア機器・サービス
TWILIO INC - A	—	134	2,504	269,263	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	93	125	1,250	134,421	各種金融
SNAP INC - A	—	799	1,445	155,459	メディア・娯楽
DXC TECHNOLOGY CO	291	362	605	65,052	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	162	170	460	49,550	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	77	86	551	59,266	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC	209	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC	180	195	571	61,426	資本財
ROLLINS INC	152	155	659	70,955	商業・専門サービス
XPO LOGISTICS INC	127	109	744	80,026	運輸
BAKER HUGHES CO	528	708	1,036	111,392	エネルギー
OKTA INC	—	118	2,066	222,153	ソフトウェア・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	110	—	—	—	保険
DUPONT DE NEMOURS INC	2,380	835	3,860	415,112	素材
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	125	131	505	54,333	運輸
BLACK KNIGHT INC	—	163	1,205	129,651	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	323	397	2,979	320,358	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	349	438	804	86,466	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	—	395	1,149	123,621	資本財
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	44	1,492	160,469	ソフトウェア・サービス
PTC INC	117	129	932	100,224	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	428	446	12,297	1,322,249	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	267	253	1,414	152,077	公益事業
ALTICE USA INC- A	323	131	313	33,656	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	25	436	46,905	保険
DOCUSIGN INC	—	120	1,449	155,849	ソフトウェア・サービス
LINDE PLC	571	605	11,311	1,216,220	素材
WIX.COM LTD	40	54	895	96,282	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	278	453	778	83,688	各種金融
BURLINGTON STORES INC	67	79	1,402	150,821	小売

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
ENBRIDGE INC	2,103	2,281	10,540	806,032	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	29	30	1,056	80,791	保険
CGI INC	260	275	2,467	188,716	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	347	328	132	10,107	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	78	88	259	19,865	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD	190	215	1,541	117,865	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,054	2,203	3,773	288,577	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	328	335	1,828	139,845	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA	354	388	2,181	166,836	銀行
ONEX CORPORATION	90	94	621	47,528	各種金融
POWER CORP OF CANADA	358	640	1,349	103,167	保険
POWER FINANCIAL CORP	274	—	—	—	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	475	547	1,271	97,252	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY INC	1,658	1,756	4,177	319,455	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	81	83	850	65,028	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	148	155	4,994	381,958	運輸
ENCANA CORP	1,584	—	—	—	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	252	268	2,424	185,429	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	162	—	—	—	資本財
KINROSS GOLD CORP	1,314	1,415	1,368	104,634	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	165	—	—	—	資本財
GREAT-WEST LIFECO INC	285	385	820	62,768	保険
METHANEX CORP	68	92	196	15,013	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	1,058	—	—	—	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	204	222	436	33,358	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC	246	276	998	76,360	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD	563	522	336	25,706	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	116	232	537	41,123	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	700	756	650	49,775	素材
FORTIS INC	430	508	2,756	210,821	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	453	981	4,051	309,820	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	688	908	558	42,702	素材
TORONTO-DOMINION BANK	1,897	2,041	11,811	903,207	銀行
FRANCO-NEVADA CORP	189	209	4,139	316,528	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	466	499	2,982	228,073	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	187	174	550	42,112	食品・生活必需品小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	149	134	437	33,487	公益事業
METRO INC/CN	250	278	1,654	126,552	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP	273	306	1,705	130,430	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP	140	159	2,225	170,185	保険
CENOVUS ENERGY INC	1,105	1,042	535	40,956	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	401	—	—	—	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP	277	—	—	—	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	524	586	1,954	149,438	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	159	—	—	—	エネルギー
DOLLARAMA INC	303	347	1,533	117,285	小売
KEYERA CORP	219	236	481	36,815	エネルギー
ALTAGAS LTD	303	288	476	36,404	公益事業
ATCO LTD -CLASS I	76	104	396	30,348	公益事業
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	207	—	—	—	不動産
INTER PIPELINE LTD	423	472	547	41,832	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	210	302	286	21,910	エネルギー

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	228	—	—	—	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	21	23	3,411	260,864	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	250	337	2,485	190,061	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	49	78	310	23,709	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	149	188	823	62,968	素材
HYDRO ONE LTD	351	369	954	72,998	公益事業
EMERA INC	54	265	1,473	112,711	公益事業
SHOPIFY INC - CLASS A	94	116	12,180	931,422	ソフトウェア・サービス
NUTRIEN LTD	638	665	3,226	246,751	素材
WSP GLOBAL INC	102	119	1,062	81,235	資本財
AURORA CANNABIS INC	741	59	61	4,721	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANOPY GROWTH CORP	219	230	482	36,864	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STARS GROUP INC/THE	199	265	993	75,971	消費者サービス
IA FINANCIAL CORP INC	121	117	482	36,870	保険
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	323	1,858	142,122	素材
CRONOS GROUP INC	199	256	188	14,447	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUEBECOR INC -CL B	—	185	551	42,200	メディア・娯楽
AIR CANADA	—	124	202	15,456	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	552	1,070	81,847	公益事業
PARKLAND FUEL CORP	—	158	537	41,079	エネルギー
OVINTIV INC	—	205	167	12,788	エネルギー
小計 株数・金額	43,615	42,325	193,649	14,808,391	
小計 銘柄数<比率>	88	83	—	<3.3%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
COMMERZBANK AG	1,024	1,071	343	39,814	銀行
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	2,072	2,245	1,429	165,799	各種金融
SIEMENS AG-REG	794	860	7,582	879,776	資本財
RWE AG	537	665	1,798	208,645	公益事業
BASF SE	952	1,046	4,735	549,386	素材
VOLKSWAGEN AG	33	47	652	75,725	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	943	1,022	3,164	367,132	自動車・自動車部品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	187	202	1,565	181,585	家庭用品・パーソナル用品
E.ON SE	2,290	2,544	2,315	268,593	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	347	362	1,860	215,869	自動車・自動車部品
BAYER AG-REG	967	1,107	6,392	741,695	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANZ SE-REG	440	467	7,311	848,268	保険
CONTINENTAL AG	113	125	980	113,711	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,179	1,411	2,514	291,691	半導体・半導体製造装置
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	154	165	762	88,427	自動車・自動車部品
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	234	226	173	20,089	運輸
HUGO BOSS AG -ORD	67	—	—	—	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE POST AG-REG	1,027	1,111	2,974	345,114	運輸
SAP SE	1,019	1,106	11,803	1,369,460	ソフトウェア・サービス
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	256	—	—	—	メディア・娯楽
DEUTSCHE BOERSE AG	197	213	3,186	369,736	各種金融
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	226	240	1,755	203,707	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	40	38	143	16,644	運輸
ADIDAS AG	187	202	4,170	483,851	耐久消費財・アパレル
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,459	3,715	5,020	582,517	電気通信サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	155	161	3,056	354,647	保険
THYSSENKRUPP AG	425	411	199	23,154	素材
BEIERSDORF AG	101	112	1,060	123,029	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
HEIDELBERGCEMENT AG	156	157	661	76,762	素材
MERCK KGAA	130	152	1,618	187,768	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOLKSWAGEN AG-PREF	192	198	2,527	293,274	自動車・自動車部品
PUMA SE	8	101	592	68,738	耐久消費財・アパレル
LANXESS AG	90	86	399	46,294	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	435	473	1,920	222,804	ヘルスケア機器・サービス
HOCHTIEF AG	25	24	170	19,750	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	374	421	1,620	188,043	不動産
GEA GROUP AG	171	157	346	40,175	資本財
SYMRISE AG	127	144	1,369	158,915	素材
HENKEL AG & CO KGAA	104	116	825	95,725	家庭用品・パーソナル用品
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	125	126	405	47,005	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	53	82	348	40,490	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE	61	68	943	109,451	保険
BRENNTAG AG	167	187	808	93,778	資本財
AXEL SPRINGER SE	49	—	—	—	メディア・娯楽
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	41	383	44,487	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB SE-PREF	67	92	323	37,506	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	679	1,280	342	39,679	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG	104	—	—	—	資本財
VONOVIA SE	511	581	2,846	330,265	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG	180	227	496	57,637	素材
ZALANDO SE	122	153	838	97,253	小売
COVESTRO AG	194	202	609	70,711	素材
UNIPER SE	197	218	538	62,454	公益事業
INNOGY SE	145	—	—	—	公益事業
METRO AG	183	142	112	13,105	食品・生活必需品小売り
KION GROUP AG	68	61	279	32,389	資本財
1&1 DRILLISCH AG	59	—	—	—	電気通信サービス
MTU AERO ENGINES AG	55	63	782	90,780	資本財
WIRECARD AG	118	137	1,257	145,938	ソフトウェア・サービス
DELIVERY HERO SE	101	133	1,171	135,891	小売
SARTORIUS AG-VORZUG	36	41	1,157	134,281	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	153	163	683	79,324	ヘルスケア機器・サービス
KNORR-BREMSE AG	—	52	423	49,133	資本財
小計 株数・金額	24,693	26,978	103,757	12,037,899	
小計 銘柄数<比率>	61	57	—	<2.7%>	
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	1,232	1,242	1,598	185,409	保険
INTESA SANPAOLO	15,379	16,811	2,369	274,906	銀行
TELECOM ITALIA SPA	12,095	9,493	330	38,351	電気通信サービス
ENI SPA	2,626	2,872	2,479	287,652	エネルギー
UNICREDIT SPA	2,074	2,321	1,535	178,174	銀行
ENEL SPA	8,434	9,189	5,587	648,247	公益事業
RECORDATI SPA	114	110	484	56,255	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLANTIA SPA	504	552	773	89,737	運輸
MEDIOBANCA SPA	623	662	355	41,278	銀行
SNAM SPA	2,394	2,234	899	104,406	公益事業
TELECOM ITALIA-RSP	6,267	8,748	310	36,074	電気通信サービス
LEONARDO SPA	423	416	246	28,562	資本財
TERNA SPA	1,430	1,705	965	111,984	公益事業
PRYSMIAN SPA	247	259	467	54,289	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	595	631	455	52,803	食品・飲料・タバコ
POSTE ITALIANE SPA	573	579	440	51,082	保険
FINECOBANK SPA	—	666	665	77,259	銀行
MONCLER SPA	181	208	674	78,267	耐久消費財・アパレル
PIRELLI & C SPA	430	351	126	14,723	自動車・自動車部品
小計 株数・金額	55,628	59,061	20,767	2,409,468	
小計 銘柄数<比率>	18	19	—	<0.5%>	
(ユーロ…フランス)					
MICHELIN (CGDE)	176	194	1,690	196,169	自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	288	313	10,939	1,269,149	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	618	680	893	103,692	自動車・自動車部品
AXA SA	2,006	2,174	3,503	406,493	保険
DANONE	639	692	4,435	514,583	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	625	661	877	101,765	食品・生活必需品小売り
VIVENDI	1,081	935	1,875	217,616	メディア・娯楽
INGENICO GROUP	67	72	872	101,268	ﾃｸﾉﾛｼﾞｰ・ﾊｰﾄﾞｳｪｱおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	801	937	1,210	140,386	銀行
AIR LIQUIDE SA	444	534	6,241	724,143	素材
TOTAL SA	2,501	2,701	8,749	1,015,111	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	515	589	1,479	171,671	資本財
VINCI SA	526	580	4,363	506,301	資本財
SANOFI	1,168	1,272	11,318	1,313,145	医薬品・ﾊﾞｲｵﾃｸﾉﾛｼﾞｰ・ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ
VEOLIA ENVIRONNEMENT	565	648	1,245	144,507	公益事業
L'OREAL	261	283	7,260	842,380	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	199	188	425	49,353	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	569	628	5,045	585,337	資本財
BNP PARIBAS	1,164	1,258	3,535	410,160	銀行
ESSILORLUXOTTICA	298	321	3,648	423,286	耐久消費財・アパレル
CAPGEMINI SE	166	187	1,614	187,337	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	52	68	242	28,189	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	245	278	561	65,180	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	32	35	2,375	275,557	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA	91	90	583	67,653	消費者サービス
KERING	78	85	3,752	435,315	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	135	144	1,990	230,955	ソフトウェア・サービス
ATOS SE	97	113	712	82,657	ソフトウェア・サービス
ORANGE	2,066	2,246	2,389	277,179	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	177	307	274	31,800	保険
IMERYS SA	32	—	—	—	素材
SAFRAN SA	345	370	2,909	337,535	資本財
RENAULT SA	199	214	377	43,851	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	226	260	682	79,153	メディア・娯楽
JCDECAUX SA	67	121	236	27,392	メディア・娯楽
SOCIETE BIC SA	29	—	—	—	商業・専門サービス
BOUYGUES SA	229	232	626	72,650	資本財
THALES SA	107	117	818	95,002	資本財
PERNOD RICARD SA	220	239	3,236	375,513	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA	1,207	1,414	993	115,280	銀行
ENGIE	1,893	2,089	2,039	236,655	公益事業
ALSTOM	161	201	728	84,502	資本財
ARKEMA	73	74	561	65,094	素材
LEGRAND SA	276	295	1,739	201,767	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SCOR SE	176	172	404	46,874	保険
ADP	32	31	245	28,469	運輸
EDF	648	627	445	51,714	公益事業
NATIXIS	932	937	198	23,087	各種金融
WENDEL	26	27	202	23,502	各種金融
BUREAU VERITAS SA	276	301	556	64,607	商業・専門サービス
EURAZEO SE	44	41	182	21,216	各種金融
EURAZEO SE-NEW	2	—	—	—	各種金融
SUEZ	415	365	381	44,263	公益事業
EIFFAGE	81	80	608	70,614	資本財
ILIAD SA	24	13	183	21,311	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	169	147	132	15,371	メディア・娯楽
BIOMERIEUX	40	51	630	73,208	ヘルスケア機器・サービス
GETLINK SE	498	586	668	77,552	運輸
EDENRED	243	296	1,153	133,771	ソフトウェア・サービス
REMY COINTREAU	20	20	210	24,459	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	292	—	—	—	資本財
BOLLORE	846	837	210	24,448	メディア・娯楽
DASSAULT AVIATION SA	2	2	186	21,597	資本財
SEB SA	21	21	237	27,580	耐久消費財・アパレル
IPSEN	40	52	355	41,253	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	62	63	374	43,407	各種金融
FAURECIA	83	69	228	26,565	自動車・自動車部品
TELEPERFORMANCE	59	65	1,446	167,848	商業・専門サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	89	97	704	81,793	メディア・娯楽
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	30	30	708	82,162	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDLINE SA	85	138	925	107,345	ソフトウェア・サービス
小計 株数・金額	27,984	29,938	120,641	13,996,780	
小計 銘柄数<比率>	71	67	—	<3.1%>	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	236	262	1,038	120,502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	1,030	1,062	547	63,545	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,129	1,273	972	112,776	自動車・自動車部品
FERRARI NV	128	139	2,056	238,574	自動車・自動車部品
EXOR NV	112	129	614	71,341	各種金融
AIRBUS SE	604	653	3,561	413,175	資本財
STMICROELECTRONICS NV	694	771	1,760	204,239	半導体・半導体製造装置
WOLTERS KLUWER	290	306	2,057	238,673	商業・専門サービス
UNILEVER NV	—	1,654	7,522	872,809	家庭用品・パーソナル用品
KONINKLIJKE KPN NV	3,377	3,846	814	94,475	電気通信サービス
AKZO NOBEL N.V.	233	229	1,601	185,808	素材
HEINEKEN NV	269	293	2,220	257,609	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	961	1,020	4,015	465,829	ヘルスケア機器・サービス
AEGON NV	1,879	2,035	446	51,760	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	1,228	1,248	2,902	336,735	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD NV	117	135	485	56,314	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	122	128	903	104,848	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	185	207	2,363	274,226	素材
ING GROEP NV	4,034	4,421	2,180	252,928	銀行
ASML HOLDING NV	425	479	13,385	1,553,033	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA	1,603	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK	83	74	371	43,064	エネルギー

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
NN GROUP NV		316	341	866	100,543	保険
ALTICE EUROPE NV		—	632	233	27,138	メディア・娯楽
ABN AMRO BANK NV-CVA		428	455	302	35,103	銀行
ADYEN NV		11	12	1,223	141,966	ソフトウェア・サービス
JUST EAT TAKEAWAY		—	126	1,266	146,989	小売
PROSUS NV		—	550	4,254	493,662	小売
小計	株数・金額	19,505	22,494	59,969	6,957,678	
	銘柄数<比率>	24	27	—	<1.5%>	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		269	236	322	37,414	資本財
ENDESA SA		318	381	772	89,609	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		273	297	704	81,715	資本財
IBERDROLA SA		6,433	6,917	5,981	694,020	公益事業
TELEFONICA SA		4,838	5,265	2,208	256,278	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		16,803	18,394	3,571	414,372	銀行
BANKINTER SA		662	676	235	27,331	銀行
REPSOL SA		1,454	1,673	1,423	165,124	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		6,895	7,566	2,002	232,370	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		372	331	548	63,665	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		1,128	1,232	2,848	330,500	小売
MAPFRE SA		1,250	1,522	240	27,936	保険
FERROVIAL SA		516	582	1,332	154,559	資本財
ENAGAS SA		240	271	561	65,169	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		435	511	793	92,097	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		5,932	6,443	198	23,085	銀行
CAIXABANK SA		3,668	3,845	636	73,844	銀行
GRIFOLS SA		308	326	959	111,378	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA		454	487	1,907	221,297	ソフトウェア・サービス
BANKIA SA		1,302	1,629	141	16,466	銀行
AENA SME SA		69	76	805	93,470	運輸
CELLNEX TELECOM SA		—	276	1,380	160,220	電気通信サービス
小計	株数・金額	53,629	58,947	29,580	3,431,932	
	銘柄数<比率>	21	22	—	<0.8%>	
(ユーロ…ベルギー)						
GALAPAGOS NV		—	52	1,101	127,752	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGEAS		198	181	584	67,791	保険
UCB SA		128	144	1,221	141,739	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		87	90	649	75,389	各種金融
UMICORE		217	208	779	90,487	素材
COLRUYT SA		63	58	342	39,785	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV		262	296	1,413	163,984	銀行
SOLVAY SA		76	86	635	73,701	素材
PROXIMUS		168	154	287	33,378	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		59	64	225	26,195	メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		790	856	3,401	394,626	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	2,052	2,194	10,643	1,234,832	
	銘柄数<比率>	10	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		320	331	652	75,681	銀行
VERBUND AG		71	66	296	34,441	公益事業
OMV AG		157	155	481	55,807	エネルギー
VOESTALPINE AG		123	109	202	23,500	素材

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ANDRITZ AG		73	66	204	23,756	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		145	210	334	38,774	銀行
小計	株数・金額	890	939	2,171	251,961	
	銘柄数<比率>	6	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP		42	—	—	—	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		818	1,363	683	79,318	不動産
TENARIS SA		497	486	297	34,540	エネルギー
SES		369	375	221	25,693	メディア・娯楽
EUROFINS SCIENTIFIC		12	12	691	80,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL		707	697	602	69,850	素材
小計	株数・金額	2,448	2,935	2,496	289,589	
	銘柄数<比率>	6	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		5,834	6,385	2,117	245,702	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		552	689	716	83,170	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ		112	121	223	25,918	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		566	580	1,443	167,501	素材
FORTUM OYJ		455	486	749	86,974	公益事業
KONE OYJ-B		353	391	2,215	257,019	資本財
METSO OYJ		108	101	260	30,227	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		465	513	1,514	175,672	保険
WARTSILA OYJ ABP		472	469	311	36,132	資本財
ELISA OYJ		150	166	918	106,560	電気通信サービス
NESTE OYJ		407	480	1,534	178,054	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		99	107	510	59,201	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	9,578	10,493	12,516	1,452,135	
	銘柄数<比率>	12	12	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		168	184	1,919	222,715	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		160	166	828	96,122	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		80	92	1,033	119,884	消費者サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW		—	1	15	1,741	消費者サービス
BANK OF IRELAND GROUP PLC		1,020	926	129	15,031	銀行
AIB GROUP PLC		897	1,193	110	12,799	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		228	259	744	86,417	素材
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD		472	472	—	—	銀行
CRH PLC		851	866	2,301	267,054	素材
小計	株数・金額	3,879	4,163	7,082	821,766	
	銘柄数<比率>	8	9	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		2,590	2,863	1,175	136,357	公益事業
JERONIMO MARTINS		243	268	422	48,992	食品・生活必需品小売り
GALP ENERGIA SGPS SA		525	647	656	76,166	エネルギー
小計	株数・金額	3,359	3,779	2,254	261,515	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額	203,649	221,926	371,880	43,145,558	
	銘柄数<比率>	240	238	—	<9.6%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		17,749	18,737	1,922	254,249	銀行
BP PLC		20,780	22,852	7,172	948,546	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		73,795	78,426	2,385	315,461	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ASTRAZENECA PLC	1,314	1,479	12,878	1,703,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	419	396	499	65,994	資本財
NEXT PLC	149	152	730	96,555	小売
DIAGEO PLC	2,518	2,637	7,467	987,614	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC	3,251	3,681	1,851	244,900	資本財
UNILEVER PLC	1,152	1,248	5,209	688,899	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	10,156	11,036	2,627	347,520	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	2,042	2,166	4,030	533,072	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,677	1,950	170	22,584	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	697	799	5,474	724,026	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC	—	412	919	121,618	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRUDENTIAL PLC	2,683	2,908	3,259	431,127	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	6,250	6,888	1,403	185,572	保険
SAGE GROUP PLC/THE	1,100	1,184	761	100,699	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	20,786	22,893	9,409	1,244,395	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,380	2,585	7,887	1,043,118	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	706	809	735	97,311	公益事業
SCHRODERS PLC	119	132	368	48,733	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	5,062	5,778	638	84,413	銀行
BHP GROUP PLC	2,189	2,361	3,190	421,894	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	990	1,093	1,766	233,659	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	1,336	1,439	849	112,307	メディア・娯楽
CENTRICA PLC	5,907	6,723	244	32,358	公益事業
BT GROUP PLC	8,750	9,872	1,053	139,377	電気通信サービス
SSE PLC	1,039	1,182	1,467	194,087	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	2,919	2,986	1,208	159,874	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,767	2,093	591	78,244	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT	125,524	—	—	—	資本財
COMPASS GROUP PLC	1,645	1,805	2,293	303,314	消費者サービス
KINGFISHER PLC	2,231	2,310	375	49,633	小売
PEARSON PLC	815	869	395	52,330	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC	255	269	656	86,864	公益事業
RIO TINTO PLC	1,198	1,273	4,678	618,713	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	5,148	5,622	9,433	1,247,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC	1,004	1,127	829	109,642	各種金融
VODAFONE GROUP PLC	27,677	30,090	3,400	449,676	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	2,401	2,632	496	65,719	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	1,772	1,850	353	46,696	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	3,963	4,467	1,081	143,087	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	201	237	465	61,584	素材
RENTOKIL INITIAL PLC	—	2,155	1,030	136,232	商業・専門サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,102	1,161	444	58,802	保険
WHITBREAD PLC	194	178	505	66,894	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	3,526	3,890	3,600	476,218	公益事業
BUNZL PLC	343	398	695	91,937	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	1,092	1,127	1,609	212,836	素材
INTERTEK GROUP PLC	172	182	868	114,812	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	425	431	592	78,336	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	172	188	663	87,716	消費者サービス
CARNIVAL PLC	174	163	156	20,733	消費者サービス
PERSIMMON PLC	321	396	879	116,308	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	810	868	213	28,195	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ITV PLC	3,763	3,850	285	37,737	メディア・娯楽
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	324	353	2,809	371,514	各種金融
G4S PLC	1,704	1,363	125	16,625	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	122	138	578	76,508	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,064	1,119	570	75,481	耐久消費財・アパレル
SMITH & NEPHEW PLC	907	992	1,594	210,842	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	3,313	3,430	516	68,355	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,669	4,747	6,236	824,808	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,884	4,177	5,272	697,272	エネルギー
INVESTEC PLC	745	—	—	—	各種金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2,689	2,521	541	71,601	各種金融
EXPERIAN PLC	942	1,019	2,607	344,784	商業・専門サービス
MONDI PLC	384	527	719	95,201	素材
WEIR GROUP PLC/THE	247	272	254	33,612	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	377	403	696	92,087	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC	408	392	313	41,431	素材
ADMIRAL GROUP PLC	209	207	501	66,365	保険
FRESNILLO PLC	211	—	—	—	素材
BABCOCK INTL GROUP PLC	227	—	—	—	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC	543	602	510	67,492	各種金融
GLENCORE PLC	11,709	12,104	1,793	237,238	素材
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	86	799	105,698	資本財
EVRAZ PLC	—	968	245	32,454	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	302	377	598	79,128	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC	132	146	730	96,627	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	5,084	5,654	530	70,097	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI	209	222	410	54,319	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC	192	218	109	14,447	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,489	1,521	416	55,125	保険
ROYAL MAIL PLC	980	—	—	—	運輸
AVEVA GROUP PLC	—	63	251	33,202	ソフトウェア・サービス
ASHTEAD GROUP PLC	508	484	1,099	145,373	資本財
MERLIN ENTERTAINMENT	681	—	—	—	消費者サービス
TUI AG-DI	469	418	111	14,740	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	368	312	139	18,458	ソフトウェア・サービス
NMC HEALTH PLC	116	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	—	502	962	127,345	小売
AUTO TRADER GROUP PLC	959	1,014	503	66,643	メディア・娯楽
DCC PLC	104	112	662	87,591	資本財
GVC HOLDINGS PLC	618	629	490	64,903	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC	1,236	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
JOHN WOOD GROUP PLC	695	—	—	—	エネルギー
INFORMA PLC	1,275	1,567	675	89,334	メディア・娯楽
FERGUSON PLC	242	256	1,498	198,223	資本財
M&G PLC	—	3,120	402	53,215	各種金融
JD SPORTS FASHION PLC	—	457	246	32,588	小売
小計 株数・金額	435,994	336,973	160,708	21,253,670	
小計 銘柄数<比率>	93	92	—	<4.7%>	
(スイス)			千スイスフラン		
NESTLE SA-REG	3,177	3,354	35,419	3,907,438	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	540	586	3,265	360,302	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	2,648	2,916	2,320	255,962	各種金融

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	503	561	2,193	242,010	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	729	792	27,318	3,013,796	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG	9	10	3,449	380,500	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	55	62	1,199	132,294	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	156	165	4,823	532,128	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	11	11	837	92,362	ヘルスケア機器・サービス
LONZA GROUP AG-REG	77	83	3,762	415,055	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	62	110	392	43,354	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	40	45	972	107,276	資本財
GEBERIT AG-REG	38	42	1,849	204,059	資本財
SWISS RE AG	315	323	2,135	235,605	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	31	25	459	50,638	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR	36	39	271	29,905	各種金融
NOVARTIS AG-REG	2,249	2,422	20,262	2,235,363	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	165	182	751	82,897	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	27	28	1,408	155,424	電気通信サービス
ABB LTD-REG	1,907	2,066	3,671	405,025	資本財
CLARIANT AG-REG	191	200	354	39,137	素材
SGS SA-REG	5	7	1,531	168,944	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	22	26	563	62,154	資本財
TEMENOS AG - REG	60	70	928	102,410	ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	56	61	839	92,654	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG	49	56	775	85,540	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	35	40	1,328	146,532	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.09	0.11	907	100,115	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD	237	242	892	98,451	各種金融
SIKA AG-REG	133	144	2,394	264,185	素材
SWISS PRIME SITE-REG	82	80	748	82,569	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	1	1,032	113,953	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG	18	20	1,591	175,553	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	3	618	68,248	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	8	8	570	62,897	素材
UBS GROUP AG-REG	3,997	4,313	4,090	451,228	各種金融
DUFRY AG-REG	36	41	112	12,360	小売
VIFOR PHARMA AG	45	58	897	99,028	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALCON INC	449	469	2,462	271,638	ヘルスケア機器・サービス
小計 株数・金額	18,221	19,679	139,403	15,379,009	
小計 銘柄数<比率>	39	39	—	<3.4%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B	261	237	3,272	35,537	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	3,187	3,442	28,820	312,985	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	389	406	12,742	138,387	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,671	1,957	14,553	158,047	銀行
INVESTOR AB-B SHS	459	520	24,779	269,104	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,586	1,777	15,763	171,191	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS	708	782	27,055	293,817	資本財
SKF AB-B SHARES	403	445	6,912	75,071	資本財
ASSA ABLOY AB-B	1,046	1,132	20,983	227,882	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	928	920	12,036	130,715	小売
SANDVIK AB	1,169	1,296	19,174	208,239	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES	958	1,011	10,751	116,761	銀行
SECURITAS AB-B SHS	333	323	3,737	40,585	商業・専門サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円	
SKANSKA AB-B SHS		363	395	7,224	78,455	資本財
SWEDISH MATCH AB		173	186	11,595	125,931	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		518	572	7,292	79,200	電気通信サービス
TELIA CO AB		2,919	3,299	10,765	116,912	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS		1,606	1,606	19,949	216,654	資本財
ALFA LAVAL AB		302	412	7,671	83,312	資本財
LUNDIN ENERGY AB		201	211	4,753	51,624	エネルギー
BOLIDEN AB		283	308	6,063	65,850	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		470	406	2,352	25,542	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		73	103	2,379	25,839	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS		262	294	14,023	152,294	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B		262	253	5,593	60,745	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		150	159	3,165	34,375	各種金融
ICA GRUPPEN AB		72	96	4,042	43,899	食品・生活必需品小売り
LUNDBERGS AB-B SHS		66	74	3,104	33,709	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B		636	684	21,552	234,063	家庭用品・パーソナル用品
EPIROC AB-B		440	417	4,265	46,320	資本財
EPIROC AB-A		643	793	8,144	88,449	資本財
NORDEA BANK ABP		3,152	3,709	21,892	237,748	銀行
小計	株数・金額	25,723	28,240	366,414	3,979,260	
	銘柄数<比率>	32	32	—	<0.9%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		1,002	1,105	12,883	133,856	銀行
NORSK HYDRO ASA		1,415	1,281	2,993	31,104	素材
ORKLA ASA		802	812	6,850	71,179	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA		1,200	1,134	16,023	166,487	エネルギー
TELENOR ASA		777	872	13,169	136,833	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		182	195	6,485	67,385	素材
MOWI ASA		430	461	8,312	86,364	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		193	221	3,905	40,573	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		109	97	2,006	20,847	メディア・娯楽
AKER BP ASA		117	102	1,765	18,340	エネルギー
小計	株数・金額	6,233	6,284	74,395	772,973	
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B		1,884	1,993	87,531	1,361,987	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S-B SHARES		226	235	8,268	128,660	素材
DANSKE BANK A/S		742	710	5,390	83,869	銀行
DEMANT A/S		104	118	2,056	31,992	ヘルスケア機器・サービス
H LUNDBECK A/S		62	63	1,573	24,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		202	218	13,265	206,408	資本財
CARLSBERG AS-B		108	127	10,740	167,129	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B		123	135	14,098	219,367	ヘルスケア機器・サービス
DSV PANALPINA A/S		189	239	17,000	264,531	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		7	7	4,844	75,380	運輸
TRYG A/S		121	147	2,710	42,180	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		3	3	2,235	34,780	運輸
PANDORA A/S		122	105	2,939	45,744	耐久消費財・アパレル
ISS A/S		183	213	2,061	32,074	商業・専門サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		99	117	7,372	114,715	素材
GENMAB A/S		62	75	14,362	223,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
ORSTED A/S	193	211	14,796	230,230	公益事業
小計 株数・金額	4,439	4,725	211,247	3,287,010	
小計 銘柄数<比率>	17	17	－	<0.7%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
BHP GROUP LTD	3,059	3,338	10,531	728,884	素材
CSL LTD	470	511	15,464	1,070,314	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALUMINA LTD	2,703	3,240	499	34,539	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	976	1,072	2,400	166,117	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,979	3,240	5,123	354,623	銀行
RIO TINTO LTD	386	411	3,456	239,214	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,364	1,622	1,239	85,788	保険
LENDLEASE GROUP	627	628	710	49,203	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,838	1,993	11,988	829,739	銀行
WESTPAC BANKING CORP	3,570	4,039	6,314	437,016	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,846	3,589	5,736	397,035	銀行
BRAMBLES LTD	1,640	1,900	2,062	142,747	商業・専門サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	－	767	270	18,744	運輸
BORAL LTD	1,267	1,130	313	21,675	素材
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,372	1,437	4,992	345,561	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD	4,389	4,567	1,402	97,041	電気通信サービス
AMP LTD	3,147	4,324	616	42,652	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD	2,062	2,078	675	46,752	消費者サービス
AMCOR LIMITED	1,197	－	－	－	素材
COMPUTERSHARE LTD	462	505	597	41,332	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	599	677	1,722	119,209	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	336	384	4,286	296,675	各種金融
CIMIC GROUP LTD	94	146	340	23,533	資本財
ASX LTD	198	210	1,748	121,006	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD	584	519	450	31,195	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	63	71	1,370	94,833	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	441	456	1,012	70,093	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	552	790	238	16,523	小売
NEWCREST MINING LTD	789	858	2,387	165,263	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	2,355	2,523	1,377	95,364	保険
ORIGIN ENERGY LTD	1,780	1,802	1,005	69,600	エネルギー
ORICA LTD	399	424	682	47,244	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	476	477	1,263	87,470	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	1,881	1,832	905	62,647	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	1,343	1,377	1,278	88,487	保険
TRANSURBAN GROUP	2,794	3,115	4,299	297,593	運輸
WESFARMERS LTD	1,179	1,278	4,837	334,829	小売
BLUESCOPE STEEL LTD	583	520	542	37,571	素材
CHALLENGER LTD	610	590	271	18,789	各種金融
SYDNEY AIRPORT	1,232	1,266	715	49,516	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD	291	289	728	50,392	エネルギー
OIL SEARCH LTD	1,406	2,206	644	44,582	エネルギー
WORLEY LTD	363	303	267	18,485	エネルギー
AGL ENERGY LTD	667	853	1,422	98,416	公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,590	1,643	1,990	137,771	素材
AUSNET SERVICES	1,869	1,900	372	25,774	公益事業
CROWN RESORTS LTD	379	382	356	24,688	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD	1,623	1,491	326	22,601	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	545	707	424	29,380	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	2,121	2,213	1,022	70,790	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	773	796	823	57,019	食品・飲料・タバコ
APA GROUP	—	1,300	1,508	104,368	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	150	191	1,177	81,519	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	51	222	249	17,277	消費者サービス
SEEK LTD	372	359	625	43,260	メディア・娯楽
BANK OF QUEENSLAND LTD	376	—	—	—	銀行
REA GROUP LTD	50	51	476	33,008	メディア・娯楽
TPG TELECOM LTD	341	315	229	15,849	電気通信サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	3,016	2,895	810	56,116	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	63	—	—	—	消費者サービス
SOUTH32 LTD	5,138	5,838	1,123	77,792	素材
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	137	748	51,823	各種金融
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	135	174	316	21,935	エネルギー
COLES GROUP LTD	1,184	1,509	2,279	157,761	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	—	213	424	29,377	ソフトウェア・サービス
小計 株数・金額	77,180	85,725	123,485	8,546,427	
小計 銘柄数<比率>	61	62	—	<1.9%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,923	1,790	831	54,172	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	993	965	577	37,583	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	576	634	1,869	121,757	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	862	805	274	17,844	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	360	382	470	30,613	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	1,237	1,208	575	37,455	公益事業
MERCURY NZ LTD	—	676	334	21,768	公益事業
A2 MILK CO LTD	738	806	1,550	100,938	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	6,693	7,271	6,482	422,133	
小計 銘柄数<比率>	7	8	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	1,170	—	—	—	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	510	520	2,633	36,530	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,808	3,068	17,552	243,458	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,660	1,805	18,447	255,861	不動産
MTR CORP	1,635	1,785	7,639	105,964	運輸
HONG KONG & CHINA GAS	9,704	11,855	16,360	226,917	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	6,570	6,440	5,905	81,909	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,435	1,640	8,290	114,985	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,239	1,346	33,650	466,725	各種金融
HANG LUNG GROUP LTD	880	—	—	—	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,180	2,110	3,587	49,751	不動産
CLP HOLDINGS LTD	1,725	1,915	15,348	212,886	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,369	1,626	5,090	70,607	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	1,366	1,294	2,119	29,403	銀行
HANG SENG BANK LTD	795	848	11,660	161,724	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	710	—	—	—	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,220	—	—	—	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	334	305	2,470	34,265	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	3,334	3,194	3,538	49,085	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	765	610	803	11,151	耐久消費財・アパレル
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	710	700	3,241	44,952	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,870	4,085	9,967	138,247	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	1,385	1,560	10,381	143,995	資本財
PCCW LTD	4,060	4,460	2,127	29,507	電気通信サービス
KERRY PROPERTIES LTD	605	925	2,021	28,033	不動産
MINTH GROUP LTD	840	—	—	—	自動車・自動車部品
NWS HOLDINGS LTD	1,785	2,145	1,662	23,057	資本財
SANDS CHINA LTD	2,464	2,732	8,783	121,825	消費者サービス
WHEELOCK & CO LTD	840	960	5,553	77,028	不動産
WYNN MACAU LTD	1,508	2,056	2,960	41,064	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD	2,400	2,100	1,734	24,058	消費者サービス
AIA GROUP LTD	12,538	13,620	96,293	1,335,589	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	1,230	1,126	2,471	34,280	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2,490	2,420	13,128	182,092	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	884	—	—	—	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	3,950	4,040	5,195	72,060	電気通信サービス
WH GROUP LTD	8,910	10,395	7,494	103,952	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,683	2,923	14,589	202,351	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	3,000	2,394	33,204	公益事業
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,260	1,350	4,542	63,007	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	900	2,565	35,576	食品・飲料・タバコ
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	1,363	3,168	43,953	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	95,823	103,223	355,376	4,929,068	
小計 銘柄数<比率>	39	36	—	<1.1%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,311	3,773	3,373	255,441	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,528	1,479	229	17,366	メディア・娯楽
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	926	1,280	207	15,703	資本財
CAPITALAND LTD	2,614	3,022	891	67,512	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	378	429	344	26,055	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	109	135	276	20,948	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,862	2,046	4,092	309,887	銀行
KEPPEL CORP LTD	1,476	1,671	1,014	76,812	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,392	1,443	2,896	219,321	銀行
VENTURE CORP LTD	300	284	447	33,874	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,748	1,693	565	42,822	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	8,473	9,344	2,569	194,608	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	583	510	225	17,045	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	812	871	864	65,433	各種金融
UOL GROUP LTD	443	440	308	23,324	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	2,383	2,682	429	32,497	運輸
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,395	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,112	2,018	714	54,099	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE LTD	6,480	5,772	444	33,657	消費者サービス
SATS LTD	650	905	272	20,629	運輸
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	2,745	3,213	327	24,818	資本財
小計 株数・金額	46,722	43,011	20,492	1,551,860	
小計 銘柄数<比率>	21	20	—	<0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
ICL LTD	710	969	1,207	37,009	素材
BANK HAPOALIM BM	1,078	1,215	2,725	83,518	銀行
NICE LTD	62	67	4,269	130,814	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,504	1,587	3,065	93,926	銀行

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		百株	百株	ﾁｲｽﾗｴﾙｼｪｹﾙ	千円	
ELBIT SYSTEMS LTD		22	32	1,555	47,670	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		—	1,244	1,427	43,747	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		1,865	—	—	—	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		159	140	987	30,269	銀行
AZRIELI GROUP LTD		37	52	1,014	31,089	不動産
小計	株数・金額	5,441	5,311	16,254	498,046	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	1,284,294	1,245,065	—	421,655,664	
	銘柄数<比率>	1,253	1,254	—	<93.7%>	

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47	55	1,327	142,732	0.0
MACERICH CO/THE	11	—	—	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11	12	1,971	211,935	0.0
PROLOGIS INC	65	83	7,387	794,345	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	9	10	939	101,010	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16	17	554	59,570	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	21	29	4,278	460,044	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	20	1,229	132,230	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6	7	1,769	190,222	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	12	14	1,312	141,090	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7	7	591	63,602	0.0
WELLTOWER INC	39	45	1,919	206,388	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	16	17	1,479	159,026	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	57	1,013	108,948	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11	13	1,537	165,299	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	22	598	64,358	0.0
REALTY INCOME CORP	30	35	1,916	206,064	0.0
REGENCY CENTERS CORP	15	18	735	79,134	0.0
SL GREEN REALTY CORP	8	9	412	44,352	0.0
SUN COMMUNITIES INC	—	10	1,515	162,987	0.0
UDR INC	27	34	1,294	139,151	0.0
VENTAS INC	37	44	1,285	138,255	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	141	—	—	—	—
WEYERHAEUSER CO	77	85	1,647	177,099	0.0
AMERICAN TOWER CORP	45	49	11,897	1,279,187	0.3
AGNC INVESTMENT CORP	56	—	—	—	—
WP CAREY INC	17	21	1,306	140,451	0.0
VEREIT INC	95	114	607	65,340	0.0
DUKE REALTY CORP	38	41	1,393	149,871	0.0
IRON MOUNTAIN INC	27	30	725	77,988	0.0
EQUINIX INC	8	9	6,523	701,429	0.2
CROWN CASTLE INTL CORP	43	46	7,493	805,650	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	38	41	2,664	286,445	0.1
INVITATION HOMES INC	36	58	1,476	158,743	0.0
VICI PROPERTIES INC	—	53	885	95,201	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12	—	—	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	12	3,763	404,698	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	75	82	837	90,087	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	15	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	16	17	3,317	356,711	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	32	33	1,858	199,791	0.0
VORNADO REALTY TRUST	18	18	675	72,578	0.0
KIMCO REALTY CORP	42	50	506	54,491	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカドル	千円	%
AVALONBAY COMMUNITIES INC		14	15	2,484	267,172	0.1
小計	口数・金額	1,250	1,351	85,134	9,153,694	
	銘柄数<比率>	38	39	—	<2.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		5	10	196	15,060	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		—	8	409	31,320	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		12	14	133	10,193	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		13	16	238	18,247	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		—	15	187	14,338	0.0
小計	口数・金額	31	64	1,165	89,160	
	銘柄数<比率>	3	5	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		4	5	610	70,844	0.0
KLEPIERRE		21	21	350	40,695	0.0
COVIVIO		4	4	255	29,691	0.0
ICADE		3	3	199	23,153	0.0
小計	口数・金額	34	34	1,416	164,384	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		14	16	796	92,403	0.0
小計	口数・金額	14	16	796	92,403	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
ユーロ計	口数・金額	48	51	2,213	256,787	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		94	106	408	53,978	0.0
HAMMERSON PLC		75	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		75	81	515	68,152	0.0
SEGRO PLC		112	125	1,055	139,600	0.0
小計	口数・金額	357	313	1,979	261,730	
	銘柄数<比率>	4	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		364	348	521	36,094	0.0
SCENTRE GROUP		564	620	1,414	97,879	0.0
GPT GROUP		199	232	969	67,101	0.0
MIRVAC GROUP		389	400	896	62,071	0.0
STOCKLAND		264	294	818	56,621	0.0
DEXUS		104	116	1,075	74,418	0.0
GOODMAN GROUP		174	186	2,715	187,937	0.0
小計	口数・金額	2,061	2,198	8,410	582,125	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		220	240	16,554	229,616	0.1
小計	口数・金額	220	240	16,554	229,616	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>	

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
SUNTEC REIT		249	194	270	20,452	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		278	363	581	44,020	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	216	419	31,777	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		244	262	486	36,818	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		278	318	955	72,382	0.0
小計	口数・金額	1,050	1,355	2,712	205,452	
	銘柄数<比率>	4	5	—	<0.0%>	
合計	口数・金額	5,021	5,574	—	10,778,567	
	銘柄数<比率>	62	65	—	<2.4%>	

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	SP EMINI	12,837	—
		SP/TSE60	572	—
		SWISS IX	629	—
		EURO ST	2,215	—
		SPI 200	710	—
		FTSE100	908	—

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

○投資信託財産の構成

(2020年５月12日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	421,655,664	93.7
投資証券	10,778,567	2.4
コール・ローン等、その他	17,484,321	3.9
投資信託財産総額	449,918,552	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（449,768,670千円）の投資信託財産総額（449,918,552千円）に対する比率は100.0%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

１アメリカドル＝107.52円	１カナダドル＝76.47円	１ユーロ＝116.02円	１イギリスポンド＝132.25円
１スイスフラン＝110.32円	１スウェーデンクローネ＝10.86円	１ノルウェークローネ＝10.39円	１デンマーククローネ＝15.56円
１オーストラリアドル＝69.21円	１ニュージーランドドル＝65.12円	１香港ドル＝13.87円	１シンガポールドル＝75.73円
１イスラエルシェケル＝30.64円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	451,053,773,434
コール・ローン等	11,358,349,528
株式(評価額)	421,655,664,074
投資証券(評価額)	10,778,567,605
未収入金	2,073,819,005
未収配当金	462,895,406
差入委託証拠金	4,724,477,816
(B) 負債	1,212,025,293
未払金	1,138,716,670
未払解約金	73,308,537
未払利息	86
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	449,841,748,141
元本	167,638,526,747
次期繰越損益金	282,203,221,394
(D) 受益権総口数	167,638,526,747口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	26,834円

＜注記事項＞

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

○損益の状況 (2019年５月14日～2020年５月12日)

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

(注) **(B)有価証券売買損益**および**(C)先物取引等取引損益**は期末の評価換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）

ＭＵＡＭ 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	36,745,576,449円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国株式インデックス	34,030,298,802円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド	16,631,581,978円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国株式インデックス	14,627,097,963円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,413,706,485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）	8,641,501,255円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（オール・カントリー）	7,810,974,582円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（除く日本）	5,584,895,740円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国株式インデックスファンド	5,210,904,253円
つみたて先進国株式	4,307,022,934円
ＭＡＸＩＳ 海外株式（ＭＳＣＩコクサイ）上場投信	3,195,879,198円
ｅＭＡＸＩＳ 全世界株式インデックス	2,630,772,978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）	2,536,144,437円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	2,267,404,126円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	2,067,853,494円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,623,766,188円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,334,052,226円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,324,147,410円
海外株式セレクション（ラップ向け）	1,090,837,580円
つみたて８資産均等バランス	915,340,278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）	656,073,592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）	640,683,877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）	572,018,703円
ＭＡＸＩＳ全世界株式（オール・カントリー）上場投信	523,136,449円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	416,237,464円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	281,651,425円
つみたて４資産均等バランス	261,109,962円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	207,463,984円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（３地域均等型）	194,631,119円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	194,017,940円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	186,327,117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）	179,818,866円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	144,646,587円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	141,041,330円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	118,101,293円
先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）	112,092,621円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	111,316,072円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	78,389,839円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	74,244,882円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	71,008,672円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	64,812,602円
ファンド・マネジャー（海外株式）	56,051,354円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	52,831,155円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	50,807,151円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	44,614,545円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	32,787,427円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,499,083円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	30,616,359円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	23,715,417円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	16,272,327円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	13,703,853円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	13,545,612円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	9,839,465円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	9,084,811円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	8,178,083円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	5,635,268円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	5,372,429円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	3,841,353円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	3,140,185円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	2,164,662円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	2,093,999円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	1,588,448円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,486,010円
つみたて全世界株式	752,488円
コアバランス	322,511円
合計	167,638,526,747円

［お知らせ］

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

②外国株式の貸付に関する指図権限を三菱ＵＦＪアセット・マネジメント（ＵＫ）に委託するため、信託約款に所要の変更を行いました。
（2019年７月１日）

新興国株式インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2020年５月12日

［計算期間：2019年５月14日～2020年５月12日］

「新興国株式インデックスマザーファンド」は、５月12日に第11期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	新興国の株式等（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（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	新興国の株式等を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
7期(2016年5月12日)	17,338	△27.7	37,865.45	△27.9	92.8	6.4	0.5	35,618
8期(2017年5月12日)	23,115	33.3	50,445.91	33.2	92.6	6.5	0.4	49,734
9期(2018年5月14日)	26,349	14.0	57,589.21	14.2	94.0	5.6	0.4	71,556
10期(2019年5月13日)	23,990	△ 9.0	52,573.03	△ 8.7	95.6	3.6	0.3	85,987
11期(2020年5月12日)	21,268	△11.3	46,859.15	△10.9	94.8	5.4	0.1	104,071

(注) ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
(注) 外国の指数は、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（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
（期　首）	円	%		%	%	%	%
2019年５月13日	23,990	－	52,573.03	－	95.6	3.6	0.3
５月末	23,052	△ 3.9	50,540.40	△ 3.9	92.3	6.1	1.6
６月末	24,283	1.2	53,098.32	1.0	93.8	4.7	1.6
７月末	24,281	1.2	53,171.46	1.1	93.2	5.4	1.6
８月末	22,206	△ 7.4	48,562.79	△ 7.6	93.2	4.0	2.8
９月末	23,227	△ 3.2	50,932.52	△ 3.1	93.4	3.9	2.7
10月末	24,483	2.1	53,500.15	1.8	92.5	5.0	2.5
11月末	24,824	3.5	54,320.61	3.3	91.4	5.9	2.6
12月末	26,440	10.2	58,006.54	10.3	96.7	6.3	0.2
2020年１月末	25,249	5.2	55,392.34	5.4	94.5	5.3	0.2
２月末	24,333	1.4	53,436.53	1.6	95.2	4.5	0.2
３月末	19,575	△18.4	43,007.66	△18.2	97.3	2.9	0.1
４月末	21,321	△11.1	46,748.89	△11.1	95.7	4.1	0.1
（期　末）							
2020年５月12日	21,268	△11.3	46,859.15	△10.9	94.8	5.4	0.1

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

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

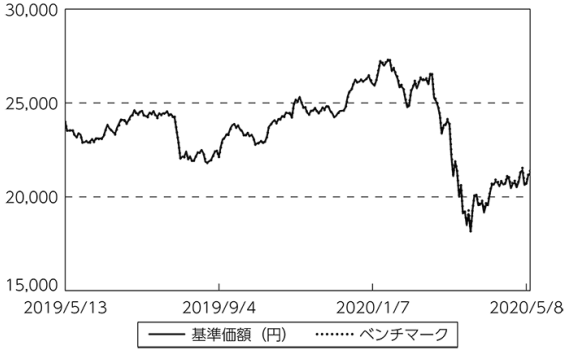
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ11.3%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－10.9%）を0.4%下回りました。

基準価額等の推移



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

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

●投資環境について
◎新興国株式市況
　新興国株式市況は下落しました。
・新興国株式市況は、新型肺炎の世界的な感染拡大懸念などを受けて下落しました。

◎為替市況
　米ドル、香港ドルは対円で下落しました。
・為替市況は、期首に比べて2.0%の円高・米ドル安、0.8%の円高・香港ドル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
・ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている新興国の株式等を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。
（注）マルチファクターモデル
　株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは10.9%の下落になったため、カイ離は△0.4%程度となりました。
　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）
・銘柄選択要因によるものです。

（主なマイナス要因）
・取引要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2019年５月14日～2020年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	16	0.067	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(14)	(0.061)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(1)	(0.005)	
(b) 有価証券取引税	9	0.040	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(9)	(0.040)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	25	0.107	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(24)	(0.100)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(2)	(0.007)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	50	0.214	
期中の平均基準価額は、23,590円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年５月14日～2020年５月12日）

株式

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

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

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

新株予約権証券

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	タイ	証券 － (123,420)	千タイバーツ － (146)	証券 123,420	千タイバーツ 152

(注) 金額は受渡代金。
(注) ( )内は株主割当および権利行使等による増減分です。

投資信託証券

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

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
外国	株式先物取引	百万円 54,419	百万円 51,169	百万円 —	百万円 —

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

○株式売買比率

(2019年５月14日～2020年５月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	55,907,734千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	92,735,025千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.60

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2019年５月14日～2020年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	72,586	3,413	4.7	41,348	3,100	7.5

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

○組入資産の明細

（2020年５月12日現在）

外国株式

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
PINDUODUO INC-ADR	264	345	1,899	204,227	小売
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	124	153	175	18,852	メディア・娯楽
NIO INC - ADR	—	1,316	492	52,954	自動車・自動車部品
ZAI LAB LTD-ADR	—	63	440	47,402	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEST INC - ADR	—	292	159	17,142	運輸
HUYA INC-ADR	—	91	146	15,752	メディア・娯楽
LUCKIN COFFEE INC - ADR	—	140	61	6,608	消費者サービス
LUKOIL PJSC-SPON ADR	686	696	4,594	494,010	エネルギー
GAZPROM PJSC-SPON ADR	7,693	9,151	4,484	482,142	エネルギー
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	133	164	2,276	244,745	エネルギー
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	178	230	697	74,978	食品・生活必需品小売り
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	531	674	748	80,435	食品・生活必需品小売り
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	3,808	4,473	4,608	495,460	銀行
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	2,337	2,572	1,021	109,787	銀行
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	290	290	195	21,017	素材
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	141	264	325	35,044	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	72	95	762	82,016	素材
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	1,569	1,569	95	10,240	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	1,058	1,968	166	17,864	不動産
小計 株数・金額	5,492,233	6,732,858	139,878	15,039,766	
小計 銘柄数<比率>	54	64	—	<14.5%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S.A.B.-A	4,732	4,718	4,633	20,709	資本財
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	727	727	3,584	16,024	資本財
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	48,785	60,157	91,378	408,461	電気通信サービス
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	2,147	2,519	8,690	38,846	家庭用品・パーソナル用品
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	7,591	9,224	53,434	238,852	食品・生活必需品小売り
CEMEX SAB-CPO	22,875	26,141	13,410	59,945	素材
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	3,702	4,208	10,553	47,174	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	2,239	3,240	11,770	52,616	食品・飲料・タバコ
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	3,759	4,662	35,552	158,919	銀行
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	2,853	3,426	55,134	246,451	食品・飲料・タバコ
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	189	226	4,133	18,475	素材
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	1,500	1,983	6,384	28,538	素材
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	5,121	6,330	33,033	147,660	素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	3,392	3,707	5,519	24,673	銀行
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	512	626	9,366	41,869	運輸
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	682	899	9,026	40,347	食品・飲料・タバコ
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	260	423	2,482	11,095	小売
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	318	330	8,037	35,929	運輸
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	300	386	6,594	29,476	運輸
GRUMA S.A.B.-B	277	361	8,812	39,392	食品・飲料・タバコ
ALSEA SAB DE CV	614	1,003	1,950	8,720	消費者サービス
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	776	996	7,318	32,714	公益事業
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	507	516	3,448	15,414	メディア・娯楽
BANCO SANTANDER MEXICO SA IN	2,700	—	—	—	銀行
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	733	1,060	10,240	45,775	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	117,296	137,872	404,493	1,808,085	
小計 銘柄数<比率>	25	24	—	<1.7%>	

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,209	1,637	1,359	25,106	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	373	493	1,217	22,491	公益事業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	5,669	7,604	13,801	254,909	エネルギー
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	516	608	2,536	46,850	公益事業
GERDAU SA-PREF	1,466	1,870	2,337	43,173	素材
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	673	777	3,645	67,328	電気通信サービス
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	7,036	8,668	19,399	358,311	銀行
COSAN SA	253	253	1,538	28,415	エネルギー
BRF SA	722	1,152	2,401	44,363	食品・飲料・タバコ
JBS SA	1,369	1,873	4,337	80,120	食品・飲料・タバコ
NATURA COSMETICOS SA	276	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
VALE SA	4,603	5,687	27,145	501,377	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,106	1,166	1,563	28,879	エネルギー
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	310	420	1,586	29,295	公益事業
PORTO SEGURO SA	154	154	613	11,332	保険
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	4,339	6,655	12,664	233,912	エネルギー
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	250	—	—	—	食品・生活必需品小売り
LOJAS RENNER S.A.	1,113	1,383	4,523	83,540	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	1,042	1,337	3,513	64,901	小売
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	6,349	8,062	6,788	125,379	銀行
EMBRAER SA	1,043	1,126	809	14,953	資本財
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	294	415	903	16,679	公益事業
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	960	967	775	14,324	素材
CCR SA	1,746	2,156	2,423	44,759	運輸
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	2,946	3,702	13,626	251,674	各種金融
B2W CIA DIGITAL	240	380	3,303	61,019	小売
BRASKEM SA-PREF A	235	323	713	13,172	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	5,831	7,785	13,741	253,806	銀行
BANCO DO BRASIL S.A.	1,238	1,584	4,319	79,782	銀行
CIELO SA	1,655	2,071	753	13,924	ソフトウェア・サービス
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	621	741	1,816	33,545	銀行
HYPERA SA	560	739	2,077	38,368	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANCO BRADESCO S.A.	1,776	2,524	4,124	76,186	銀行
WEG SA	1,284	1,558	6,051	111,769	資本財
BR MALLS PARTICIPACOES SA	1,310	1,275	1,014	18,729	不動産
LOCALIZA RENT A CAR	812	1,165	3,274	60,471	運輸
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	403	453	832	15,378	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	273	566	2,371	43,794	保険
TIM PARTICIPACOES SA	1,297	1,493	1,935	35,756	電気通信サービス
RAIA DROGASIL SA	325	398	4,179	77,186	食品・生活必需品小売り
M DIAS BRANCO SA	128	—	—	—	食品・飲料・タバコ
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	237	1,345	2,406	44,442	公益事業
MAGAZINE LUIZA SA	118	1,332	7,319	135,188	小売
COGNA EDUCACAO	1,997	2,942	1,330	24,568	消費者サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	981	1,271	2,993	55,284	保険
AMBEV SA	6,890	8,314	9,926	183,350	食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	986	1,174	2,542	46,967	素材
ENERGISA SA-UNITS	—	286	1,180	21,805	公益事業
RUMO SA	1,570	1,869	3,732	68,937	運輸
ATACADAO SA	578	747	1,447	26,738	食品・生活必需品小売り

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
SUZANO SA		798	963	4,584	84,683	素材
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE		—	355	1,750	32,338	ヘルスケア機器・サービス
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA		467	1,380	2,471	45,650	小売
IRB BRASIL RESSEGUROS SA		204	1,199	923	17,052	保険
NOTRE DAME INTERMED PAR SA		—	844	4,538	83,820	ヘルスケア機器・サービス
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		—	372	1,379	25,477	各種金融
NATURA &CO HOLDING SA		—	1,230	4,200	77,582	家庭用品・パーソナル用品
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC		—	303	1,997	36,891	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	78,641	107,155	234,745	4,335,751	
	銘柄数<比率>	52	55	—	<4.2%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION		71	94	267,029	34,847	銀行
CENCOSUD SA		1,825	2,203	213,937	27,918	食品・生活必需品小売り
EMPRESAS CMPC SA		1,837	1,884	324,013	42,283	素材
COLBUN SA		9,588	13,513	156,740	20,454	公益事業
EMPRESAS COPEC SA		546	784	399,885	52,185	エネルギー
ITAU CORPBANCA		198,652	333,659	72,737	9,492	銀行
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		251	261	131,840	17,205	電気通信サービス
FALABELLA SA		1,010	1,411	338,724	44,203	小売
AGUAS ANDINAS SA-A		3,366	4,722	124,198	16,207	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA		422	395	92,746	12,103	運輸
BANCO SANTANDER CHILE		90,457	118,265	389,565	50,838	銀行
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		166	215	411,179	53,658	素材
ENEL AMERICAS SA		38,665	69,485	916,513	119,605	公益事業
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		225	225	123,377	16,100	食品・飲料・タバコ
BANCO DE CHILE		37,338	84,086	592,809	77,361	銀行
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		570	570	109,643	14,308	食品・飲料・タバコ
ENEL CHILE SA		37,598	46,083	280,186	36,564	公益事業
小計	株数・金額	422,597	677,861	4,945,130	645,339	
	銘柄数<比率>	17	17	—	<0.6%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF		5,576	6,470	511,135	14,107	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		681	875	2,100,264	57,967	銀行
ECOPETROL SA		7,249	8,772	1,811,568	49,999	エネルギー
INTERCONEXION ELECTRICA SA		583	727	1,315,960	36,320	公益事業
GRUPO ARGOS SA		419	591	526,844	14,540	素材
BANCOLOMBIA SA		331	396	934,654	25,796	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA		304	380	746,541	20,604	各種金融
CEMENTOS ARGOS SA		618	—	—	—	素材
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		195	—	—	—	各種金融
小計	株数・金額	15,961	18,213	7,946,968	219,336	
	銘柄数<比率>	9	7	—	<0.2%>	
(ユーロ…ベルギー)				千ユーロ		
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T		—	77	91	10,609	素材
小計	株数・金額	—	77	91	10,609	
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…ギリシャ)						
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		306	424	474	55,067	電気通信サービス
ALPHA BANK AE		2,009	2,512	150	17,490	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		—	1,026	116	13,538	銀行

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	6,320	8,540	4,329	60,054	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	3,170	3,170	646	8,969	エネルギー
SHENZHEN INTL HOLDINGS	1,305	1,895	2,861	39,688	運輸
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	980	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	5,440	6,780	17,763	246,381	不動産
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	3,480	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	13,330	15,630	5,923	82,162	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,590	1,910	12,892	178,818	耐久消費財・アパレル
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	5,620	7,410	3,408	47,277	資本財
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	18,980	15,720	1,399	19,405	小売
HENGAN INTL GROUP CO LTD	1,080	1,250	8,056	111,740	家庭用品・パーソナル用品
CHINA RESOURCES LAND LTD	4,040	5,680	17,977	249,343	不動産
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	2,685	3,390	2,756	38,226	資本財
GUANGDONG INVESTMENT LTD	4,440	5,140	8,121	112,641	公益事業
FOSUN INTERNATIONAL LTD	3,650	4,570	4,579	63,512	資本財
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	4,975	4,975	1,004	13,938	不動産
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	5,200	6,780	6,732	93,380	素材
SHUI ON LAND LTD	3,745	7,170	975	13,524	不動産
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,858	3,428	5,162	71,604	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	4,405	4,405	951	13,197	運輸
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	7,380	8,920	5,004	69,407	食品・飲料・タバコ
KUNLUN ENERGY CO LTD	4,740	7,080	3,610	50,081	公益事業
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	11,162	13,952	14,287	198,163	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1,240	1,580	6,944	96,314	公益事業
SOHO CHINA LTD	3,175	3,175	977	13,563	不動産
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	8,120	8,120	2,395	33,224	公益事業
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	7,270	8,860	11,588	160,737	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	4,240	5,620	2,124	29,464	公益事業
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	9,048	12,258	6,864	95,211	銀行
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	3,900	4,688	11,626	161,255	保険
CRRC CORP LTD - H	5,545	8,165	3,339	46,321	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	839	1,059	2,705	37,528	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	41,760	52,830	17,011	235,946	銀行
CHINA EVERGRANDE GROUP	3,810	3,190	4,823	66,898	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	3,929	5,289	3,887	53,923	自動車・自動車部品
SINOPHARM GROUP CO-H	1,760	2,584	5,374	74,547	ヘルスケア機器・サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	2,530	4,646	12,822	177,854	公益事業
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	1,172	1,172	882	12,240	資本財
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	7,080	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	2,130	3,230	11,789	163,520	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	1,050	1,286	15,509	215,112	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES CEMENT	3,660	4,400	4,593	63,713	素材
SSY GROUP LTD	2,240	3,280	1,830	25,385	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	—	2,194	1,423	19,749	資本財
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	4,860	6,190	3,342	46,361	自動車・自動車部品
BBMG CORP-H	4,160	4,160	815	11,309	素材
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	7,220	9,620	5,377	74,587	不動産
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1,555	2,360	2,171	30,114	素材
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3,060	4,140	2,537	35,199	資本財
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	3,340	4,290	5,036	69,855	ソフトウェア・サービス

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円	
TELEKOM MALAYSIA BHD	1,355	2,148	912	22,557	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	4,430	5,508	6,796	167,950	公益事業
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	593	827	1,703	42,096	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	5,556	6,921	5,128	126,724	銀行
IOI CORP BHD	2,419	3,161	1,226	30,306	食品・飲料・タバコ
AMMB HOLDINGS BHD	2,319	2,715	790	19,522	銀行
YTL CORP BHD	6,372	3,487	258	6,377	公益事業
GAMUDA BHD	2,862	2,827	947	23,401	資本財
MISC BHD	1,590	2,281	1,801	44,527	運輸
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	7,354	8,497	2,922	72,226	銀行
PETRONAS GAS BHD	1,039	1,378	2,047	50,598	公益事業
SP SETIA BHD	2,669	—	—	—	不動産
SIME DARBY BERHAD	3,509	4,932	971	24,008	資本財
PUBLIC BANK BERHAD	4,185	5,634	8,867	219,126	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	173	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	819	1,083	1,759	43,475	食品・飲料・タバコ
IJM CORP BHD	4,797	4,576	768	18,996	資本財
DIGI.COM BHD	4,856	5,673	2,541	62,800	電気通信サービス
MAXIS BHD	3,327	3,932	2,072	51,203	電気通信サービス
AXIATA GROUP BERHAD	4,065	5,451	2,120	52,396	電気通信サービス
HONG LEONG BANK BERHAD	993	1,237	1,657	40,958	銀行
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	3,417	4,619	2,531	62,546	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	261	563	1,154	28,519	エネルギー
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	1,204	1,583	775	19,166	運輸
IHH HEALTHCARE BHD	3,539	3,561	1,837	45,404	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	333	333	426	10,548	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	970	1,331	955	23,614	資本財
TOP GLOVE CORP BHD	1,776	2,904	2,122	52,454	ヘルスケア機器・サービス
GENTING PLANTATIONS BHD	392	392	364	9,008	食品・飲料・タバコ
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	—	275	760	18,795	食品・飲料・タバコ
WESTPORTS HOLDINGS BHD	1,484	1,484	543	13,421	運輸
DIALOG GROUP BHD	5,613	6,672	2,188	54,082	エネルギー
IOI PROPERTIES GROUP BHD	1,728	—	—	—	不動産
QL RESOURCES BHD	808	1,014	821	20,295	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	157	245	772	19,094	食品・飲料・タバコ
HARTALEGA HOLDINGS BHD	2,300	2,847	2,098	51,847	ヘルスケア機器・サービス
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	93	115	1,589	39,271	食品・飲料・タバコ
RHB BANK BHD	1,379	3,192	1,487	36,761	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	1,462	—	—	—	銀行
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	1,691	2,417	932	23,053	素材
SIME DARBY PLANTATION BHD	3,518	3,907	1,863	46,050	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY PROPERTY BHD	4,517	—	—	—	不動産
AIRASIA GROUP BHD	2,152	2,152	166	4,121	運輸
小計 株数・金額	111,636	120,934	71,626	1,769,898	
小計 銘柄数<比率>	44	40	—	<1.7%>	
(タイ)			千タイバーツ		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,961	3,989	18,947	63,285	不動産
KASIKORNBANK PCL-NVDR	2,527	3,081	26,188	87,469	銀行
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	—	1,180	4,897	16,355	電気通信サービス
TMB BANK PCL-NVDR	15,421	33,932	3,121	10,426	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千タイバーツ	千円	
CP ALL PCL-NVDR	7,244	10,446	77,300	258,183	食品・生活必需品小売り
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	480	728	7,134	23,828	銀行
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,553	2,154	41,679	139,210	電気通信サービス
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	2,756	1,780	12,104	40,427	銀行
SIAM CEMENT PCL-NVDR	571	1,403	47,578	158,912	素材
PTT PCL-NVDR	15,509	20,293	72,040	240,614	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	2,090	2,434	20,202	67,475	エネルギー
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	6,405	7,671	46,026	153,726	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	2,706	7,685	4,265	14,245	エネルギー
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	4,665	7,444	20,471	68,373	食品・飲料・タバコ
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	2,309	2,930	8,204	27,401	素材
IRPC PCL - NVDR	15,255	20,385	5,748	19,200	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	3,037	4,569	18,506	61,813	素材
THAI OIL PCL-NVDR	1,623	1,711	7,400	24,716	エネルギー
KRUNG THAI BANK - NVDR	5,334	7,914	8,151	27,225	銀行
GLOW ENERGY PCL - NVDR	669	—	—	—	公益事業
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	—	4,115	22,221	74,218	電気通信サービス
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	6,006	17,430	34,511	115,268	ヘルスケア機器・サービス
LAND & HOUSES PUB - NVDR	3,759	13,501	9,045	30,212	不動産
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	2,622	5,521	7,122	23,787	食品・飲料・タバコ
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	5,007	11,563	16,072	53,682	小売
RATCH GROUP PCL-NVDR	—	1,105	7,265	24,266	公益事業
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	211	480	12,960	43,286	公益事業
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	7,818	12,597	14,864	49,647	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	534	670	7,705	25,734	ヘルスケア機器・サービス
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	606	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRUE CORP PCL-NVDR	16,580	20,450	6,585	21,994	電気通信サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,554	5,099	9,841	32,869	消費者サービス
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,715	2,437	9,504	31,744	食品・生活必需品小売り
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	1,775	2,746	10,709	35,769	公益事業
ROBINSON PCL-NVDR	758	—	—	—	小売
BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	10,780	13,003	12,612	42,127	運輸
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	—	1,428	7,568	25,278	各種金融
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	824	1,013	4,761	15,902	各種金融
B GRIMM POWER PCL-NVDR	—	1,117	5,082	16,975	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	542	4,890	19,193	64,105	公益事業
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	—	1,459	10,541	35,207	公益事業
OSOTSPA PCL-NVDR	—	1,105	4,641	15,500	食品・飲料・タバコ
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	—	3,886	14,378	48,025	小売
小計 株数・金額	155,207	267,346	697,154	2,328,495	
小計 銘柄数<比率>	35	40	—	<2.2%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ		
PLDT INC	112	147	17,269	36,956	電気通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	14,919	18,559	56,883	121,730	不動産
AYALA LAND INC	10,397	12,835	42,741	91,466	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	1,356	1,356	7,951	17,016	銀行
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,231	2,119	17,930	38,370	運輸
MEGAWORLD CORP	17,930	17,930	4,625	9,899	不動産
JOLLIBEE FOODS CORP	637	852	11,976	25,629	消費者サービス
SM INVESTMENTS CORP	371	427	34,550	73,937	資本財

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(フィリピン)		百株	百株	千フィリピンペソ	千円	
MANILA ELECTRIC COMPANY		340	501	12,800	27,393	公益事業
AYALA CORPORATION		385	505	35,316	75,578	資本財
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		2,639	3,422	14,033	30,031	資本財
ABOITIZ POWER CORP		1,953	2,495	6,661	14,255	公益事業
METROPOLITAN BANK & TRUST		2,507	4,021	14,799	31,670	銀行
BDO UNIBANK INC		2,685	3,429	33,613	71,931	銀行
DMCI HOLDINGS INC		5,719	—	—	—	資本財
UNIVERSAL ROBINA CORP		1,164	1,749	22,562	48,282	食品・飲料・タバコ
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC		5,593	—	—	—	資本財
JG SUMMIT HOLDINGS INC		4,407	5,080	24,791	53,053	資本財
GLOBE TELECOM INC		42	62	13,020	27,864	電気通信サービス
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		22,665	22,665	6,731	14,405	各種金融
SECURITY BANK CORP		420	420	4,213	9,016	銀行
ROBINSONS LAND CO		3,047	3,047	4,479	9,585	不動産
GT CAPITAL HOLDINGS INC		139	150	6,322	13,530	資本財
小計	株数・金額	100,665	101,779	393,273	841,605	
	銘柄数<比率>	23	21	—	<0.8%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
KALBE FARMA TBK PT		28,041	35,836	4,963,286	36,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER		73,487	90,513	29,145,186	212,759	電気通信サービス
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P		5,863	7,439	4,853,947	35,433	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT		12,449	16,313	2,707,958	19,768	食品・飲料・タバコ
BANK CENTRAL ASIA TBK PT		14,504	17,927	47,461,732	346,470	銀行
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA		2,582	3,106	3,540,840	25,848	素材
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT		29,629	37,772	14,806,624	108,088	自動車・自動車部品
GUDANG GARAM TBK PT		731	960	4,310,400	31,465	食品・飲料・タバコ
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER		80,831	102,010	26,726,620	195,104	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK		4,415	4,832	3,865,600	28,218	素材
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT		17,073	17,073	1,528,033	11,154	公益事業
UNITED TRACTORS TBK PT		2,655	3,281	5,159,372	37,663	エネルギー
BUKIT ASAM TBK PT		3,873	5,905	1,210,525	8,836	エネルギー
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT		27,466	34,506	14,596,038	106,551	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT		2,229	14,056	11,350,220	82,856	家庭用品・パーソナル用品
ADARO ENERGY TBK PT		21,136	21,136	2,177,008	15,892	エネルギー
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT		2,812	5,000	1,900,000	13,870	運輸
BANK NEGARA INDONESIA PERSER		10,642	12,333	4,686,540	34,211	銀行
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO		5,806	5,806	499,316	3,645	銀行
CHAROEN POKPHAND INDONESI PT		10,072	12,160	5,472,000	39,945	食品・飲料・タバコ
XL AXIATA TBK PT		—	5,147	1,235,280	9,017	電気通信サービス
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK		4,389	4,389	2,260,335	16,500	素材
PAKUWON JATI TBK PT		19,000	25,572	920,592	6,720	不動産
BUMI SERPONG DAMAI PT		9,750	11,250	748,125	5,461	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T		3,833	3,857	3,760,575	27,452	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE		2,126	—	—	—	電気通信サービス
ACE HARDWARE INDONESIA		—	10,630	1,472,255	10,747	小売
SURYA CITRA MEDIA PT TBK		8,664	—	—	—	メディア・娯楽
BARITO PACIFIC TBK PT		—	41,743	5,092,646	37,176	素材
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT		1,837	2,282	1,099,924	8,029	素材
小計	株数・金額	405,895	552,834	207,550,979	1,515,122	
	銘柄数<比率>	27	28	—	<1.5%>	

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,928	8,540	41,335,778	3,625,147	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA ELECTRIC POWER CORP	365	441	967,410	84,841	公益事業
SHINSEGAE INC	11	11	287,573	25,220	小売
CJ CORP	21	32	253,342	22,218	資本財
SK TELECOM	28	38	782,895	68,659	電気通信サービス
HYUNDAI MOTOR CO	198	267	2,503,851	219,587	自動車・自動車部品
POSCO	112	140	2,478,960	217,404	素材
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	76	95	1,115,254	97,807	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KT CORP	22	—	—	—	電気通信サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	98	99	283,261	24,842	各種金融
HYUNDAI MOBIS CO LTD	96	120	2,081,385	182,537	自動車・自動車部品
CHEIL WORLDWIDE INC	95	101	174,501	15,303	メディア・娯楽
KB FINANCIAL GROUP INC	570	709	2,281,364	200,075	銀行
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	44	53	995,472	87,302	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	81	100	2,883,489	252,881	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	627	823	2,432,703	213,348	銀行
LG ELECTRONICS INC	157	185	1,009,503	88,533	耐久消費財・アパレル
AMOREPACIFIC GROUP	46	46	262,920	23,058	家庭用品・パーソナル用品
HYUNDAI DEPT STORE CO	20	20	136,600	11,979	小売
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	39	45	364,165	31,937	資本財
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	77	101	248,323	21,777	資本財
KT&G CORP	171	210	1,648,203	144,547	食品・飲料・タバコ
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	48	65	111,269	9,758	資本財
NCSOFT CORP	25	29	2,069,040	181,454	メディア・娯楽
LG DISPLAY CO LTD	338	458	493,414	43,272	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	53	74	594,935	52,175	資本財
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	643	843	354,429	31,083	資本財
AMOREPACIFIC CORP	48	57	1,010,002	88,577	家庭用品・パーソナル用品
HANA FINANCIAL GROUP	442	556	1,460,340	128,071	銀行
LG CHEM LTD	64	81	2,808,382	246,295	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	13	16	2,373,708	208,174	家庭用品・パーソナル用品
SK INNOVATION CO LTD	92	97	954,037	83,669	エネルギー
KAKAO CORP	72	93	1,939,087	170,057	メディア・娯楽
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	62	86	414,091	36,315	各種金融
HANMI SCIENCE CO LTD	17	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COWAY CO LTD	80	95	613,796	53,829	耐久消費財・アパレル
S-1 CORPORATION	23	36	315,114	27,635	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORP	380	479	1,466,033	128,571	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	842	977	8,259,959	724,398	半導体・半導体製造装置
LG CORP	141	166	1,029,944	90,326	資本財
HYUNDAI STEEL CO	118	172	356,277	31,245	素材
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,195	1,472	6,109,090	535,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OCI CO LTD	25	33	130,878	11,478	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	373	541	411,304	36,071	銀行
PAN OCEAN CO LTD	331	399	131,399	11,523	運輸
KANGWON LAND INC	162	193	474,540	41,617	消費者サービス
NAVER CORP	204	250	5,382,019	472,003	メディア・娯楽
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	623	624	344,845	30,242	各種金融
CELLTRION INC	119	169	3,567,554	312,874	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOREA GAS CORPORATION	36	36	101,420	8,894	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
LG UPLUS CORP	138	362	487,064	42,715	電気通信サービス
LOTTE SHOPPING CO	15	21	198,919	17,445	小売
YUHAN CORP	13	92	483,340	42,388	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DB INSURANCE CO LTD	73	96	444,952	39,022	保険
S-OIL CORP	64	82	562,245	49,308	エネルギー
KCC CORP	8	7	113,985	9,996	素材
POSCO INTERNATIONAL CORP	75	75	105,434	9,246	資本財
SAMSUNG CARD CO	57	45	134,077	11,758	各種金融
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	204	258	293,465	25,736	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	52	77	454,825	39,888	自動車・自動車部品
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	113	158	535,992	47,006	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	57	95	179,131	15,709	運輸
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	99	134	628,945	55,158	保険
LOTTE CHEMICAL CORP	24	33	621,214	54,480	素材
GS HOLDINGS	77	104	395,010	34,642	エネルギー
NH INVESTMENT & SECURITIES C	208	208	195,941	17,184	各種金融
HANWHA SOLUTIONS CORP	164	164	246,256	21,596	素材
HANWHA CORPORATION	54	101	194,745	17,079	資本財
CJ CHEILJEDANG CORP	13	17	480,266	42,119	食品・飲料・タバコ
BNK FINANCIAL GROUP INC	364	488	233,670	20,492	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	27	30	305,121	26,759	運輸
DGB FINANCIAL GROUP INC	304	—	—	—	銀行
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	35	35	200,043	17,543	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	11	13	508,090	44,559	素材
E-MART INC	29	33	374,417	32,836	食品・生活必需品小売り
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	30	29	210,740	18,481	素材
SK HOLDINGS CO LTD	45	65	1,174,956	103,043	資本財
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	86	102	263,628	23,120	保険
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	95	121	290,528	25,479	資本財
LOTTE CORP	39	39	149,583	13,118	資本財
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	398	398	67,663	5,934	保険
LG INNOTEK CO LTD	16	25	341,904	29,984	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD-PREFERENCE	13	13	214,619	18,822	素材
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	103	116	250,257	21,947	自動車・自動車部品
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	260	260	92,023	8,070	資本財
HANON SYSTEMS	296	296	271,853	23,841	自動車・自動車部品
CJ ENM CO LTD	16	16	194,121	17,024	小売
CJ LOGISTICS	11	18	257,543	22,586	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	46	51	411,528	36,091	小売
SAMSUNG SDS CO LTD	50	61	1,112,421	97,559	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG C&T CORP	107	158	1,623,292	142,362	資本財
AMOREPACIFIC CORP-PREF	12	12	75,397	6,612	家庭用品・パーソナル用品
HANMI PHARM CO LTD	8	10	292,409	25,644	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GS RETAIL CO LTD	40	40	153,379	13,451	食品・生活必需品小売り
OTTOGI CORPORATION	1	1	99,858	8,757	食品・飲料・タバコ
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	2	3	241,815	21,207	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	24	28	1,680,062	147,341	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETMARBLE CORP	38	48	486,100	42,630	メディア・娯楽
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	15	20	509,903	44,718	資本財
DOOSAN BOBCAT INC	55	80	195,566	17,151	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
MEDY-TOX INC	6	6	108,696	9,532	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	34	47	583,167	51,143	食品・飲料・タバコ
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	76	95	851,414	74,669	ヘルスケア機器・サービス
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	60	—	—	—	保険
SILLAJEN INC	80	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGF RETAIL CO LTD	13	13	202,350	17,746	食品・生活必需品小売り
POSCO CHEMICAL CO LTD	30	39	202,317	17,743	素材
HLB INC	50	60	689,135	60,437	耐久消費財・アパレル
HLB INC -RIGHTS	—	6	33,154	2,907	耐久消費財・アパレル
CELLTRION PHARM INC	16	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HELIXMITH CO LTD	20	31	211,365	18,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HELIXMITH CO LTD-NEW	—	7	52,807	4,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEARL ABYSS CORP	8	11	231,420	20,295	メディア・娯楽
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	40	91	180,238	15,806	資本財
FILA HOLDINGS CORP	74	76	253,671	22,246	耐久消費財・アパレル
WOORI FINANCIAL GROUP INC	691	1,054	844,614	74,072	銀行
MERITZ SECURITIES CO LTD	—	585	187,492	16,443	各種金融
KMW CO LTD	—	39	237,900	20,863	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計 株数・金額	21,792	27,224	131,711,924	11,551,135	
小計 銘柄数<比率>	114	112	—	<11.1%>	
(台湾)			千ニュー台湾ドル		
COMPAL ELECTRONICS	5,477	8,067	15,167	54,602	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	2,942	3,502	49,030	176,510	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	4,551	5,871	15,999	57,598	資本財
FORMOSA PLASTICS CORP	6,446	7,916	69,265	249,354	素材
HON HAI PRECISION INDUSTRY	19,052	22,282	175,810	632,918	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNITED MICROELECTRONICS CORP	17,130	19,450	30,342	109,231	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	7,325	9,315	60,178	216,642	素材
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	880	1,000	30,450	109,620	食品・生活必需品小売り
TAIWAN CEMENT	6,612	8,995	38,816	139,738	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	35,690	44,050	1,325,905	4,773,258	半導体・半導体製造装置
ASUSTEK COMPUTER INC	977	1,257	25,406	91,462	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WINBOND ELECTRONICS CORP	4,030	4,600	6,302	22,687	半導体・半導体製造装置
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	577	927	23,175	83,432	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	359	439	18,174	65,426	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	3,891	4,721	31,114	112,012	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	12,163	13,703	54,266	195,359	保険
ACER INC	4,321	5,731	9,428	33,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	16,680	18,610	21,960	79,056	銀行
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	5,194	6,234	46,570	167,652	素材
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	10,030	11,790	48,578	174,882	保険
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	697	1,017	8,120	29,235	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC	2,142	2,702	110,796	398,868	半導体・半導体製造装置
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	14,137	17,323	21,827	78,577	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	25,249	33,069	66,139	238,100	銀行
TAIWAN MOBILE CO LTD	2,324	2,834	30,607	110,185	電気通信サービス
CHINA STEEL CORP	18,729	20,869	41,425	149,133	素材
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	880	1,020	20,808	74,908	半導体・半導体製造装置
ADVANTECH CO LTD	466	646	18,885	67,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	1,230	1,630	9,358	33,690	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	990	1,160	27,956	100,641	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP	11,620	14,280	11,181	40,252	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TATUNG CO LTD	2,440	2,970	6,355	22,880	耐久消費財・アパレル
POWERTECH TECHNOLOGY INC	1,113	1,473	15,245	54,883	半導体・半導体製造装置
INVENTEC CORP	3,854	4,884	11,478	41,321	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	5,540	6,750	74,250	267,300	電気通信サービス
PHISON ELECTRONICS CORP	210	230	6,532	23,515	半導体・半導体製造装置
WPG HOLDINGS LTD	1,981	2,581	10,016	36,060	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	1,080	1,380	12,930	46,550	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GIANT MANUFACTURING	490	490	9,187	33,075	耐久消費財・アパレル
RUENTEX INDUSTRIES LTD	456	836	5,643	20,314	耐久消費財・アパレル
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	2,311	2,371	9,464	34,070	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	14,253	17,193	28,712	103,365	各種金融
INNOLUX CORP	11,951	17,331	11,178	40,242	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	11,468	13,598	26,313	94,729	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	15,858	19,098	16,023	57,685	保険
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	2,420	2,910	19,613	70,608	電気通信サービス
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	3,164	3,224	10,913	39,289	自動車・自動車部品
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,811	2,191	19,482	70,136	エネルギー
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	16,037	19,057	57,934	208,565	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	14,542	18,458	40,607	146,188	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	148	178	74,844	269,438	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	6,916	8,726	61,956	223,042	食品・飲料・タバコ
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	8,005	9,795	18,758	67,531	銀行
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	18,982	22,252	20,249	72,899	保険
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	3,071	3,911	18,364	66,113	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA CEMENT CORP	3,172	3,972	17,679	63,644	素材
POU CHEN	3,155	4,195	11,787	42,436	耐久消費財・アパレル
WISTRON CORP	3,758	5,258	14,619	52,628	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEGATRON CORP	2,929	3,489	23,346	84,047	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	4,050	4,050	3,264	11,751	運輸
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	14,123	18,571	50,234	180,844	銀行
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	3,540	4,550	9,396	33,828	保険
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	353	474	14,031	50,514	資本財
EVA AIRWAYS CORP	3,256	5,963	6,738	24,260	運輸
EVERGREEN MARINE CORP LTD	2,638	4,398	4,728	17,023	運輸
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	190	250	14,200	51,120	資本財
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	13,531	16,788	33,744	121,479	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	410	520	27,248	98,092	小売
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	517	1,087	4,816	17,338	不動産
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	1,180	1,710	7,643	27,517	不動産
TAIWAN BUSINESS BANK	4,779	9,058	9,828	35,382	銀行
STANDARD FOODS CORP	610	610	4,015	14,455	食品・飲料・タバコ
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	670	870	10,266	36,957	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORMOSA TAFFETA CO.	1,110	1,310	4,408	15,869	耐久消費財・アパレル
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,761	2,184	25,452	91,629	各種金融
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	1,450	1,470	10,319	37,149	半導体・半導体製造装置
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	237	317	8,947	32,210	耐久消費財・アパレル
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	439	543	8,826	31,776	耐久消費財・アパレル
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,520	2,170	14,039	50,543	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千ニュー台湾ドル	千円	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	280	280	6,706	24,141	耐久消費財・アパレル
TAIMED BIOLOGICS INC	210	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WIN SEMICONDUCTORS CORP	540	610	17,232	62,037	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	310	420	16,212	58,363	半導体・半導体製造装置
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	2,930	3,860	13,066	47,037	運輸
WALSIN TECHNOLOGY CORP	500	650	13,325	47,970	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	5,052	6,222	42,876	154,353	半導体・半導体製造装置
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	4,350	5,790	25,504	91,817	銀行
ACCTON TECHNOLOGY CORP	—	930	19,437	69,973	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WIWYNN CORP	—	150	13,095	47,142	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計 株数・金額	474,469	589,642	3,556,145	12,802,122	
小計 銘柄数<比率>	87	88	—	<12.3%>	
(インド)			千インドルピー		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	2,368	2,930	485,972	690,080	銀行
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	1,305	1,608	311,223	441,937	ソフトウェア・サービス
ITC LTD	4,981	6,141	97,307	138,176	食品・飲料・タバコ
HINDUSTAN UNILEVER LTD	930	1,468	300,826	427,173	家庭用品・パーソナル用品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	3,656	4,898	37,742	53,594	エネルギー
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,720	1,855	22,221	31,554	素材
COAL INDIA LTD	1,798	2,384	30,622	43,483	エネルギー
GAIL INDIA LTD	1,176	2,507	23,083	32,778	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD	821	952	16,561	23,516	素材
HERO MOTOCORP LTD	68	181	37,881	53,792	自動車・自動車部品
BAJAJ AUTO LTD	112	149	38,438	54,582	自動車・自動車部品
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	1,276	1,463	67,870	96,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASIAN PAINTS LTD	424	494	77,575	110,157	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	2,574	3,219	51,123	72,595	公益事業
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	202	153	11,321	16,076	各種金融
VEDANTA LTD	1,957	3,325	26,474	37,593	素材
TATA POWER CO LTD	1,689	1,689	4,612	6,550	公益事業
BHARTI AIRTEL LTD	2,079	4,429	237,492	337,239	電気通信サービス
BHARTI AIRTEL LTD-RIGHT	589	—	—	—	電気通信サービス
CIPLA LTD	521	652	38,237	54,297	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NTPC LTD	3,494	4,280	37,091	52,669	公益事業
INFOSYS LTD	5,068	6,092	416,080	590,834	ソフトウェア・サービス
ULTRATECH CEMENT LTD	139	177	59,700	84,774	素材
DLF LTD	—	878	11,711	16,630	不動産
DR. REDDY'S LABORATORIES	164	204	79,024	112,214	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ICICI BANK LTD	3,402	8,530	273,099	387,801	銀行
LUPIN LTD	320	433	36,777	52,223	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	155	190	93,862	133,284	自動車・自動車部品
RELIANCE INDUSTRIES LTD	4,137	5,100	804,306	1,142,115	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	2,543	3,064	50,704	72,000	銀行
TATA STEEL LTD	545	548	15,145	21,506	素材
LIC HOUSING FINANCE LTD	396	502	13,477	19,137	銀行
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	1,151	1,155	36,388	51,672	エネルギー
VODAFONE IDEA LTD	12,669	—	—	—	電気通信サービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	489	698	36,092	51,251	家庭用品・パーソナル用品
REC LTD	876	1,266	11,293	16,036	各種金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	669	1,475	22,923	32,551	メディア・娯楽

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア元	千円	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	80	413	148	2,248	公益事業
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	11	77	792	11,977	ソフトウェア・サービス
IND & COMM BK OF CHINA-A	995	5,125	2,634	39,832	銀行
IFLYTEK CO LTD - A	38	210	725	10,967	ソフトウェア・サービス
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	124	636	384	5,808	各種金融
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	701	4,334	481	7,273	素材
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	28	142	1,404	21,234	食品・飲料・タバコ
JIANGXI COPPER CO LTD-A	38	197	255	3,860	素材
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	50	255	153	2,324	素材
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	99	507	422	6,393	不動産
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	35	178	322	4,876	ヘルスケア機器・サービス
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	28	145	257	3,895	小売
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	52	504	1,553	23,486	半導体・半導体製造装置
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	76	507	2,368	35,809	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	27	139	1,150	17,401	食品・飲料・タバコ
MAANSHAN IRON & STEEL-A	110	566	148	2,250	素材
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	58	355	417	6,306	ヘルスケア機器・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	329	1,696	444	6,719	資本財
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	32	228	2,658	40,196	食品・飲料・タバコ
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	38	197	901	13,635	保険
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	78	400	1,234	18,670	食品・飲料・タバコ
NINESTAR CORP-A	13	101	316	4,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	—	836	286	4,335	運輸
OFILM GROUP CO LTD-A	50	257	414	6,267	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	82	420	212	3,213	エネルギー
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	110	568	535	8,090	各種金融
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	63	326	300	4,539	メディア・娯楽
PERFECT WORLD CO LTD-A	16	122	549	8,300	メディア・娯楽
PETROCHINA CO LTD-A	299	1,540	688	10,408	エネルギー
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	200	1,129	8,344	126,175	保険
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	80	413	335	5,076	不動産
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	54	907	1,072	16,223	素材
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	142	795	1,631	24,670	資本財
SDIC CAPITAL CO LTD-A	72	335	410	6,209	各種金融
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	125	645	490	7,411	公益事業
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	123	792	588	8,897	エネルギー
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	16	107	236	3,576	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	34	246	885	13,389	素材
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	82	548	166	2,513	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	—	845	272	4,114	資本財
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	145	773	362	5,481	資本財
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	37	192	649	9,826	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	18	91	624	9,438	運輸
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	57	297	170	2,570	資本財
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	55	284	160	2,421	エネルギー
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	52	269	191	2,899	各種金融
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	—	541	198	2,993	素材
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	16	83	888	13,440	食品・飲料・タバコ
SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	58	299	142	2,151	エネルギー
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	84	466	246	3,720	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア元	千円	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	346	2,142	961	14,542	各種金融
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	61	313	171	2,588	公益事業
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	151	780	499	7,547	消費者サービス
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	16	82	155	2,348	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	66	339	122	1,850	素材
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	81	418	374	5,662	公益事業
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	27	136	280	4,236	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	56	287	294	4,447	各種金融
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	90	581	230	3,478	素材
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	55	285	224	3,395	各種金融
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	—	537	245	3,718	各種金融
SPRING AIRLINES CO LTD-A	14	87	308	4,661	運輸
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	49	254	215	3,264	資本財
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	28	143	210	3,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TBEA CO LTD-A	69	352	273	4,140	資本財
TIANMA MICROELECTRONICS-A	38	194	273	4,141	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	38	193	264	3,994	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONGLING NONFERROUS METALS-A	194	1,001	196	2,966	素材
TONGWEI CO LTD-A	72	370	529	7,999	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	13	66	361	5,467	食品・飲料・タバコ
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A	26	135	110	1,671	商業・専門サービス
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	51	261	132	2,004	自動車・自動車部品
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	15	79	166	2,513	自動車・自動車部品
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	65	332	269	4,071	各種金融
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	33	200	741	11,216	メディア・娯楽
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	145	744	474	7,177	資本財
XIAMEN C & D INC-A	52	269	239	3,615	資本財
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	159	817	251	3,804	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	54	328	337	5,108	資本財
YOUNGOR GROUP CO-A	66	—	—	—	不動産
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	—	148	197	2,989	不動産
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	11	58	843	12,747	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	101	—	—	—	不動産
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	40	205	528	7,987	資本財
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	53	285	493	7,463	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	60	309	379	5,741	素材
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	167	—	—	—	公益事業
ZHONGJIN GOLD CORP-A	64	327	273	4,128	素材
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	319	2,813	1,111	16,800	素材
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	118	609	423	6,399	資本財
ZTE CORP-A	63	442	1,902	28,763	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	17	88	307	4,643	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	81	417	663	10,025	エネルギー
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	362	1,864	367	5,552	公益事業
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	40	557	789	11,933	素材
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	85	439	866	13,102	資本財
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	18	114	252	3,812	自動車・自動車部品
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	250	1,286	622	9,411	耐久消費財・アパレル
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	45	235	1,109	16,771	ソフトウェア・サービス
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	—	294	1,341	20,287	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	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	
NAVINFO CO LTD-A	—	186	283	4,291	耐久消費財・アパレル
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	—	57	355	5,369	半導体・半導体製造装置
ANGEL YEAST CO LTD-A	—	78	297	4,505	食品・飲料・タバコ
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	19	128	229	3,468	ソフトウェア・サービス
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	407	2,174	919	13,904	資本財
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	54	261	243	3,685	資本財
OPPEIN HOME GROUP INC-A	4	26	303	4,588	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	49	171	127	1,933	耐久消費財・アパレル
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	225	1,244	352	5,323	素材
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	99	378	548	8,298	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	140	645	161	2,438	エネルギー
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	36	249	256	3,881	各種金融
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	—	343	268	4,066	銀行
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	—	341	327	4,958	各種金融
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	—	165	360	5,445	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	—	125	1,007	15,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	—	208	2,863	43,297	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	—	638	1,164	17,613	各種金融
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	—	70	543	8,221	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	—	270	331	5,011	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	—	51	610	9,235	各種金融
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	—	803	230	3,485	素材
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	—	311	560	8,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	—	169	657	9,939	ヘルスケア機器・サービス
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	—	252	1,210	18,305	メディア・娯楽
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	—	329	113	1,716	不動産
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	—	60	808	12,221	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	—	106	2,757	41,686	ヘルスケア機器・サービス
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	—	138	424	6,419	消費者サービス
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	—	153	405	6,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	—	309	188	2,850	素材
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	—	146	625	9,453	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	—	232	199	3,009	ソフトウェア・サービス
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	—	504	1,495	22,609	食品・飲料・タバコ
YANZHOU COAL MINING CO-A	—	210	176	2,661	エネルギー
WUXI APPTEC CO LTD-A	—	139	1,428	21,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUNDA HOLDING CO LTD-A	—	142	451	6,823	運輸
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	—	57	379	5,732	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	—	150	194	2,941	資本財
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	—	64	202	3,065	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	—	109	145	2,206	資本財
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	—	259	177	2,682	資本財
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	—	36	525	7,940	食品・飲料・タバコ
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	—	56	243	3,686	食品・飲料・タバコ
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	—	22	401	6,069	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OVCTEK CHINA INC-A	—	38	252	3,824	ヘルスケア機器・サービス
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	—	27	354	5,354	ヘルスケア機器・サービス
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	—	343	282	4,273	資本財
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	—	100	364	5,511	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	—	245	157	2,381	不動産

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア元	千円	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	—	279	302	4,577	メディア・娯楽
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	—	161	398	6,032	資本財
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	—	142	553	8,369	素材
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	—	70	381	5,767	食品・飲料・タバコ
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	—	147	410	6,201	ソフトウェア・サービス
BEIJING SL PHARMACEUTICAL -A	—	98	110	1,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	—	99	340	5,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	—	268	162	2,463	食品・飲料・タバコ
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	—	38	376	5,694	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BGI GENOMICS CO LTD-A	—	38	399	6,046	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOHAI LEASING CO LTD-A	—	588	166	2,524	資本財
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	—	94	147	2,225	消費者サービス
BY-HEALTH CO LTD-A	—	150	282	4,263	家庭用品・パーソナル用品
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	—	158	276	4,180	商業・専門サービス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	—	16	976	14,757	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	—	26	289	4,383	自動車・自動車部品
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	—	69	263	3,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	—	284	136	2,056	公益事業
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	—	387	161	2,440	不動産
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	—	278	371	5,611	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MEHECO CO LTD -A	—	102	146	2,217	資本財
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	—	577	378	5,723	エネルギー
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	—	47	405	6,132	ソフトウェア・サービス
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	—	36	147	2,228	ヘルスケア機器・サービス
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	—	72	227	3,441	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	—	211	209	3,161	資本財
CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	—	99	128	1,935	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	—	141	345	5,221	ソフトウェア・サービス
CHONGQING BREWERY CO-A	—	46	257	3,896	食品・飲料・タバコ
CHONGQING FULING ZHACAI-A	—	75	251	3,806	食品・飲料・タバコ
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	—	260	197	2,991	エネルギー
CSC FINANCIAL CO LTD-A	—	263	916	13,854	各種金融
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	—	735	127	1,933	運輸
DAWNING INFORMATION INDUST-A	—	120	471	7,123	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVE ENERGY CO LTD-A	—	92	616	9,328	資本財
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	—	111	405	6,130	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	—	98	228	3,458	食品・飲料・タバコ
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	—	7	291	4,408	メディア・娯楽
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	—	483	124	1,876	半導体・半導体製造装置
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	—	43	956	14,461	半導体・半導体製造装置
GLODON CO LTD-A	—	107	539	8,157	ソフトウェア・サービス
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	—	311	161	2,445	不動産
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	—	229	308	4,663	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	—	150	652	9,865	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	—	287	191	2,894	素材
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	—	196	275	4,161	運輸
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	—	44	301	4,563	ヘルスケア機器・サービス
GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	—	134	111	1,689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	—	125	185	2,806	半導体・半導体製造装置
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	—	64	270	4,083	資本財

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

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

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

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

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

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

外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				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		481	621	11,783	52,670	0.1
小計	口数・金額	481	621	11,783	52,670	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.1%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		444	537	7,126	41,547	0.0
REDEFINE PROPERTIES LTD		845	1,056	1,891	11,029	0.0
HYPROP INVESTMENTS LTD		39	－	－	－	－
RESILIENT REIT LTD		45	－	－	－	－
FORTRESS REIT LTD-A		180	180	1,780	10,379	0.0
FORTRESS REIT LTD-B		89	－	－	－	－
小計	口数・金額	1,644	1,774	10,798	62,955	
	銘柄数<比率>	6	3	－	<0.1%>	
合計	口数・金額	2,126	2,396	－	115,626	
	銘柄数<比率>	7	4	－	<0.1%>	

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引	MINI MS	百万円 5,652	百万円 －

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

○投資信託財産の構成

(2020年５月12日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	98,650,813	94.8
投資証券	115,626	0.1
コール・ローン等、その他	5,330,026	5.1
投資信託財産総額	104,096,465	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（104,007,741千円）の投資信託財産総額（104,096,465千円）に対する比率は99.9%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年５月12日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　35,842,976,285円
　期中追加設定元本額　21,858,278,344円
　期中一部解約元本額　8,767,478,927円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.1268円です。

○損益の状況 (2019年５月14日～2020年５月12日)

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

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

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

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

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

［ お 知 ら せ ］

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

日本債券インデックスマザーファンド

《第19期》決算日2020年５月12日

［計算期間：2019年５月14日～2020年５月12日］

「日本債券インデックスマザーファンド」は、５月12日に第19期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
19期(2020年５月12日)	13,524	0.2	388.75	0.2	99.6	0.1	630,705

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

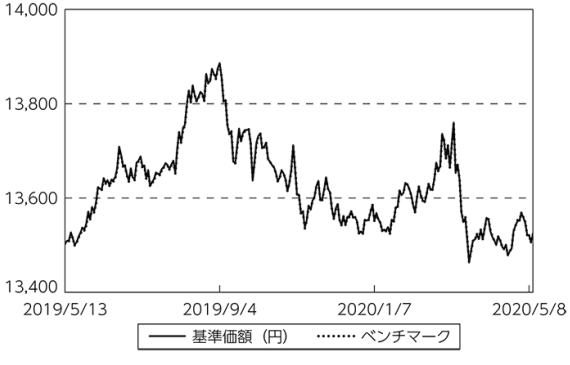
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.2%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（0.2%）とほぼ同程度となりました。

基準価額等の推移



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

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

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは0.2%の上昇になったため、カイ離は0.0%程度となりました。

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
（主なプラス要因）
・評価時価差異要因※によるものです。
※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

（主なマイナス要因）
・ポートフォリオ要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2019年５月14日～2020年５月12日）

項目	当期 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、13,628円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年５月14日～2020年５月12日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	367,425,827	343,804,522
	地方債証券	24,378,782	24,530,720
	特殊債券	33,388,897	31,003,810 (752,447)
	社債券	14,599,007	14,254,870 (100,000)

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	債券先物取引	14,144	13,990	－	－

○利害関係人との取引状況等

（2019年５月14日～2020年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	439,792	162,091	36.9	413,593	126,506	30.6

（注）公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	2,946	302	4,337

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
公社債	4,900

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

○組入資産の明細

（2020年５月12日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	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	484,304,000	526,406,617	83.5	－	56.8	18.2	8.4
地方債証券	30,568,420	32,031,730	5.1	－	2.6	1.7	0.8
	(30,568,420)	(32,031,730)	(5.1)	(－)	(2.6)	(1.7)	(0.8)
特殊債券（除く金融債）	35,182,562	37,218,986	5.9	－	3.7	1.2	1.0
	(35,182,562)	(37,218,986)	(5.9)	(－)	(3.7)	(1.2)	(1.0)
金融債券	3,300,000	3,306,410	0.5	－	0.0	0.3	0.2
	(3,300,000)	(3,306,410)	(0.5)	(－)	(0.0)	(0.3)	(0.2)
普通社債券	29,000,000	29,200,369	4.6	0.0	1.4	2.9	0.3
	(29,000,000)	(29,200,369)	(4.6)	(0.0)	(1.4)	(2.9)	(0.3)
合計	582,354,982	628,164,115	99.6	0.0	64.6	24.4	10.6
	(98,050,982)	(101,757,497)	(16.1)	(0.0)	(7.7)	(6.2)	(2.2)

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

（B）国内（邦貨建）公社債　銘柄別開示

銘柄	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404回利付国債（２年）	0.1	1,150,000	1,154,209	2021/９/１
第405回利付国債（２年）	0.1	700,000	702,968	2021/10/１
第407回利付国債（２年）	0.1	150,000	150,666	2021/12/１
第408回利付国債（２年）	0.1	8,150,000	8,187,490	2022/１/１
第409回利付国債（２年）	0.1	6,300,000	6,330,492	2022/２/１
第128回利付国債（５年）	0.1	3,850,000	3,861,896	2021/６/20
第129回利付国債（５年）	0.1	3,100,000	3,111,563	2021/９/20
第130回利付国債（５年）	0.1	4,950,000	4,971,879	2021/12/20
第131回利付国債（５年）	0.1	5,010,000	5,035,551	2022/３/20
第132回利付国債（５年）	0.1	3,850,000	3,872,330	2022/６/20
第133回利付国債（５年）	0.1	4,900,000	4,931,850	2022/９/20
第134回利付国債（５年）	0.1	9,360,000	9,427,298	2022/12/20
第135回利付国債（５年）	0.1	880,000	886,934	2023/３/20
第136回利付国債（５年）	0.1	3,250,000	3,277,365	2023/６/20
第137回利付国債（５年）	0.1	7,400,000	7,466,156	2023/９/20
第138回利付国債（５年）	0.1	5,150,000	5,198,513	2023/12/20
第139回利付国債（５年）	0.1	600,000	605,928	2024/３/20
第140回利付国債（５年）	0.1	3,960,000	4,000,867	2024/６/20
第141回利付国債（５年）	0.1	4,640,000	4,689,833	2024/９/20
第142回利付国債（５年）	0.1	7,070,000	7,146,992	2024/12/20
第１回利付国債（40年）	2.4	475,000	717,563	2048/３/20
第２回利付国債（40年）	2.2	870,000	1,281,701	2049/３/20
第３回利付国債（40年）	2.2	733,000	1,090,667	2050/３/20
第４回利付国債（40年）	2.2	1,098,000	1,649,832	2051/３/20
第５回利付国債（40年）	2.0	1,195,000	1,742,560	2052/３/20
第６回利付国債（40年）	1.9	1,060,000	1,526,103	2053/３/20
第７回利付国債（40年）	1.7	1,280,000	1,776,115	2054/３/20
第８回利付国債（40年）	1.4	1,280,000	1,666,419	2055/３/20
第９回利付国債（40年）	0.4	1,950,000	1,908,114	2056/３/20
第10回利付国債（40年）	0.9	2,400,000	2,750,064	2057/３/20
第11回利付国債（40年）	0.8	2,010,000	2,241,150	2058/３/20
第12回利付国債（40年）	0.5	1,690,000	1,709,451	2059/３/20
第315回利付国債（10年）	1.2	3,633,000	3,688,257	2021/６/20
第316回利付国債（10年）	1.1	2,280,000	2,312,148	2021/６/20
第317回利付国債（10年）	1.1	1,957,000	1,990,914	2021/９/20
第318回利付国債（10年）	1.0	2,480,000	2,519,605	2021/９/20
第319回利付国債（10年）	1.1	1,719,000	1,754,411	2021/12/20
第320回利付国債（10年）	1.0	1,980,000	2,017,600	2021/12/20
第321回利付国債（10年）	1.0	2,515,000	2,569,902	2022/３/20
第322回利付国債（10年）	0.9	1,470,000	1,499,355	2022/３/20
第323回利付国債（10年）	0.9	1,675,000	1,713,206	2022/６/20
第324回利付国債（10年）	0.8	2,800,000	2,857,932	2022/６/20
第325回利付国債（10年）	0.8	3,835,000	3,923,435	2022/９/20
第326回利付国債（10年）	0.7	730,000	746,614	2022/12/20

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
平成25年度第８回静岡県公募公債	0.699	130,000	132,999	2023/10/24
平成23年度第７回愛知県公募公債	1.11	100,000	101,311	2021/７/29
平成23年度第９回愛知県公募公債	1.019	100,000	101,370	2021/９/30
平成23年度第13回愛知県公募公債	1.529	300,000	328,236	2026/11/13
平成23年度第14回愛知県公募公債	1.006	100,000	101,514	2021/11/30
平成23年度第17回愛知県公募公債	0.996	100,000	101,660	2022/１/31
平成24年度第13回愛知県公募公債	0.772	100,000	101,880	2022/11/30
平成28年度第17回愛知県公募公債	0.225	200,000	202,052	2027/３/29
平成30年度第８回愛知県公募公債	0.255	600,000	607,656	2028/８/31
平成22年度第８回広島県公募公債	1.33	26,650	26,950	2021/３/25
平成23年度第７回広島県公募公債	1.0	100,000	101,798	2022/３/23
平成28年度第１回広島県公募公債（20年）	0.414	100,000	100,610	2036/９/26
平成29年度第７回広島県公募公債	0.2	100,000	100,898	2028/３/23
第４回埼玉県公募公債（20年）	2.18	200,000	230,642	2027/９/21
第16回埼玉県公募公債（20年）	1.216	100,000	112,875	2035/８/14
平成23年度第４回埼玉県公募公債	1.2	100,000	101,414	2021/７/27
平成24年度第６回埼玉県公募公債	0.801	100,000	101,881	2022/10/26
平成26年度第８回埼玉県公募公債	0.335	100,000	101,436	2025/１/28
平成29年度第８回埼玉県公募公債	0.245	200,000	202,450	2028/１/26
平成19年度第１回福岡県公募公債（30年）	2.62	70,000	96,054	2037/９/18
平成20年度第１回福岡県公募公債（30年）	2.28	80,000	106,405	2038/９/17
平成26年度第８回福岡県公募公債	0.441	100,000	101,896	2024/12/25
平成26年度第１回福岡県公募公債	0.654	100,000	102,571	2024/６/26
平成27年度第７回福岡県公募公債	0.464	100,000	102,292	2025/12/25
第９回千葉県公募公債（20年）	1.84	80,000	93,674	2030/10/11
平成23年度第９回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,360	2022/３/25
平成24年度第１回千葉県公募公債	1.05	20,000	20,396	2022/４/25
平成24年度第６回千葉県公募公債	0.81	100,000	101,966	2022/11/25
平成25年度第１回千葉県公募公債	0.58	82,500	83,838	2023/４/25
平成25年度第８回千葉県公募公債	0.67	100,000	102,261	2023/11/24
第７回群馬県公募公債（20年）	0.313	300,000	297,390	2036/６/13
平成24年度第１回大分県公募公債	0.8	100,260	102,152	2022/10/31
平成27年度第１回大分県公募公債	0.476	203,400	208,068	2025/10/30
第99回共同発行市場公募地方債	1.17	200,000	202,556	2021/６/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	101,413	2021/７/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	101,313	2021/８/25
第106回共同発行市場公募地方債	0.97	1,500,000	1,524,000	2022/１/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	173,369	2022/４/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	300,000	305,217	2022/５/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	200,000	203,358	2022/８/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	101,854	2022/９/22
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	101,861	2023/３/24
第126回共同発行市場公募地方債	0.81	210,000	215,518	2023/９/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,243	2023/10/25
第129回共同発行市場公募地方債	0.71	200,000	204,920	2023/12/25

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

銘柄	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27回横浜市公募公債（20年）	1.599	60,000	70,075	2033/5/20
第33回横浜市公募公債（20年）	0.323	100,000	99,220	2036/4/28
第35回横浜市公募公債（20年）	0.443	300,000	302,952	2036/10/28
平成22年度第８回札幌市公募公債（30年）	2.277	80,000	109,199	2040/9/20
平成23年度第３回札幌市公募公債	1.944	300,000	357,390	2031/7/29
平成26年度第５回札幌市公募公債	0.961	100,000	107,788	2029/9/20
平成27年度第９回札幌市公募公債	0.19	100,000	100,754	2025/12/19
第17回北九州市公募公債（20年）	1.529	100,000	116,333	2034/6/20
平成25年度第３回北九州市公募公債	0.728	300,000	307,359	2023/12/26
平成23年度第６回福岡市公募公債	1.0	100,000	101,418	2021/10/28
平成24年度第４回福岡市公募公債	0.8	200,000	203,776	2022/10/31
平成25年度第４回福岡市公募公債	0.68	50,000	51,120	2023/10/24
平成26年度第６回福岡市公募公債（20年）	1.371	100,000	114,681	2034/9/20
平成25年度第２回広島市公募公債	0.72	100,000	102,500	2023/12/27
平成29年度第６回広島市公募公債	0.23	300,000	303,366	2028/2/25
平成24年度第１回相模原市公募公債	0.71	200,000	203,518	2022/12/20
平成23年度第１回三重県公募公債	1.021	98,410	99,923	2021/11/30
平成24年度第４回福井県公募公債	0.46	100,000	101,270	2023/4/26
平成26年度第４回福井県公募公債	0.425	100,000	101,962	2025/4/24
平成23年度第１回徳島県公募公債	1.02	100,000	101,536	2021/11/30
平成24年度第１回山梨県公募公債	0.8	200,000	203,764	2022/10/28
平成30年度第１回山梨県公募公債	0.289	100,000	101,586	2028/10/30
平成24年度第２回岡山県公募公債	0.68	100,000	101,869	2023/3/29
平成26年度第１回岡山市公募公債	0.33	100,000	101,414	2025/1/30
平成28年度第１回岡山県公募公債	0.18	300,000	302,103	2027/1/29
第４回京都市保証京都市土地開発公社債券	0.06	200,000	199,684	2023/3/29
第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	2.34	100,000	117,655	2028/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券	0.704	100,000	102,180	2024/3/19
小計		30,568,420	32,031,730	
特殊債券（除く金融債）				
第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	400,000	473,572	2028/11/28
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	136,425	2040/2/29
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	91,000	92,081	2021/5/31
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	122,000	123,638	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	200,000	203,018	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	237,346	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	136,000	138,174	2021/11/30
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	300,000	304,797	2022/1/31
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	212,000	215,536	2022/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	109,000	110,867	2022/3/18
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.977	433,000	441,517	2022/4/28
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.737	100,000	118,449	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.83	200,000	256,692	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	512,000	521,661	2022/6/30
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.791	430,000	438,294	2022/10/31

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.805	400,000	408,116	2022/11/30
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	201,000	205,522	2023/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	170,700	173,921	2023/3/17
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	115,018	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	155,428	2023/4/28
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	100,000	102,748	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	223,000	229,504	2023/7/31
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	100,000	102,693	2023/9/29
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.66	200,000	204,976	2024/2/29
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	332,000	340,243	2024/3/29
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	124,000	127,129	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	100,000	115,678	2034/8/31
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.495	283,000	289,322	2024/11/29
第256回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.425	213,000	217,698	2025/9/30
第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.01	100,000	99,872	2026/9/30
第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.174	106,000	107,034	2027/2/26
第318回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.16	100,000	100,935	2027/7/30
第２回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	0.502	300,000	302,580	2021/12/24
第５回政府保証公営企業債券（15年）	2.2	300,000	314,286	2022/7/15
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券（６年）	0.001	240,000	239,954	2022/5/30
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	30,000	30,332	2021/3/12
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	21,000	21,310	2021/10/18
第30回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	401,000	407,243	2021/11/15
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	50,000	50,899	2021/12/14
第35回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.977	200,000	203,900	2022/4/22
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,787	2022/8/15
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	102,239	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	17,000	17,320	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	36,000	36,650	2023/5/16
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.693	160,000	163,964	2023/12/18
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	315,000	323,193	2024/4/12
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.644	100,000	102,613	2024/6/14
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	102,496	2024/7/16
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	240,000	245,678	2024/9/13
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.484	302,000	309,193	2025/6/13
第74回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.557	113,000	116,166	2025/7/15
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.381	150,000	153,027	2025/11/18
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	174,000	174,050	2026/3/13
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.115	206,000	207,168	2027/1/19
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,904	2027/8/13
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	100,000	101,277	2028/2/15
第106回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.145	116,000	117,042	2028/3/14
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	102,255	2023/2/24
第17回政府保証民間都市開発債券	0.145	200,000	201,504	2026/2/26
第211回政府保証預金保険機構債券	0.1	100,000	100,186	2021/10/19

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３回政府保証新関西国際空港債券	0.644	100,000	102,636	2024/６/26
第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債	0.001	400,000	399,924	2022/５/20
第19回政府保証日本政策投資銀行	0.668	400,000	407,528	2023/３/15
第22回政府保証日本政策投資銀行	0.693	20,000	20,495	2023/12/18
第60回政府保証日本政策投資銀行債券	0.001	1,000,000	998,050	2027/１/29
第18回政府保証中部国際空港債券	0.668	558,000	568,579	2023/３/22
第94回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	0.001	200,000	199,908	2021/９/17
第９回道路債券（財投機関債）	2.9	100,000	131,534	2032/５/20
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.35	200,000	228,616	2026/９/18
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.87	30,000	46,776	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.75	100,000	153,205	2047/３/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.67	130,000	196,939	2047/３/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.39	500,000	581,285	2027/７/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.34	200,000	232,906	2027/10/20
第33回道路債券（財投機関債）	2.91	500,000	677,040	2034/６/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	2.14	50,000	59,792	2030/５/10
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.9	50,000	59,773	2032/３/19
第87回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	0.893	200,000	203,654	2022/６/20
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.711	100,000	117,576	2032/６/18
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.038	200,000	205,808	2023/３/20
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.523	200,000	243,258	2044/12/20
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.133	200,000	222,598	2035/３/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.974	100,000	138,919	2055/３/19
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.284	100,000	113,866	2035/９/20
第167回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.11	200,000	222,676	2035/12/20
第１回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	2.266	50,000	59,603	2029/６/28
第３回公営企業債券（20年）（財投機関債）	1.03	20,000	20,577	2023/３/22
第６回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.03	100,000	107,228	2023/12/20
第８回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	2.043	200,000	237,652	2030/６/28
第９回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.33	50,000	55,006	2024/９/24
第11回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.851	300,000	352,386	2030/10/28
第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	2.187	80,000	97,311	2031/４/28
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.846	80,000	94,651	2031/８/28
Ｆ17回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.625	400,000	411,028	2022/１/28
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	2.39	150,000	170,277	2026/３/24
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.68	300,000	351,876	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	73,306	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	59,494	2033/１/28
第33回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.035	400,000	407,316	2022/２/28
第44回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	1.298	100,000	114,034	2035/６/28
Ｆ67回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.805	300,000	335,628	2027/６/４
Ｆ89回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.602	300,000	332,289	2027/８/20
Ｆ90回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.609	300,000	334,389	2028/１/28
Ｆ104回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.314	100,000	106,127	2025/３/７
Ｆ122回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.412	300,000	327,513	2027/６/18

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
Ｆ123回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.6	100,000	114,058	2030/３/19
第128回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	0.155	400,000	400,388	2030/１/28
Ｆ149回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.145	100,000	105,972	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	320,919	2027/10/29
Ｆ234回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.605	100,000	118,342	2035/４/27
第10回日本政策金融公庫（財投機関債）	2.167	80,000	95,647	2030/３/19
第15回日本政策金融公庫（財投機関債）	1.911	80,000	94,467	2030/10/29
第48回福祉医療機構債券（財投機関債）	0.175	700,000	703,444	2026/12/18
第54回福祉医療機構債券（財投機関債）	0.225	300,000	302,286	2028/６/20
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	12,945	13,354	2042/５/10
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.08	13,434	13,955	2037/11/10
第２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	14,327	14,997	2042/６/10
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.27	13,750	14,381	2037/11/10
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.18	72,110	72,156	2032/５/10
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.16	152,482	152,692	2033/１/10
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	13,623	14,185	2042/８/10
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.08	184,134	183,861	2033/４/10
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	1.76	11,864	12,092	2036/11/10
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.26	12,279	12,665	2037/５/10
第６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	13,641	14,163	2042/10/10
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.94	14,300	14,875	2038/11/10
第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.25	12,327	12,710	2037/５/10
第８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	14,532	15,131	2042/12/10
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.19	12,925	13,405	2037/５/10
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.24	15,205	16,058	2039/５/10
第10回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.15	13,318	13,816	2037/５/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	15,251	15,972	2043/５/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	10,243	10,305	2039/１/10
第14回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.7	12,106	12,251	2032/５/10
第16回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.64	14,673	14,964	2032/11/10
第17回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.71	14,733	15,032	2032/11/10
第18回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.57	44,502	45,369	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8	11,566	11,791	2039/６/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	11,725	12,004	2039/７/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	46,208	50,040	2044/６/10
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.67	11,723	11,953	2040/５/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	25,786	26,469	2040/６/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	14,048	14,496	2040/７/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	27,786	29,802	2045/２/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	28,785	30,689	2045/４/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	28,700	30,461	2045/５/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	13,981	14,545	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	31,547	33,353	2045/７/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	13,240	13,706	2041/２/10
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.36	32,933	34,530	2045/９/10

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	14,491	15,171	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	13,044	13,640	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	38,321	40,734	2045/12/10
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	37,230	39,814	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	31,426	33,484	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.92	28,616	30,513	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	89,235	95,062	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	29,589	31,438	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	30,400	32,224	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	13,057	13,588	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	32,824	34,807	2046/8/10
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	35,499	37,555	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	37,087	39,236	2046/10/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	40,990	43,379	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	123,198	130,511	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	42,090	44,590	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	43,829	46,276	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	45,257	47,551	2047/7/10
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	45,400	47,497	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	47,405	49,644	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	42,874	45,091	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.32	48,101	50,852	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	2.066	80,000	96,404	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	290,962	305,303	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.751	30,000	33,024	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	43,511	45,425	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	176,092	183,836	2048/12/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	95,572	99,876	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	47,322	49,458	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	50,368	52,593	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	98,886	103,109	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	102,232	106,677	2049/6/10
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	54,972	57,187	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	56,395	58,436	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	114,766	118,763	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	58,429	60,154	2050/1/10
第92回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.06	180,000	183,022	2021/12/20
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	122,986	125,681	2050/2/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.81	71,026	73,457	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	71,165	73,956	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	142,638	148,083	2050/8/10
第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.441	300,000	327,369	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.86	371,285	385,375	2050/12/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	409,760	412,935	2051/6/10
第114回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.473	190,000	208,876	2027/9/17

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	254,607	257,428	2051/12/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	430,050	436,586	2052/3/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	2.227	130,000	176,048	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.801	100,000	118,866	2032/9/17
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	533,100	539,358	2052/10/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	89,468	90,510	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	90,492	91,786	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	90,657	91,731	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	182,278	184,148	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	182,034	183,903	2053/5/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	457,365	462,720	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	185,300	187,030	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	186,566	188,972	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	93,640	95,053	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	94,239	95,866	2053/11/10
第143回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.192	200,000	217,636	2028/10/20
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	97,098	96,561	2054/8/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	195,896	194,714	2054/11/10
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	197,288	196,846	2054/12/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	197,722	198,410	2055/1/10
第174回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	1.129	180,000	200,809	2035/11/20
第６回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	2.04	50,000	55,025	2025/6/20
第７回国際協力機構債券（財投機関債）	1.991	70,000	83,783	2031/6/13
第39回東日本高速道路	0.03	1,000,000	1,000,230	2021/12/20
第33回中日本高速道路	1.084	50,000	50,721	2021/9/17
第39回中日本高速道路	1.057	400,000	406,696	2021/12/20
第65回中日本高速道路	0.03	700,000	700,126	2021/7/14
第72回中日本高速道路	0.05	300,000	300,090	2022/5/30
第29回西日本高速道路	0.31	500,000	505,570	2026/2/12
第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	0.905	200,000	214,322	2029/11/27
第18回韓国輸出入銀行	0.27	100,000	99,815	2021/6/28
小計		35,182,562	37,218,986	
金融債券				
い第814号商工債券	0.17	200,000	200,400	2023/3/27
い第832号商工債券	0.06	300,000	298,755	2024/9/27
い第818号農林債券	0.08	200,000	199,904	2023/7/27
第322回信金中金債	0.03	300,000	299,874	2021/9/27
第327回信金中金債	0.06	200,000	199,988	2022/2/25
第336回信金中金債	0.1	300,000	300,111	2022/11/25
第338回信金中金債	0.11	200,000	200,146	2023/1/27
第11号商工債券（10年）	0.66	100,000	102,186	2024/9/20
第223号商工債券（３年）	0.11	300,000	300,117	2021/8/27
第230号商工債券（３年）	0.09	300,000	300,033	2022/3/25
第231号商工債券（３年）	0.08	100,000	99,990	2022/4/27
第236号商工債券（３年）	0.02	500,000	498,990	2022/9/27

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

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11回ブリヂストン	0.295	300,000	298,740	2027/4/21
第13回ブリヂストン	0.23	200,000	198,750	2026/4/17
第10回日本特殊陶業	0.11	100,000	99,415	2024/6/20
第１回日本製鉄	0.14	400,000	396,696	2024/6/20
第４回新日本製鐵	0.375	200,000	198,146	2027/5/20
第19回豊田自動織機	1.109	100,000	101,299	2021/9/17
第48回日本精工	0.16	200,000	199,472	2023/11/29
第51回日本精工	0.19	100,000	98,785	2026/9/2
第19回日立製作所	0.16	300,000	295,215	2027/3/12
第53回日本電気	0.26	200,000	199,732	2023/9/21
第56回日本電気	0.28	300,000	300,216	2023/4/21
第17回パナソニック	0.47	100,000	100,171	2026/9/18
第18回デンソー	0.315	500,000	498,285	2028/3/17
第29回三菱重工業	0.662	300,000	304,221	2024/9/3
第１回日本生命2017基金	0.304	100,000	99,702	2021/8/2
第２回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.25	200,000	199,964	2022/10/31
第60回日産自動車	0.22	200,000	195,446	2023/3/20
第13回アイシン精機	0.827	100,000	102,005	2023/9/20
第１回明治安田生命2018基金	0.315	300,000	296,730	2023/9/25
第１回明治安田生命2019基金	0.29	200,000	197,496	2024/8/2
第48回クレディセゾン	1.038	200,000	204,676	2023/10/20
第３回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	0.724	300,000	300,012	2025/3/5
第17回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	0.535	300,000	293,529	2028/5/31
第８回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	1.62	100,000	101,958	2021/10/29
第９回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	2.2	100,000	109,334	2026/10/30
第28回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	1.56	100,000	100,853	2021/1/20
第29回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	2.16	200,000	216,282	2026/1/20
第30回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	2.46	100,000	116,243	2031/1/20
第57回三菱東京ＵＦＪ銀行	2.22	200,000	210,224	2022/10/27
第８回三菱ＵＦＪ信託銀行（劣後特約付）	1.92	200,000	212,918	2025/10/28
第23回三井住友銀行（劣後特約付）	1.61	100,000	100,778	2020/12/17
第15回芙蓉総合リース	0.33	100,000	99,447	2024/12/6
第47回日産フィナンシャルサービス	0.23	200,000	195,554	2022/12/20
第20回東京センチュリーリース	0.19	100,000	99,801	2022/10/18
第23回東京センチュリーリース	0.2	200,000	199,414	2023/4/13
第42回ホンダファイナンス	0.05	100,000	99,731	2022/6/20
第91回トヨタファイナンス	0.19	300,000	300,087	2023/4/27
第23回リコーリース	0.05	200,000	199,620	2021/9/24
第27回リコーリース	0.16	100,000	99,874	2022/7/20
第30回リコーリース	0.16	200,000	199,852	2022/1/21
第35回リコーリース	0.04	100,000	99,638	2022/7/12
第37回リコーリース	0.02	300,000	298,470	2022/10/11
第７回イオンフィナンシャルサービス	0.19	200,000	198,358	2023/3/20
第79回アコム	0.29	300,000	294,039	2025/2/28
第47回日立キャピタル	0.874	100,000	101,448	2023/3/20

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

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
国内	債券先物取引	１０年国債標準物	百万円 609	百万円 —

○投資信託財産の構成

（2020年５月12日現在）

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年５月12日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　450,894,780,414円
　期中追加設定元本額　307,363,156,249円
　期中一部解約元本額　291,909,761,677円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.3524円です。

○損益の状況 (2019年５月14日～2020年５月12日)

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

(注) **(B)有価証券売買損益**および**(C)先物取引等取引損益**は期末の評価換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）

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

三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	2,035,608,272円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	1,974,933,223円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,931,137,648円
つみたて８資産均等バランス	1,609,028,373円
ＭＵＫＡＭ バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	1,188,668,654円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,187,494,871円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	1,134,033,350円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	664,017,745円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	651,394,383円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	494,190,717円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	493,158,520円
つみたて４資産均等バランス	484,552,426円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	408,544,762円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	385,698,534円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	332,696,834円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	256,630,202円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	243,287,476円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	242,394,210円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	220,647,949円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	201,177,980円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	137,013,411円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	124,190,981円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	97,163,240円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	87,659,350円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	74,654,433円
ｅＭＡＸＩＳ 債券バランス（２資産均等型）	68,355,964円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	67,251,260円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	57,018,629円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	51,217,410円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	27,724,765円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	21,458,298円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,965,089円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	18,206,223円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	15,046,178円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	12,048,218円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	11,726,700円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	11,414,627円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	6,132,389円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	3,864,092円
コアバランス	1,676,166円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	1,511,500円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	922,473円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	62,733円
合計	466,348,174,986円

外国債券インデックスマザーファンド

《第19期》決算日2020年５月12日

［計算期間：2019年５月14日～2020年５月12日］

「外国債券インデックスマザーファンド」は、５月12日に第19期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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
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
19期(2020年５月12日)	21,324	4.5	119,287.72	4.6	98.6	－	149,310

(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	%		%	%	%
2019年５月13日	20,412	－	113,996.81	－	98.7	－
５月末	20,456	0.2	114,188.44	0.2	98.6	－
６月末	20,724	1.5	115,685.41	1.5	98.5	－
７月末	20,786	1.8	115,950.32	1.7	97.5	－
８月末	20,922	2.5	116,876.64	2.5	97.9	－
９月末	21,023	3.0	117,408.61	3.0	98.3	－
10月末	21,229	4.0	118,313.83	3.8	98.4	－
11月末	21,240	4.1	118,546.99	4.0	98.7	－
12月末	21,339	4.5	118,980.17	4.4	98.5	－
2020年１月末	21,509	5.4	120,069.31	5.3	98.4	－
２月末	21,764	6.6	121,401.29	6.5	98.5	－
３月末	21,796	6.8	121,796.59	6.8	98.5	－
４月末	21,381	4.7	119,329.72	4.7	98.0	－
（期　末）						
2020年５月12日	21,324	4.5	119,287.72	4.6	98.6	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

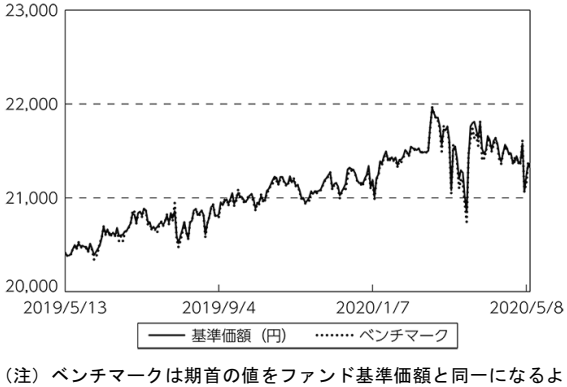
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

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

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

◎為替市況
・期首に比べて米ドル、ユーロは対円で下落しました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは4.6%の上昇になったため、カイ離は△0.1%程度となりました。

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
（主なプラス要因）
・ポートフォリオ要因によるものです。

（主なマイナス要因）
・評価時価差異要因※によるものです。
※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

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

○１万口当たりの費用明細

（2019年５月14日～2020年５月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	2	0.011	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(2)	(0.011)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	2	0.011	
期中の平均基準価額は、21,088円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年５月14日～2020年５月12日）

公社債

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

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2019年５月14日～2020年５月12日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	36,920	13,961	37.8	30,920	8,422	27.2

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱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５月12日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	573,360	643,922	69,234,594	46.4	－	21.0	17.3	8.0
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	31,990	37,068	2,834,629	1.9	－	0.9	0.7	0.3
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	225,130	249,067	1,113,331	0.7	－	0.4	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	74,720	91,388	10,602,937	7.1	－	4.2	2.3	0.6
イタリア	100,910	111,552	12,942,300	8.7	－	5.1	2.4	1.2
フランス	102,840	125,138	14,518,558	9.7	－	6.7	2.4	0.6
オランダ	19,710	24,530	2,846,004	1.9	－	1.3	0.4	0.2
スペイン	60,760	72,274	8,385,249	5.6	－	3.8	1.2	0.6
ベルギー	24,460	30,403	3,527,379	2.4	－	1.8	0.4	0.1
オーストリア	15,180	18,816	2,183,038	1.5	－	1.0	0.3	0.1
フィンランド	6,200	6,921	803,060	0.5	－	0.4	0.1	0.0
アイルランド	8,270	9,319	1,081,302	0.7	－	0.5	0.2	0.0
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	52,160	74,698	9,878,880	6.6	－	5.4	1.1	0.1
	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	32,570	36,997	401,792	0.3	－	0.2	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	30,660	33,342	346,428	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	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	36,130	46,864	729,213	0.5	－	0.4	0.0	0.1
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	30,230	33,068	840,605	0.6	－	0.3	0.2	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	36,920	42,500	2,941,472	2.0	－	1.3	0.5	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	7,880	8,898	673,847	0.5	－	0.3	0.1	0.1
	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	26,470	28,964	715,704	0.5	－	0.3	0.1	0.1
	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル						
イスラエル	14,800	18,833	577,047	0.4	－	0.2	0.1	0.1
合計	－	－	147,177,380	98.6	－	55.7	30.3	12.5

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

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

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

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		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	1.875 T-NOTE 220430	1.875	5,700	5,887	632,973	2022/4/30
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	6,760	6,992	751,820	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220731	1.875	4,500	4,666	501,757	2022/7/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	1,500	1,557	167,466	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 220930	1.875	2,000	2,078	223,507	2022/9/30
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,700	2,810	302,188	2022/10/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	1,850	1,893	203,636	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	1,700	1,744	187,610	2021/10/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	2,650	2,722	292,730	2021/11/15
		2 T-NOTE 211231	2.0	5,850	6,020	647,370	2021/12/31
		2 T-NOTE 220215	2.0	2,200	2,270	244,130	2022/2/15
		2 T-NOTE 220731	2.0	2,900	3,015	324,255	2022/7/31
		2 T-NOTE 221031	2.0	2,000	2,087	224,498	2022/10/31
		2 T-NOTE 221130	2.0	6,200	6,479	696,726	2022/11/30
		2 T-NOTE 240430	2.0	2,000	2,133	229,370	2024/4/30
		2 T-NOTE 240531	2.0	3,850	4,111	442,055	2024/5/31
		2 T-NOTE 240630	2.0	2,200	2,351	252,880	2024/6/30
		2 T-NOTE 250215	2.0	4,700	5,063	544,468	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	5,300	5,738	617,047	2025/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	5,150	5,632	605,640	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 210630	2.125	1,650	1,686	181,371	2021/6/30
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	4,500	4,610	495,746	2021/8/15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,200	2,258	242,864	2021/9/30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	4,060	4,187	450,206	2021/12/31
		2.125 T-NOTE 220630	2.125	1,800	1,874	201,519	2022/6/30
		2.125 T-NOTE 221231	2.125	5,150	5,406	581,284	2022/12/31
		2.125 T-NOTE 231130	2.125	4,500	4,793	515,440	2023/11/30
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	4,550	4,863	522,887	2024/2/29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	3,460	3,703	398,234	2024/3/31
		2.125 T-NOTE 240731	2.125	1,750	1,881	202,286	2024/7/31
		2.125 T-NOTE 240930	2.125	2,250	2,425	260,782	2024/9/30
		2.125 T-NOTE 241130	2.125	1,900	2,052	220,710	2024/11/30
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	2,300	2,499	268,721	2025/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	2,710	3,187	342,666	2046/8/15
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	3,400	3,485	374,735	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 220415	2.25	2,700	2,806	301,746	2022/4/15
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	4,900	5,248	564,344	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 240131	2.25	7,300	7,829	841,862	2024/1/31
		2.25 T-NOTE 240430	2.25	5,000	5,382	578,760	2024/4/30
		2.25 T-NOTE 241031	2.25	2,800	3,037	326,575	2024/10/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	7,250	7,867	845,900	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	6,570	7,215	775,832	2025/11/15
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	4,750	5,285	568,295	2027/2/15
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	4,700	5,260	565,590	2027/8/15
		2.25 T-NOTE 271115	2.25	3,000	3,364	361,796	2027/11/15
		2.375 T-NOTE 230131	2.375	5,000	5,292	569,016	2023/1/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	4,300	4,671	502,284	2024/8/15

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

銘柄			当期末				
			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	3.125 T-BOND 430215	3.125	4,000	5,373	577,718	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	4,450	6,015	646,786	2044/8/15
		3.125 T-BOND 480515	3.125	2,610	3,622	389,457	2048/5/15
		3.125 T-NOTE 281115	3.125	9,950	11,978	1,287,967	2028/11/15
		3.375 T-BOND 440515	3.375	4,240	5,947	639,485	2044/5/15
		3.625 T-BOND 430815	3.625	2,850	4,125	443,560	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	4,550	6,608	710,548	2044/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,459	156,970	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	4,450	6,569	706,332	2043/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	1,150	1,700	182,844	2040/8/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	1,030	1,584	170,401	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	1,370	2,123	228,318	2040/11/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	1,350	2,112	227,128	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,250	1,963	211,112	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,300	2,050	220,496	2041/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	1,100	1,745	187,636	2039/8/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	1,900	3,063	329,430	2040/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,530	2,515	270,496	2041/2/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	550	760	81,778	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	300	417	44,929	2029/2/15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	600	835	89,873	2028/8/15
		6 T-BOND 260215	6.0	2,600	3,424	368,244	2026/2/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	2,130	2,546	273,837	2023/8/15
		8 T-BOND 211115	8.0	600	671	72,180	2021/11/15
小計						69,234,594	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,500	1,506	115,236	2022/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	3,120	3,140	240,175	2021/9/1
		1 CAN GOVT 220901	1.0	2,350	2,389	182,759	2022/9/1
		1 CAN GOVT 270601	1.0	1,200	1,244	95,195	2027/6/1
		1.25 CAN GOVT 250301	1.25	600	625	47,821	2025/3/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	850	882	67,476	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 240901	1.5	2,000	2,099	160,542	2024/9/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	970	1,034	79,121	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 210501	1.75	1,100	1,116	85,365	2021/5/1
		1.75 CAN GOVT 230301	1.75	800	833	63,765	2023/3/1
		2 CAN GOVT 230901	2.0	2,400	2,535	193,926	2023/9/1
		2 CAN GOVT 280601	2.0	900	1,007	77,028	2028/6/1
		2 CAN GOVT 511201	2.0	1,160	1,417	108,432	2051/12/1
		2.25 CAN GOVT 240301	2.25	800	858	65,665	2024/3/1
		2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,300	1,422	108,788	2025/6/1
		2.25 CAN GOVT 290601	2.25	890	1,026	78,522	2029/6/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,500	1,631	124,791	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	850	893	68,329	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	860	1,187	90,838	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	310	479	36,686	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	800	825	63,139	2021/6/1

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
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,270	1,918	146,685	2045/12/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,100	1,699	129,996	2041/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	850	1,390	106,350	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	900	1,318	100,794	2029/6/1
		5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,370	2,212	169,209	2033/6/1
		8 CAN GOVT 270601	8.0	240	365	27,984	2027/6/1
小計						2,834,629	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	19,300	23,096	103,242	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	6,600	8,825	39,450	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	11,700	11,940	53,372	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	26,740	27,129	121,267	2021/6/10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	19,400	20,015	89,469	2022/6/9
		6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	10,500	10,988	49,117	2023/3/9
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	6,500	6,729	30,081	2021/12/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	24,150	26,795	119,775	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	9,150	10,309	46,085	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	9,500	10,749	48,052	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	13,240	14,468	64,674	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	23,450	25,763	115,162	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	10,800	12,087	54,031	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	22,000	25,914	115,837	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	12,100	14,253	63,711	2038/11/18
小計						1,113,331	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 500815	—	470	478	55,539	2050/8/15
		0 OBL 220408	—	1,700	1,724	200,127	2022/4/8
		0 OBL 221007	—	2,000	2,037	236,336	2022/10/7
		0 OBL 230414	—	1,400	1,432	166,178	2023/4/14
		0 OBL 231013	—	2,150	2,208	256,213	2023/10/13
		0 SCHATS 220311	—	3,900	3,954	458,842	2022/3/11
		0.25 BUND 270215	0.25	2,600	2,768	321,221	2027/2/15
		0.25 BUND 280815	0.25	1,990	2,135	247,787	2028/8/15
		0.25 BUND 290215	0.25	5,700	6,130	711,261	2029/2/15
		0.5 BUND 250215	0.5	4,000	4,244	492,494	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	2,600	2,788	323,470	2026/2/15
		0.5 BUND 270815	0.5	2,300	2,498	289,887	2027/8/15
		0.5 BUND 280215	0.5	1,900	2,072	240,427	2028/2/15
		1 BUND 240815	1.0	1,750	1,884	218,680	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	2,800	3,062	355,299	2025/8/15
		1.25 BUND 480815	1.25	2,850	3,935	456,583	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	1,300	1,369	158,877	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	2,500	2,660	308,650	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,500	1,604	186,140	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,550	1,694	196,556	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,300	2,425	281,371	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	4,450	4,881	566,327	2024/2/15

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	2 BUND 220104	2.0	1,500	1,568	182,000	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,450	1,583	183,718	2023/8/15
		2.5 BUND 440704	2.5	1,880	3,104	360,189	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	2,030	3,441	399,306	2046/8/15
		3.25 BUND 420704	3.25	1,030	1,828	212,104	2042/7/4
		4 BUND 370104	4.0	1,690	2,934	340,482	2037/1/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,650	3,106	360,421	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	930	1,344	155,940	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,040	3,567	413,849	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,190	2,415	280,193	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,290	2,136	247,874	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,250	1,860	215,912	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,130	1,422	165,093	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	750	1,254	145,514	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	1,200	1,827	212,058	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	1,350	1,346	156,222	2021/11/1
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,500	1,435	166,542	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,300	1,301	151,024	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	2,700	2,673	310,156	2023/10/15
		0.9 ITALY GOVT 220801	0.9	3,200	3,212	372,675	2022/8/1
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	1,980	1,985	230,335	2023/3/15
		1.2 ITALY GOVT 220401	1.2	1,400	1,413	163,962	2022/4/1
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,550	1,521	176,536	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,150	1,164	135,092	2022/4/15
		1.35 ITALY GOVT 300401	1.35	2,300	2,191	254,227	2030/4/1
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	1,400	1,422	165,039	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,600	1,614	187,272	2024/11/15
		1.45 ITALY GOVT 250515	1.45	1,600	1,607	186,475	2025/5/15
		1.45 ITALY GOVT 360301	1.45	750	671	77,857	2036/3/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,550	1,559	180,959	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,000	2,010	233,235	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,850	1,779	206,479	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	850	873	101,303	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,730	1,781	206,697	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	1,800	1,840	213,509	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,300	1,333	154,749	2027/8/1
		2.1 ITALY GOVT 260715	2.1	1,350	1,393	161,689	2026/7/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	1,400	1,450	168,342	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	1,260	1,252	145,351	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	1,400	1,445	167,717	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	1,080	1,023	118,799	2050/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,800	1,896	220,046	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	1,410	1,488	172,647	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	1,200	1,212	140,644	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	1,550	1,673	194,120	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	630	624	72,459	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	1,250	1,341	155,593	2038/9/1

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	3 ITALY GOVT 290801	3.0	550	602	69,933	2029/8/1
		3.1 ITALY GOVT 400301	3.1	590	642	74,502	2040/3/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,150	1,270	147,439	2046/9/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,190	1,359	157,743	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,700	1,937	224,800	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,800	1,860	215,825	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	3,000	3,120	362,044	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,500	1,656	192,130	2024/9/1
		3.85 ITALY GOVT 490901	3.85	920	1,123	130,331	2049/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,050	2,496	289,609	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,300	2,542	294,975	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,120	2,385	276,722	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,450	1,691	196,274	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	3,000	3,166	367,426	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	1,700	1,904	220,958	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	2,000	2,458	285,232	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,220	1,662	192,928	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,500	1,617	187,618	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,920	2,247	260,710	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,310	3,076	356,897	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,620	2,231	258,924	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,050	2,829	328,241	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,100	2,709	314,334	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,150	1,273	147,763	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,200	2,451	284,377	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,730	2,415	280,223	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,530	3,511	407,376	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,070	2,758	320,078	2027/11/1
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	1,100	1,482	171,994	2026/11/1
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,200	1,526	177,111	2023/11/1
フランス	国債証券	0 O.A.T 220525	—	2,700	2,730	316,794	2022/5/25
		0 O.A.T 230325	—	3,100	3,148	365,258	2023/3/25
		0 O.A.T 250325	—	2,000	2,040	236,737	2025/3/25
		0 O.A.T 291125	—	2,100	2,103	244,049	2029/11/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	1,500	1,550	179,889	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	2,750	2,878	333,977	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	3,250	3,411	395,763	2026/5/25
		0.5 O.A.T 290525	0.5	2,200	2,312	268,337	2029/5/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	3,190	3,419	396,735	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	3,100	3,327	386,023	2028/11/25
		1 O.A.T 251125	1.0	1,920	2,066	239,710	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	2,900	3,148	365,340	2027/5/25
		1.25 O.A.T 340525	1.25	2,070	2,348	272,418	2034/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	2,730	3,104	360,232	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	3,390	3,926	455,504	2031/5/25
		1.5 O.A.T 500525	1.5	1,180	1,424	165,274	2050/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	6,850	7,333	850,866	2023/5/25

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	1.75 O.A.T 241125	1.75	2,900	3,193	370,539	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	2,370	2,926	339,492	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,270	1,719	199,551	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	1,840	2,444	283,645	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	3,850	4,117	477,680	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	2,740	3,046	353,469	2024/5/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	2,950	3,690	428,134	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	3,270	3,996	463,649	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	5,500	5,882	682,518	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	1,600	1,687	195,795	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,960	3,146	365,007	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,550	3,135	363,773	2026/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	1,840	3,001	348,192	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,440	2,862	332,088	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,310	2,736	317,491	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,590	4,191	486,300	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,560	4,579	531,328	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,400	3,968	460,415	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	2,750	4,131	479,354	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,220	3,758	436,055	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	3,700	4,998	579,936	2025/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	1,300	1,648	191,222	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	－	800	808	93,849	2022/1/15
		0 NETH GOVT 240115	－	1,250	1,280	148,508	2024/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,350	1,408	163,451	2025/7/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	400	420	48,834	2029/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	1,350	1,436	166,606	2026/7/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	1,180	1,282	148,813	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	1,330	1,454	168,764	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,000	1,077	125,026	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	950	1,055	122,502	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	900	958	111,162	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,730	2,323	269,573	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	980	1,680	194,934	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,600	1,671	193,933	2021/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	300	336	38,985	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,300	2,357	273,462	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,490	2,506	290,780	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,150	1,677	194,651	2028/1/15
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	650	794	92,162	2023/1/15
スペイン	国債証券	0.05 SPAIN GOVT 211031	0.05	1,000	1,003	116,474	2021/10/31
		0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	1,100	1,113	129,165	2023/7/30
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	1,500	1,517	176,092	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	1,450	1,471	170,748	2022/10/31
		0.6 SPAIN GOVT 291031	0.6	2,100	2,069	240,158	2029/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	2,600	2,632	305,394	2021/7/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	600	509	59,085	2050/10/31

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	1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	1,950	2,060	239,004	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280430	1.4	1,500	1,591	184,592	2028/4/30
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,900	2,015	233,831	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	2,100	2,234	259,259	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	1,320	1,403	162,828	2029/4/30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	1,450	1,550	179,928	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,800	1,923	223,109	2025/4/30
		1.85 SPAIN GOVT 350730	1.85	850	931	108,084	2035/7/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,900	2,078	241,156	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	2,220	2,463	285,862	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	2,000	2,202	255,558	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	1,740	2,022	234,673	2033/7/30
		2.7 SPAIN GOVT 481031	2.7	970	1,215	140,985	2048/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,050	2,288	265,516	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,310	1,688	195,916	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	820	1,250	145,054	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	2,300	2,638	306,144	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,470	2,136	247,925	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	2,350	2,709	314,368	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	2,050	2,517	292,134	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,550	2,489	288,862	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,300	1,529	177,510	2024/1/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,300	2,111	244,995	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,350	1,846	214,265	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	1,160	2,021	234,581	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,750	2,012	233,481	2023/1/31
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,850	4,434	514,502	2032/7/30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,850	2,042	237,004	2022/1/31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,450	1,938	224,887	2026/7/30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	1,800	2,603	302,102	2029/1/31
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	600	614	71,263	2023/10/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	800	831	96,498	2024/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,300	1,375	159,616	2025/6/22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,080	1,153	133,863	2027/6/22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,100	2,252	261,332	2028/6/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	1,060	1,147	133,186	2029/6/22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	1,100	1,183	137,345	2026/6/22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	650	712	82,683	2031/6/22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	940	1,061	123,163	2033/4/22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	300	347	40,273	2037/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	880	1,067	123,815	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	390	485	56,300	2050/6/22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	630	778	90,374	2038/6/22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	570	842	97,689	2066/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	820	891	103,402	2023/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	360	520	60,444	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,180	1,328	154,080	2024/6/22

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	3 BEL GOVT 340622	3.0	610	836	96,998	2034/6/22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	970	1,655	192,064	2045/6/22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	750	814	94,518	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	620	898	104,191	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	950	1,012	117,479	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,100	1,227	142,381	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,300	2,218	257,427	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	680	872	101,203	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,520	2,538	294,543	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,200	1,734	201,236	2028/3/28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 220920	—	400	406	47,106	2022/9/20
		0 AUSTRIA GOVT 230715	—	950	967	112,225	2023/7/15
		0 AUSTRIA GOVT 300220	—	600	605	70,234	2030/2/20
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,150	1,213	140,765	2027/4/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	850	910	105,611	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	1,010	1,085	125,990	2028/2/20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	910	990	114,959	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	450	583	67,679	2047/2/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	200	289	33,549	2086/11/2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	700	767	89,084	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,200	1,297	150,528	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	420	795	92,243	2117/9/20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	590	778	90,321	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	450	755	87,660	2044/6/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	650	716	83,177	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,050	1,108	128,589	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	650	75,459	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	480	1,083	125,714	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,000	1,665	193,243	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	550	720	83,555	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	970	1,425	165,338	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	250	253	29,362	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	350	356	41,387	2023/9/15
		0 FINNISH GOVT 240915	—	250	255	29,622	2024/9/15
		0.125 FINNISH GOV 360415	0.125	200	198	23,083	2036/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	400	421	48,888	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	1,000	1,055	122,493	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	250	264	30,669	2028/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 290915	0.5	200	211	24,543	2029/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	350	381	44,212	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	500	535	62,091	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	280	320	37,147	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	240	306	35,603	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	250	265	30,806	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	300	315	36,656	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	200	220	25,541	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	531	61,610	2042/7/4

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

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
イギリス			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
	国債証券	4.25 GILT 401207	4.25	1,170	2,005	265,286	2040/12/7
		4.25 GILT 461207	4.25	1,410	2,674	353,699	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	930	1,855	245,439	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,320	2,921	386,429	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,260	1,968	260,399	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,210	2,211	292,513	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,070	1,570	207,691	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,410	2,464	325,915	2038/12/7
		5 GILT 250307	5.0	1,130	1,397	184,777	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	1,080	1,614	213,531	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	300	325	43,045	2021/6/7
小計						9,878,880	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	0.75	2,550	2,734	29,694	2028/5/12
		0.75 SWD GOVT 291112	0.75	4,400	4,740	51,484	2029/11/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	5,660	6,118	66,447	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,100	5,428	58,950	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,630	5,283	57,382	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,900	7,445	80,863	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,330	5,245	56,970	2039/3/30
小計						401,792	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	1,800	1,973	20,500	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	4,160	4,488	46,634	2026/2/19
		1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,300	2,490	25,880	2025/3/13
		1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	3,050	3,368	34,998	2027/2/17
		1.75 NORWE GOVT 290906	1.75	2,200	2,480	25,768	2029/9/6
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	5,150	5,470	56,841	2023/5/24
		2 NORWE GOVT 280426	2.0	2,850	3,230	33,564	2028/4/26
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	4,400	4,904	50,960	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	4,750	4,935	51,278	2021/5/25
小計						346,428	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	7,350	7,864	122,378	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	4,400	4,742	73,798	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	3,650	3,920	60,995	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	4,850	5,466	85,062	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	6,020	6,345	98,732	2021/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	9,860	18,524	288,245	2039/11/15
小計						729,213	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	1.75 POLAND 210725	1.75	1,900	1,929	49,040	2021/7/25
		2.25 POLAND 220425	2.25	1,250	1,292	32,849	2022/4/25
		2.25 POLAND 241025	2.25	1,000	1,060	26,955	2024/10/25
		2.5 POLAND 230125	2.5	2,500	2,624	66,724	2023/1/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	2,600	2,774	70,523	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	5,500	5,927	150,684	2026/7/25

銘柄			当期末 利率	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
ポーランド			%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
	国債証券	2.5 POLAND 270725	2.5	2,050	2,208	56,152	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	2,660	2,917	74,163	2028/4/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	1,950	2,166	55,073	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	2,700	3,003	76,358	2023/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,700	1,829	46,506	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	1,550	1,737	44,156	2022/9/23
		5.75 POLAND 290425	5.75	2,070	2,806	71,346	2029/4/25
		POLAND 220725	—	800	789	20,068	2022/7/25
小計						840,605	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	2,800	2,787	192,899	2024/11/21
		1.25 AUST GOVT 320521	1.25	760	774	53,606	2032/5/21
		1.5 AUST GOVT 310621	1.5	1,000	1,049	72,603	2031/6/21
		2 AUST GOVT 211221	2.0	1,150	1,182	81,862	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 221121	2.25	1,000	1,051	72,741	2022/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	2,300	2,561	177,306	2028/5/21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	2,300	2,637	182,514	2030/5/21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,700	1,863	128,985	2024/4/21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	1,950	2,238	154,931	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	1,950	2,255	156,090	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,830	2,133	147,681	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	500	596	41,279	2035/6/21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	1,350	1,703	117,893	2047/3/21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,800	2,051	142,013	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	2,090	2,513	173,993	2029/4/21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	820	1,044	72,259	2039/6/21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	800	1,071	74,185	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	2,490	3,034	210,023	2026/4/21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	1,270	1,785	123,602	2033/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,950	2,493	172,593	2027/4/21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,750	2,019	139,804	2023/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,760	1,857	128,571	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,600	1,792	124,027	2022/7/15
小計						2,941,472	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	550	556	42,170	2021/10/1
		1.75 SINGAPORGOVT 220401	1.75	350	358	27,175	2022/4/1
		1.75 SINGAPORGOVT 230201	1.75	250	258	19,597	2023/2/1
		1.875 SINGAPORGOV 500301	1.875	250	292	22,126	2050/3/1
		2 SINGAPORGOVT 240201	2.0	100	105	7,987	2024/2/1
		2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	630	685	51,884	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	420	428	32,451	2021/6/1
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	260	300	22,771	2036/8/1
		2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	300	326	24,734	2025/6/1
		2.375 SINGAPORGOV 390701	2.375	200	239	18,145	2039/7/1
		2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	300	342	25,963	2028/5/1
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	450	481	36,474	2023/7/1

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
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	290	374	28,330	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	520	687	52,099	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	250	293	22,232	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	300	356	27,001	2030/9/1
		3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	600	662	50,197	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	800	849	64,340	2022/9/1
		3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	410	526	39,868	2033/9/1
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	650	769	58,296	2027/3/1
小計						673,847	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.418MALAYSIAGOVT 220815	3.418	900	922	22,796	2022/8/15
		3.48 MALAYSIAGOVT 230315	3.48	1,200	1,239	30,625	2023/3/15
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3.502	300	315	7,806	2027/5/31
		3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	1,100	1,172	28,963	2028/6/15
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	500	517	12,791	2022/9/30
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	3.8	200	209	5,165	2023/8/17
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	500	542	13,400	2034/7/5
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	600	645	15,944	2033/4/15
		3.882 MALAYSIAGOV 220310	3.882	500	514	12,719	2022/3/10
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	1,000	1,062	26,247	2025/3/14
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	536	13,268	2027/3/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	1,100	1,185	29,285	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3.9	1,000	1,074	26,553	2026/11/30
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,700	1,821	45,015	2026/7/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	800	858	21,212	2025/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	922	22,805	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	1,060	1,172	28,974	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4.16	2,250	2,302	56,896	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,000	1,068	26,395	2024/7/15
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	850	949	23,466	2035/5/31
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	900	986	24,386	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,100	1,241	30,676	2030/4/15
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	4.642	1,200	1,391	34,374	2033/11/7
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	4.736	1,050	1,239	30,631	2046/3/15
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	1,600	1,885	46,579	2037/4/7
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	4.921	600	729	18,019	2048/7/6
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	1,200	1,443	35,680	2043/9/30
		5.248 MALAYSIA 280915	5.248	860	1,012	25,018	2028/9/15
小計						715,704	
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券	2.25 ISRAEL FIXED 280928	2.25	1,900	2,163	66,302	2028/9/28
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	3.75	2,000	2,272	69,635	2024/3/31
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3.75	1,200	1,723	52,820	2047/3/31
		4.25 ISRAEL FIXED 230331	4.25	1,000	1,119	34,315	2023/3/31
		5.5 ISRAEL FIXED 220131	5.5	3,800	4,211	129,047	2022/1/31
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5.5	1,400	2,455	75,235	2042/1/31

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イスラエル			%	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル	千円	
	国債証券	6.25 ISRAEL FIXED 261030	6.25	3,500	4,885	149,690	2026/10/30
小計						577,047	
合計						147,177,380	

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

○投資信託財産の構成

(2020年５月12日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	147,177,380	98.2
コール・ローン等、その他	2,708,393	1.8
投資信託財産総額	149,885,773	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（149,217,319千円）の投資信託財産総額（149,885,773千円）に対する比率は99.6%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

１アメリカドル＝107.52円	１カナダドル＝76.47円	１メキシコペソ＝4.47円	１ユーロ＝116.02円
１イギリスポンド＝132.25円	１スウェーデンクローネ＝10.86円	１ノルウェークローネ＝10.39円	１デンマーククローネ＝15.56円
１ポーランドズロチ＝25.42円	１オーストラリアドル＝69.21円	１シンガポールドル＝75.73円	１マレーシアリンギット＝24.71円
１イスラエルシェケル＝30.64円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年５月12日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	150,196,638,522
コール・ローン等	1,606,933,871
公社債(評価額)	147,177,380,764
未収入金	310,865,338
未収利息	978,667,015
前払費用	122,791,534
(B) 負債	886,399,564
未払金	874,057,047
未払解約金	12,342,455
未払利息	62
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	149,310,238,958
元本	70,021,031,430
次期繰越損益金	79,289,207,528
(D) 受益権総口数	70,021,031,430口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	21,324円

＜注記事項＞

①期首元本額　67,295,786,020円
　期中追加設定元本額　16,311,803,664円
　期中一部解約元本額　13,586,558,254円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.1324円です。

○損益の状況 (2019年５月14日～2020年５月12日)

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

(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）

ＭＵＡＭ 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	26,414,882,933円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	10,200,387,984円
ｅＭＡＸＩＳ 先進国債券インデックス	5,122,242,114円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 先進国債券インデックス	4,324,032,523円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	2,779,451,871円
ＭＵＫＡＭ 外国債券インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	2,640,109,093円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,239,490,397円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,047,844,821円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞外国債券インデックスファンド	1,961,147,101円
海外債券セレクション（ラップ向け）	1,612,485,673円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,607,967,471円
外国債券インデックスファンドｉ（適格機関投資家限定）	1,547,760,325円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,474,962,155円
つみたて８資産均等バランス	1,122,245,178円
ファンド・マネジャー（海外債券）	932,502,192円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	634,889,113円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	527,920,565円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	389,643,524円
つみたて４資産均等バランス	320,391,297円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（４資産均等型）	254,438,953円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイゴールキーパー）	246,002,409円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	212,749,942円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	204,923,110円
三菱ＵＦＪ ＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	139,293,594円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	136,358,854円

ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	120,739,411円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	110,224,076円
ＭＵＫＡＭ スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	104,661,150円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	103,150,429円
アドバンスト・バランスＩ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	100,614,309円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	48,020,053円
三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドＶＡ	42,361,257円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	42,179,647円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	39,539,015円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	31,615,729円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国債券）	31,018,793円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	23,572,599円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	22,213,126円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	18,294,746円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	17,141,039円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	16,600,604円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	9,597,890円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	7,735,425円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	7,730,040円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,341,987円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	4,392,572円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	4,053,511円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	2,528,547円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	2,528,431円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	2,322,536円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	2,195,263円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,638,542円
コアバランス	1,570,604円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	1,312,036円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	679,371円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	295,303円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	40,197円
合計	70,021,031,430円

新興国債券インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2021年１月26日

［計算期間：2020年１月28日～2021年１月26日］

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、１月26日に第11期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として対象インデックス（ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建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
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
11期(2021年1月26日)	13,819	△ 4.2	32,923.96	△ 3.7	97.6	－	37,779

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 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

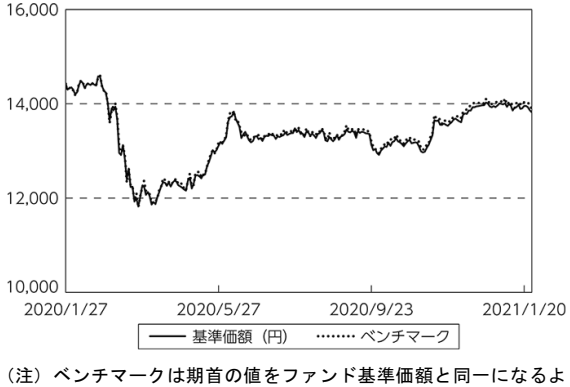
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.2%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（△3.7%）を0.5%下回りました。

基準価額等の推移



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

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

●投資環境について
◎債券市況
　新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。
　新興国の現地通貨建て債券市況は、新型コロナウイルスの感染拡大とそれにともなう影響が警戒されるなど、市場参加者のリスク回避姿勢が強まり下落しましたが、その後は各国での金融および財政支援策等を受け、経済回復期待や投資家心理の改善等を背景に上昇し、期を通じてみると上昇しました。

◎為替市況
　世界景気の減速懸念が高まったことなどから、多くの新興国通貨は対円で売られました。

●当該投資信託のポートフォリオについて
・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるＪＰモルガンＧＢＩ－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3.7%の下落になったため、カイ離は△0.5%程度となりました。

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

（主なマイナス要因）
・取引要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2020年１月28日～2021年１月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	14	0.108	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(11)	(0.084)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(3)	(0.024)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	14	0.108	
期中の平均基準価額は、13,314円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2020年１月28日～2021年１月26日）

公社債

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

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2020年１月28日～2021年１月26日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	%
為替先物取引	1,194	268	22.4	1,188	291	24.5
為替直物取引	20,352	4,411	21.7	12,151	2,733	22.5

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

○組入資産の明細

（2021年１月26日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	%	%	%	%	%
メキシコ	600,100	682,291	3,520,626	9.3	－	5.6	2.9	0.8
	千ブラジルレアル	千ブラジルレアル						
ブラジル	153,870	154,431	2,931,115	7.8	7.8	1.8	3.9	2.0
	千チリペソ	千チリペソ						
チリ	6,080,000	7,148,730	1,012,260	2.7	－	1.8	0.9	－
	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
コロンビア	60,580,000	68,040,329	1,966,365	5.2	－	3.3	1.4	0.5
	千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル						
ペルー	28,700	34,927	994,374	2.6	－	2.5	0.1	－
	千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ						
ウルグアイ	15,200	15,984	39,481	0.1	－	0.0	－	0.1
	千ドミニカペソ	千ドミニカペソ						
ドミニカ	24,000	25,520	45,681	0.1	0.1	0.1	0.0	－
	千トルコリラ	千トルコリラ						
トルコ	52,600	48,717	682,045	1.8	1.8	0.7	0.5	0.6
	千チェココルナ	千チェココルナ						
チェコ	304,100	297,056	1,428,839	3.8	－	2.8	1.0	－
	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	3,808,000	4,222,652	1,486,373	3.9	－	2.1	1.6	0.2
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	99,750	109,687	3,041,635	8.1	－	3.5	2.8	1.8
	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル						
ロシア	1,808,100	1,938,846	2,675,608	7.1	－	4.4	1.8	0.9
	千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ						
ルーマニア	40,460	44,102	1,139,172	3.0	－	1.0	1.5	0.5
	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	93,340	100,603	2,581,496	6.8	－	3.9	2.5	0.5
	千タイバーツ	千タイバーツ						
タイ	828,400	945,876	3,272,732	8.7	－	5.5	2.3	0.8
	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ						
フィリピン	20,000	25,869	55,877	0.1	－	0.1	－	－
	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	437,130,000	472,319,067	3,495,161	9.3	－	6.7	2.2	0.4
	千中国元	千中国元						
中国	239,200	238,138	3,812,600	10.1	－	5.4	4.6	－

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	%	%	%	%	%
南アフリカ	434,600	394,348	2,681,569	7.1	7.1	6.7	0.4	－
合計	－	－	36,863,016	97.6	16.8	58.0	30.5	9.0

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

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			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	56,700	67,875	350,237	2024/12/5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	14,700	20,420	105,371	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	62,200	65,180	336,332	2026/3/5
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	56,200	57,906	298,796	2022/6/9
		6.75 MEXICAN BONO 230309	6.75	35,000	36,781	189,794	2023/3/9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	59,700	68,070	351,243	2027/6/3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	24,300	28,417	146,636	2031/5/29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	32,400	37,946	195,805	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	41,900	47,614	245,692	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	63,300	69,547	358,862	2023/12/7
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	33,000	36,962	190,725	2024/9/5
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	30,300	35,239	181,837	2047/11/7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	55,000	66,960	345,517	2029/5/31
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	35,400	43,366	223,772	2038/11/18
小計						3,520,626	
ブラジル				千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	10.0	18,320	20,758	393,994	2027/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	26,850	30,097	571,252	2025/1/1
		10 (IN)BRAZIL NTN 310101	10.0	2,300	2,615	49,642	2031/1/1
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	10.0	10,800	12,293	233,331	2029/1/1
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	26,600	29,005	550,520	2023/1/1
		BRAZIL-LTN 220701	—	12,000	11,268	213,881	2022/7/1
		BRAZIL-LTN 230701	—	24,900	21,639	410,712	2023/7/1
		BRAZIL-LTN 240101	—	32,100	26,753	507,778	2024/1/1
小計						2,931,115	
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券	2.5 BONOS TESORER 250301	2.5	1,640,000	1,740,778	246,494	2025/3/1
		4 BONOS TESORERIA 230301	4.0	490,000	534,075	75,625	2023/3/1
		4.5 BONOS TESORER 260301	4.5	1,000,000	1,163,750	164,787	2026/3/1
		4.7 BONOS TESORER 300901	4.7	960,000	1,149,936	162,830	2030/9/1
		5 BONOS TESORERIA 350301	5.0	1,100,000	1,345,919	190,582	2035/3/1
		6 BONOS TESORERIA 430101	6.0	890,000	1,214,271	171,940	2043/1/1
小計						1,012,260	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	10.0	8,900,000	10,855,133	313,713	2024/7/24
		4.375 COLOMBI(GL) 230321	4.375	1,680,000	1,720,033	49,708	2023/3/21
		6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	8,180,000	8,722,405	252,077	2028/4/28
		6.25 TITULOS DE T 251126	6.25	5,690,000	6,269,400	181,185	2025/11/26
		7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	6,210,000	6,589,324	190,431	2022/5/4
		7 TITULOS DE TESO 320630	7.0	6,000,000	6,541,210	189,040	2032/6/30
		7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	6,100,000	6,749,168	195,050	2034/10/18
		7.25 TITULOS DE T 501026	7.25	3,000,000	3,206,991	92,682	2050/10/26
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	7,770,000	9,012,945	260,474	2026/8/26
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	5,760,000	6,700,794	193,652	2030/9/18

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
コロンビア			%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円	
	国債証券	9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,672,923	48,347	2027/6/28
小計						1,966,365	
ペルー				千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
	国債証券	5.35 PERU 400812	5.35	2,100	2,150	61,210	2040/8/12
		5.4 PERU 340812	5.4	1,900	2,077	59,132	2034/8/12
		5.7 PERU 240812	5.7	1,300	1,512	43,055	2024/8/12
		5.94 PERU 290212	5.94	4,700	5,727	163,066	2029/2/12
		6.15 PERU 320812	6.15	2,800	3,359	95,638	2032/8/12
		6.35 PERU 280812	6.35	3,900	4,857	138,303	2028/8/12
		6.9 PERU 370812	6.9	4,200	5,112	145,543	2037/8/12
		6.95 PERU 310812	6.95	5,300	6,778	192,992	2031/8/12
		8.2 PERU 260812	8.2	2,500	3,351	95,431	2026/8/12
小計						994,374	
ウルグアイ				千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ		
	国債証券	8.5 URUGUAY(GL) 280315	8.5	7,000	7,419	18,326	2028/3/15
		9.875 URUGUAY(GL) 220620	9.875	8,200	8,564	21,155	2022/6/20
小計						39,481	
ドミニカ				千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
	国債証券	8.9 DOMINICAN 230215	8.9	8,000	8,264	14,793	2023/2/15
		9.75 DOMINICAN 260605	9.75	16,000	17,256	30,888	2026/6/5
小計						45,681	
トルコ				千トルコリラ	千トルコリラ		
	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	2,400	2,221	31,096	2024/3/20
		10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	5,200	4,667	65,338	2027/8/11
		10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	6,200	5,654	79,161	2026/2/11
		10.7 TURKEY GOVT 220817	10.7	4,400	4,199	58,797	2022/8/17
		11 TURKEY GOVT 220302	11.0	4,400	4,241	59,382	2022/3/2
		11 TURKEY GOVT 270224	11.0	4,500	4,126	57,771	2027/2/24
		12.2 TURKEY GOVT 230118	12.2	5,600	5,469	76,577	2023/1/18
		12.4 TURKEY GOVT 280308	12.4	4,100	4,015	56,223	2028/3/8
		16.2 TURKEY GOVT 230614	16.2	1,300	1,363	19,091	2023/6/14
		7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	3,400	2,996	41,947	2023/3/8
		8 TURKEY GOVT 250312	8.0	4,000	3,356	46,984	2025/3/12
		8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	3,400	3,138	43,934	2022/9/14
		9 TURKEY GOVT 240724	9.0	3,700	3,267	45,739	2024/7/24
小計						682,045	
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	101,600	97,343	468,223	2027/2/10
		0.45 CZECH REPUBL 231025	0.45	80,500	80,622	387,792	2023/10/25
		0.95 CZECH REPUBL 300515	0.95	122,000	119,090	572,824	2030/5/15
小計						1,428,839	
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	1.5 HUNGARY 230823	1.5	250,000	254,629	89,629	2023/8/23
		2.5 HUNGARY 241024	2.5	210,000	221,371	77,922	2024/10/24
		2.75 HUNGARY 261222	2.75	733,000	784,561	276,165	2026/12/22

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	
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	千円	
	国債証券	3 HUNGARY 240626	3.0	384,000	410,534	144,508	2024/6/26
		3 HUNGARY 271027	3.0	421,000	459,637	161,792	2027/10/27
		3 HUNGARY 300821	3.0	260,000	284,064	99,990	2030/8/21
		3 HUNGARY 381027	3.0	120,000	130,200	45,830	2038/10/27
		3.25 HUNGARY 311022	3.25	338,000	378,187	133,121	2031/10/22
		5.5 HUNGARY 250624	5.5	412,000	488,812	172,061	2025/6/24
		6 HUNGARY 231124	6.0	333,000	382,117	134,505	2023/11/24
		6.75 HUNGARY 281022	6.75	182,000	248,430	87,447	2028/10/22
		7 HUNGARY 220624	7.0	165,000	180,105	63,397	2022/6/24
小計						1,486,373	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	2.25 POLAND 220425	2.25	7,300	7,512	208,319	2022/4/25
		2.25 POLAND 241025	2.25	9,500	10,225	283,560	2024/10/25
		2.5 POLAND 230125	2.5	9,100	9,549	264,803	2023/1/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	8,900	9,584	265,777	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	14,500	16,052	445,141	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	8,100	9,025	250,277	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	9,150	10,442	289,581	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	10,800	12,369	343,011	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	9,100	10,262	284,584	2025/7/25
		4 POLAND 231025	4.0	6,800	7,538	209,048	2023/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	6,500	7,123	197,528	2022/9/23
小計						3,041,635	
ロシア				千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
	国債証券	4.5 RUSSIA OFZ 250716	4.5	38,000	36,379	50,204	2025/7/16
		6 RUSSIA OFZ 271006	6.0	108,900	109,268	150,791	2027/10/6
		6.5 RUSSIA OFZ 240228	6.5	90,000	93,290	128,740	2024/2/28
		6.9 RUSSIA OFZ 290523	6.9	92,200	97,084	133,976	2029/5/23
		7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	44,500	46,511	64,185	2023/1/25
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	62,000	65,017	89,724	2023/8/16
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	125,700	133,562	184,316	2028/1/19
		7.1 RUSSIA OFZ 241016	7.1	106,400	112,722	155,556	2024/10/16
		7.15 RUSSIA OFZ 251112	7.15	88,500	94,149	129,926	2025/11/12
		7.25 RUSSIA OFZ 340510	7.25	83,300	88,340	121,909	2034/5/10
		7.4 RUSSIA OFZ 221207	7.4	86,700	91,166	125,809	2022/12/7
		7.4 RUSSIA OFZ 240717	7.4	98,000	104,691	144,474	2024/7/17
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	98,000	102,507	141,459	2022/7/20
		7.65 RUSSIA OFZ 300410	7.65	97,000	106,988	147,643	2030/4/10
		7.7 RUSSIA OFZ 330323	7.7	95,700	105,461	145,536	2033/3/23
		7.7 RUSSIA OFZ 390316	7.7	85,800	94,852	130,896	2039/3/16
		7.75 RUSSIA OFZ 260916	7.75	107,600	117,929	162,742	2026/9/16
		7.95 RUSSIA OFZ 261007	7.95	101,100	111,579	153,979	2026/10/7
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	111,000	124,381	171,646	2027/2/3
		8.5 RUSSIA OFZ 310917	8.5	87,700	102,960	142,085	2031/9/17
小計						2,675,608	

銘柄			当期末				
			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	
ルーマニア			%	千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ	千円	
	国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 240429	3.25	4,400	4,561	117,821	2024/4/29
		3.4 ROMANIA GOVER 220308	3.4	2,900	2,948	76,168	2022/3/8
		3.5 ROMANIA GOVER 221219	3.5	3,800	3,909	100,970	2022/12/19
		3.65 ROMANIA GOVE 310924	3.65	3,300	3,520	90,939	2031/9/24
		4.25 ROMANIA GOVE 230628	4.25	4,200	4,416	114,072	2023/6/28
		4.5 ROMANIA GOVER 240617	4.5	3,300	3,557	91,878	2024/6/17
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	5,700	6,272	162,015	2025/2/24
		5 ROMANIA GOVERNM 290212	5.0	4,560	5,352	138,252	2029/2/12
		5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	4,800	5,772	149,116	2027/7/26
		5.85 ROMANIA GOVE 230426	5.85	3,500	3,791	97,937	2023/4/26
小計						1,139,172	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	5,900	6,404	164,332	2028/6/15
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	3.8	12,100	12,663	324,947	2023/8/17
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	6,570	6,929	177,809	2034/7/5
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	6,300	6,866	176,197	2029/8/15
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	11,700	12,763	327,510	2027/11/16
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	3.9	10,720	11,695	300,095	2026/11/30
		3.948 MALAYSIA IN 220414	3.948	7,300	7,491	192,228	2022/4/14
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	9,000	9,735	249,805	2025/9/15
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	6,700	7,179	184,224	2024/9/30
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	6,350	6,809	174,729	2024/7/15
		4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	7,200	8,051	206,606	2028/10/31
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	3,500	4,014	103,009	2037/4/7
小計						2,581,496	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	1.45 THAILAND 241217	1.45	49,700	51,324	177,583	2024/12/17
		1.6 THAILAND 291217	1.6	42,100	43,599	150,855	2029/12/17
		1.6 THAILAND 350617	1.6	20,000	20,295	70,222	2035/6/17
		1.875 THAILAND 220617	1.875	44,000	44,885	155,302	2022/6/17
		2 THAILAND 221217	2.0	42,300	43,550	150,683	2022/12/17
		2.125 THAILAND 261217	2.125	63,400	68,390	236,632	2026/12/17
		2.4 THAILAND 231217	2.4	51,600	54,416	188,282	2023/12/17
		2.875 THAILAND 281217	2.875	48,800	55,416	191,740	2028/12/17
		2.875 THAILAND 460617	2.875	49,200	58,735	203,223	2046/6/17
		3.3 THAILAND 380617	3.3	46,500	57,380	198,538	2038/6/17
		3.4 THAILAND 360617	3.4	62,000	76,851	265,906	2036/6/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	47,900	51,483	178,131	2023/6/16
		3.65 THAILAND 310620	3.65	54,600	67,153	232,351	2031/6/20
		3.775 THAILAND 320625	3.775	67,700	84,692	293,035	2032/6/25
		3.85 THAILAND 251212	3.85	83,800	96,486	333,844	2025/12/12
		4.875 THAILAND 290622	4.875	54,800	71,213	246,397	2029/6/22
小計						3,272,732	

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
フィリピン			%	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ	千円	
	国債証券	6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	20,000	25,869	55,877	2036/1/14
小計						55,877	
インドネシア				千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	10.5	7,050,000	9,081,387	67,202	2030/8/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	3,250,000	3,967,437	29,359	2025/9/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	34,200,000	34,989,336	258,921	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	39,500,000	39,453,390	291,955	2028/5/15
		6.5 INDONESIA 250615	6.5	33,200,000	34,600,376	256,042	2025/6/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	34,400,000	34,646,304	256,382	2033/5/15
		7 INDONESIA 220515	7.0	19,450,000	20,115,190	148,852	2022/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	23,450,000	24,768,124	183,284	2027/5/15
		7 INDONESIA 300915	7.0	23,800,000	24,983,812	184,880	2030/9/15
		7.5 INDONESIA 320815	7.5	10,900,000	11,547,569	85,452	2032/8/15
		7.5 INDONESIA 380515	7.5	17,100,000	17,894,979	132,422	2038/5/15
		8.25 INDONESIA 290515	8.25	9,500,000	10,709,350	79,249	2029/5/15
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	8,800,000	9,861,016	72,971	2032/6/15
		8.25 INDONESIA 360515	8.25	20,000,000	22,417,600	165,890	2036/5/15
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	33,800,000	36,904,192	273,091	2024/3/15
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	27,930,000	31,497,219	233,079	2026/9/15
		8.375 INDONESIA 340315	8.375	30,700,000	34,725,691	256,970	2034/3/15
		8.375 INDONESIA 390415	8.375	18,700,000	21,365,124	158,101	2039/4/15
		8.75 INDONESIA 310515	8.75	15,400,000	17,943,310	132,780	2031/5/15
		9 INDONESIA 290315	9.0	15,500,000	18,112,525	134,032	2029/3/15
		9.5 INDONESIA 310715	9.5	10,500,000	12,735,135	94,239	2031/7/15
小計						3,495,161	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	24,000	23,081	369,538	2025/4/9
		2.36 CHINA GOVT 230702	2.36	11,000	10,885	174,279	2023/7/2
		2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	25,000	23,988	384,055	2030/5/21
		2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	19,000	18,719	299,704	2027/6/4
		2.88 CHINA GOVT 231105	2.88	16,000	16,047	256,919	2023/11/5
		2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	16,000	16,027	256,607	2024/10/17
		3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	12,000	12,102	193,760	2026/12/5
		3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	22,000	21,953	351,471	2029/11/21
		3.19 CHINA GOVT 240411	3.19	13,000	13,149	210,524	2024/4/11
		3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	22,000	22,262	356,429	2025/12/6
		3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	14,200	14,434	231,099	2026/6/6
		3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	10,000	10,075	161,310	2028/11/22
		3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	11,000	11,097	177,678	2027/12/3
		3.29 CHINA GOVT 231018	3.29	8,000	8,130	130,166	2023/10/18
		3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	16,000	16,180	259,056	2029/5/23
小計						3,812,600	
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	71,900	85,129	578,881	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	22,400	15,399	104,714	2036/3/31

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

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

○投資信託財産の構成

(2021年1月26日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	36,863,016	97.5
コール・ローン等、その他	944,801	2.5
投資信託財産総額	37,807,817	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(37,764,052千円)の投資信託財産総額(37,807,817千円)に対する比率は99.9%です。

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

1アメリカドル=103.77円	1アルゼンチンペソ=1.19円	1メキシコペソ=5.16円	1ブラジルレアル=18.98円
100チリペソ=14.16円	100コロンビアペソ=2.89円	1ペルーヌエボソル=28.47円	1ウルグアイペソ=2.47円
1ドミニカペソ=1.79円	1トルコリラ=14.00円	1チェココルナ=4.81円	100ハンガリーフォリント=35.20円
1ポーランドズロチ=27.73円	1ロシアルーブル=1.38円	1ルーマニアレイ=25.83円	1マレーシアリンギット=25.66円
1タイバーツ=3.46円	1フィリピンペソ=2.16円	100インドネシアルピア=0.74円	1中国元=16.01円
1南アフリカランド=6.80円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年１月26日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　21,159,314,350円
　期中追加設定元本額　7,957,478,368円
　期中一部解約元本額　1,778,192,120円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.3819円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月26日)

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

(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	8,289,038,543円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	6,701,099,641円
ｅＭＡＸＩＳ 新興国債券インデックス	4,369,267,511円
つみたて８資産均等バランス	3,083,076,433円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	2,920,955,754円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	733,924,793円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	349,165,960円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	276,608,799円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイフォワード）	237,931,636円
海外債券セレクション（ラップ向け）	213,938,524円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイストライカー）	63,828,067円
ｅＭＡＸＩＳ 最適化バランス（マイディフェンダー）	48,189,414円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	25,141,369円
アドバンスト・バランスⅡ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	10,364,781円
アドバンスト・バランスⅠ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	7,863,232円
新興国債券インデックスファンド（ラップ向け）	4,094,625円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1980s	1,540,970円
コアバランス	1,499,789円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1970s	820,167円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー 1990s	250,590円
合計	27,338,600,598円

東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

《第12期》決算日2021年１月26日

［計算期間：2020年１月28日～2021年１月26日］

「東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド」は、１月26日に第12期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		投資信託証券組入比率	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
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
12期(2021年１月26日)	31,049	△14.8	3,872.69	△14.6	98.0	2.0	42,741

（注）東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証ＲＥＩＴ指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。東証ＲＥＩＴ指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証ＲＥＩＴ指数の内容の変更、公表の停止または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証ＲＥＩＴ指数の指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	%		%	%	%
2020年１月27日	36,432	－	4,533.90	－	98.4	1.6
１月末	37,036	1.7	4,608.85	1.7	98.6	1.4
２月末	33,901	△ 6.9	4,218.40	△ 7.0	98.3	1.7
３月末	26,800	△26.4	3,343.59	△26.3	97.1	3.3
４月末	26,558	△27.1	3,313.25	△26.9	98.2	1.9
５月末	28,744	△21.1	3,586.37	△20.9	98.6	1.4
６月末	28,256	△22.4	3,525.99	△22.2	98.6	1.6
７月末	28,332	△22.2	3,535.10	△22.0	98.1	1.9
８月末	29,936	△17.8	3,735.15	△17.6	96.9	3.0
９月末	29,645	△18.6	3,698.94	△18.4	97.3	2.6
10月末	28,159	△22.7	3,512.43	△22.5	98.0	2.1
11月末	29,147	△20.0	3,635.82	△19.8	98.1	2.0
12月末	30,903	△15.2	3,854.76	△15.0	98.3	1.6
（期　末）						
2021年１月26日	31,049	△14.8	3,872.69	△14.6	98.0	2.0

（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

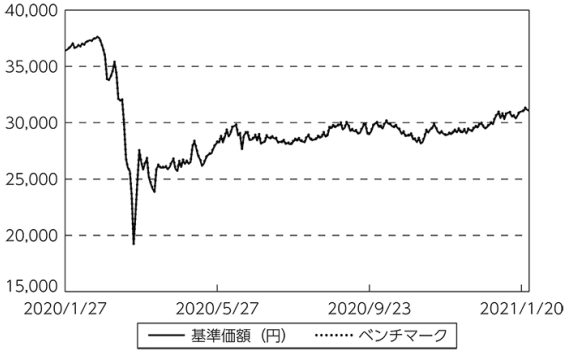
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.8%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（－14.6%）を0.2%下回りました。

基準価額等の推移



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

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

●投資環境について
◎国内ＲＥＩＴ市況
・国内ＲＥＩＴ市況は下落しました。
・新型コロナウイルスの世界的流行を受け、国内ＲＥＩＴ市況は下落しました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは14.6%の下落となったため、カイ離は△0.2%程度となりました。
　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因※によるものです。
※留保金等が含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2020年１月28日～2021年１月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	2	0.005	(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)	(0.001)	
（先物・オプション）	(1)	(0.004)	
合計	2	0.005	
期中の平均基準価額は、29,458円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2020年１月28日～2021年１月26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	0.484 (0.014)	50,863 (1,920)	0.103	10,937
	サンケイリアルエステート投資法人	0.755	70,694	0.136	14,141
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	1 (0.057)	155,737 (6,737)	0.182	22,136
	日本アコモデーションファンド投資法人	0.748	442,907	0.273	171,947
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	2	208,456	1	110,037
	森ヒルズリート投資法人	2	339,658	0.946	142,707
	産業ファンド投資法人	3	537,295	1	175,503
	アドバンス・レジデンス投資法人	1	597,806	0.774	244,223
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1	242,841	0.499	88,317
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	391,847	0.414	174,932
	ＧＬＰ投資法人	7	1,176,229	2	291,647
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.937 (0.009)	280,981 (3,180)	0.339	106,903
	日本プロロジスリート投資法人	3	1,022,600	1	358,848
	星野リゾート・リート投資法人	0.32	136,182	0.127	56,342
	Ｏｎｅリート投資法人	0.325	80,476	0.127	35,260
	イオンリート投資法人	2	244,419	1	130,585
	ヒューリックリート投資法人	1	233,056	0.862	126,009
	日本リート投資法人	0.676	227,788	0.264	101,527
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	13	195,819	5	90,430
	日本ヘルスケア投資法人	0.031 (△0.16)	5,415 (△33,195)	0.021	4,179
	積水ハウス・リート投資法人	6	426,970	2	178,227
	トーセイ・リート投資法人	0.469	48,449	0.178	19,700
	ケネディクス商業リート投資法人	0.791	152,381	0.382	78,387
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	0.448	52,093	0.177	21,293
	サムティ・レジデンシャル投資法人	0.416	39,275	0.196	18,889
	野村不動産マスターファンド投資法人	6	888,971	2	394,247
	いちごホテルリート投資法人	0.384	25,398	0.134	10,396
	ラサールロジポート投資法人	2 (0.304)	384,581 (53,709)	0.757	119,194
	スターアジア不動産投資法人	1 (2)	73,079 (72,326)	0.489	31,953
	マリモ地方創生リート投資法人	0.203	20,214	0.099	10,228
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.958 (0.03)	461,999 (15,823)	0.227	108,247
	大江戸温泉リート投資法人	0.348	22,188	0.17	11,247
	さくら総合リート投資法人	0.288 (△0.82)	20,835 (△72,326)	0.138	10,931
	投資法人みらい	2	90,163	1	47,051
	森トラスト・ホテルリート投資法人	0.48	47,274	0.261	26,917
	三菱地所物流リート投資法人	0.512 (0.021)	197,171 (9,065)	0.16	60,618
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.981	144,851	0.167	23,222
	ザイマックス・リート投資法人	0.337	30,958	0.118	12,029

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

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	不動産投信指数先物取引	百万円 13,851	百万円 13,423	百万円 149	百万円 152

○利害関係人との取引状況等

（2020年１月28日～2021年１月26日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	19,708	7,595	38.5	7,821	3,853	49.3
不動産投信指数先物取引	14,004	11,154	79.6	13,572	10,223	75.3

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	買付額
	百万円
投資信託証券	732

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	1,890千円
うち利害関係人への支払額（B）	1,086千円
（B）／（A）	57.5%

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

○組入資産の明細

（2021年１月26日現在）

国内投資信託証券

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

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) エスコンジャパンリート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、ＭＣＵＢＳ ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、アクティビア・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、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラ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、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、大和証券リビング投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新）につきましては、委託会社の利害関係人である三菱ＵＦＪ信託銀行、三菱ＵＦＪ銀行、三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレー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2020年７月31日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載）

純資産総額の10％を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容

当期末において10％を超える銘柄の組入れはございません。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
国内	不動産投信指数先物取引	東証ＲＥＩＴ指数	百万円 867	百万円 －

○有価証券の貸付及び借入の状況

（2021年１月26日現在）

区分	当期末
	数量
貸付有価証券＜投資証券＞総口数	口 58,204

○投資信託財産の構成

（2021年１月26日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	41,902,242	80.4
コール・ローン等、その他	10,234,076	19.6
投資信託財産総額	52,136,318	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年１月26日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　9,655,654,154円
　期中追加設定元本額　8,237,978,896円
　期中一部解約元本額　4,127,664,554円
　また、１口当たり純資産額は、期末3.1049円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月26日)

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

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

ＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド

《第15期》決算日2021年１月５日

［計算期間：2020年１月７日～2021年１月５日］

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

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

○最近５期の運用実績

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

（注）Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックスとは、Ｓ＆Ｐダウ・ジョーンズ・インデックスＬＬＣが有するＳ＆Ｐグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託（ＲＥＩＴ）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み）をもとに、委託会社が計算したものです。Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC（「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	
（期　首） 2020年１月６日	円 18,377	% －	47,161.24	% －	% 99.0
１月末	18,923	3.0	48,553.04	3.0	99.0
２月末	17,805	△ 3.1	45,640.42	△ 3.2	98.8
３月末	13,378	△27.2	34,126.01	△27.6	99.0
４月末	14,298	△22.2	36,418.41	△22.8	99.4
５月末	14,433	△21.5	36,769.78	△22.0	99.3
６月末	14,590	△20.6	37,151.26	△21.2	98.8
７月末	14,857	△19.2	37,787.41	△19.9	99.3
８月末	15,317	△16.7	39,001.97	△17.3	99.3
９月末	14,683	△20.1	37,350.97	△20.8	99.1
10月末	14,203	△22.7	36,104.61	△23.4	99.5
11月末	15,983	△13.0	40,687.85	△13.7	99.7
12月末	16,149	△12.1	41,107.17	△12.8	98.7
（期　末） 2021年１月５日	15,806	△14.0	40,236.52	△14.7	99.0

（注）騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

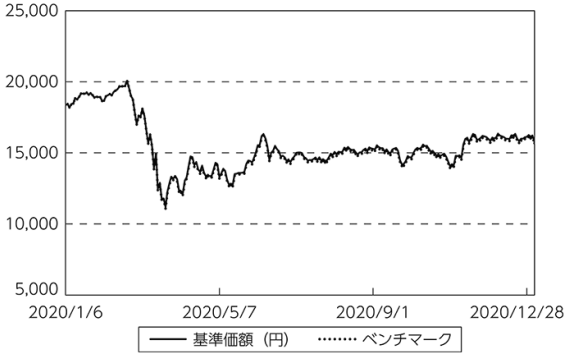
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.0%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

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

●投資環境について
◎外国ＲＥＩＴ市況
・外国ＲＥＩＴ市況は下落しました。
・外国ＲＥＩＴ市況は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念などを受けて下落しました。

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

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

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

　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

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

（主なマイナス要因）
・取引要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2020年１月７日～2021年１月５日）

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

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

○売買及び取引の状況

（2020年１月７日～2021年１月５日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 －	千アメリカドル －	百株 32	千アメリカドル 10

（注）金額は受渡代金。

投資信託証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

○株式売買比率

(2020年１月７日～2021年１月５日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2020年１月７日～2021年１月５日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況Ｂ	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	16,830	570	3.4	3,658	21	0.6

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

○組入資産の明細

（2021年１月５日現在）

外国株式

2021年１月５日現在の組入れはございません。

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

外国投資信託証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

○投資信託財産の構成

（2021年１月５日現在）

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

（注）期末における外貨建純資産（40,358,023千円）の投資信託財産総額（40,849,626千円）に対する比率は98.8%です。
（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年１月５日現在)

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

＜注記事項＞

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

○損益の状況 (2020年１月７日～2021年１月５日)

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

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

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

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

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