253617

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型	
信託期間	無期限（2019年８月23日設定）	
運用方針	三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド受益証券、三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド受益証券、三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド受益証券および三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式および公社債に投資を行います。 国内株式16%、先進国株式９%、国内債券57%、先進国債券15%および短期金融資産３%を実質的な基本投資割合とします。 基本投資割合については、原則として年１回確認を行います。経済環境等の大きな変化に際して必要と判断される場合には、基本投資割合を見直すことがあります。 合成ベンチマークとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式および公社債の実質投資比率が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	各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、日本を含む世界各国の株式（ＤＲ（預託証書）を含みます。）および公社債に直接投資することがあります。
	三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
	三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。
	三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）並びに外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）

第１期（決算日：2020年５月20日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）」は、去る５月20日に第１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。

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			合成ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	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
2019年８月23日	10,000	－	－	10,000	－	－	－	－	－	－	10
1期(2020年５月20日)	9,975	0	△0.3	9,985	△0.2	24.6	0.5	71.2	0.1	0.2	679

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
(注) 当ファンドのベンチマークは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）16%、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）９%、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合57%、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）15%および短期金融資産（有担保コール（翌日物））３%で組み合わせた合成ベンチマークです。ベンチマークは、設定日の前営業日を10,000として委託会社が計算したものです。
(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		合成ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率					
(設定日)	円	%		%	%	%	%	%	%
2019年８月23日	10,000	－	10,000	－	－	－	－	－	－
８月末	10,035	0.4	10,038	0.4	24.6	0.7	69.9	0.1	0.2
９月末	10,106	1.1	10,113	1.1	24.8	0.5	71.9	0.1	0.2
10月末	10,213	2.1	10,213	2.1	24.8	0.4	71.7	0.1	0.2
11月末	10,258	2.6	10,263	2.6	24.5	0.6	71.6	0.1	0.2
12月末	10,298	3.0	10,303	3.0	24.6	0.4	71.8	0.1	0.2
2020年１月末	10,300	3.0	10,302	3.0	24.1	0.5	71.2	0.1	0.2
２月末	10,120	1.2	10,135	1.3	22.9	0.4	71.8	0.1	0.2
３月末	9,796	△2.0	9,796	△2.0	23.1	0.9	71.2	0.1	0.2
４月末	9,941	△0.6	9,945	△0.6	24.9	0.6	71.3	0.1	0.2
(期末)									
2020年５月20日	9,975	△0.3	9,985	△0.2	24.6	0.5	71.2	0.1	0.2

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
(注) 騰落率は設定日比。
(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１期：2019年８月23日～2020年５月20日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移

第 1 期 首	10,000円
第 1 期 末	9,975円
既払分配金	0円
騰 落 率	−0.3%

※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

基準価額は設定時に比べ0.3%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（－0.2%）を0.1%下回りました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

主に国内債券市況が下落したことなどが、基準価額の下落要因となりました。

組入ファンド	騰落率	組入比率（対純資産総額）
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	2.2%	16.3%
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	－1.0%	9.0%
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	－2.2%	56.6%
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	3.5%	15.1%

第１期：2019年８月23日～2020年５月20日

投資環境について

▶ 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

2020年１月末以降、新型肺炎の世界的流行（パンデミック）を受けて下落する局面もありましたが、３月下旬以降の日銀による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などが支援材料となり、国内株式市況は上昇して終えました。

▶ 外国株式市況

外国株式市況は下落しました。

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。

▶ 国内債券市況

国内債券市況は下落しました。

期の前半は、日本銀行による追加緩和期待の後退や米中貿易交渉の進展などから国内債券市況は下落しました。また、期の後半は、新型肺炎による景気後退懸念などから上昇しましたが、すぐに財政拡張による国債増発懸念などから下落し、設定時と比べ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、設定時との比較では上昇しました。

▶ 為替市況

米ドルは対円で上昇、ユーロは対円でほぼ横ばいに推移しました。

設定時に比べて米ドルは対円で上昇、ユーロは対円でほぼ横ばいの推移となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）

日本を含む世界各国の株式および公社債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。
各マザーファンドを通じて、基本投資割合に則り運用を行いました。

＜基本投資割合＞
国内株式：16％
先進国株式：９％
国内債券：57％
先進国債券：15％
短期金融資産：３％

▶三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド

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

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

▶三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

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

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

▶三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

▶三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

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

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

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）

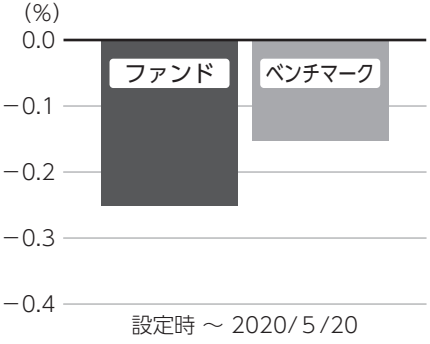
基準価額の騰落率は、0.3％の下落となり、ベンチマークの0.2％との下落を0.1％下回りました。

差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	0.0％程度
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	0.0％程度
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	0.0％程度
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	0.0％程度
その他（信託報酬等）	△0.1％程度

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



▶三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：取引要因によるものです。

主なマイナス要因：組入要因によるものです。

▶三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因によるものです。

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

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

▶三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

主なマイナス要因：評価時価差異要因※によるものです。

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

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１期 2019年８月23日～2020年５月20日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	68

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

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

今後の運用方針（作成対象期間末での見解です。）

▶**三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）**
資産配分方針は、従前通り基本投資割合を維持します。また、各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

▶**三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶**三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶**三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

▶**三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2019年８月23日～2020年５月20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	11	0.114	(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）	(5)	(0.049)	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）	(5)	(0.049)	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）	(2)	(0.016)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b)売買委託手数料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c)有価証券取引税	0	0.001	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d)そ の 他 費 用	1	0.011	(d)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.008)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（監査費用）	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合　計	12	0.127	

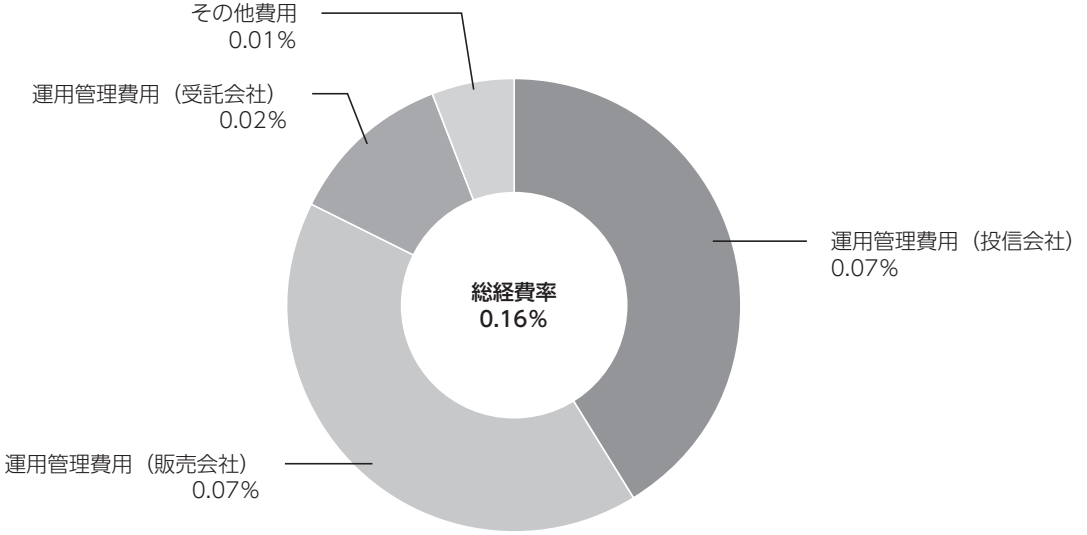
期中の平均基準価額は、10,091円です。

（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0.16%**です。



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

○売買及び取引の状況

（2019年８月23日～2020年５月20日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	91,670	116,738	6,279	7,765
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	287,604	407,033	15,571	22,099
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	38,897	108,666	2,366	6,618
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	29,398	67,736	3,237	7,462

○株式売買比率

（2019年８月23日～2020年５月20日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	63,407,231千円	28,439,885千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	228,242,807千円	94,114,239千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.27	0.30

(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８月23日～2020年５月20日）

利害関係人との取引状況

＜三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式25）＞

該当事項はございません。

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	29,856	8,589	28.8	33,550	1,963	5.9
貸付有価証券(株式)	572,300	314,566	55.0	569,929	303,515	53.3

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。

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	63,096	17,853	28.3	60,638	20,541	33.9

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。
（注）公社債には現先などによるものを含みません。

＜三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	11,987	9,197	76.7	17,192	11,358	66.1

平均保有割合　0.1%

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

＜三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	21,924	16,750	76.4	23,833	21,679	91.0

平均保有割合　0.0%

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

利害関係人の発行する有価証券等

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	489	479	3,269

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	602	202	1,209

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド＞

種　　類	買　付　額
	百万円
株式	1

＜三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド＞

種　　類	買　付　額
	百万円
公社債	1,300

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）	0.991千円
うち利害関係人への支払額（B）	0.092千円
（B）／（A）	9.4％

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

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2019年８月23日～2020年５月20日）

設定時残高(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

（2020年５月20日現在）

親投資信託残高

銘　　柄	当　期　末	
	口　数	評　価　額
	千口	千円
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	85,390	110,529
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	272,033	384,519
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	36,531	102,685
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	26,160	61,243

○有価証券の貸付及び借入の状況

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

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

○投資信託財産の構成

（2020年５月20日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド	110,529	16.3
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド	384,519	56.5
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド	102,685	15.1
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド	61,243	9.0
コール・ローン等、その他	21,012	3.1
投資信託財産総額	679,988	100.0

（注）三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（46,788,998千円）の投資信託財産総額（46,964,533千円）に対する比率は99.6%です。

（注）三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（94,539,008千円）の投資信託財産総額（94,629,119千円）に対する比率は99.9%です。

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

１アメリカドル＝107.98円	１カナダドル＝77.58円	１メキシコペソ＝4.57円	１ユーロ＝118.10円
１イギリスポンド＝132.43円	１スイスフラン＝111.26円	１スウェーデンクローネ＝11.15円	１ノルウェークローネ＝10.83円
１デンマーククローネ＝15.84円	１ポーランドズロチ＝25.94円	１オーストラリアドル＝70.75円	１ニュージーランドドル＝65.95円
１香港ドル＝13.93円	１シンガポールドル＝76.26円	１マレーシアリンギット＝24.81円	１イスラエルシェケル＝30.73円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2020年５月20日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	679,988,121
コール・ローン等	20,629,664
三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド(評価額)	110,529,196
三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド(評価額)	384,519,438
三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド(評価額)	102,685,001
三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド(評価額)	61,243,964
未収入金	380,858
(B) 負債	715,015
未払解約金	552,250
未払信託報酬	158,700
未払利息	38
その他未払費用	4,027
(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）	679,273,106
元本	680,968,904
次期繰越損益金	△ 1,695,798
(D) 受益権総口数	680,968,904口
１万口当たり基準価額（Ｃ／Ｄ）	9,975円

＜注記事項＞

①設定元本額　10,000,000円
　期中追加設定元本額　730,138,054円
　期中一部解約元本額　59,169,150円
　また、１口当たり純資産額は、期末0.9975円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,695,798円です。

③分配金の計算過程

項　　目	2019年８月23日～2020年５月20日
費用控除後の配当等収益額	1,627,828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	2,585,097円
収益調整金額	454,944円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	4,667,869円
１万口当たり収益分配対象額	68円
１万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況 （2019年８月23日～2020年５月20日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,093
受取利息	17
支払利息	△ 1,110
(B) 有価証券売買損益	4,376,745
売買益	5,951,079
売買損	△1,574,334
(C) 信託報酬等	△ 162,727
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	4,212,925
(E) 追加信託差損益金	△5,908,723
（配当等相当額）	（△ 1,856）
（売買損益相当額）	（△5,906,867）
(F) 計（Ｄ＋Ｅ）	△1,695,798
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金（Ｆ＋Ｇ）	△1,695,798
追加信託差損益金	△5,908,723
（配当等相当額）	（ 454,944）
（売買損益相当額）	（△6,363,667）
分配準備積立金	4,212,925

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

＊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。

三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド

《第20期》決算日2020年２月20日

［計算期間：2019年２月21日～2020年２月20日］

「三菱ＵＦＪ トピックスインデックスマザーファンド」は、２月20日に第20期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率	（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）	期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
16期(2016年２月22日)	10,155	△11.7	1,813.06	△11.7	99.0	1.0	199,359
17期(2017年２月20日)	12,356	21.7	2,205.76	21.7	98.6	1.3	209,506
18期(2018年２月20日)	14,375	16.3	2,565.77	16.3	99.0	1.0	206,265
19期(2019年２月20日)	13,457	△ 6.4	2,400.99	△ 6.4	99.4	0.5	207,606
20期(2020年２月20日)	14,322	6.4	2,554.63	6.4	99.2	0.7	238,603

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
2019年２月20日	13,457	－	2,400.99	－	99.4	0.5
２月末	13,413	△0.3	2,393.08	△0.3	98.6	0.9
３月末	13,424	△0.2	2,395.21	△0.2	99.2	1.8
４月末	13,647	1.4	2,434.82	1.4	98.2	1.6
５月末	12,761	△5.2	2,275.96	△5.2	99.8	1.8
６月末	13,109	△2.6	2,338.89	△2.6	97.8	1.7
７月末	13,229	△1.7	2,360.18	△1.7	99.3	0.5
８月末	12,783	△5.0	2,280.58	△5.0	100.9	0.6
９月末	13,554	0.7	2,418.29	0.7	95.4	2.0
10月末	14,232	5.8	2,539.02	5.7	96.7	1.6
11月末	14,510	7.8	2,588.40	7.8	97.7	1.6
12月末	14,721	9.4	2,625.91	9.4	98.4	1.1
2020年１月末	14,406	7.1	2,569.77	7.0	100.5	0.8
（期末）						
2020年２月20日	14,322	6.4	2,554.63	6.4	99.2	0.7

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

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

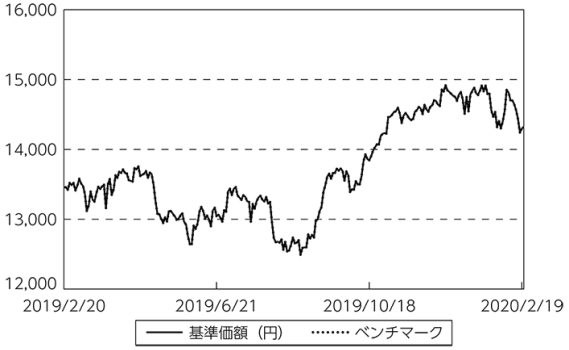
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.4%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（6.4%）と同程度となりました。

基準価額等の推移



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

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

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

●当該投資信託のポートフォリオについて
・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
・株式ポートフォリオは、ベンチマークである東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）と業種別比率等がほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いて構築しました。
（注）マルチファクターモデル
株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・企業規模等）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは6.4%の上昇となったため、カイ離は0.0%程度となりました。
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）
・その他の要因※によるものです。
※貸株収入要因等が含まれます。

（主なマイナス要因）
・取引要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2019年２月21日～2020年２月20日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.001	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) その他費用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（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	0.001	
期中の平均基準価額は、13,691円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年２月21日～2020年２月20日）

株式

		買付 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	31,157 (2,460)	56,302,846 (－)	18,391	36,843,413

（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	－	－	168,500	674
	(168,500)	(－)		

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	株式先物取引	百万円 42,422	百万円 41,890	百万円 －	百万円 －

○株式売買比率

(2019年２月21日～2020年２月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年２月21日～2020年２月20日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 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	56,302	11,289	20.1	36,843	6,580	17.9
新株予約権証券	－	－	－	0.674	0.674	100.0
貸付有価証券(株式)	661,390	361,009	54.6	650,605	345,721	53.1

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	900	588	4,222

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
株式	2

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

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

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

○組入資産の明細

（2020年２月20日現在）

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	3.9	4.8	13,440
日本水産	121.6	136.3	83,143
マルハニチロ	17.6	19.7	50,530
カネコ種苗	3.7	4.1	5,432
サカタのタネ	14.8	16.2	54,027
ホクト	10.2	10.4	20,529
ホクリヨウ	2	2.1	1,602
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	27	27.5	3,932
日鉄鉱業	2.8	3.1	13,113
三井松島ホールディングス	5	5.3	5,936
国際石油開発帝石	487.9	546.7	586,062
石油資源開発	17.4	17.8	49,804
K&Oエナジーグループ	5.8	6.6	10,863
建設業（2.8%）			
ヒノキヤグループ	2.5	3.4	6,929
ショーボンドホールディングス	8.7	21.2	89,782
ミライト・ホールディングス	34.1	40.5	61,155
タマホーム	5.9	7.3	10,329
サンヨーホームズ	1.9	1.2	891
日本アクア	3.2	5.4	3,299
ファーストコーポレーション	3.7	4.2	2,499
ベステラ	2.4	2.3	2,553
ＴＡＴＥＲＵ	14.8	28.1	5,339
キャンディル	－	1.2	796
スペースバリューホールディングス	15	16.6	8,847
ダイセキ環境ソリューション	2.4	2.6	2,576
第一カッター興業	1.5	1.7	3,245
明豊ファシリティワークス	－	3.3	2,471
安藤・間	77.8	81.1	69,421
東急建設	35.4	39.9	29,885
コムシスホールディングス	43.1	48.3	140,987
ミサワホーム	9.5	－	－
ビーアールホールディングス	10.4	14.8	7,281
高松コンストラクショングループ	7.6	8.5	22,049
東建コーポレーション	3.8	4.2	34,440
ソネック	1.4	1.4	1,057
ヤマウラ	4.6	5.9	5,540
大成建設	99.9	104.9	426,943
大林組	300.9	314.7	386,766
清水建設	306.9	319.4	345,590
飛島建設	8.8	9	12,177
長谷工コーポレーション	125.4	121.8	172,468
松井建設	11	12.4	8,853
錢高組	1.2	1.4	5,544
鹿島建設	235.2	247	315,666
不動テトラ	6.9	8.2	13,456
大末建設	3.6	3.6	3,427
鉄建建設	6.1	6.8	18,054
西松建設	21.6	24.2	58,685
三井住友建設	72	76	46,360
大豊建設	6.8	7.1	18,651
前田建設工業	71.5	78.8	84,079
佐田建設	6.4	6.8	2,665
ナカノフドー建設	7.7	8.6	3,887
奥村組	16.5	17.1	48,375
東鉄工業	12	13.5	41,445
イチケン	1.9	2.3	3,889
富士ピー・エス	3.4	4.6	2,387
淺沼組	3.5	3.5	18,025
戸田建設	116.6	130.7	93,058
熊谷組	14.3	14.6	46,574
青木あすなろ建設	4.7	－	－
北野建設	2.1	1.9	4,769
植木組	1.5	1.4	3,491
矢作建設工業	13.4	13.9	11,606
ピーエス三菱	10.7	10.4	6,822

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本ハウスホールディングス	19.7	21.5	9,503
大東建託	35.7	37.7	468,234
新日本建設	11.9	13.4	11,524
ＮＩＰＰＯ	26.6	26	69,680
東亜道路工業	1.9	2	6,720
前田道路	31.4	33.3	113,220
日本道路	2.7	3	21,480
東亜建設工業	8.8	9.8	17,297
日本国土開発	－	23	13,593
若築建設	5	5.7	9,114
東洋建設	36.5	35.3	17,720
五洋建設	119.3	124.7	82,052
世紀東急工業	14.6	15.1	13,333
福田組	3.3	3.6	15,894
住友林業	71.1	79.7	137,084
日本基礎技術	10.6	10.6	3,847
巴コーポレーション	12.6	14	5,222
大和ハウス工業	277.8	311.3	1,027,290
ライト工業	19.2	18	26,370
積水ハウス	307.2	344.3	797,915
日特建設	8.4	8.2	6,920
北陸電気工事	4.8	5.4	5,772
ユアテック	15.9	18	11,466
四電工	1.5	1.7	4,386
中電工	12.9	12.7	31,000
関電工	45.5	44.8	44,934
きんでん	66.7	74.8	134,116
東京エネシス	10.2	10.4	8,694
トーエネック	2.7	3.2	11,616
住友電設	6.9	8.9	21,902
日本電設工業	17.1	17.3	38,475
協和エクシオ	39.3	47.7	125,403
新日本空調	8.4	8.3	16,425
九電工	19.8	22.1	69,173
三機工業	22.6	22.7	31,076
日揮ホールディングス	86.4	96.9	150,291
中外炉工業	2.8	3.4	5,780
ヤマト	8.8	10.1	7,332
太平電業	6.7	7.6	19,250
高砂熱学工業	25.1	27.3	50,778
三晃金属工業	1.2	1.4	3,649
朝日工業社	2.1	2.1	6,583
明星工業	18	20.4	16,054
大氣社	13.6	15.3	52,632
ダイダン	6.7	7.5	20,512
日比谷総合設備	9.5	10.1	19,331
東芝プラントシステム	21.6	－	－
フィル・カンパニー	－	1.4	5,488
ＯＳＪＢホールディングス	44.9	49.6	13,094
東洋エンジニアリング	12	13.2	7,590
千代田化工建設	72.7	－	－
レイズネクスト	17.9	16.9	21,733
食料品（3.8%）			
日本製粉	29.8	29.5	48,645
日清製粉グループ本社	101.5	113.8	222,592
日東富士製粉	0.6	0.7	4,354
昭和産業	8.3	9.2	27,922
鳥越製粉	8.3	8.9	7,351
中部飼料	10.9	12.3	20,036
フィード・ワン	60.2	67.6	11,830
東洋精糖	1.4	1.7	2,019
日本甜菜製糖	5.2	5.3	9,789
三井製糖	7.1	8.8	18,321
塩水港精糖	11	10.9	2,463
日新製糖	4.3	4.8	9,638
森永製菓	22.6	23.6	110,684
中村屋	2.3	2.6	10,439
江崎グリコ	27	29.9	140,829
名糖産業	4.3	4.8	6,672
井村屋グループ	3.8	4.3	8,170
不二家	4.8	5.6	12,969
山崎製パン	73.5	75.5	151,528
第一屋製パン	1.9	1.7	1,620
モロゾフ	1.5	1.7	8,364
亀田製菓	5.6	5.7	27,217
寿スピリッツ	9.5	9.7	61,013
カルビー	41	45.9	139,995
森永乳業	18	18.6	75,702

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＪＣＵ	11.6	12.1	35,840
新田ゼラチン	5.6	6.3	4,032
ＯＡＴアグリオ	1.3	1.7	2,317
デクセリアルズ	23	25.9	23,698
アース製薬	6.7	7.6	46,056
北興化学工業	9.4	10.3	6,437
大成ラミック	2.8	3.3	9,253
クミアイ化学工業	37.1	41.5	34,569
日本農薬	21.4	17.9	9,880
アキレス	6.6	6.9	13,448
有沢製作所	14.1	15.9	14,469
日東電工	67.6	69.2	415,200
レック	9.5	10.7	12,465
三光合成	7.7	11.5	3,852
きもと	15.7	17.1	2,736
藤森工業	8	9	29,565
前澤化成工業	6.1	6.4	7,180
未来工業	4.8	5.4	10,956
ウェーブロックホールディングス	1.9	3.5	2,425
ＪＳＰ	5.3	5.9	10,525
エフピコ	7.4	11	75,790
天馬	6.1	6.7	12,830
信越ポリマー	16	18	17,100
東リ	21.9	25	7,300
ニフコ	35.9	36.8	104,953
バルカー	7.3	8.2	19,007
ユニ・チャーム	189.9	193.4	762,963
ショーエイコーポレーション	0.5	1.1	941
医薬品（6.2%）			
協和キリン	112.2	100.9	273,439
武田薬品工業	567.6	834.9	3,475,688
アステラス製薬	825.6	882.7	1,688,605
大日本住友製薬	66.4	74.4	128,116
塩野義製薬	117.2	128.3	828,689
田辺三菱製薬	93.7	－	－
わかもと製薬	11.6	11.9	3,320
あすか製薬	11.1	11.4	12,665
日本新薬	23.4	26.3	242,486
ビオフェルミン製薬	1.4	1.7	4,035
中外製薬	93.4	104.6	1,264,091
科研製薬	16.2	17.2	100,104
エーザイ	107.2	120.1	1,077,056
ロート製薬	45.9	51.5	168,405
小野薬品工業	211.5	230.4	585,446
久光製薬	26.5	26.5	146,545
持田製薬	6.8	13.9	59,214
参天製薬	169.8	186.9	365,202
扶桑薬品工業	3.1	3.5	6,842
日本ケミファ	1.2	1.3	3,400
ツムラ	27.7	31.1	87,173
日医工	22.9	28.4	37,374
キッセイ薬品工業	15.7	17.8	50,872
生化学工業	17.6	19.5	23,770
栄研化学	15.8	17.6	38,209
日水製薬	3.7	4.2	5,539
鳥居薬品	4.8	6.3	22,711
ＪＣＲファーマ	6.3	7.1	78,313
東和薬品	4.3	12.8	30,566
富士製薬工業	6	6.8	8,425
沢井製薬	18.4	20.6	145,024
ゼリア新薬工業	17.7	18.2	35,490
第一三共	256.3	287.2	2,215,748
キョーリン製薬ホールディングス	19.7	22.1	47,050
大幸薬品	4.1	4	20,920
ダイト	5.2	5.9	20,060
大塚ホールディングス	170.6	191.2	858,679
大正製薬ホールディングス	20	21.2	153,488
ペプチドリーム	44.6	50.8	263,652
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	72.1	84.8	6,444
昭和シェル石油	69.7	－	－
ニチレキ	11.6	11.8	16,437
ユシロ化学工業	4.3	5.6	7,476
ビーピー・カストロール	3.1	3.6	4,939
富士石油	21.9	26.8	6,217
ＭＯＲＥＳＣＯ	3.4	3.6	4,809
出光興産	75	112.9	327,748
ＪＸＴＧホールディングス	1,506.2	1,509.6	706,945

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オルガノ	3.2	3.6	24,804
トーヨーカネツ	3.4	4.4	10,797
栗田工業	48.5	54.3	175,660
椿本チエイン	11.6	14.3	46,046
大同工業	4.2	4.8	3,705
木村化工機	7.4	8.3	4,623
アネスト岩田	14	15.6	15,974
ダイフク	49.3	51.3	357,561
サムコ	2.6	2.8	5,376
加藤製作所	4.6	5.5	8,002
油研工業	1.6	1.7	2,849
タダノ	43.2	48.4	49,077
フジテック	32.4	36.5	62,050
ＣＫＤ	24.9	27.9	54,851
キトー	6.8	7.6	12,783
平和	25	28	63,000
理想科学工業	8	8.9	17,159
ＳＡＮＫＹＯ	22.4	22.3	86,858
日本金銭機械	10.2	11.1	8,658
マースグループホールディングス	5.8	6.4	12,748
フクシマガリレイ	5.5	6.2	24,955
オーイズミ	4.5	4.2	2,280
ダイコク電機	4.4	4.6	6,361
竹内製作所	15	16.8	32,104
アマノ	25.6	26.3	75,770
ＪＵＫＩ	12.5	14	11,228
サンデンホールディングス	11.2	13.1	8,174
蛇の目ミシン工業	8.1	9.1	3,549
マックス	13.8	15.3	30,707
グローリー	24.8	25.8	81,528
新晃工業	8.4	9.3	15,475
大和冷機工業	13	14.5	15,529
セガサミーホールディングス	88.8	99.5	165,170
日本ピストンリング	3.3	3.7	5,298
リケン	4.1	4.6	15,663
ＴＰＲ	12	13.5	22,261
ツバキ・ナカシマ	13.6	20.5	24,559
ホシザキ	26.2	29.3	307,064
大豊工業	7.4	8.2	5,559
日本精工	183.9	188.9	171,521
ＮＴＮ	192.4	232.2	68,266
ジェイテクト	85.9	96.3	111,611
不二越	8.3	9.3	37,386
日本トムソン	26.7	29.8	12,784
ＴＨＫ	55.8	58.4	161,300
ユーシン精機	7.1	7.8	7,012
前澤給装工業	3.5	3.6	7,912
イーグル工業	11.1	12.4	11,581
前澤工業	6	6.7	2,586
日本ピラー工業	9	10.1	15,240
キッツ	36.2	40.7	28,978
マキタ	109	130.9	540,617
日立造船	71.4	79.5	33,708
三菱重工業	150.1	168.2	632,768
ＩＨＩ	68.8	72.3	197,885
スター精密	15.2	15.5	20,584
電気機器（14.6%）			
日清紡ホールディングス	49.6	66.9	69,442
イビデン	54.8	61.4	167,990
コニカミノルタ	195.7	219.2	143,356
ブラザー工業	116.6	122.5	262,395
ミネベアミツミ	166.2	186.3	404,643
日立製作所	403.1	482.2	2,019,935
三菱電機	895.4	1,003.4	1,571,826
富士電機	58.1	60.5	204,792
東洋電機製造	3.6	3.6	5,014
安川電機	103.8	108	403,380
シンフォニアテクノロジー	12.5	13	15,405
明電舎	17.7	18.4	36,450
オリジン	2.5	2.7	4,012
山洋電気	4.3	4.8	24,672
デンヨー	8.3	8.5	17,348
東芝テック	11.3	12.6	52,416
芝浦メカトロニクス	1.6	1.8	6,102
マブチモーター	24.8	27.8	115,648
日本電産	107.8	120.7	1,698,852
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4.8	6	2,328
トレックス・セミコンダクター	3	5.8	8,624

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
チノー	3.2	3.5	4,445
共和電業	9.7	10.5	4,546
日本電子材料	3.6	4	3,996
堀場製作所	17.7	19.9	136,116
アドバンテスト	61	74.6	418,506
小野測器	4.2	4.2	2,448
エスペック	8	8.9	19,437
キーエンス	44	90.9	3,486,015
日置電機	4.7	5.2	19,214
シスメックス	69.8	71.7	533,734
日本マイクロニクス	14.7	17.5	19,022
メガチップス	7.1	9.3	16,740
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5.2	5.2	16,068
澤藤電機	1.1	1.2	2,341
原田工業	2.8	4.7	4,497
コーセル	11.5	13.4	15,316
イリソ電子工業	8.2	8.4	34,104
オプテックスグループ	15.8	16.5	24,964
千代田インテグレ	3.8	4.6	9,742
アイ・オー・データ機器	3.3	3.2	2,908
レーザーテック	18.3	44.1	248,283
スタンレー電気	63.3	70.6	206,152
岩崎電気	3.5	3.9	6,372
ウシオ電機	54.3	58.3	85,992
岡谷電機産業	6.6	7.9	2,867
ヘリオス　テクノ　ホールディング	8.3	9.2	3,634
エノモト	1.9	3	3,627
日本セラミック	9.1	10.2	25,122
遠藤照明	4.6	5.1	3,498
古河電池	6.4	7.2	5,040
双信電機	4.6	4.9	2,018
山一電機	6.5	7.3	13,702
図研	5.9	6.5	15,769
日本電子	17.7	19.8	66,627
カシオ計算機	79.2	88.8	186,480
ファナック	85.1	95.3	1,950,791
日本シイエムケイ	22.9	23.6	13,216
エンプラス	4.1	5.1	15,264
大真空	3.4	3.7	6,341
ローム	43.3	44.6	367,058
浜松ホトニクス	64.2	72	332,280
三井ハイテック	10	11.1	17,882
新光電気工業	30.1	33.7	45,865
京セラ	136.5	141.2	1,055,046
太陽誘電	39.8	44.6	155,431
村田製作所	93.9	294.8	1,853,997
ユーシン	13.6	－	－
双葉電子工業	14.8	15.9	18,841
北陸電気工業	3.5	4	4,164
ニチコン	28.3	34	29,818
日本ケミコン	6.4	7.6	13,573
ＫＯＡ	13.5	15.1	17,893
市光工業	13.4	15	10,740
小糸製作所	53.6	60.1	279,765
ミツバ	16.7	18.5	13,431
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	15.5	17.4	108,054
キヤノン電子	8.2	10.5	21,283
キヤノン	482.1	540.2	1,505,807
リコー	269.2	255.3	283,638
象印マホービン	16.8	29.4	56,330
ＭＵＴＯＨホールディングス	1.3	1.4	2,363
東京エレクトロン	59.7	66.9	1,683,538
輸送用機器（7.7%）			
トヨタ紡織	31.3	29.2	47,420
芦森工業	1.9	2.1	2,669
ユニプレス	17.3	19.4	25,142
豊田自動織機	72.5	81.2	514,808
モリタホールディングス	15.6	17.5	30,905
三櫻工業	11.6	12.7	12,877
デンソー	197.2	220.9	986,760
東海理化電機製作所	23.4	26.4	47,995
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	32.4	36.2	31,783
川崎重工業	69.7	78.1	173,303
名村造船所	27.3	32.3	7,848
サノヤスホールディングス	13.1	12.2	2,098
日本車輌製造	3.3	3.7	10,619
三菱ロジスネクスト	10.7	13.3	22,330
近畿車輌	1.3	1.5	2,035

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
松風	4.1	4.5	8,815
セイコーホールディングス	13.9	14.2	32,475
ニプロ	62	69.4	86,056
その他製品（2.2%）			
中本パックス	2.4	2.5	3,955
スノーピーク	3.5	4.9	4,169
パラマウントベッドホールディングス	10.2	10.6	48,442
トランザクション	4.9	6.4	6,867
粧美堂	3.3	2.9	1,133
ニホンフラッシュ	3.9	4.7	11,980
前田工繊	9.8	11.1	23,654
永大産業	12.3	13.1	4,270
アートネイチャー	10.1	10.7	7,843
バンダイナムコホールディングス	92.6	103.7	612,867
アイフィスジャパン	2.3	2.6	1,838
共立印刷	13.4	16.7	2,788
ＳＨＯＥＩ	4.3	4.8	25,776
フランスベッドホールディングス	12.5	14.2	13,021
パイロットコーポレーション	15.6	16.4	68,798
萩原工業	5	5.6	9,195
トッパン・フォームズ	19	21.5	24,832
フジシールインターナショナル	20.1	22.5	47,430
タカラトミー	37.5	45	47,655
廣済堂	8.6	7	6,083
エステールホールディングス	2.5	2.7	1,841
アーク	34.7	38.3	3,447
タカノ	3.1	3.9	2,889
プロネクサス	7.6	8.6	9,735
ホクシン	8.1	6.2	899
ウッドワン	3.1	3.4	3,631
大建工業	6.8	6.7	12,696
凸版印刷	126.4	141.6	288,580
大日本印刷	126.2	131.3	385,496
図書印刷	8.4	－	－
共同印刷	2.6	3.1	8,862
ＮＩＳＳＨＡ	18.5	20.6	20,352
光村印刷	0.8	0.9	1,490
ＴＡＫＡＲＡ ＆ ＣＯＭＰＡＮＹ	4.4	4.8	7,944
アシックス	88.9	82.8	110,620
ツツミ	2.8	3.1	6,116
小松ウオール工業	2.6	3.1	6,426
ヤマハ	53.3	59.7	351,036
河合楽器製作所	2.8	3.1	9,346
クリナップ	8.3	9.3	5,580
ピジョン	54.1	60.6	238,158
オリバー	－	2.1	7,822
兼松サステック	0.7	0.6	1,095
キングジム	7.6	8.3	6,972
リンテック	21.2	23.9	60,801
イトーキ	16.6	21.3	8,988
任天堂	55.1	61.5	2,466,150
三菱鉛筆	14.7	16.5	26,235
タカラスタンダード	18.5	20.7	35,521
コクヨ	43	48.1	76,430
ナカバヤシ	9	9.9	5,969
グローブライド	4.3	4.5	9,936
オカムラ	31.2	35	35,210
美津濃	8.9	9.1	22,795
電気・ガス業（1.5%）			
東京電力ホールディングス	714.9	801	349,236
中部電力	274	307	466,947
関西電力	365.4	380.2	482,093
中国電力	123.8	138.7	203,889
北陸電力	87.7	91.7	76,202
東北電力	209.7	250.7	255,964
四国電力	80.6	90.4	79,190
九州電力	184.6	206.8	176,400
北海道電力	83.8	93.9	48,734
沖縄電力	16.5	18.6	37,367
電源開発	71.2	79.8	201,574
エフオン	4.2	5.4	3,547
イーレックス	15.6	14.3	21,164
レノバ	11	16.6	18,791
東京瓦斯	175.7	193	459,147
大阪瓦斯	173.8	194.7	365,062
東邦瓦斯	44.4	49.4	202,046
北海道瓦斯	4.8	5.4	8,640
広島ガス	18	20.7	7,017

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西部瓦斯	10.1	11.3	26,668
静岡ガス	27.7	28.5	27,189
メタウォーター	4.3	4.8	19,680
陸運業（4.1%）			
ＳＢＳホールディングス	8.8	8.7	15,799
東武鉄道	94.4	105.8	379,822
相鉄ホールディングス	30.7	32.1	86,894
東急	243.2	253.1	469,753
京浜急行電鉄	122.7	128.9	233,824
小田急電鉄	143.4	149.2	343,756
京王電鉄	50	52.1	304,264
京成電鉄	67.1	69.8	273,267
富士急行	12.2	13.7	46,306
新京成電鉄	2.2	2.6	6,216
東日本旅客鉄道	159.2	176.6	1,591,872
西日本旅客鉄道	80.3	89.4	780,640
東海旅客鉄道	80.2	83.4	1,728,465
西武ホールディングス	114.1	134.6	225,455
鴻池運輸	14.1	16	23,536
西日本鉄道	24.8	27.8	72,280
ハマキョウレックス	6.9	7.7	24,409
サカイ引越センター	4.7	5.3	32,118
近鉄グループホールディングス	84.8	95	491,150
阪急阪神ホールディングス	113.1	126.8	507,834
南海電気鉄道	37.8	45	119,475
京阪ホールディングス	37.8	42.3	201,136
神戸電鉄	2.2	2.3	9,096
名古屋鉄道	67.9	78.1	239,376
山陽電気鉄道	6.6	6.8	14,334
日本通運	33.3	33.6	197,904
ヤマトホールディングス	148.7	166.6	321,038
山九	23.6	26.4	134,640
丸運	5.3	5.4	1,663
丸全昭和運輸	6.8	7.7	21,275
センコーグループホールディングス	46.7	52.4	45,430
トナミホールディングス	2	2.3	11,166
ニッコンホールディングス	32.3	34	81,736
日本石油輸送	1.1	1	3,095
福山通運	10.8	12.2	43,859
セイノーホールディングス	63.5	71.2	95,479
エスライン	2.4	2.9	2,856
神奈川中央交通	2.1	2.4	9,420
日立物流	18.6	17.4	54,114
丸和運輸機関	4.5	10	19,920
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	8.6	9.6	12,144
九州旅客鉄道	71.2	84.7	306,614
ＳＧホールディングス	80.1	99.8	222,454
海運業（0.2%）			
日本郵船	70.9	79.5	138,807
商船三井	50.3	60.1	154,156
川崎汽船	26.3	29.3	43,539
ＮＳユナイテッド海運	4.7	5.2	9,588
明治海運	9.2	10.1	3,585
飯野海運	40.8	45	16,065
共栄タンカー	0.9	1.7	1,567
乾汽船	7.7	5.5	6,550
空運業（0.5%）			
日本航空	155.3	171.1	513,043
ＡＮＡホールディングス	155	173.7	568,346
パスコ	1.9	1.8	3,477
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	2.4	2.7	21,006
日新	7.3	8.2	13,841
三菱倉庫	29.3	30.1	87,530
三井倉庫ホールディングス	10.4	10.9	18,944
住友倉庫	31.7	35	50,400
澁澤倉庫	4.5	5.2	10,769
東陽倉庫	16.2	17.2	5,332
日本トランスシティ	18.6	20.9	9,969
ケイヒン	1.8	1.8	2,426
中央倉庫	5.1	5.8	6,559
川西倉庫	1.8	1.7	1,759
安田倉庫	7	7.8	7,823
ファイズホールディングス	1.1	2	1,616
東洋埠頭	2.5	2.9	3,981
宇徳	7.5	8.1	4,131
上組	52.3	54.4	123,270
サンリツ	2.2	2.2	1,463

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東計電算	1.3	1.5	6,795
エックスネット	1.8	1.5	1,456
大塚商会	47.5	53.3	258,505
サイボウズ	10.2	11.5	25,863
ソフトブレーン	7	5.8	2,940
電通国際情報サービス	5.4	6.1	30,225
デジタルガレージ	17.1	17.7	72,127
ＥＭシステムズ	7.2	13.8	12,406
ウェザーニューズ	2.9	3.3	12,688
ＣＩＪ	7	6.7	5,514
ビジネスエンジニアリング	0.9	1.1	3,498
日本エンタープライズ	10	10	2,560
WOWOW	4.2	4.7	12,516
スカラ	6.2	6.5	4,608
インテリジェント　ウェイブ	－	4.3	3,182
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	7.6	8.4	3,872
ネットワンシステムズ	31.1	37.5	92,512
システムソフト	23.4	23.3	2,190
アルゴグラフィックス	3.7	8.4	30,870
マーベラス	13.5	15	10,080
エイベックス	15.2	16.9	20,972
日本ユニシス	27.4	30.7	115,125
兼松エレクトロニクス	4.8	5.4	18,306
東京放送ホールディングス	58.3	59.9	113,690
日本テレビホールディングス	80.7	82.2	119,847
朝日放送グループホールディングス	8.9	9.8	7,056
テレビ朝日ホールディングス	24.1	27	54,729
スカパーＪＳＡＴホールディングス	66.7	64.8	30,391
テレビ東京ホールディングス	7.2	8.1	19,156
日本ＢＳ放送	2.7	3.3	4,072
ビジョン	2.7	9.2	10,258
スマートバリュー	1.9	2.6	2,259
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3.4	3.7	6,230
ワイヤレスゲート	4	4.6	2,677
コネクシオ	6.2	5.6	8,573
日本通信	76.8	76.8	16,512
クロップス	1.7	1.8	1,305
日本電信電話	601	1,316.2	3,653,771
ＫＤＤＩ	774.3	733.8	2,501,524
ソフトバンク	698.7	894.8	1,328,330
光通信	10.4	10.2	236,334
ＮＴＴドコモ	630.9	727.3	2,277,176
エムティーアイ	10.3	9.5	6,156
ＧＭＯインターネット	32	38.8	80,548
ファイバーゲート	－	2.3	2,888
アイドママーケティングコミュニケーション	2	2.9	1,647
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	25.8	26.5	43,592
学研ホールディングス	3	3.3	23,628
ゼンリン	17.5	19.6	28,616
昭文社	4.7	4.5	1,651
インプレスホールディングス	8.3	8.1	1,344
アイネット	5	5.1	7,486
松竹	5.8	6.5	90,155
東宝	57.8	58.9	227,943
東映	3.7	3.7	51,652
エヌ・ティ・ティ・データ	234	262.2	381,501
ピー・シー・エー	1.2	1.3	5,356
ビジネスブレイン太田昭和	1.5	1.7	4,766
ＤＴＳ	9.7	22	48,180
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40.9	42	208,320
シーイーシー	9.4	10.5	20,349
カプコン	37.7	46.4	160,312
アイ・エス・ビー	1.7	1.9	4,411
ジャステック	5.1	6.3	6,577
ＳＣＳＫ	23.2	22.7	141,648
日本システムウエア	2.9	3.2	7,324
アイネス	11.2	9.7	16,296
ＴＫＣ	7.4	8.3	43,990
富士ソフト	13.1	12.6	51,849
ＮＳＤ	14.2	31.6	59,850
コナミホールディングス	35.9	35.8	156,625
福井コンピュータホールディングス	2.9	3.9	12,207
ＪＢＣＣホールディングス	6.9	6.6	12,718
ミロク情報サービス	8.7	8.7	23,055
ソフトバンクグループ	367.2	781.3	4,321,370
卸売業（5.0%）			
ホウスイ	1	0.8	694
高千穂交易	3.5	3.8	4,259

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シークス	11.3	12.6	17,110
田中商事	3	3	2,124
オーハシテクニカ	5.1	5.6	8,299
白銅	2.7	3.5	4,928
伊藤忠商事	616.9	691.3	1,800,490
丸紅	869.7	1,028.7	812,158
高島	1.2	1.6	3,030
長瀬産業	49.6	55.6	79,897
蝶理	5.5	6.3	13,230
豊田通商	98.4	110.3	407,007
三共生興	15.9	15	8,235
兼松	35.1	36.9	47,453
ツカモトコーポレーション	1.7	1.8	2,037
三井物産	726.6	868.7	1,676,156
日本紙パルプ商事	5	5.6	21,616
日立ハイテク	26.8	34.3	275,086
カメイ	11.5	12.9	14,151
東都水産	1.3	1.3	3,712
ＯＵＧホールディングス	1.4	1.6	4,161
スターゼン	3.2	3.6	15,858
山善	34.2	38.6	38,831
椿本興業	2	1.8	7,182
住友商事	521.6	623.6	1,028,628
内田洋行	4	4.2	25,284
三菱商事	618.9	693.5	1,977,862
第一実業	3.9	4.8	16,944
キヤノンマーケティングジャパン	25.2	28.2	77,014
西華産業	4.9	5.6	7,280
佐藤商事	7.8	8.1	7,443
菱洋エレクトロ	9	10	19,230
東京産業	9	8.9	5,206
ユアサ商事	9	9.4	31,208
神鋼商事	2	2.5	5,977
小林産業	5.4	5.9	1,681
阪和興業	15.3	18.5	46,176
正栄食品工業	4.7	6.4	23,872
カナデン	8.4	8	10,456
菱電商事	6.7	7.1	11,672
フルサト工業	4.9	5.4	8,764
岩谷産業	19.6	21.9	79,935
すてきナイスグループ	4	4.2	4,771
昭光通商	3.4	3.2	2,176
ニチモウ	1.4	1.5	2,974
極東貿易	2.8	2.8	5,306
イワキ	10.6	12.9	6,488
三愛石油	23.5	24.3	25,855
稲畑産業	21.3	21.8	31,370
ＧＳＩクレオス	2.5	2.4	2,901
明和産業	7.5	9.1	5,187
クワザワ	－	3.5	2,173
ワキタ	18.8	21.1	21,522
東邦ホールディングス	26.1	31.7	71,071
サンゲツ	26.5	27.2	48,824
ミツウロコグループホールディングス	12.7	14.6	16,687
シナネンホールディングス	3.5	4.1	8,831
伊藤忠エネクス	19.3	21.8	20,056
サンリオ	27.2	27.7	54,485
サンワテクノス	5.2	7	6,237
リョーサン	9.7	10.9	26,301
新光商事	8.3	15.5	12,276
トーホー	4	4.5	7,866
三信電気	7.3	5.3	8,564
東陽テクニカ	10.3	11.4	11,833
モスフードサービス	11.5	13	38,844
加賀電子	8.8	9.8	22,393
ソーダニッカ	9.3	10.2	5,936
立花エレテック	6.3	7.3	12,563
フォーバル	4	4.3	4,871
ＰＡＬＴＡＣ	15.9	15.8	79,316
三谷産業	10.4	13	4,589
太平洋興発	3.5	3.9	2,971
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2	1.8	5,661
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	0.9	1,887
国際紙パルプ商事	15.3	23.4	6,739
ヤマタネ	4.5	4.9	7,232
丸紅建材リース	0.8	1	1,829
日鉄物産	6.2	7	32,025
泉州電業	2.9	3	8,928

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トラスコ中山	18.3	20.6	48,554
オートバックスセブン	35.1	36.7	56,481
モリト	6.5	7.2	5,702
加藤産業	13.7	15.5	53,707
北恵	1.7	1.9	1,757
イノテック	5.3	5.9	6,407
イエローハット	8.3	18.7	30,761
ＪＫホールディングス	8.2	8.9	6,612
日伝	7.2	8.9	17,283
北沢産業	7.1	7.4	1,887
杉本商事	4.8	5.3	10,027
因幡電機産業	12.4	28.1	73,481
バイテックホールディングス	4	－	－
東テク	2.9	3.3	8,094
ミスミグループ本社	110.4	123.8	329,431
アルテック	7.2	7.8	1,965
タキヒヨー	2.7	3	5,475
蔵王産業	1.6	1.9	2,755
スズケン	40.2	41.9	167,809
ジェコス	6.1	6.8	7,031
グローセル	8.2	9.9	4,365
小売業（4.5%）			
ローソン	22.3	25	155,500
サンエー	6.7	8.2	37,392
カワチ薬品	6.8	7.7	16,093
エービーシー・マート	13.8	15.4	104,258
ハードオフコーポレーション	3.4	3.9	3,120
アスクル	9.2	10.3	34,659
ゲオホールディングス	13.4	17.8	21,805
アダストリア	12.2	13.7	28,852
ジーフット	5.9	6	3,678
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1.3	1.4	924
くら寿司	5.2	5.2	28,080
キャンドゥ	4.3	4.7	7,665
パルグループホールディングス	4.5	5	17,150
エディオン	37.3	45.4	45,944
サーラコーポレーション	18	20.1	12,160
ワッツ	3	4.3	2,614
ハローズ	3.3	3.7	10,115
フジオフードシステム	2.9	8.3	13,802
あみやき亭	1.9	2.1	7,171
ひらまつ	18.1	18.2	4,422
大黒天物産	2.1	2.4	8,004
ハニーズホールディングス	7.8	8.7	11,675
ファーマライズホールディングス	2.3	2.4	1,564
アルペン	6.6	7.6	14,440
ハブ	2.9	2.8	2,828
クオールホールディングス	13	14.5	20,126
ジンズホールディングス	6	5.2	38,532
ビックカメラ	47.1	58.6	63,288
ＤＣＭホールディングス	46.9	53.3	55,645
ペッパーフードサービス	7	7.9	6,865
ＭｏｎｏｔａＲＯ	55.7	70.3	185,240
東京一番フーズ	2.6	2.5	1,520
ＤＤホールディングス	2	3.9	6,567
きちりホールディングス	2.5	2.6	1,853
アークランドサービスホールディングス	6.4	7.2	14,472
Ｊ．フロント　リテイリング	112.8	118	151,630
ドトール・日レスホールディングス	15.3	15.8	32,943
マツモトキヨシホールディングス	36.5	40.9	158,487
ブロンコビリー	4.6	5.2	13,156
ＺＯＺＯ	95.3	68	117,164
トレジャー・ファクトリー	2.7	2.9	2,459
物語コーポレーション	2.2	2.6	21,866
ココカラファイン	9.9	10.3	52,530
三越伊勢丹ホールディングス	165	172.7	138,332
Ｈａｍｅｅ	2.7	3.5	5,579
ウエルシアホールディングス	23.3	29.4	183,750
クリエイトＳＤホールディングス	13	16.7	45,373
丸善ＣＨＩホールディングス	9.4	11.5	4,220
ミサワ	2.5	2	1,548
ティーライフ	1.3	1.3	1,103
エー・ピーカンパニー	1.9	1.9	1,124
チムニー	2.6	3	6,675
シュッピン	6.1	6.7	6,559
ネクステージ	13.6	14.1	14,142
ジョイフル本田	25.7	28.9	36,009
鳥貴族	3	3.3	8,728

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
木曽路	10.8	12.9	36,726
ＳＲＳホールディングス	10	11.6	12,040
千趣会	17	17.8	9,220
タカキュー	7	7.6	1,375
ケーヨー	16.4	20.3	11,083
上新電機	10.4	11.7	23,598
日本瓦斯	14.3	15.6	58,188
ロイヤルホールディングス	15.4	17.3	36,814
東天紅	0.7	0.7	875
いなげや	9.8	12.2	16,555
島忠	20	18.6	55,893
チヨダ	9.2	10.4	15,173
ライフコーポレーション	6.7	7.5	19,417
リンガーハット	10.9	12.2	29,365
ＭｒＭａｘＨＤ	12.5	13.6	6,432
テンアライド	7.9	9.1	3,958
ＡＯＫＩホールディングス	17.5	19.8	20,176
オークワ	12.5	15.5	22,692
コメリ	13.6	15.3	33,797
青山商事	15.4	20.4	26,234
しまむら	10.3	11.5	88,780
はせがわ	4.8	5.2	2,054
高島屋	69.2	72	80,352
松屋	17.8	19.9	15,442
エイチ・ツー・オー　リテイリング	45.3	46.8	43,804
近鉄百貨店	3.4	3.8	12,996
パルコ	8.6	9.4	17,333
丸井グループ	74.6	90.6	214,812
アクシアル　リテイリング	7.3	8.2	30,299
井筒屋	－	5.4	1,252
イオン	339.4	380.3	874,690
イズミ	17.9	20.1	66,832
平和堂	17.8	20.1	37,365
フジ	10.6	11.9	21,705
ヤオコー	10	11.2	64,960
ゼビオホールディングス	10.4	11.9	13,090
ケーズホールディングス	91.6	95.4	125,546
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5.3	5.1	2,988
日産東京販売ホールディングス	13.2	14.5	3,726
シルバーライフ	－	0.7	1,740
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4.3	4.3	8,372
ナルミヤ・インターナショナル	－	1.7	1,980
総合メディカルホールディングス	7.7	8.6	21,904
ブックオフグループホールディングス	4.8	5.8	5,370
アインホールディングス	11.8	12.1	82,038
元気寿司	2.5	2.5	7,265
ヤマダ電機	268.7	301.1	178,853
アークランドサカモト	14.8	15.5	18,305
ニトリホールディングス	38.2	42.8	708,768
グルメ杵屋	6.3	7	8,127
愛眼	7.3	7.9	1,911
ケーユーホールディングス	4.4	5.2	4,581
吉野家ホールディングス	30.7	32.5	82,192
松屋フーズホールディングス	4.2	4.8	21,408
サガミホールディングス	12	13.2	17,463
関西スーパーマーケット	6.8	8.2	8,208
王将フードサービス	6.4	7.3	46,939
プレナス	9.9	11.1	21,423
ミニストップ	6.5	7.3	11,110
アークス	16.5	20.2	38,683
バローホールディングス	19	21.9	39,441
藤久	0.8	0.8	551
ベルク	4.3	4.9	27,391
大庄	4.5	5.3	8,617
ファーストリテイリング	11.8	13.2	787,248
サンドラッグ	33.2	37.2	122,574
サックスバー　ホールディングス	7.5	8.4	6,736
ヤマザワ	1.8	2.3	3,834
やまや	1.5	2	4,412
ベルーナ	21.6	21.2	13,016
銀行業（5.6%）			
島根銀行	1.9	2	1,218
じもとホールディングス	61.1	66.9	6,890
めぶきフィナンシャルグループ	458.9	514.3	120,346
東京きらぼしフィナンシャルグループ	12.1	13.4	16,147
九州フィナンシャルグループ	144.9	162.4	66,584
ゆうちょ銀行	250.2	280.4	282,643
富山第一銀行	20.4	23.6	7,268

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コンコルディア・フィナンシャルグループ	562.5	582.1	244,482
西日本フィナンシャルホールディングス	56.6	67.5	46,035
関西みらいフィナンシャルグループ	41.3	58.1	32,884
三十三フィナンシャルグループ	7.4	9.2	14,039
第四北越フィナンシャルグループ	15.3	17.2	43,791
新生銀行	64.8	72.6	122,694
あおぞら銀行	49.3	59	178,770
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,151	6,812.9	3,834,300
りそなホールディングス	969.2	1,086.1	477,123
三井住友トラスト・ホールディングス	173.6	187.1	748,587
三井住友フィナンシャルグループ	622.5	684.5	2,567,559
千葉銀行	312.8	340.4	205,942
群馬銀行	176.7	194.5	69,436
武蔵野銀行	13.1	14.7	24,357
千葉興業銀行	24.8	27.1	8,997
筑波銀行	38	41.2	8,075
七十七銀行	27.6	33.4	52,304
青森銀行	6.9	7.7	19,812
秋田銀行	5.7	6.3	11,894
山形銀行	10	11.1	15,173
岩手銀行	6.2	6.5	16,529
東邦銀行	79.1	88.5	21,505
東北銀行	4.5	4.7	4,775
みちのく銀行	5.4	6.4	8,531
ふくおかフィナンシャルグループ	71.7	83.4	153,956
静岡銀行	222.3	245.1	184,070
十六銀行	11.9	12.4	25,680
スルガ銀行	90.6	101.2	44,123
八十二銀行	159.9	238.8	96,236
山梨中央銀行	10.7	11.5	10,545
大垣共立銀行	13.8	19.5	43,524
福井銀行	7.7	8.5	13,175
北國銀行	9.3	10.2	31,926
清水銀行	3.8	4.1	7,982
富山銀行	1.8	1.9	3,739
滋賀銀行	17.5	19.8	51,955
南都銀行	10.2	16.5	40,837
百五銀行	79.2	89.1	28,155
京都銀行	31.6	35.4	148,680
紀陽銀行	31.1	35	55,615
ほくほくフィナンシャルグループ	58.8	65.9	66,427
広島銀行	130.4	146.1	75,972
山陰合同銀行	52	58.7	35,748
中国銀行	57	85.2	80,684
鳥取銀行	3.3	3.4	4,457
伊予銀行	117	141.2	75,542
百十四銀行	9.4	10.5	21,021
四国銀行	12.6	15	13,755
阿波銀行	14.1	16.2	38,426
大分銀行	5.5	5.7	12,956
宮崎銀行	5.9	6.6	15,516
佐賀銀行	5.4	6	9,006
十八銀行	5.4	－	－
沖縄銀行	8	9.1	30,212
琉球銀行	20.1	22.8	23,962
セブン銀行	298.4	330.6	105,461
みずほフィナンシャルグループ	12,001.4	13,448.4	2,134,261
高知銀行	3.9	3.6	2,829
山口フィナンシャルグループ	110.2	123.5	79,904
長野銀行	3	3.2	4,691
名古屋銀行	7.1	8	27,040
北洋銀行	132.1	149.2	33,868
愛知銀行	3.2	3.6	12,222
中京銀行	3.7	4.1	9,028
大光銀行	3.2	3.4	5,433
愛媛銀行	12.2	13.8	14,848
トマト銀行	3.3	3.8	3,944
京葉銀行	38.5	42.2	24,054
栃木銀行	45.1	47.8	9,273
北日本銀行	2.8	3.1	6,401
東和銀行	15.7	17.4	13,467
福島銀行	8.1	9.3	1,971
大東銀行	4.5	5.1	3,146
トモニホールディングス	68.3	76.5	26,010
フィデアホールディングス	87.5	96.1	11,628
池田泉州ホールディングス	93.7	113.8	21,394
証券、商品先物取引業（0.9%）			
ＦＰＧ	27.7	30.5	29,585

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ハウスコム	－	1.3	1,995
日本管理センター	6.1	6.5	9,152
サンセイランディック	2.5	2.9	2,378
エストラスト	1.6	1.3	1,072
フージャースホールディングス	19.4	19.7	13,730
オープンハウス	14.4	28.7	88,970
東急不動産ホールディングス	237.6	269.1	210,436
飯田グループホールディングス	73.7	82.6	134,307
イーグランド	1.7	1.6	1,292
ムゲンエステート	6.4	6.8	4,039
ビーロット	1.4	2.3	4,406
ファーストブラザーズ	2.4	2.3	2,587
ハウスドゥ	4.9	4.9	5,831
シーアールイー	3.1	2.4	2,652
プロパティエージェント	1	1.6	1,617
ケイアイスター不動産	2.5	3.1	5,149
アグレ都市デザイン	1.3	1.6	827
グッドコムアセット	1.6	2.3	4,386
ジェイ・エス・ビー	0.3	1.1	5,687
テンポイノベーション	0.8	2.2	2,096
グローバル・リンク・マネジメント	0.6	1.6	1,208
パーク２４	51.6	53.1	139,599
パラカ	2.3	2.6	5,135
三井不動産	468.6	488.1	1,436,478
三菱地所	618.8	693.5	1,484,090
平和不動産	16.8	18.2	62,426
東京建物	96.5	108.1	186,364
ダイビル	26.2	25.5	35,241
京阪神ビルディング	16.1	16.1	23,747
住友不動産	198.5	222.5	887,775
テーオーシー	20.4	19.4	16,373
東京楽天地	1.3	1.6	8,944
レオパレス２１	108.9	129.7	52,398
スターツコーポレーション	12.1	13.5	34,924
フジ住宅	11.4	11.5	7,567
空港施設	10.2	9.9	5,177
明和地所	5.2	5.4	3,375
ゴールドクレスト	7	7.8	14,788
エスリード	3.5	3.9	7,332
日神グループホールディングス	13	14.6	7,781
日本エスコン	16	17.9	16,038
タカラレーベン	42.1	45.2	22,148
ＡＶＡＮＴＩＡ	5.3	5.6	5,320
イオンモール	44.3	49.6	90,569
毎日コムネット	1.9	2.5	2,265
ファースト住建	3.4	4.2	5,241
ランド	－	538.7	5,387
カチタス	9.9	12.3	48,892
トーセイ	12.3	13.6	18,468
穴吹興産	1	2.2	3,601
サンフロンティア不動産	12.2	13.7	17,316
エフ・ジェー・ネクスト	7.7	8.6	9,537
インテリックス	2.7	2.8	1,864
ランドビジネス	4.7	4.2	3,099
日本社宅サービス	－	2.3	2,357
グランディハウス	8	7.7	3,395
日本空港ビルデング	28.2	31.6	163,372
サービス業（5.2%）			
日本工営	5.7	6.5	21,580
ＬＩＦＵＬＬ	33.3	33.5	16,984
ジェイエイシーリクルートメント	6.8	6.4	10,336
日本M&Aセンター	63.8	72.4	266,432
メンバーズ	2.9	2.8	4,466
中広	1.3	1	540
ＵＴグループ	－	11.3	30,385
アイティメディア	－	2.9	3,259
タケエイ	9	9.2	9,328
Ｅ・Ｊホールディングス	1	1.7	2,815
ビーネックスグループ	4.7	11.9	11,673
コシダカホールディングス	22.9	23.1	34,488
アルトナー	1.7	2.3	1,978
パソナグループ	10.4	10.4	13,728
ＣＤＳ	2.1	2.4	3,319
リンクアンドモチベーション	15.8	21.1	10,697
ＧＣＡ	9.1	11.5	9,211
エス・エム・エス	31.4	29.8	70,000
サニーサイドアップグループ	0.9	2.5	2,275
パーソルホールディングス	85.6	95.9	167,153

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
楽天	398.8	446.9	423,661
クリーク・アンド・リバー社	5.1	4.9	4,924
テー・オー・ダブリュー	7.5	7.6	6,528
山田コンサルティンググループ	2.6	4.6	7,130
セントラルスポーツ	3.2	3.6	10,713
フルキャストホールディングス	8.5	9.6	23,644
エン・ジャパン	9.3	17	59,245
リソルホールディングス	0.9	1	4,145
テクノプロ・ホールディングス	17.2	19.1	147,643
アトラ	1.9	2.2	715
インターワークス	2	1.8	968
アイ・アールジャパンホールディングス	2.6	3.9	28,743
ＫｅｅＰｅｒ技研	3.2	3.5	3,920
ファーストロジック	1.8	2.2	1,300
三機サービス	1.8	1.8	1,791
Ｇｕｎｏｓｙ	5.9	6	6,954
デザインワン・ジャパン	1.7	1.9	535
イー・ガーディアン	4.1	4.9	9,378
リブセンス	5.1	6.1	1,714
ジャパンマテリアル	23.4	29.5	44,751
ベクトル	10.4	11.9	14,268
ウチヤマホールディングス	4	4.7	2,100
チャーム・ケア・コーポレーション	2.1	8.2	7,691
ライクキッズ	2.1	1.6	1,425
キャリアリンク	3.7	3.1	1,810
ＩＢＪ	5.9	6.5	7,936
アサンテ	3.5	3.8	7,125
Ｎ・フィールド	5.6	6.6	3,709
バリューＨＲ	1.9	1.9	6,545
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	2.2	6.8	25,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.6	3.6	5,994
ＥＲＩホールディングス	2.5	2.7	2,068
アビスト	1.3	1.5	3,799
シグマクシス	4.1	6.5	10,822
ウィルグループ	5.6	6.3	6,268
エスクロー・エージェント・ジャパン	12	13.2	2,798
日本ビューホテル	2.7	－	－
リクルートホールディングス	613	686.9	3,126,768
エラン	5.9	5.7	9,370
土木管理総合試験所	3.9	4.2	1,751
ネットマーケティング	－	2.8	2,242
日本郵政	701.3	785.9	789,829
ベルシステム２４ホールディングス	14.3	16.1	24,278
鎌倉新書	6.3	7.2	11,865
ＳＭＮ	－	1.5	1,210
一蔵	1.1	1	623
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2	3.3	8,170
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1.1	1.4	1,023
エアトリ	2.5	4.3	5,710
アトラエ	1.6	2.5	7,012
ストライク	2.2	3.6	17,028
ソラスト	20.9	26.4	27,984
セラク	2	3	3,678
インソース	2.8	4.6	13,307
ベイカレント・コンサルティング	4.5	5.8	45,704
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1.1	2	2,028
アイモバイル	2.1	3	2,217
キャリアインデックス	2.9	3.9	1,306
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3.5	3.1	3,915
船場	1.5	1.6	1,721
グレイステクノロジー	2.3	4.4	14,102
ジャパンエレベーターサービスホールディン	5	10.1	22,381
フルテック	1	1.3	1,469
グリーンズ	2.4	2.4	2,066
ツナググループ・ホールディングス	0.9	1.1	642
ＧａｍｅＷｉｔｈ	－	2.1	1,545
ソウルドアウト	－	1.5	2,751
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1	1.3	1,378
ミダック	－	0.9	1,086
日総工産	2.1	6.4	5,235
キュービーネットホールディングス	3.9	3.9	8,892
ＲＰＡホールディングス	－	5.4	5,891
スプリックス	2.4	3.2	3,136
マネジメントソリューションズ	－	1	3,615
ａｎｄ ｆａｃｔｏｒｙ	－	0.7	1,291
アドバンテッジリスクマネジメント	3.4	4.8	4,176
リログループ	46.8	52.4	135,558
東祥	5.3	6	11,868

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エイチ・アイ・エス	15.2	14.9	37,026
ラックランド	1.7	2.2	4,683
共立メンテナンス	13.1	15.9	64,236
イチネンホールディングス	8.9	10.7	14,712
建設技術研究所	5.9	6.6	14,652
スペース	5.6	6.2	7,154
長大	3.6	3.5	3,773
燦ホールディングス	1.9	4.2	6,568
スバル興業	0.6	0.6	5,184
東京テアトル	4	3.7	4,869
タナベ経営	1.6	1.8	2,329
ナガワ	2.4	3.1	20,522
よみうりランド	1.9	2.1	8,599
東京都競馬	5.6	6.3	23,152
常磐興産	3.5	3.8	6,159
カナモト	12.8	15.7	41,667
東京ドーム	31.9	38.8	37,519
西尾レントオール	8.7	9.7	28,382
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	－	61.4	1,842
トランス・コスモス	9.5	9.1	24,133
乃村工藝社	20	41.1	48,539
藤田観光	3.4	4.2	10,361
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	4.7	6	6,876
日本管財	9.1	10.3	19,580
トーカイ	8.2	9.3	22,896
白洋舎	1	1.1	3,042
セコム	90.8	101.8	981,453
セントラル警備保障	4.1	4.6	25,116
丹青社	16.1	18.1	20,796
メイテック	10.8	11.9	67,116
応用地質	9.1	10.3	14,605
船井総研ホールディングス	17.6	19.8	59,023
進学会ホールディングス	3.8	3.7	1,887
オオバ	6.8	6.9	4,926
いであ	1.9	1.8	3,481
学究社	2.7	2.8	3,780
ベネッセホールディングス	31.3	31.9	94,168
イオンディライト	10.5	11.8	44,368
ナック	5.5	5.3	5,273
ニチイ学館	12.3	13.6	18,142
ダイセキ	14.3	16.1	47,060
ステップ	3.1	3.5	5,768
合計 株数・金額	103,559	118,785	236,764,705
合計 銘柄数＜比率＞	2,102	2,157	＜99.2%＞

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	百万円 1,694	百万円 －

○有価証券の貸付及び借入の状況

（2020年２月20日現在）

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

（注）（ ）内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

（2020年２月20日現在）

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年２月20日現在)

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

＜注記事項＞

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

○損益の状況 (2019年２月21日～2020年２月20日)

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

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

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

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

［お 知 ら せ］

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

（2019年７月１日）

三菱ＵＦＪ 外国株式マザーファンド

《第20期》決算日2020年５月20日

［計算期間：2019年５月21日～2020年５月20日］

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

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	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
16期(2016年５月20日)	17,145	△15.6	550,658.40	△16.0	95.4	1.8	2.7	114,202
17期(2017年５月22日)	20,708	20.8	663,775.10	20.5	95.7	1.7	2.5	105,751
18期(2018年５月21日)	23,482	13.4	751,162.81	13.2	95.2	2.5	2.2	106,222
19期(2019年５月20日)	24,065	2.5	767,061.93	2.1	94.3	3.1	2.5	97,464
20期(2020年５月20日)	23,411	△ 2.7	744,889.56	△ 2.9	95.4	2.3	2.4	94,605

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		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20日	24,065	－	767,061.93	－	94.3	3.1	2.5
５月末	23,325	△ 3.1	743,484.51	△ 3.1	96.6	3.1	2.6
６月末	24,164	0.4	770,156.42	0.4	94.1	2.3	2.5
７月末	24,822	3.1	790,836.41	3.1	93.5	2.4	2.5
８月末	23,591	△ 2.0	751,785.28	△ 2.0	93.9	6.6	2.7
９月末	24,347	1.2	775,713.31	1.1	95.4	1.8	2.7
10月末	25,313	5.2	805,459.07	5.0	94.6	1.8	2.6
11月末	26,255	9.1	835,911.03	9.0	93.4	3.9	2.6
12月末	27,049	12.4	860,793.53	12.2	94.2	2.3	2.5
2020年１月末	27,082	12.5	861,985.05	12.4	92.7	3.9	2.6
２月末	24,951	3.7	794,123.11	3.5	93.8	3.8	2.7
３月末	21,195	△11.9	675,468.96	△11.9	102.9	6.8	2.8
４月末	23,273	△ 3.3	740,391.09	△ 3.5	90.9	3.0	2.4
（期末）							
2020年５月20日	23,411	△ 2.7	744,889.56	△ 2.9	95.4	2.3	2.4

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

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

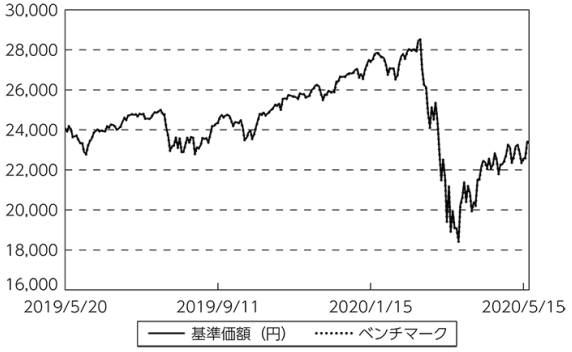
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.7%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

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

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

◎為替市況
・米ドル、ユーロは円に対して下落しました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは2.9%の下落となったため、カイ離は0.2%程度となりました。
　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
　主なプラス要因：その他の要因※によるものです。
※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。
　主なマイナス要因：取引要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2019年５月21日～2020年５月20日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.004	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（株式）	(1)	(0.003)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	2	0.008	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(2)	(0.008)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	9	0.039	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(9)	(0.038)	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	12	0.051	
期中の平均基準価額は、24,469円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年５月21日～2020年５月20日）

株式

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

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	ニュージーランド	百株 332	千ニュージーランドドル 186	百株 195	千ニュージーランドドル 78
	香港	5,283 (254)	千香港ドル 18,258 (－)	5,787	千香港ドル 17,716
	シンガポール	1,195 (629)	千シンガポールドル 850 (－)	3,609	千シンガポールドル 1,016
	イスラエル	307 (12)	千イスラエルシェケル 469 (－)	655	千イスラエルシェケル 337

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

投資信託証券

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

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

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	45 (－)	111 (△0.01371)	－	－
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	12 (－)	36 (△0.94123)	－	－
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	－ (10)	－ (－)	10	2
	小計	164 (10)	303 (△1)	69	113

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 37,238	百万円 37,933	百万円 －	百万円 －

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

○株式売買比率

(2019年５月21日～2020年５月20日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年５月21日～2020年５月20日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

（2020年５月20日現在）

外国株式

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
DANAHER CORP	146	149	2,381	257,108	ヘルスケア機器・サービス
WALT DISNEY CO/THE	418	432	4,948	534,382	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	28	28	215	23,226	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	166	174	1,457	157,352	公益事業
DR HORTON INC	80	86	447	48,359	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	114	122	1,503	162,338	小売
DAVITA INC	32	22	184	19,885	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	35	35	318	34,408	資本財
DTE ENERGY COMPANY	43	46	476	51,457	公益事業
EXXON MOBIL CORP	985	1,015	4,463	482,008	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	47	50	1,077	116,395	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	134	143	726	78,460	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	145	146	817	88,280	資本財
EXELON CORP	226	233	858	92,692	公益事業
ECOLAB INC	60	62	1,250	134,986	素材
EQUIFAX INC	27	28	421	45,531	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	51	52	922	99,647	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	100	102	781	84,426	資本財
EDISON INTERNATIONAL	77	83	480	51,883	公益事業
ENTERGY CORP	41	51	494	53,404	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	8	9	180	19,499	保険
NEXTERA ENERGY INC	111	116	2,684	289,836	公益事業
MACY'S INC	69	—	—	—	小売
FEDEX CORP	58	59	685	74,035	運輸
FORD MOTOR CO	860	991	525	56,765	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	70	70	126	13,690	各種金融
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	8	256	27,652	各種金融
FIRSTENERGY CORP	121	127	516	55,739	公益事業
FLUOR CORP	32	—	—	—	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	320	321	294	31,763	素材
GENERAL MILLS INC	142	146	888	95,964	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	58	60	829	89,573	資本財
WW GRAINGER INC	10	11	321	34,680	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,021	2,102	1,305	141,011	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	36	72	1,295	139,891	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	32	35	274	29,591	小売
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	58	—	—	—	自動車・自動車部品
GAP INC/THE	56	—	—	—	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	77	76	1,360	146,876	各種金融
HALLIBURTON CO	199	196	218	23,608	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	172	171	2,257	243,796	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	40	42	92	9,951	自動車・自動車部品
HP INC	364	368	616	66,587	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	82	88	302	32,671	保険
HERSHEY CO/THE	32	35	465	50,252	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	262	261	6,232	673,011	小売
HASBRO INC	29	29	202	21,900	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	58	56	452	48,848	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	211	212	2,550	275,429	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	92	91	292	31,540	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	69	76	1,241	134,025	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	92	92	148	16,051	メディア・娯楽

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ORACLE CORP	617	550	2,882	311,277	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	101	105	4,745	512,456	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18	18	761	82,212	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	167	184	1,347	145,539	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	42	41	461	49,840	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	33	31	181	19,552	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	27	26	287	31,030	小売
LAM RESEARCH CORP	36	34	904	97,617	半導体・半導体製造装置
COPART INC	51	49	417	45,041	商業・専門サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	20	241	26,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WYNN RESORTS LTD	22	20	172	18,592	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,055	1,088	4,160	449,258	メディア・娯楽
XILINX INC	58	60	523	56,551	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	82	81	560	60,548	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	49	63	262	28,313	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	17	18	408	44,069	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	300	304	2,200	237,611	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	30	30	414	44,790	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	26	27	1,482	160,085	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	57	62	1,797	194,077	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	12	12	232	25,093	銀行
PAYCHEX INC	77	83	546	59,012	ソフトウェア・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	104	88	136	14,783	半導体・半導体製造装置
SIGNATURE BANK	14	12	116	12,628	銀行
CHECK POINT SOFTWARE TECH	30	32	340	36,750	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13	20	318	34,340	運輸
AUTODESK INC	50	53	1,037	111,978	ソフトウェア・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	47	37	81	8,784	メディア・娯楽
SALESFORCE.COM INC	177	200	3,525	380,632	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	28	—	—	—	小売
ALPHABET INC-CL A	69	71	9,879	1,066,754	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	12	302	32,624	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EAST WEST BANCORP INC	34	34	113	12,229	銀行
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	9	440	47,540	各種金融
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	28	32	262	28,386	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	60	54	212	22,939	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	281	274	2,142	231,344	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	67	59	313	33,878	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	34	35	577	62,369	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	64	65	360	38,911	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	96	101	24,757	2,673,350	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	54	58	670	72,390	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	29	29	329	35,585	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	37	37	643	69,503	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	57	50	121	13,154	素材
E*TRADE FINANCIAL CORP	58	49	200	21,691	各種金融
CERNER CORP	70	74	507	54,752	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	40	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	25	25	536	57,959	ソフトウェア・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	61	64	595	64,250	商業・専門サービス
EBAY INC	212	183	779	84,191	小売

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BURLINGTON STORES INC	16	15	271	29,363	小売
KKR & CO INC	104	119	308	33,350	各種金融
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	67	89	173	18,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIGNA CORP	88	90	1,729	186,706	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	34	33	148	16,011	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MONGODB INC	－	10	213	23,089	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	76	84	231	25,033	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	35	46	124	13,439	メディア・娯楽
DOW INC	177	181	647	69,921	素材
DROPBOX INC-CLASS A	－	48	104	11,280	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	－	19	307	33,194	ヘルスケア機器・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	－	104	348	37,619	運輸
CORTEVA INC	－	192	460	49,746	素材
AMCOR PLC	－	382	359	38,861	素材
XEROX HOLDINGS CORP	－	45	79	8,600	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROKU INC	－	22	262	28,375	メディア・娯楽
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	－	32	234	25,343	ソフトウェア・サービス
PINTEREST INC- CLASS A	－	65	122	13,266	メディア・娯楽
RINGCENTRAL INC-CLASS A	－	17	473	51,124	ソフトウェア・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	－	30	210	22,689	素材
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	－	338	211	22,788	各種金融
AGNC INVESTMENT CORP	－	124	161	17,491	各種金融
AON PLC	－	55	1,084	117,142	保険
OTIS WORLDWIDE CORP	－	93	489	52,869	資本財
CARRIER GLOBAL CORP	－	187	332	35,920	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	280	280	109	11,821	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	53	53	113	12,229	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	51	51	223	24,170	資本財
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	80	80	37	4,085	食品・生活必需品小売り
小計 株数・金額	70,489	72,003	598,708	64,648,535	
小計 銘柄数＜比率＞	598	602	－	＜68.3%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA	336	342	2,863	222,155	銀行
IMPERIAL OIL LTD	69	60	125	9,700	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP	44	44	418	32,457	商業・専門サービス
TC ENERGY CORP	215	224	1,374	106,665	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	82	94	521	40,473	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	135	154	709	55,065	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B	114	113	152	11,808	素材
BARRICK GOLD CORP	408	424	1,660	128,812	素材
BCE INC	33	33	182	14,162	電気通信サービス
BOMBARDIER INC-B	530	－	－	－	資本財
BANK OF MONTREAL	150	160	1,043	80,956	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	195	305	1,272	98,751	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA	286	292	1,491	115,713	銀行
BAUSCH HEALTH COS INC	76	67	167	12,989	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC	60	60	124	9,635	資本財
CAMECO CORP	106	75	102	7,948	エネルギー
CI FINANCIAL CORP	44	45	67	5,264	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	102	108	884	68,595	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	278	301	754	58,519	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	170	172	1,950	151,291	運輸

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SCOR SE	40	32	76	9,019	保険
ADP	6	6	54	6,414	運輸
EDF	151	130	96	11,370	公益事業
NATIXIS	225	225	43	5,165	各種金融
WENDEL	6	6	51	6,090	各種金融
BUREAU VERITAS SA	54	66	123	14,570	商業・専門サービス
EURAZEO SE	13	9	38	4,572	各種金融
SUEZ	88	71	67	7,928	公益事業
EIFFAGE	19	24	184	21,847	資本財
ILIAD SA	7	5	72	8,534	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	30	44	40	4,742	メディア・娯楽
BIOMERIEUX	10	10	129	15,298	ヘルスケア機器・サービス
GETLINK SE	95	91	102	12,061	運輸
EDENRED	51	59	208	24,644	ソフトウェア・サービス
REMY COINTREAU	5	5	60	7,197	食品・飲料・タバコ
REXEL SA	66	—	—	—	資本財
BOLLORE	169	225	56	6,636	メディア・娯楽
DASSAULT AVIATION SA	0.63	0.63	43	5,137	資本財
SEB SA	5	6	65	7,769	耐久消費財・アパレル
IPSEN	8	8	56	6,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	15	15	91	10,854	各種金融
FAURECIA	18	18	60	7,161	自動車・自動車部品
TELEPERFORMANCE	12	13	295	34,855	商業・専門サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	20	20	137	16,182	メディア・娯楽
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	7	7	157	18,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDLINE SA	19	28	180	21,369	ソフトウェア・サービス
小計 株数・金額	6,210	6,312	25,463	3,007,204	
小計 銘柄数＜比率＞	70	67	—	＜3.2%＞	
(ユーロ…オランダ)					
QIAGEN N.V.	49	56	221	26,147	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV	248	252	130	15,395	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	247	245	182	21,537	自動車・自動車部品
FERRARI NV	28	28	418	49,451	自動車・自動車部品
EXOR NV	25	25	116	13,720	各種金融
AIRBUS SE	135	137	748	88,370	資本財
STMICROELECTRONICS NV	161	164	366	43,254	半導体・半導体製造装置
WOLTERS KLUWER	67	66	442	52,217	商業・専門サービス
UNILEVER NV	—	352	1,563	184,619	家庭用品・パーソナル用品
KONINKLIJKE KPN NV	834	834	173	20,473	電気通信サービス
AKZO NOBEL N.V.	52	46	332	39,320	素材
HEINEKEN NV	58	61	465	54,921	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV	214	218	870	102,816	ヘルスケア機器・サービス
AEGON NV	436	372	84	9,998	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	269	276	622	73,468	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD NV	27	27	102	12,054	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV	27	25	174	20,619	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	41	42	475	56,109	素材
ING GROEP NV	904	1,002	520	61,474	銀行
ASML HOLDING NV	95	102	2,906	343,265	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA	358	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK	14	15	75	8,875	エネルギー
NN GROUP NV	75	90	235	27,781	保険

銘柄		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	
ALTICE EUROPE NV		－	154	58	6,957	メディア・娯楽
ABN AMRO BANK NV-CVA		91	87	55	6,603	銀行
ADYEN NV		2	2	262	30,942	ソフトウェア・サービス
JUST EAT TAKEAWAY		－	28	277	32,797	小売
PROSUS NV		－	115	940	111,035	小売
小計	株数・金額	4,470	4,837	12,821	1,514,232	
	銘柄数＜比率＞	24	27	－	＜1.6%＞	
(ユーロ…スペイン)						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		64	48	63	7,480	資本財
ENDESA SA		72	72	146	17,267	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		55	62	129	15,313	資本財
IBERDROLA SA		1,451	1,459	1,300	153,590	公益事業
TELEFONICA SA		1,081	1,140	444	52,516	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		3,784	4,098	747	88,257	銀行
BANKINTER SA		176	150	52	6,152	銀行
REPSOL SA		323	336	287	33,936	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,542	1,670	434	51,260	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		76	62	96	11,404	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		250	262	605	71,456	小売
MAPFRE SA		297	335	49	5,847	保険
FERROVIAL SA		108	113	258	30,483	資本財
FERROVIAL SA-RTS		108	－	－	－	資本財
ENAGAS SA		60	51	104	12,331	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		94	101	159	18,848	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,253	1,272	34	4,105	銀行
CAIXABANK SA		792	784	121	14,353	銀行
GRIFOLS SA		72	70	204	24,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA		101	104	450	53,221	ソフトウェア・サービス
BANKIA SA		331	331	26	3,163	銀行
AENA SME SA		16	16	187	22,129	運輸
CELLNEX TELECOM SA		－	60	300	35,493	電気通信サービス
小計	株数・金額	12,117	12,607	6,204	732,733	
	銘柄数＜比率＞	22	22	－	＜0.8%＞	
(ユーロ…ベルギー)						
GALAPAGOS NV		－	10	205	24,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGEAS		39	45	137	16,271	保険
UCB SA		29	29	246	29,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		19	19	130	15,437	各種金融
UMICORE		52	44	153	18,134	素材
COLRUYT SA		16	12	67	8,012	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV		57	61	260	30,779	銀行
SOLVAY SA		17	23	160	18,897	素材
PROXIMUS		28	37	66	7,839	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		14	10	33	3,991	メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		176	180	683	80,662	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	452	474	2,146	253,508	
	銘柄数＜比率＞	10	11	－	＜0.3%＞	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		66	73	134	15,914	銀行
VERBUND AG		17	17	64	7,635	公益事業
OMV AG		35	35	105	12,466	エネルギー
VOESTALPINE AG		18	27	46	5,541	素材

銘柄		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		19	13	40	4,771	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		40	29	44	5,306	銀行
小計	株数・金額	197	196	437	51,636	
	銘柄数＜比率＞	6	6	－	＜0.1%＞	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP		10	－	－	－	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		192	270	128	15,130	不動産
TENARIS SA		110	110	62	7,400	エネルギー
SES		94	81	48	5,762	メディア・娯楽
EUROFINS SCIENTIFIC		2	2	142	16,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL		153	154	132	15,671	素材
小計	株数・金額	564	619	514	60,806	
	銘柄数＜比率＞	6	5	－	＜0.1%＞	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		1,278	1,403	476	56,270	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		132	132	140	16,599	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ		29	29	52	6,200	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		120	129	329	38,876	素材
FORTUM OYJ		97	97	152	17,951	公益事業
KONE OYJ-B		78	81	467	55,222	資本財
METSO OYJ		29	21	57	6,841	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		105	119	356	42,052	保険
WARTSILA OYJ ABP		104	104	72	8,548	資本財
ELISA OYJ		31	32	170	20,188	電気通信サービス
NESTE OYJ		89	95	316	37,434	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		27	21	94	11,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	2,124	2,268	2,686	317,317	
	銘柄数＜比率＞	12	12	－	＜0.3%＞	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		37	37	384	45,451	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		37	33	167	19,724	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		20	19	233	27,595	消費者サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW		－	0.4	4	554	消費者サービス
BANK OF IRELAND GROUP PLC		233	233	36	4,304	銀行
AIB GROUP PLC		200	200	20	2,385	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		47	57	165	19,598	素材
CRH PLC		189	188	516	61,001	素材
小計	株数・金額	766	771	1,529	180,615	
	銘柄数＜比率＞	7	8	－	＜0.2%＞	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		634	574	233	27,628	公益事業
JERONIMO MARTINS		54	54	79	9,391	食品・生活必需品小売り
GALP ENERGIA SGPS SA		109	133	139	16,476	エネルギー
小計	株数・金額	799	762	452	53,495	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.1%＞	
ユーロ計	株数・金額	45,514	46,849	79,166	9,349,559	
	銘柄数＜比率＞	239	237	－	＜9.9%＞	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		3,989	4,413	462	61,202	銀行
BP PLC		4,671	4,871	1,530	202,682	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		16,655	17,613	521	69,008	銀行
ASTRAZENECA PLC		295	315	2,734	362,084	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
SMITHS GROUP PLC	87	101	127	16,844	資本財
NEXT PLC	31	28	126	16,800	小売
DIAGEO PLC	565	563	1,601	212,098	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC	759	745	370	49,113	資本財
UNILEVER PLC	258	267	1,101	145,888	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	2,252	2,366	561	74,420	食品・生活必需品小売り
RELX PLC	459	462	850	112,671	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	375	377	32	4,284	小売
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	156	170	1,201	159,178	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC	—	95	210	27,884	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PRUDENTIAL PLC	603	618	693	91,847	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,425	1,570	301	39,991	保険
SAGE GROUP PLC/THE	261	262	174	23,128	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC	4,669	4,866	2,002	265,222	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	533	551	1,679	222,424	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	146	165	148	19,673	公益事業
SCHRODERS PLC	28	28	80	10,651	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,095	1,197	127	16,917	銀行
BHP GROUP PLC	493	502	774	102,616	素材
IMPERIAL BRANDS PLC	218	229	355	47,016	食品・飲料・タバコ
WPP PLC	286	280	163	21,665	メディア・娯楽
CENTRICA PLC	1,333	1,333	49	6,571	公益事業
BT GROUP PLC	1,966	1,966	218	28,976	電気通信サービス
SSE PLC	233	242	296	39,322	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	656	636	261	34,601	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	387	409	109	14,510	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT	29,619	—	—	—	資本財
COMPASS GROUP PLC	375	380	424	56,160	消費者サービス
KINGFISHER PLC	522	420	70	9,288	小売
PEARSON PLC	195	204	89	11,881	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC	49	51	123	16,379	公益事業
RIO TINTO PLC	269	270	1,155	152,988	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,156	1,197	1,989	263,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC	234	235	191	25,330	各種金融
VODAFONE GROUP PLC	6,210	6,387	811	107,485	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS	462	559	104	13,902	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC	433	433	79	10,538	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC	927	938	224	29,758	保険
JOHNSON MATTHEY PLC	46	46	93	12,341	素材
RENTOKIL INITIAL PLC	—	436	212	28,182	商業・専門サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	244	244	90	12,032	保険
WHITBREAD PLC	40	32	94	12,550	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	780	828	757	100,307	公益事業
BUNZL PLC	74	84	151	20,107	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	240	266	428	56,728	素材
INTERTEK GROUP PLC	36	38	185	24,539	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	90	88	125	16,590	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	38	51	189	25,126	消費者サービス
CARNIVAL PLC	41	—	—	—	消費者サービス
PERSIMMON PLC	70	73	160	21,249	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC	201	321	88	11,714	資本財
ITV PLC	728	758	58	7,683	メディア・娯楽

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	127	127	73	5,203	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD	527	432	200	14,170	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	167	167	167	11,835	食品・飲料・タバコ
APA GROUP	—	288	332	23,554	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	32	38	258	18,307	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	14	15	1,101	消費者サービス
SEEK LTD	66	84	151	10,747	メディア・娯楽
BANK OF QUEENSLAND LTD	110	—	—	—	銀行
REA GROUP LTD	9	13	132	9,407	メディア・娯楽
TPG TELECOM LTD	104	104	75	5,357	電気通信サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	687	687	197	13,955	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	17	—	—	—	消費者サービス
SOUTH32 LTD	1,200	1,061	211	14,945	素材
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	31	174	12,359	各種金融
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	27	27	49	3,516	エネルギー
COLES GROUP LTD	280	311	475	33,645	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	—	32	67	4,741	ソフトウェア・サービス
小計 株数・金額	17,542	17,868	26,676	1,887,386	
小計 銘柄数<比率>	61	61	—	<2.0%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	482	483	223	14,745	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	170	216	124	8,216	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	138	138	415	27,414	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	177	177	60	3,980	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	70	104	131	8,693	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	356	265	127	8,399	公益事業
MERCURY NZ LTD	—	145	72	4,760	公益事業
A2 MILK CO LTD	182	182	353	23,309	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	1,578	1,714	1,509	99,519	
小計 銘柄数<比率>	7	8	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD	320	—	—	—	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	100	120	591	8,232	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	611	641	3,530	49,180	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES	375	375	3,720	51,819	不動産
MTR CORP	380	365	1,536	21,405	運輸
HONG KONG & CHINA GAS	2,111	2,433	3,377	47,053	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,340	1,520	1,377	19,183	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	345	315	1,508	21,018	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	270	286	7,584	105,655	各種金融
HANG LUNG GROUP LTD	240	—	—	—	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD	450	450	757	10,556	不動産
CLP HOLDINGS LTD	375	400	3,222	44,882	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	281	353	1,072	14,940	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	329	329	523	7,286	銀行
HANG SENG BANK LTD	181	180	2,415	33,649	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO	170	—	—	—	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	360	—	—	—	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	71	71	546	7,615	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO	842	682	705	9,823	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	210	120	157	2,189	耐久消費財・アパレル
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	150	150	672	9,360	公益事業

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		835	885	2,168	30,203	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		335	330	2,244	31,258	資本財
PCCW LTD		1,240	800	356	4,970	電気通信サービス
KERRY PROPERTIES LTD		185	185	391	5,450	不動産
MINTH GROUP LTD		180	—	—	—	自動車・自動車部品
NWS HOLDINGS LTD		310	310	237	3,307	資本財
SANDS CHINA LTD		528	692	2,148	29,930	消費者サービス
WHEELOCK & CO LTD		210	210	1,186	16,527	不動産
WYNN MACAU LTD		308	316	450	6,277	消費者サービス
SJM HOLDINGS LTD		580	580	489	6,819	消費者サービス
AIA GROUP LTD		2,796	2,908	20,472	285,179	保険
SWIRE PROPERTIES LTD		250	250	530	7,382	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		560	530	2,811	39,166	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD		264	—	—	—	消費者サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		960	780	934	13,016	電気通信サービス
WH GROUP LTD		2,120	2,195	1,492	20,791	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD		616	616	2,936	40,905	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		—	650	514	7,162	公益事業
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		260	300	985	13,728	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD		—	180	634	8,838	食品・飲料・タバコ
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		—	291	644	8,978	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	22,051	21,801	74,928	1,043,750	
	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		752	746	671	51,200	銀行
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		306	306	45	3,435	メディア・娯楽
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		293	293	45	3,463	資本財
CAPITALAND LTD		612	612	179	13,721	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		61	102	79	6,036	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		27	27	54	4,194	小売
DBS GROUP HOLDINGS LTD		411	409	802	61,164	銀行
KEPPEL CORP LTD		348	348	212	16,215	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD		302	285	565	43,120	銀行
VENTURE CORP LTD		70	70	109	8,380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TECH ENGINEERING		294	385	128	9,776	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,916	1,934	522	39,839	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD		141	141	52	3,989	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		212	187	186	14,189	各種金融
UOL GROUP LTD		138	88	58	4,435	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		562	562	87	6,685	運輸
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		1,857	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WILMAR INTERNATIONAL LTD		444	444	171	13,069	食品・飲料・タバコ
GENTING SINGAPORE LTD		1,397	1,397	107	8,203	消費者サービス
SATS LTD		188	210	59	4,548	運輸
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		635	635	60	4,576	資本財
小計	株数・金額	10,968	9,182	4,199	320,247	
	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 GROUP LTD		189	141	167	5,148	素材
BANK HAPOALIM BM		251	251	550	16,910	銀行
NICE LTD		15	13	851	26,174	ソフトウェア・サービス
BANK LEUMI LE-ISRAEL		316	354	655	20,131	銀行

銘柄		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	ｲｽﾗｴﾙｼｪｹﾙ	千円	
ELBIT SYSTEMS LTD		5	5	275	8,463	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		—	269	290	8,912	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		593	—	—	—	電気通信サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		38	38	262	8,061	銀行
AZRIELI GROUP LTD		11	11	210	6,483	不動産
小計	株数・金額	1,421	1,086	3,263	100,285	
	銘柄数＜比率＞	8	8	—	＜0.1%＞	
合計	株数・金額	290,745	263,885	—	90,255,775	
	銘柄数＜比率＞	1,252	1,236	—	＜95.4%＞	

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

外国投資信託証券

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

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカドル	千円	%
AVALONBAY COMMUNITIES INC		3	3	508	54,923	0.1
小計	口数・金額	279	295	17,627	1,903,421	
	銘柄数<比率>	38	39	－	<2.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1	1	35	2,746	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		－	1	80	6,276	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3	3	33	2,589	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		4	4	61	4,807	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		－	2	30	2,398	0.0
小計	口数・金額	9	13	242	18,817	
	銘柄数<比率>	3	5	－	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		1	1	118	13,967	0.0
KLEPIERRE		5	4	59	7,015	0.0
COVIVIO		1	1	58	6,917	0.0
ICADE		0.932	0.634	39	4,720	0.0
小計	口数・金額	8	7	276	32,620	
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3	3	157	18,648	0.0
小計	口数・金額	3	3	157	18,648	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
ユーロ計	口数・金額	11	10	434	51,269	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		22	17	61	8,165	0.0
HAMMERSON PLC		17	－	－	－	－
LAND SECURITIES GROUP PLC		17	15	88	11,655	0.0
SEGRO PLC		25	25	206	27,365	0.0
小計	口数・金額	83	58	356	47,186	
	銘柄数<比率>	4	3	－	<0.0%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		83	63	97	6,927	0.0
SCENTRE GROUP		121	117	263	18,671	0.0
GPT GROUP		39	45	186	13,217	0.0
MIRVAC GROUP		94	91	200	14,196	0.0
STOCKLAND		47	57	171	12,115	0.0
DEXUS		21	27	247	17,475	0.0
GOODMAN GROUP		39	40	594	42,056	0.0
小計	口数・金額	447	444	1,762	124,661	
	銘柄数<比率>	7	7	－	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		50	54	3,731	51,978	0.1
小計	口数・金額	50	54	3,731	51,978	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.1%>	

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
SUNTEC REIT		53	100	143	10,915	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		58	58	93	7,121	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	45	87	6,691	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		64	64	121	9,261	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		51	63	194	14,813	0.0
小計	口数・金額	227	333	639	48,803	
	銘柄数＜比率＞	4	5	—	＜0.1%＞	
合計	口数・金額	1,110	1,209	—	2,246,139	
	銘柄数＜比率＞	62	65	—	＜2.4%＞	

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	SP EMINI	1,528	—
		SP/TSE60	55	—
		SWISS IX	65	—
		EURO ST	290	—
		SPI 200	98	—
		FTSE100	119	—

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

○投資信託財産の構成

(2020年５月20日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	90,255,775	95.4
投資証券	2,246,139	2.4
コール・ローン等、その他	2,127,205	2.2
投資信託財産総額	94,629,119	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（94,539,008千円）の投資信託財産総額（94,629,119千円）に対する比率は99.9%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年５月20日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　　40,500,882,275円
　期中追加設定元本額　　13,150,569,171円
　期中一部解約元本額　　13,240,037,153円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.3411円です。

○損益の状況 (2019年５月21日～2020年５月20日)

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

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

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

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

［お 知 ら せ］

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

（2019年７月１日）

三菱ＵＦＪ 国内債券マザーファンド

《第20期》決算日2020年５月20日

［計算期間：2019年５月21日～2020年５月20日］

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

運用方針	わが国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ―ＢＰＩ総合）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とし、外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合		債券組入比率	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
16期(2016年５月20日)	14,075	6.7	386.993	6.7	99.3	0.3	219,902
17期(2017年５月22日)	13,798	△2.0	379.387	△2.0	99.3	0.3	212,031
18期(2018年５月21日)	13,877	0.6	381.504	0.6	99.2	0.4	225,098
19期(2019年５月20日)	14,116	1.7	388.062	1.7	99.3	0.2	239,103
20期(2020年５月20日)	14,135	0.1	388.555	0.1	99.5	0.2	242,398

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合		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20日	14,116	－	388.062	－	99.3	0.2
５月末	14,200	0.6	390.322	0.6	97.4	0.2
６月末	14,286	1.2	392.695	1.2	100.4	0.1
７月末	14,302	1.3	393.155	1.3	100.3	0.1
８月末	14,495	2.7	398.496	2.7	97.2	0.2
９月末	14,342	1.6	394.271	1.6	101.9	0.2
10月末	14,284	1.2	392.608	1.2	101.2	0.2
11月末	14,234	0.8	391.325	0.8	100.6	0.2
12月末	14,190	0.5	390.136	0.5	100.6	0.2
2020年１月末	14,251	1.0	391.771	1.0	98.7	0.2
２月末	14,362	1.7	394.745	1.7	97.4	0.2
３月末	14,130	0.1	388.450	0.1	97.2	0.2
４月末	14,179	0.4	389.790	0.4	100.9	0.2
（期末）						
2020年５月20日	14,135	0.1	388.555	0.1	99.5	0.2

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

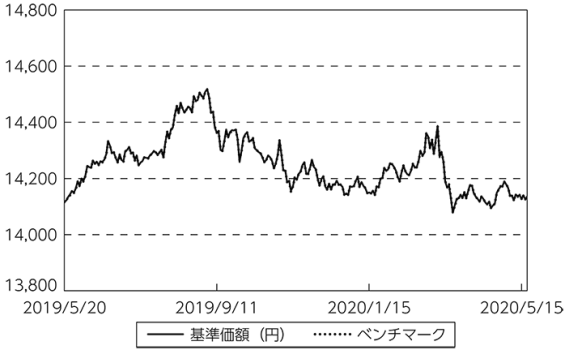
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

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

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

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは0.1%の上昇となったため、カイ離は0.0%程度となりました。
　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。
主なマイナス要因：取引要因によるものです。

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

○１万口当たりの費用明細

（2019年５月21日～2020年５月20日）

項目	当期 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、14,250円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年５月21日～2020年５月20日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	67,966,209	63,390,384
	地方債証券	4,812,010	5,403,873
	特殊債券	6,586,648	5,105,895 (294,070)
	社債券	5,118,093	4,789,017 (100,000)

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建 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	2,006	2,004	－	－

○利害関係人との取引状況等

（2019年５月21日～2020年５月20日）

利害関係人との取引状況

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	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	84,482	23,379	27.7	78,689	27,600	35.1

（注）公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	703	302	1,209

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　付　額
	百万円
公社債	2,200

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

○組入資産の明細

（2020年５月20日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	183,704,000	200,679,370	82.8	－	56.9	17.8	8.0
地方債証券	10,936,350	11,612,991	4.8	－	2.6	1.3	0.9
	(10,936,350)	(11,612,991)	(4.8)	(－)	(2.6)	(1.3)	(0.9)
特殊債券（除く金融債）	13,677,761	14,517,823	6.0	－	3.8	1.6	0.6
	(13,677,761)	(14,517,823)	(6.0)	(－)	(3.8)	(1.6)	(0.6)
金融債券	1,400,000	1,400,135	0.6	－	－	0.4	0.2
	(1,400,000)	(1,400,135)	(0.6)	(－)	(－)	(0.4)	(0.2)
普通社債券	12,771,000	12,912,480	5.3	－	1.7	3.1	0.5
	(12,771,000)	(12,912,480)	(5.3)	(－)	(1.7)	(3.1)	(0.5)
合計	222,489,111	241,122,801	99.5	－	65.0	24.3	10.2
	(38,785,111)	(40,443,430)	(16.7)	(－)	(8.1)	(6.4)	(2.2)

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

(Ｂ)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第15回東京電力パワーグリッド	0.89	100,000	98,168	2030/7/24
第28回東京電力パワーグリッド	1.01	100,000	100,333	2029/7/10
第30回東京電力パワーグリッド	0.58	100,000	100,685	2024/10/9
第31回東京電力パワーグリッド	0.98	100,000	99,955	2029/10/9
第23回東京ガス	1.01	100,000	102,818	2023/6/9
第13回広島ガス	0.405	100,000	99,995	2028/9/13
第６回ＳＣＳＫ	0.14	100,000	99,706	2022/7/21
第４回ファーストリテイリング	0.749	100,000	102,234	2025/12/18
第14回フランス相互信用連合銀行	0.563	100,000	99,903	2021/10/15
第26回フランス相互信用連合銀行	0.443	100,000	99,427	2023/10/12
第29回フランス相互信用連合銀行	0.25	100,000	98,187	2024/10/10
第８回新韓銀行	0.52	300,000	300,027	2022/11/2
第１回韓国石油公社債	0.24	100,000	99,437	2022/1/21
小計		12,771,000	12,912,480	
合計		222,489,111	241,122,801	

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
国内	債券先物取引	１０年国債標準物	百万円 456	百万円 ―

○投資信託財産の構成

（2020年５月20日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	241,122,801	99.3
コール・ローン等、その他	1,581,932	0.7
投資信託財産総額	242,704,733	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年５月20日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　169,381,679,941円
　期中追加設定元本額　44,209,423,557円
　期中一部解約元本額　42,104,144,156円
　また、１口当たり純資産額は、期末1.4135円です。

○損益の状況 (2019年５月21日～2020年５月20日)

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

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

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

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

三菱ＵＦＪ 外国債券マザーファンド

《第20期》決算日2020年５月20日

［計算期間：2019年５月21日～2020年５月20日］

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

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）		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
16期(2016年５月20日)	25,716	△6.5	436.8953	△6.3	98.7	－	73,559
17期(2017年５月22日)	25,920	0.8	441.3251	1.0	98.9	－	54,433
18期(2018年５月21日)	26,312	1.5	446.7912	1.2	98.7	－	48,418
19期(2019年５月20日)	26,691	1.4	453.5333	1.5	98.6	－	51,055
20期(2020年５月20日)	28,109	5.3	479.0346	5.6	98.3	－	46,870

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）		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20日	26,691	－	453.5333	－	98.6	－
５月末	26,639	△0.2	455.6393	0.5	97.5	－
６月末	26,987	1.1	459.5523	1.3	98.7	－
７月末	27,069	1.4	460.6900	1.6	97.6	－
８月末	27,245	2.1	464.2836	2.4	97.0	－
９月末	27,377	2.6	467.4782	3.1	99.1	－
10月末	27,644	3.6	470.0589	3.6	99.0	－
11月末	27,658	3.6	470.8993	3.8	98.4	－
12月末	27,783	4.1	472.8141	4.3	98.8	－
2020年１月末	28,004	4.9	475.3494	4.8	97.6	－
２月末	28,336	6.2	484.7936	6.9	96.3	－
３月末	28,373	6.3	480.5834	6.0	96.2	－
４月末	27,831	4.3	472.8751	4.3	99.6	－
（期末）						
2020年５月20日	28,109	5.3	479.0346	5.6	98.3	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

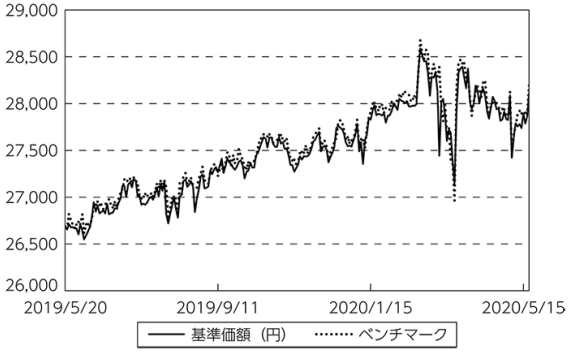
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ5.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

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

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

◎為替市況
・米ドル、ユーロは対円で下落しました。

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
　ベンチマークは5.6%の上昇となったため、カイ離は△0.3%程度となりました。
　ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。
主なプラス要因：ありません。
主なマイナス要因：評価時価差異要因※によるものです。
※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

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

○１万口当たりの費用明細

（2019年５月21日～2020年５月20日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	7	0.025	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(7)	(0.025)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	7	0.025	
期中の平均基準価額は、27,486円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2019年５月21日～2020年５月20日）

公社債

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

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2019年５月21日～2020年５月20日）

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

（2020年５月20日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

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

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

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

○投資信託財産の構成

（2020年５月20日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	46,074,269	98.1
コール・ローン等、その他	890,264	1.9
投資信託財産総額	46,964,533	100.0

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年５月20日現在)

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

＜注記事項＞

①期首元本額　19,128,732,358円
　期中追加設定元本額　4,991,395,696円
　期中一部解約元本額　7,445,334,047円
　また、１口当たり純資産額は、期末2.8109円です。

○損益の状況 (2019年５月21日～2020年５月20日)

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

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

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

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