

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	
信 託 期 間	2023年3月24日まで（2013年10月25日設定）	
運 用 方 針	各マザーファンド受益証券等への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。株式の実質組入比率は、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。債券の実質組入比率は、株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りの部分は国内債券等を組入れます。国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な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。三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、ファンドの運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	TOPIXマザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国株式インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。
	日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	マネー・マーケット・マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	TOPIXマザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	外国株式インデックスマザーファンド	株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分 配 方 針	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	マネー・マーケット・マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）		

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）」およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)

愛称：ファーストラップ（ささえ）

第7期（決算日：2020年3月25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 バランス・イノベーション（株式重視型）」は、去る3月25日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

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

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			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 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金	期 騰 落 中 率						
	円	円		%	%	%	%	%	%	百万円
3期(2016年3月25日)	11,488	0		△2.4	7.7	0.1	73.6	0.1	0.2	61,738
4期(2017年3月27日)	11,535	0		0.4	67.5	1.8	26.8	—	0.8	43,553
5期(2018年3月26日)	12,321	0		6.8	56.7	0.8	37.1	0.0	0.6	27,531
6期(2019年3月25日)	12,534	0		1.7	10.1	0.4	75.1	0.0	0.2	31,437
7期(2020年3月25日)	12,010	0		△4.2	—	—	71.5	0.1	—	28,750

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(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) 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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2019年3月25日	12,534	—	10.1	0.4	75.1	0.0	0.2
3月末	12,555	0.2	7.2	0.5	75.7	0.0	0.2
4月末	12,563	0.2	35.0	1.4	56.9	0.0	0.6
5月末	12,402	△1.1	14.7	0.5	75.0	0.0	0.2
6月末	12,484	△0.4	9.5	0.4	75.7	0.0	0.2
7月末	12,505	△0.2	12.8	0.2	75.2	0.1	0.2
8月末	12,585	0.4	2.7	0.3	74.8	0.0	0.1
9月末	12,497	△0.3	8.8	0.2	76.1	0.0	0.1
10月末	12,459	△0.6	19.3	0.6	75.6	0.0	0.3
11月末	12,512	△0.2	30.7	1.1	62.5	0.0	0.4
12月末	12,608	0.6	49.6	2.0	44.8	0.1	0.7
2020年1月末	12,581	0.4	46.9	1.0	44.5	0.0	0.7
2月末	12,127	△3.2	24.0	0.4	48.8	0.1	0.4
(期 末)							
2020年3月25日	12,010	△4.2	—	—	71.5	0.1	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 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7期：2019年3月26日～2020年3月25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7期首	12,534円
第7期末	12,010円
既払分配金	0円
騰落率	-4.2%

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

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

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.2%の下落となりました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

国内株式の下落などがマイナスに影響しました。

第7期：2019年3月26日～2020年3月25日

投資環境について

【株式】

日本を含む先進国株式市況は下落しました。期首から2020年2月中旬までは堅調に推移したものの、その後は期末にかけて新型肺炎の感染拡大を受け、世界的な実体経済停滞に対する懸念が高まったことなどを背景に下落し、期を通しては下落しました。

【債券】

海外先進国の債券利回りは低下しました。期首から2020年3月上旬にかけては、欧米の中央銀行による金融緩和姿勢や、新型肺炎の感染拡大による世界的な実体経済停滞に対する懸念が高まったことなどを背景に利下げ期待が高まったことなどから低下しました。その後、期末にかけて上昇する局面があったものの、期を通しては低下しました。

日本の債券利回りは上昇しました。期首から2020年3月上旬にかけては、米中通商協議の進展期待などが上昇要因となった一方、海外先進国の債券利回りの低下や新型肺炎の感染拡大による世界的な実体経済停滞に対する懸念が高まったことなどを背景に、利下げ期待が高まったことなどが低下要因となりました。その後期末にかけては上昇し、期を通しては小幅に上昇しました。

【為替】

米ドルは、2020年3月上旬にかけては米国の金利が日本の金利に対して相対的に大きく低下したことや、新型肺炎の感染拡大に対する懸念から投資家のリスク回避姿勢が高まったことなどから、円に対して下落したものの、その後期末にかけては上昇し、期を通しては米ドルは円に対して上昇しました。

ユーロは、欧州の金利が日本の金利に対して相対的に大きく低下したことや、新型肺炎の感染拡大に対する懸念から投資家のリスク回避姿勢が高まったことなどから、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

マザーファンドへの投資を通じて、国内および先進国の株式、債券および短期金融資産に実質的な投資を行いました。

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、各マザーファンドを組み入れた運用を行いました。

株式の組入比率については、投資環境や株式部分の収益寄与に基づいて決定する「株式ウエイトマトリクス」（※「目論見書」運用方法・運用プロセスをご参照ください）を活用しています。

株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りは国内債券等に投資しました。

なお、国内外の債券市場が下落した場合等に債券の組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等への投資を行う場合がありますが、当期は債券の代わりとしてマネー・マーケット・マザーファンドを組入れることはありませんでした。

各資産の組入比率は以下の範囲で変動します。
国内株式（ＴＯＰＩＸマザーファンド）

0.0%～42.5%

先進国株式（外国株式インデックスマザーファンド）

0.0%～42.5%

国内債券（日本債券インデックスマザーファンド）

0.0%～51.0%

先進国債券（ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド）

0.0%～25.0%

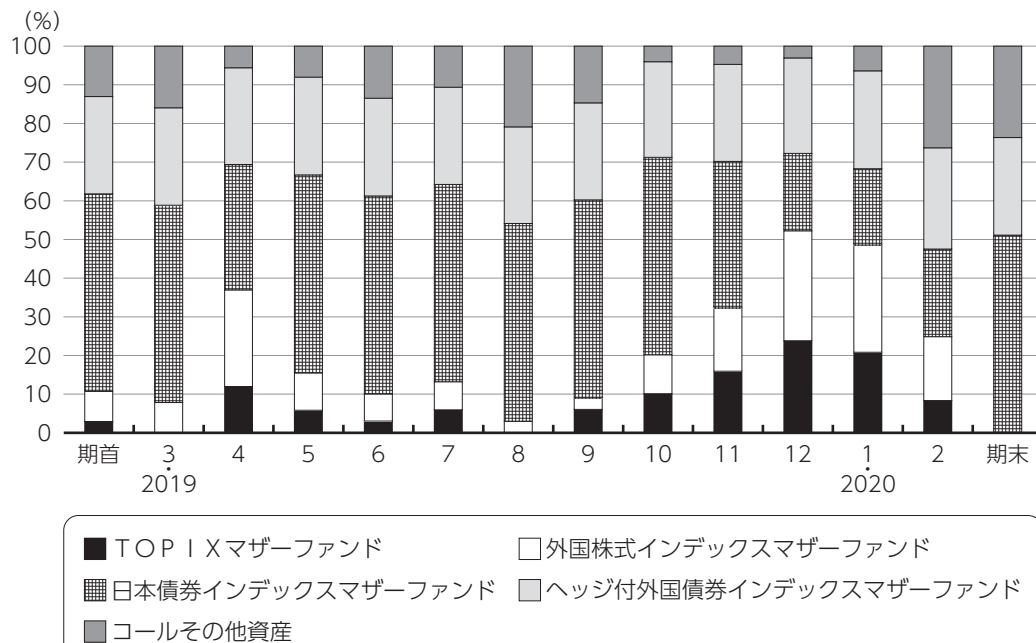
（原則、13.0%～25.0%とします。）

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行いました。その他の実質的な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でした。

期初は、先進国株式を組入れ、国内株式の組入れは抑制していました。2019年4月の初めに「投資環境」の改善などを受け、国内株式の組み入れを再開しました。その後、10月下旬にかけて、国内株式、先進国株式の組み入れを行わない、もしくは概ね低水準での組み入れを行いました。11月の初めから2020年2月中旬にかけては、「投資環境」の改善や「株式部分の収益寄与」が上昇したことなどを受け、国内株式と先進国株式の組入れを引き上げました。しかし、2月下旬から3月初めにかけて「投資環境」や「株式部分の収益寄与」が悪化したことなどを受け、国内株式、先進国株式の組入比率を0%に引き下げ、期末まで組入れを0%で維持しました。

(ご参考)

■資産別組入比率の推移（月末ベース）



▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

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

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第7期 2019年3月26日～2020年3月25日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	2,010

（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。）

各マザーファンドへの投資を通じて、国内および先進国の株式、債券および短期金融資産に実質的な投資を行います。

三菱ＵＦＪ信託銀行の投資助言・情報提供に基づいた運用を行います。

株式の組入比率については、投資環境や株式部分の収益寄与に基づいて決定する「株式ウエイトマトリクス」を活用します。

株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りは国内債券等に投資します。

なお、国内外の債券市場が下落した場合等に債券の組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等への投資を行う場合があります。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な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。

2019年3月26日～2020年3月25日

1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a)信託報酬	177	1.417	(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）	(102)	(0.818)	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）	(68)	(0.545)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(7)	(0.054)	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)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(c)有価証券取引税	1	0.007	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(1)	(0.007)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d)その他費用	1	0.009	(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)	(0.005)	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)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	179	1.434	

期中の平均基準価額は、12,480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。

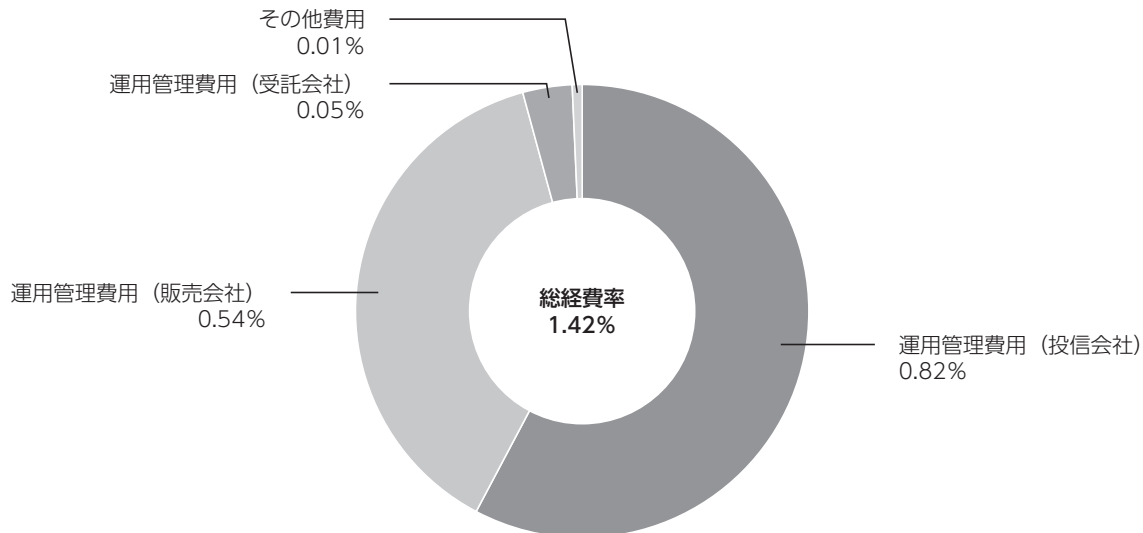
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.42%**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3月26日～2020年3月25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
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	569,554	775,000	1,451,504	1,970,000
ＴＯＰＩＸマザーファンド	16,755,868	29,951,000	17,302,644	29,992,565
外国株式インデックスマザーファンド	10,835,643	31,433,000	11,736,344	33,540,805
日本債券インデックスマザーファンド	20,340,734	27,716,000	21,332,393	28,923,426

○株式売買比率

(2019年3月26日～2020年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	ＴＯＰＩＸマザーファンド	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	689,448,530千円	706,444,814千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	291,909,195千円	434,466,414千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.36	1.62

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年3月26日～2020年3月25日)

利害関係人との取引状況

<三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）>

該当事項はございません。

<ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	2,888,741	621,785	21.5	2,855,576	565,567	19.8
為替直物取引	58,409	18,945	32.4	111,804	77,418	69.2

平均保有割合 3.3%

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

<ＴＯＰＩＸマザーファンド>

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

平均保有割合 1.1%

※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。

<外国株式インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 485,593	百万円 392,371	% 80.8	百万円 396,764	百万円 368,898	% 93.0

平均保有割合 0.9%

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 407,002	百万円 147,846	% 36.3	百万円 417,758	百万円 128,508	% 30.8

平均保有割合 2.0%

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

(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

<ＴＯＰＩＸマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 6,260	百万円 5,730	百万円 3,861

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 2,648	百万円 302	百万円 3,625

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

<ＴＯＰＩＸマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 30

<日本債券インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 4,600

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)	375千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	0.4%

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

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

○組入資産の明細

(2020年3月25日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	6,128,002	5,246,052	7,260,012
ＴＯＰＩＸマザーファンド	546,775	—	—
外国株式インデックスマザーファンド	900,700	—	—
日本債券インデックスマザーファンド	11,866,215	10,874,556	14,693,700

○投資信託財産の構成

(2020年3月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	7,260,012	25.0
日本債券インデックスマザーファンド	14,693,700	50.6
コール・ローン等、その他	7,107,587	24.4
投資信託財産総額	29,061,299	100.0

(注) ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（242,356,055千円）の投資信託財産総額（246,823,140千円）に対する比率は98.2%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=111.16円	1 カナダドル=76.87円	1 メキシコペソ=4.46円	1 ユーロ=119.93円
1 イギリスポンド=130.84円	1 スイスフラン=113.19円	1 スウェーデンクローネ=10.99円	1 ノルウェークローネ=10.02円
1 デンマーククローネ=16.07円	1 ポーランドズロチ=26.03円	1 オーストラリアドル=66.22円	1 ニュージーランドドル=64.61円
1 香港ドル=14.34円	1 シンガポールドル=76.68円	1 イスラエルシェケル=30.75円	1 南アフリカランド=6.33円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年3月25日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	29,061,299,033
コール・ローン等	7,107,586,033
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	7,260,012,058
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	14,693,700,942
(B) 負債	310,538,179
未払解約金	94,113,759
未払信託報酬	215,823,198
未払利息	3,614
その他未払費用	597,608
(C) 純資産総額(A－B)	28,750,760,854
元本	23,938,102,845
次期繰越損益金	4,812,658,009
(D) 受益権総口数	23,938,102,845口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,010円

<注記事項>

- ①期首元本額 25,081,973,518円
 期中追加設定元本額 2,340,829,162円
 期中一部解約元本額 3,484,699,835円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,010円です。

②分配金の計算過程

項 目	2019年3月26日～ 2020年3月25日
費用控除後の配当等収益額	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	3,594,914,684円
分配準備積立金額	1,217,743,325円
当ファンドの分配対象収益額	4,812,658,009円
1万口当たり収益分配対象額	2,010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3月26日～2020年3月25日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,261,095
受取利息	11,926
支払利息	△ 1,273,021
(B) 有価証券売買損益	△ 815,073,404
売買益	1,093,634,650
売買損	△1,908,708,054
(C) 信託報酬等	△ 437,558,835
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,253,893,334
(E) 前期繰越損益金	1,217,743,325
(F) 追加信託差損益金	4,848,808,018
(配当等相当額)	(1,492,928,827)
(売買損益相当額)	(3,355,879,191)
(G) 計(D+E+F)	4,812,658,009
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	4,812,658,009
追加信託差損益金	4,848,808,018
(配当等相当額)	(1,494,662,541)
(売買損益相当額)	(3,354,145,477)
分配準備積立金	1,217,743,325
繰越損益金	△1,253,893,334

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

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

【お 知 ら せ】

- ①株式等を組み入れるマザーファンドにおいて、ベンチマーク等を「配当落ち指数」から「配当込み指数」に変更しました。
②後掲載のマザーファンドは、ベンチマーク等の変更を行う前の報告書を掲載している場合があります。

<訂正のお知らせとお詫び>

「三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）（愛称：ファーストラップ（ささえ））」の運用報告書（全体版）の「第６期：決算日 2019年３月２５日」におきまして、「利害関係人との取引状況等」に下記の通り記載漏れがございました。

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

何卒、今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

記

(誤) 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）（愛称：ファーストラップ（ささえ）） 9 頁
○利害関係人との取引状況等
<ＴＯＰＩＸマザーファンド> (2018年３月27日～2019年３月25日)

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	
		— A	— B		— C	— D
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	176,465	71,101	40.3	190,442	79,523	41.8
貸付有価証券(株式)	347,867	347,867	100.0	345,950	345,950	100.0

ＴＯＰＩＸマザーファンド 18 頁
○利害関係人との取引状況等 (2018年３月27日～2019年３月25日)

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	
		— A	— B		— C	— D
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	176,465	71,101	40.3	190,442	79,523	41.8
貸付有価証券(株式)	347,867	347,867	100.0	345,950	345,950	100.0

(正) 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）（愛称：ファーストラップ（ささえ）） 9 頁
○利害関係人との取引状況等
<ＴＯＰＩＸマザーファンド> (2018年３月27日～2019年３月25日)

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	
		— A	— B		— C	— D
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	176,465	71,101	40.3	190,442	79,523	41.8
新株予約権証券	—	—	—	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	347,867	347,867	100.0	345,950	345,950	100.0

ＴＯＰＩＸマザーファンド 18 頁
○利害関係人との取引状況等 (2018年３月27日～2019年３月25日)

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	
		— A	— B		— C	— D
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	176,465	71,101	40.3	190,442	79,523	41.8
新株予約権証券	—	—	—	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	347,867	347,867	100.0	345,950	345,950	100.0

以上

T O P I X マザーファンド

《第19期》決算日2020年3月25日

[計算期間：2019年3月26日～2020年3月25日]

「T O P I X マザーファンド」は、3月25日に第19期の決算を行いました。

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

運 用 方 針	東証株価指数（T O P I X）（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は、原則として高位を維持します。
主 要 運 用 対 象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落 率	(T O P I X) (配当込み)	期 騰 落 率			
	円	%		%	%	%	百万円
15期(2016年3月25日)	13,743	△12.5	1,905.92	△12.5	98.2	1.9	220,801
16期(2017年3月27日)	15,678	14.1	2,174.27	14.1	98.8	1.0	296,391
17期(2018年3月26日)	17,551	11.9	2,433.96	11.9	98.1	1.1	275,958
18期(2019年3月25日)	16,939	△3.5	2,348.27	△3.5	99.3	1.4	245,020
19期(2020年3月25日)	15,695	△7.3	2,174.58	△7.4	95.4	4.2	244,088

(注) 東証株価指数（T O P I X）（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（T O P I X）（配当込み）（T O P I Xといいます）の指数値およびT O P I X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T O P I Xに関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (TOPIX) (配当込み)	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率				
(期 首) 2019年3月25日	円	%		%	%	%
	16,939	—	2,348.27	—	99.3	1.4
3月末	17,277	2.0	2,395.21	2.0	98.2	1.8
4月末	17,564	3.7	2,434.82	3.7	98.4	1.6
5月末	16,424	△ 3.0	2,275.96	△ 3.1	98.2	1.4
6月末	16,872	△ 0.4	2,338.89	△ 0.4	97.0	3.1
7月末	17,025	0.5	2,360.18	0.5	99.4	0.7
8月末	16,451	△ 2.9	2,280.58	△ 2.9	99.4	0.6
9月末	17,444	3.0	2,418.29	3.0	98.2	1.8
10月末	18,316	8.1	2,539.02	8.1	98.8	1.4
11月末	18,674	10.2	2,588.40	10.2	98.9	1.2
12月末	18,945	11.8	2,625.91	11.8	97.0	3.1
2020年1月末	18,539	9.4	2,569.77	9.4	99.5	0.5
2月末	16,635	△ 1.8	2,305.76	△ 1.8	98.4	0.7
(期 末) 2020年3月25日	15,695	△ 7.3	2,174.58	△ 7.4	95.4	4.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

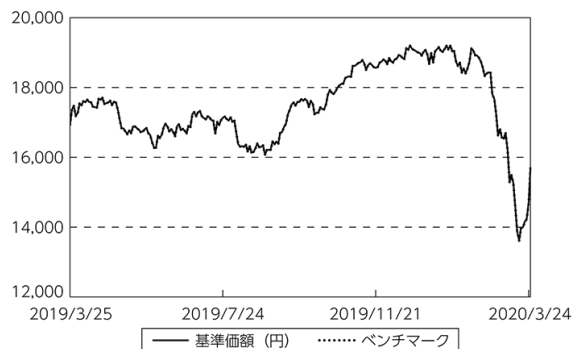
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ7.3%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因
(下落要因)

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

●投資環境について

◎国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・組入要因によるものです。

（主なマイナス要因）

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年3月26日～2020年3月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 0	% 0.002	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) そ の 他 費 用	0	0.000	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、17,480円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2019年3月26日～2020年3月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		184,176	357,845,063	174,898	331,603,466
		(3,018)	(—)		

(注) 金額は受渡代金。

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

新株予約権証券

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証券 — (176,300)	千円 — (—)	証券 176,300	千円 705

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株主割当および権利行使等による増減分です。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 71,009	百万円 64,308	百万円 —	百万円 —

○株式売買比率

(2019年3月26日～2020年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年3月26日～2020年3月25日)

利害関係人との取引状況

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

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 6,260	百万円 5,730	百万円 3,861

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 30

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

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

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

○組入資産の明細

(2020年3月25日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	4.7	5.5	14,646
日本水産	146	157.6	77,696
マルハニチロ	21.1	22.8	51,596
カネコ種苗	4.4	4.8	5,716
サカタのタネ	17.8	18.8	57,340
ホクト	12.2	12	22,416
ホクリョウ	2	2.4	1,500
鉱業 (0.2%)			
住石ホールディングス	31.4	31.8	3,943
日鉄鉱業	3.3	3.6	15,516
三井松島ホールディングス	6.1	6.1	5,746
国際石油開発帝石	585.6	632.2	397,148
石油資源開発	21	20.6	37,347
K&Oエナジーグループ	7.1	7.7	11,342
建設業 (2.7%)			
ヒノキヤグループ	3.1	3.9	5,534
ショーボンドホールディングス	10.4	24.5	98,122
ミライト・ホールディングス	41.1	46.8	62,010
タマホーム	7	8.5	9,877
サンヨーホームズ	2.1	1.4	957
日本アクア	3.5	6.3	3,817
ファーストコーポレーション	4.5	4.8	2,208
ベステラ	2.8	2.7	2,419
T A T E R U	17.8	32.5	3,802
キャンディル	—	1.4	610
スペースバリューホールディングス	17.8	19.2	8,064
ダイセキ環境ソリューション	2.8	3	2,583
第一カッター興業	1.8	1.9	3,030
明豊ファシリティワークス	—	3.8	1,926
安藤・間	93.4	93.8	65,191
東急建設	42.8	46.2	26,657
コムシスホールディングス	51.8	55.9	149,420
ミサワホーム	11.5	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビーアールホールディングス	11.9	17.2	8,531
高松コンストラクショングループ	9.1	9.8	23,637
東建コーポレーション	4.5	4.9	38,808
ソネック	1.5	1.6	1,073
ヤマウラ	5.6	6.8	6,167
大成建設	119.9	121.4	404,262
大林組	361.2	363.9	341,338
清水建設	368.4	369.3	320,183
飛鳥建設	10.3	10.4	10,868
長谷工コーポレーション	150.6	140.9	172,602
松井建設	13.3	14.3	9,266
銭高組	1.5	1.6	4,952
鹿島建設	282.3	285.7	326,269
不動テトラ	8.3	9.5	12,160
大末建設	4.3	4.2	3,397
鉄建建設	7.3	7.9	17,585
西松建設	26	28	61,208
三井住友建設	86.9	87.9	43,510
大豊建設	8.1	8.2	18,802
前田建設工業	85.9	91.2	72,321
佐田建設	7.8	7.8	2,480
ナカノフドー建設	9.2	9.9	3,672
奥村組	19.8	19.7	47,398
東鉄工業	14.5	15.6	44,709
イチケン	2.2	2.6	3,694
富士ビー・エス	3.7	5.4	2,592
浅沼組	4.3	4.1	17,609
戸田建設	140	151.1	95,041
熊谷組	17.2	16.9	43,872
青木あすなろ建設	5.9	—	—
北野建設	2.5	2.2	5,482
植木組	1.5	1.6	3,843
矢作建設工業	16.4	16.1	13,105
ビーエス三菱	12.7	12	6,624

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本ハウスホールディングス	23	24.8	7,291
大東建託	42.9	43.6	454,312
新日本建設	14.3	15.5	12,725
N I P P O	31.9	30.1	65,226
東亜道路工業	2.3	2.3	7,003
前田道路	37.7	38.5	88,781
日本道路	3.3	3.5	22,890
東亜建設工業	10.5	11.3	16,385
日本国土開発	—	26.6	13,805
若築建設	6.1	6.5	8,333
東洋建設	44.1	40.8	17,707
五洋建設	143.2	144.3	77,922
世紀東急工業	17.5	17.5	14,560
福田組	3.9	4.2	16,464
住友林業	85.4	92.2	126,129
日本基礎技術	12.4	12.2	4,623
巴コーポレーション	15	16.2	5,378
大和ハウス工業	333.5	360.1	974,970
ライト工業	23.1	20.8	25,979
積水ハウス	368.8	398.2	735,873
日特建設	10.3	9.5	6,973
北陸電気工事	5.8	6.3	6,224
ユアテック	19.3	20.8	12,188
日本リーテック	—	6.8	10,744
四電工	1.8	2	4,630
中電工	15.5	14.7	32,251
関電工	54.8	51.8	44,030
きんでん	80.1	86.5	134,075
東京エネシス	12.4	12.1	8,978
トーエネック	3.4	3.7	11,858
住友電設	8.3	10.3	21,630
日本電設工業	20.5	20	41,700
協和エクシオ	47.2	55.2	124,089
新日本空調	10.1	9.6	19,104
九電工	23.8	25.5	71,247
三機工業	27.2	26.2	31,544
日揮ホールディングス	103.7	112	100,688
中外炉工業	3.4	3.9	5,814
ヤマト	10.8	11.6	6,786

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ダイキン工業	146.7	147.8	2,075,112	
オルガノ	3.9	4.2	22,848	
トーヨーカネツ	4	5	10,165	
栗田工業	58.2	62.8	158,130	
椿本チエイン	14.1	16.6	41,599	
大同工業	5.1	5.5	3,668	
木村化工機	8.9	9.6	4,406	
アネスト岩田	16.7	18	16,092	
ダイフク	59.2	59.3	380,113	
サムコ	3	3.2	5,344	
加藤製作所	5.5	6.3	7,534	
油研工業	1.8	2	3,092	
タダノ	51.9	56	43,512	
フジテック	39.1	42.2	60,303	
CKD	29.9	32.3	47,739	
キトー	8.1	8.8	8,984	
平和	30	32.4	66,128	
理想科学工業	9.5	10.2	16,258	
SANKYO	26.9	25.8	81,915	
日本金銭機械	11.9	12.8	7,296	
マースグループホールディングス	6.8	7.4	12,535	
フクシマガリレイ	6.6	7.2	24,264	
オーイズミ	4.5	4.9	1,857	
ダイコク電機	4.9	5.3	6,312	
竹内製作所	18	19.4	26,675	
アマノ	30.7	30.4	76,334	
JUKI	15	16.1	9,257	
サンデンホールディングス	13.1	15.2	5,988	
蛇の目ミシン工業	9.8	10.6	3,243	
マックス	16.5	17.7	28,408	
グローリー	29.8	29.8	72,563	
新晃工業	10	10.8	15,087	
大和冷機工業	15.5	16.8	15,405	
セガサミーホールディングス	106.6	115.1	150,090	
日本ビストロリング	3.9	4.2	5,329	
リケン	5	5.4	14,558	
TPR	14.5	15.6	19,921	
ツバキ・ナカシマ	16.3	23.7	16,590	
ホシザキ	31.4	33.9	308,829	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大豊工業	8.8	9.5	5,101
日本精工	220.8	218.5	162,564
N T N	231	268.6	56,674
ジェイテクト	103.1	111.3	91,377
不二越	10	10.8	31,568
日本トムソン	31.9	34.4	13,209
T H K	67	67.5	155,452
ユースン精機	8.3	9	6,075
前澤給装工業	4.2	4.2	8,295
イーグル工業	13.3	14.3	10,796
前澤工業	7.2	7.7	2,340
日本ビラー工業	10.9	11.7	14,274
キッツ	43.6	47	28,764
マキタ	130.8	151.3	500,046
日立造船	85.2	92	32,752
三菱重工業	180.1	194.5	576,011
I H I	82.6	83.6	127,322
スター精密	18.3	17.9	19,922
電気機器 (14.2%)			
日清紡ホールディングス	59.7	77.3	55,192
イビデン	65.8	71.1	162,108
コニカミノルタ	234.9	253.5	121,680
ブラザー工業	140	141.7	236,213
ミネベアミツミ	199.5	215.4	354,763
日立製作所	483.9	557.6	1,788,223
三菱電機	1,074.9	1,160.4	1,544,492
富士電機	69.8	69.9	172,583
東洋電機製造	4.2	4.2	4,872
安川電機	124.6	124.9	384,067
シンフォニアテクノロジー	14.9	15	14,325
明電舎	21.3	21.3	34,506
オリジン	2.9	3.1	4,333
山洋電気	5.2	5.6	23,016
デンヨー	9.9	9.9	18,582
東芝テック	13.5	14.5	50,387
芝浦メカトロニクス	1.9	2.1	5,420
マブチモーター	29.7	32.1	103,522
日本電産	129.3	139.6	1,563,520
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5.8	7	1,694

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
トレックス・セミコンダクター	3.6	6.6	6,652	
東光高岳	5.4	6.5	6,233	
ダブル・スコープ	15.7	18.3	8,967	
宮越ホールディングス	4	4.3	2,377	
ダイヘン	11.8	12.7	36,156	
田淵電機	14.9	—	—	
ヤーマン	15.6	18.9	11,793	
JVCケンウッド	82.1	94.5	18,994	
ミマキエンジニアリング	9.6	10.4	4,232	
第一精工	4.5	4.7	8,638	
日新電機	25.2	27.2	23,963	
大崎電気工業	21.4	23.1	12,104	
オムロン	114.2	104	612,560	
日東工業	17.2	17	29,427	
I D E C	14.4	16.8	22,646	
正興電機製作所	1.9	2.7	2,546	
不二電機工業	1.2	1.4	1,538	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	38.6	38.7	60,642	
サクサホールディングス	2.7	2.7	3,960	
メルコホールディングス	4.5	4	8,404	
テクノメディア	2.4	2.6	4,737	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	—	1.9	921	
日本電気	139.1	140.8	558,272	
富士通	103.6	111.9	1,066,183	
沖電気工業	46.6	47.1	50,302	
岩崎通信機	5	5.1	4,131	
電気興業	5.6	5.6	14,134	
サンケン電気	12.6	12.7	27,635	
ナカヨ	2.1	2.2	3,229	
アイホン	6.1	6.6	9,893	
ルネサスエレクトロニクス	111.4	554.6	240,141	
セイコーエプソン	133.4	144	181,440	
ワコム	77.8	78	24,024	
アルバック	21.4	21.3	59,448	
アクセル	4.5	4.8	2,812	
E I Z O	9.9	9	27,810	
ジャパンディスプレイ	254.2	335.4	16,434	
日本信号	27.4	29.5	32,922	
京三製作所	23.1	27.2	12,403	

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

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
松風	5.2	5.2	9,266
セイコーホールディングス	16.6	16.4	29,831
ニプロ	74.4	80.3	88,410
その他製品 (2.4%)			
中本バックス	3	2.9	3,529
スノーピーク	4.1	5.8	4,344
パラマウントベッドホールディングス	12.4	12.2	51,728
トランザクション	5.8	7.4	5,809
粧美堂	3.1	3.4	1,132
ニホンフラッシュ	4.6	5.4	11,691
前田工繊	11.8	12.8	24,755
永大産業	14.1	15.2	4,408
アートネイチャー	11.5	12.4	8,084
バンダイナムコホールディングス	111.1	120	644,280
アイフィスジャパン	2.4	3	1,848
共立印刷	17.9	19.4	2,968
SHOEI	5.2	5.6	22,904
フランスベッドホールディングス	15.2	16.4	13,956
パイロットコーポレーション	18.7	18.9	65,394
萩原工業	6	6.4	8,128
トッパン・フォームズ	23	24.9	22,758
フジシールインターナショナル	24.1	26	49,634
タカラトミー	45	52	42,796
廣済堂	9.1	8.1	5,864
エステールホールディングス	2.9	3.1	1,925
アーク	41	44.3	3,233
タカノ	4.2	4.5	3,213
プロネックス	9.2	10	10,350
ホクシン	6.6	7.2	892
ウッドワン	3.6	3.9	4,430
大建工業	8.1	7.8	12,667
凸版印刷	151.7	163.8	276,166
大日本印刷	151.5	151.9	341,167
図書印刷	10.1	—	—
共同印刷	3.3	3.6	9,694
N I S S H A	22.1	23.8	17,659
光村印刷	0.9	1	1,265
TAKARA & COMPANY	5.2	5.6	9,251
アシックス	106.7	95.8	96,566

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツツミ	3.4	3.6	6,552
小松ウォール工業	3.3	3.5	6,737
ヤマハ	63.9	69	313,605
河合楽器製作所	3.3	3.6	8,740
クリナップ	10	10.8	5,886
ビジョン	65	70.1	266,029
オリバー	—	2.5	8,000
兼松サステック	0.7	0.7	1,038
キングジム	8.9	9.6	7,728
リンテック	25.6	27.6	59,698
イトーキ	19.8	24.7	8,027
任天堂	66.2	71.2	2,822,368
三菱鉛筆	17.7	19.1	25,059
タカラスタンダード	22.2	24	37,944
コクヨ	51.6	55.7	80,319
ナカバヤシ	10.6	11.4	6,042
グローブライド	5.2	5.2	9,765
オカムラ	37.5	40.5	34,911
美津濃	10.6	10.5	19,729
電気・ガス業 (1.7%)			
東京電力ホールディングス	858.1	926.4	353,884
中部電力	328.9	355	501,437
関西電力	438.6	439.7	492,683
中国電力	148.6	167.4	244,236
北陸電力	105.3	106.1	76,392
東北電力	251.7	289.9	285,551
四国電力	96.8	104.5	86,839
九州電力	221.5	239.2	205,951
北海道電力	100.6	108.6	48,652
沖縄電力	19.9	21.5	39,044
電源開発	85.5	92.3	199,275
エフオン	5.1	6.2	3,050
イーレックス	18.7	16.5	19,981
レノバ	13.2	19.3	17,099
東京瓦斯	210.9	223.2	537,800
大阪瓦斯	208.6	225.2	428,780
東邦瓦斯	53.2	57.1	263,802
北海道瓦斯	5.8	6.2	9,672
広島ガス	22.1	23.9	8,580

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末
			買 建 額 売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 百万円 10,339 —

〇有価証券の貸付及び借入の状況 (2020年3月25日現在)

区 分	当 期 末
	数 量
貸付有価証券<株式>総株数 (モルガン・スタンレーMUFG証券)	株 11,620,100 (4,974,400)

(注) ()内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

(2020年3月25日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年3月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	279,963,283,626
コール・ローン等	45,312,244,104
株式(評価額)	232,815,716,820
未収入金	772,205,210
未収配当金	432,658,283
その他未収収益	57,404,409
差入委託証拠金	573,054,800
(B) 負債	35,874,581,890
未払金	15,212,019,027
未払解約金	1,130,526,409
未払利息	△ 2,203,424
受入担保金	19,534,239,878
(C) 純資産総額(A－B)	244,088,701,736
元本	155,521,677,140
次期繰越損益金	88,567,024,596
(D) 受益権総口数	155,521,677,140口
1万口当たり基準価額(C／D)	15.695円

○損益の状況

(2019年3月26日～2020年3月25日)

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

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

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

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

<注記事項>

①期首元本額	144,648,237,224円	
期中追加設定元本額	243,091,402,690円	
期中一部解約元本額	232,217,962,774円	
また、1口当たり純資産額は、期末1.5695円です。		
②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）		
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド		50,790,692,412円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）		31,979,987,647円
eMAXIS TOPIXインデックス		10,654,280,427円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）		9,924,809,163円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）		8,988,945,317円
三菱UFJ TOPIX・ファンド		7,724,777,644円
つみたて日本株式（TOPIX）		3,566,921,468円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）		3,404,533,401円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）		3,193,400,465円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）		2,885,466,020円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）		2,291,088,282円
eMAXIS バランス（8資産均等型）		2,187,156,516円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）		1,915,137,116円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド		1,704,856,116円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）		1,533,370,129円
国内株式セレクション（ラップ向け）		1,418,965,813円
つみたて8資産均等バランス		1,339,622,487円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1		1,278,905,086円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）		968,589,616円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）		882,732,804円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）		624,564,692円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）		537,084,578円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）		446,401,997円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）		443,083,780円
つみたて4資産均等バランス		397,776,772円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）		380,713,319円
eMAXIS バランス（4資産均等型）		339,997,505円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）		280,568,775円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）		267,655,808円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）		261,441,477円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）		245,849,929円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA		230,875,003円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）		200,062,658円
ファンド・マネジャー（国内株式）		199,069,822円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）		199,009,336円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）		195,305,481円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2019-04（適格機関投資家限定）		158,613,947円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）		147,450,253円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）		142,731,821円
MUAMトピックスリスクコントロール（10%）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）		136,741,102円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2019-11（適格機関投資家限定）		120,109,106円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）		115,644,940円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）		111,059,861円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）		99,593,659円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）		97,539,899円
eMAXIS バランス（波乗り型）		96,621,074円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）		66,522,945円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）		46,177,528円

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

【お 知 ら せ】

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

外国株式インデックスマザーファンド

《第18期》決算日2019年5月13日

[計算期間：2018年5月15日～2019年5月13日]

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月13日に第18期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰 落 中 率	(円換算ベース)	騰 落 中 率				
14期(2015年5月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	227,514
15期(2016年5月12日)	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	270,065
16期(2017年5月12日)	24,302	23.2	163.31	20.4	92.9	1.9	2.4	332,985
17期(2018年5月14日)	26,785	10.2	176.07	7.8	94.4	3.4	2.2	337,226
18期(2019年5月13日)	27,724	3.5	178.38	1.3	93.8	3.8	2.5	437,368

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

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		M S C I K o k u s a i I n d e x (MSCIコクサイインデックス) (円換算ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(期 首) 2018年5月14日	円	%		%	%	%	%
	26,785	—	176.07	—	94.4	3.4	2.2
5月末	26,344	△1.6	172.74	△ 1.9	93.9	3.1	2.2
6月末	26,558	△0.8	174.02	△ 1.2	94.9	3.0	2.3
7月末	27,606	3.1	180.76	2.7	94.8	3.0	2.2
8月末	28,202	5.3	184.18	4.6	92.8	5.5	2.2
9月末	28,916	8.0	188.72	7.2	93.6	4.6	2.1
10月末	26,374	△1.5	171.88	△ 2.4	94.8	2.9	2.4
11月末	26,984	0.7	175.40	△ 0.4	92.8	4.7	2.4
12月末	24,170	△9.8	156.81	△10.9	92.2	6.4	2.4
2019年1月末	25,738	△3.9	166.68	△ 5.3	93.6	3.9	2.5
2月末	27,280	1.8	176.62	0.3	92.8	4.8	2.4
3月末	27,471	2.6	177.42	0.8	91.5	6.2	2.5
4月末	28,697	7.1	185.03	5.1	92.9	4.8	2.4
(期 末) 2019年5月13日	27,724	3.5	178.38	1.3	93.8	3.8	2.5

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

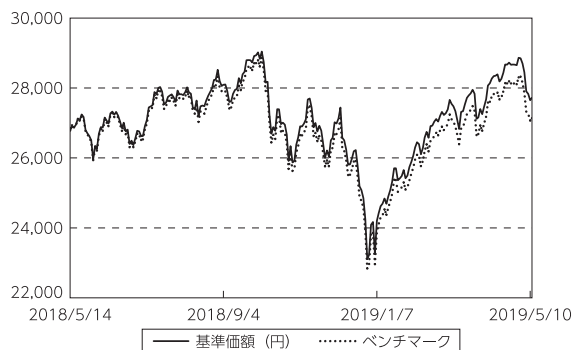
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率
(1.3%) を2.2%上回りました。

基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

- ・外国株式市況は、米国の堅調な企業決算内容などが好感され、上昇しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べて0.4%の円安・米ドル高、5.7%の円高・ユーロ安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは1.3%の上昇になったため、乖離は2.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・配当要因※ 2.2%

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

(主なマイナス要因)

- ・取引要因

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年5月15日～2019年5月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 2	% 0.008	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(1)	(0.004)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(1)	(0.004)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	8	0.030	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(8)	(0.029)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	8	0.028	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	(7)	(0.025)	
(そ の 他)	(1)	(0.004)	
合 計	18	0.066	
期中の平均基準価額は、27,083円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2018年5月15日～2019年5月13日)

株式

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

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

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

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

銘柄		買付		売付	
		口数	金 額	口数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8	1,504	4	827
	小計	643 (21)	38,901 (513)	383 (57)	19,363 (1,194)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4	108	4	108
	小計	4	108	4	108
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	1	257	0.636	85
	KLEPIERRE	8	263	4	150
	UNIBAIL-RODAMCO SE	—	—	(7)	(1,558)
	COVIVIO	1	168	—	—
	ICADE	2	145	2	146
	小計	14	834	7 (7)	381 (1,558)
	オランダ				
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10 (7)	1,885 (1,558)	4	752
	小計	10 (7)	1,885 (1,558)	4	752
	ユ ー ロ 計	25 (7)	2,720 (1,558)	12 (7)	1,134 (1,558)
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	39	230	24	140
	HAMMERSON PLC	30	138	14	64
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32	294	16	147
	SEGRO PLC	55	372	22	140
	小計	157	1,036	77	493
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	VICINITY CENTRES	304	805	197	529
	SCENTRE GROUP	247	1,010	111	439
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIEL/CDI	— (58)	— (870)	58	851
	ONEMARKET LTD	— (7)	— (12)	7	10
	GPT GROUP	86	484	23	118
	MIRVAC GROUP	159	387	53	119
	STOCKLAND	99	398	34	138
	WESTFIELD CORP	—	—	— (158)	— (1,442)
	DEXUS	36	417	12	120
	GOODMAN GROUP	74	870	46	454
	小計	1,007 (66)	4,374 (882)	545 (158)	2,782 (1,442)

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	LINK REIT	94	7,870	50	3,636
	小 計	94	7,870	50	3,636
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	76 (-)	147 (△ 2)	66	118
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	153	285	79	137
	CAPITALAND MALL TRUST	247	543	180	381
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	141 (-)	388 (△ 4)	45	116
	小 計	619 (-)	1,364 (△ 7)	371	753

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株式先物取引	百万円 242,816	百万円 238,585	百万円 —	百万円 —

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

○株式売買比率

(2018年5月15日～2019年5月13日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	327,449,149千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	332,915,144千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.98

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2018年5月15日～2019年5月13日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 263,448	百万円 47,407	% 18.0	百万円 172,797	百万円 40,731	% 23.6

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

○組入資産の明細

(2019年5月13日現在)

外国株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
GODADDY INC - CLASS A		—	179	1,395	153,187	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO		60	—	—	—	素材
WAYFAIR INC- CLASS A		—	63	920	100,976	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		170	211	405	44,552	耐久消費財・アパレル
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		150	171	683	75,000	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		69	98	387	42,575	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		168	217	838	91,991	メディア・娯楽
VAIL RESORTS INC		32	41	940	103,251	消費者サービス
DOMINO'S PIZZA INC		35	39	1,113	122,162	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		149	166	6,281	689,349	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC		69	89	2,220	243,711	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP		119	146	737	80,936	資本財
UGI CORP		136	176	972	106,736	公益事業
WESTAR ENERGY INC		113	—	—	—	公益事業
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		165	224	1,228	134,779	食品・飲料・タバコ
FORTIVE CORP		250	311	2,573	282,435	資本財
IHS MARKIT LTD		318	413	2,325	255,157	商業・専門サービス
XL GROUP LTD		204	—	—	—	保険
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		161	238	1,402	153,873	ソフトウェア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V		162	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COTY INC-CL A		407	503	590	64,795	家庭用品・パーソナル用品
ARCONIC INC		369	467	1,051	115,374	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC		—	153	1,037	113,908	食品・飲料・タバコ
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A		170	256	529	58,128	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		53	66	987	108,368	保険
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC		16	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
TELEFLEX INC		36	46	1,421	155,960	ヘルスケア機器・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC		141	206	678	74,425	電気通信サービス
BEIGENE LTD-ADR		—	33	443	48,709	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENVISION HEALTHCARE CORP		101	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC		354	441	1,006	110,501	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		87	130	1,880	206,411	ヘルスケア機器・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC		83	93	967	106,172	各種金融
DXC TECHNOLOGY CO		228	291	1,720	188,774	ソフトウェア・サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		119	162	736	80,870	保険
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		58	77	796	87,450	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC		165	209	399	43,813	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HD SUPPLY HOLDINGS INC		133	180	779	85,511	資本財
ROLLINS INC		71	152	554	60,887	商業・専門サービス
TESARO INC		33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XPO LOGISTICS INC		—	127	781	85,777	運輸
BAKER HUGHES A GE CO		325	528	1,180	129,494	エネルギー
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC		61	110	433	47,522	保険
DOWDUPONT INC	1,872	2,380	7,494	822,467	素材	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	101	125	395	43,396	運輸	
SQUARE INC - A	215	323	2,134	234,241	ソフトウェア・サービス	
VISTRA ENERGY CORP	271	349	866	95,097	公益事業	
PTC INC	—	117	1,027	112,740	ソフトウェア・サービス	
BROADCOM INC	326	428	13,034	1,430,429	半導体・半導体製造装置	
APERGY CORP	57	—	—	—	エネルギー	
EVERGY INC	—	267	1,552	170,397	公益事業	
ALTICE USA INC- A	—	323	793	87,072	メディア・娯楽	

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
LINDE PLC		—	571	10,378	1,138,927	素材
WIX.COM LTD		—	40	582	63,920	ソフトウェア・サービス
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC		—	278	619	67,936	各種金融
BURLINGTON STORES INC		—	67	1,121	123,043	小売
KKR & CO INC -A		—	483	1,168	128,236	各種金融
ELANCO ANIMAL HEALTH INC		—	286	954	104,766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIGNA CORP		—	394	6,254	686,394	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C		—	158	1,064	116,816	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FOX CORP - CLASS A		—	369	1,424	156,273	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B		—	148	566	62,137	メディア・娯楽
DOW INC		—	793	4,212	462,278	素材
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		929	1,204	831	91,299	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		174	232	874	95,957	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		177	227	1,459	160,202	資本財
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD		—	410	321	35,319	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	244,756	314,557	2,558,910	280,814,854	
	銘 柄 数 < 比 率 >	601	598	—	<64.2%>	
(カナダ)				千カナダドル		
ROYAL BANK OF CANADA		1,166	1,491	15,718	1,283,856	銀行
IMPERIAL OIL LTD		231	298	1,130	92,372	エネルギー
THOMSON REUTERS CORP		232	212	1,823	148,970	商業・専門サービス
TC ENERGY CORP		699	955	6,011	491,037	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		291	377	2,604	212,720	電気通信サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC		490	621	3,335	272,434	保険
TECK RESOURCES LTD-CLS B		457	520	1,528	124,872	素材
BARRICK GOLD CORP		944	1,812	2,915	238,138	素材
BCE INC		115	162	968	79,128	電気通信サービス
BOMBARDIER INC-B		1,756	2,265	482	39,406	資本財
BANK OF MONTREAL		518	662	6,895	563,215	銀行
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		673	875	5,612	458,408	各種金融
BANK OF NOVA SCOTIA		959	1,271	9,193	750,895	銀行
BAUSCH HEALTH COS INC		243	329	1,117	91,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAE INC		192	280	875	71,538	資本財
CAMECO CORP		350	412	570	46,608	エネルギー
CI FINANCIAL CORP		239	261	541	44,214	各種金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		348	458	5,073	414,384	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES		973	1,246	4,729	386,331	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO		598	755	9,368	765,181	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		52	62	895	73,141	小売
ENBRIDGE INC		1,324	2,103	10,390	848,730	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		22	29	1,788	146,123	保険
CGI INC		204	260	2,502	204,425	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC		257	347	466	38,121	エネルギー
IGM FINANCIAL INC		78	78	286	23,394	各種金融
LOBLAW COMPANIES LTD		174	190	1,291	105,484	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP		1,583	2,054	4,888	399,294	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC		275	328	2,081	169,989	自動車・自動車部品
NATIONAL BANK OF CANADA		273	354	2,243	183,261	銀行
ONEX CORPORATION		63	90	679	55,501	各種金融
POWER CORP OF CANADA		278	358	1,068	87,314	保険
POWER FINANCIAL CORP		192	274	855	69,871	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		329	475	1,296	105,879	メディア・娯楽

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC		1,325	1,658	7,089	579,079	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD		36	81	817	66,800	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		116	148	4,357	355,889	運輸
ENCANA CORP		788	1,584	1,401	114,502	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD		189	252	1,365	111,541	素材
FINNING INTERNATIONAL INC		150	162	367	30,037	資本財
GOLDCORP INC		704	—	—	—	素材
KINROSS GOLD CORP		901	1,314	536	43,789	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC		134	165	448	36,617	資本財
GREAT-WEST LIFE CO INC		238	285	911	74,422	保険
METHANEX CORP		65	68	446	36,496	素材
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		670	1,058	194	15,900	素材
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A		73	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC		170	204	1,030	84,146	耐久消費財・アパレル
SAPUTO INC		160	246	1,124	91,866	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LTD		389	563	664	54,309	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP		116	116	570	46,569	電気通信サービス
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		566	700	871	71,184	素材
FORTIS INC		342	430	2,142	175,014	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		345	453	3,665	299,375	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP		484	688	456	37,314	素材
TORONTO-DOMINION BANK		1,478	1,897	14,090	1,150,946	銀行
FRANCO-NEVADA CORP		151	189	1,855	151,550	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		351	466	1,259	102,883	素材
EMPIRE CO LTD 'A'		116	187	574	46,906	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		76	—	—	—	保険
CANADIAN UTILITIES LTD-A		123	149	545	44,543	公益事業
METRO INC/CN		174	250	1,217	99,404	食品・生活必需品小売り
OPEN TEXT CORP		215	273	1,478	120,724	ソフトウェア・サービス
INTACT FINANCIAL CORP		106	140	1,594	130,258	保険
CRESCENT POINT ENERGY CORP		483	—	—	—	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC		814	1,105	1,340	109,481	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		244	401	317	25,940	エネルギー
TOURMALINE OIL CORP		205	277	550	44,979	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		404	524	2,497	203,982	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		101	159	501	40,987	エネルギー
DOLLARAMA INC		86	303	1,213	99,119	小売
KEYERA CORP		173	219	684	55,899	エネルギー
ALTAGAS LTD		155	303	565	46,156	公益事業
ATCO LTD -CLASS I		76	76	344	28,139	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC		138	207	432	35,337	不動産
INTER PIPELINE LTD		300	423	877	71,692	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		151	210	391	31,986	エネルギー
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		228	228	202	16,574	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		16	21	2,419	197,612	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN		183	250	2,255	184,241	消費者サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD		49	49	295	24,101	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B		106	149	833	68,080	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR		352	—	—	—	各種金融
LINAMAR CORP		44	—	—	—	自動車・自動車部品
HYDRO ONE LTD		225	351	769	62,815	公益事業
EMERA INC		54	54	271	22,194	公益事業

銘柄		株数	期首(前期末)		当期		業種等
			株数	株数	期末		
					評価額	金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円		
SHOPIFY INC - CLASS A		71	94	3,264	266,631	ソフトウェア・サービス	
NUTRIEN LTD		515	638	4,465	364,702	素材	
WSP GLOBAL INC		—	102	714	58,352	資本財	
AURORA CANNABIS INC		—	741	834	68,151	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CANOPY GROWTH CORP		—	219	1,394	113,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
STARS GROUP INC/THE		—	199	526	43,008	消費者サービス	
IA FINANCIAL CORP INC		—	121	618	50,503	保険	
CRONOS GROUP INC		—	199	410	33,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計		株数・金額	32,504	43,615	191,304	15,625,753	
銘柄数<比率>			88	88	—	<3.6%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ			
COMMERZBANK AG		855	1,024	775	95,564	銀行	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		1,653	2,072	1,438	177,313	各種金融	
SIEMENS AG-REG		611	794	8,497	1,047,355	資本財	
RWE AG		418	537	1,191	146,813	公益事業	
BASF SE		735	952	6,216	766,157	素材	
VOLKSWAGEN AG		27	33	508	62,617	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		770	943	5,083	626,574	自動車・自動車部品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		140	187	1,643	202,558	家庭用品・パーソナル用品	
E.ON SE		1,767	2,290	2,180	268,805	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		266	347	2,390	294,617	自動車・自動車部品	
BAYER AG-REG		661	967	5,567	686,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALLIANZ SE-REG		356	440	8,755	1,079,118	保険	
MAN SE		25	—	—	—	資本財	
CONTINENTAL AG		88	113	1,523	187,828	自動車・自動車部品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG		910	1,179	2,171	267,646	半導体・半導体製造装置	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		122	154	923	113,790	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		194	234	433	53,474	運輸	
HUGO BOSS AG -ORD		46	67	405	49,957	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE POST AG-REG		778	1,027	2,955	364,220	運輸	
SAP SE		786	1,019	11,240	1,385,365	ソフトウェア・サービス	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE		185	256	396	48,834	メディア・娯楽	
DEUTSCHE BOERSE AG		154	197	2,336	287,959	各種金融	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		172	226	1,639	202,009	ヘルスケア機器・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		29	40	293	36,170	運輸	
ADIDAS AG		150	187	4,719	581,735	耐久消費財・アパレル	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		2,669	3,459	5,159	635,873	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		124	155	3,261	401,991	保険	
THYSSENKRUPP AG		352	425	612	75,494	素材	
BEIERSDORF AG		82	101	994	122,599	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG		119	156	1,070	131,939	素材	
MERCK KGAA		104	130	1,258	155,125	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VOLKSWAGEN AG-PREF		147	192	2,893	356,662	自動車・自動車部品	
PUMA SE		—	8	493	60,851	耐久消費財・アパレル	
LANXESS AG		71	90	426	52,597	素材	
FRESENIUS SE & CO KGAA		332	435	2,194	270,433	ヘルスケア機器・サービス	
HOCHTIEF AG		17	25	300	37,005	資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE		284	374	1,564	192,787	不動産	
GEA GROUP AG		145	171	430	53,089	資本財	
SYMRISE AG		101	127	1,073	132,368	素材	
K+S AG-REG		141	—	—	—	素材	
HENKEL AG & CO KGAA		86	104	864	106,520	家庭用品・パーソナル用品	

銘柄		期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		99	125	431	53,155	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		40	53	323	39,891	自動車・自動車部品
HANNOVER RUECK SE		48	61	791	97,593	保険
BRENNTAG AG		130	167	753	92,827	資本財
AXEL SPRINGER SE		33	49	235	28,967	メディア・娯楽
FUCHS PETROLUB SE -PREF		63	67	238	29,363	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		679	679	193	23,884	電気通信サービス
OSRAM LICHT AG		83	104	299	36,863	資本財
VONOVIA SE		389	511	2,453	302,343	不動産
EVONIK INDUSTRIES AG		122	180	473	58,306	素材
ZALANDO SE		85	122	477	58,901	小売
COVESTRO AG		154	194	854	105,328	素材
SCHAEFFLER AG - PREF		161	—	—	—	自動車・自動車部品
UNIPER SE		162	197	519	64,085	公益事業
INNOGY SE		108	145	582	71,850	公益事業
METRO AG		118	183	255	31,475	食品・生活必需品小売り
KION GROUP AG		53	68	376	46,366	資本財
LINDE AG - TENDER		148	—	—	—	素材
1&1 DRILLISCH AG		39	59	192	23,685	電気通信サービス
MTU AERO ENGINES AG		39	55	1,112	137,174	資本財
WIRECARD AG		94	118	1,599	197,142	ソフトウェア・サービス
DELIVERY HERO SE		—	101	424	52,369	小売
SARTORIUS AG-VORZUG		—	36	595	73,423	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		127	153	555	68,469	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	19,677	24,693	109,627	13,511,533	
	銘柄数<比率>	62	61	—	<3.1%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		1,000	1,232	2,084	256,904	保険
INTESA SANPAOLO		10,692	15,379	3,321	409,347	銀行
TELECOM ITALIA SPA		9,443	12,095	565	69,645	電気通信サービス
ENI SPA		2,038	2,626	3,746	461,750	エネルギー
UNICREDIT SPA		1,602	2,074	2,325	286,627	銀行
ENEL SPA		6,530	8,434	4,681	577,028	公益事業
RECORDATI SPA		72	114	404	49,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLANTIA SPA		364	504	1,158	142,815	運輸
INTESA SANPAOLO-RSP		843	—	—	—	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA		139	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA		524	623	567	69,971	銀行
SNAM SPA		1,864	2,394	1,085	133,745	エネルギー
TELECOM ITALIA-RSP		4,414	6,267	273	33,727	電気通信サービス
LEONARDO SPA		332	423	425	52,492	資本財
TERNA SPA		1,155	1,430	791	97,593	公益事業
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		880	—	—	—	保険
PRYSMIAN SPA		158	247	407	50,244	資本財
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		426	595	548	67,660	食品・飲料・タバコ
POSTE ITALIANE SPA		373	573	515	63,578	保険
MONCLER SPA		—	181	665	82,071	耐久消費財・アパレル
PIRELLI & C SPA		—	430	246	30,356	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	42,860	55,628	23,816	2,935,362	
	銘柄数<比率>	19	18	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)		137	176	1,941	239,235	自動車・自動車部品

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		223	288	9,607	1,184,092	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA		471	618	1,308	161,237	自動車・自動車部品
AXA SA		1,551	2,006	4,433	546,475	保険
DANONE		482	639	4,465	550,335	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA		474	625	1,096	135,120	食品・生活必需品小売り
VIVENDI		826	1,081	2,676	329,888	メディア・娯楽
INGENICO GROUP		43	67	481	59,328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA		613	801	2,090	257,594	銀行
AIR LIQUIDE SA		343	444	5,041	621,379	素材
TOTAL SA		1,922	2,501	11,722	1,444,817	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		399	515	1,752	215,968	資本財
VINCI SA		405	526	4,520	557,141	資本財
SANOFI		909	1,168	8,500	1,047,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		392	565	1,170	144,297	公益事業
L' OREAL		201	261	6,143	757,141	家庭用品・ パーソナル用品
ACCOR SA		154	199	701	86,454	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		453	569	4,058	500,241	資本財
BNP PARIBAS		898	1,164	5,298	652,983	銀行
ESSILORLUXOTTICA		166	298	3,289	405,400	耐久消費財・アパレル
CAPGEMINI SE		128	166	1,733	213,622	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		52	52	174	21,561	食品・生活必需品小売り
VALEO SA		191	245	702	86,534	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL		25	32	2,004	247,007	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA		75	91	911	112,361	消費者サービス
KERING		60	78	3,980	490,563	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA		104	135	1,839	226,757	ソフトウェア・サービス
ATOS SE		76	97	664	81,842	ソフトウェア・サービス
ORANGE		1,599	2,066	2,837	349,767	電気通信サービス
CNP ASSURANCES		126	177	354	43,721	保険
IMERYS SA		32	32	131	16,246	素材
SAFRAN SA		266	345	4,257	524,695	資本財
RENAULT SA		153	199	1,110	136,831	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE		165	226	1,154	142,334	メディア・娯楽
LAGARDERE SCA		110	—	—	—	メディア・娯楽
JCDECAUX SA		67	67	190	23,441	メディア・娯楽
SOCIETE BIC SA		26	29	219	27,033	商業・専門サービス
BOUYGUES SA		176	229	748	92,291	資本財
THALES SA		84	107	1,079	133,069	資本財
PERNOD RICARD SA		170	220	3,379	416,486	食品・飲料・タバコ
CREDIT AGRICOLE SA		910	1,207	1,395	171,939	銀行
ENGIE		1,467	1,893	2,484	306,265	公益事業
ALSTOM		117	161	624	76,916	資本財
ARKEMA		55	73	585	72,220	素材
LEGRAND SA		213	276	1,660	204,671	資本財
SCOR SE		132	176	628	77,467	保険
ADP		23	32	504	62,210	運輸
EDF		447	648	789	97,257	公益事業
NATIXIS		739	932	474	58,429	各種金融
WENDEL		20	26	323	39,876	各種金融
BUREAU VERITAS SA		209	276	596	73,528	商業・専門サービス
EURAZEO SE		32	44	289	35,668	各種金融
EURAZEO SE-NEW		—	2	14	1,777	各種金融

銘柄		株数	株数	期 末		業 種 等
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SUEZ		276	415	514	63,408	公益事業
EIFFAGE		60	81	716	88,329	資本財
ILIAD SA		19	24	252	31,141	電気通信サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		158	169	275	33,960	メディア・娯楽
BIOMERIEUX		29	40	288	35,540	ヘルスケア機器・サービス
GETLINK SE		368	498	710	87,557	運輸
EDENRED		177	243	992	122,386	商業・専門サービス
REMY COINTREAU		20	20	246	30,422	食品・飲料・タバコ
REXEL SA		221	292	322	39,773	資本財
BOLLORE		633	846	349	43,104	運輸
DASSAULT AVIATION SA		1	2	362	44,733	資本財
SEB SA		16	21	338	41,737	耐久消費財・アパレル
IPSEN		28	40	399	49,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA		46	62	380	46,845	各種金融
FAURECIA		62	83	329	40,669	自動車・自動車部品
TELEPERFORMANCE		44	59	981	120,967	商業・専門サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		59	89	746	91,971	メディア・娯楽
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		—	30	375	46,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDLINE SA		—	85	440	54,315	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	21,359	27,984	127,168	15,673,512	
	銘柄 数 < 比 率 >	69	71	—	<3.6%>	
(ユーロ…オランダ)						
QIAGEN N.V.		165	236	764	94,266	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNH INDUSTRIAL NV		824	1,030	882	108,718	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		860	1,129	1,462	180,289	自動車・自動車部品
FERRARI NV		98	128	1,601	197,402	自動車・自動車部品
EXOR NV		86	112	627	77,354	各種金融
AIRBUS SE		464	604	7,099	875,052	資本財
STMICROELECTRONICS NV		510	694	1,036	127,752	半導体・半導体製造装置
WOLTERS KLUWER		232	290	1,758	216,726	商業・専門サービス
KONINKLIJKE KPN NV		2,775	3,377	915	112,806	電気通信サービス
AKZO NOBEL N.V.		201	233	1,746	215,203	素材
HEINEKEN NV		206	269	2,580	318,055	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE PHILIPS NV		751	961	3,573	440,450	ヘルスケア機器・サービス
RELX NV		772	—	—	—	商業・専門サービス
AEGON NV		1,435	1,879	805	99,234	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		1,023	1,228	2,527	311,553	食品・生活必需品小売り
RANDSTAD NV		97	117	577	71,231	商業・専門サービス
HEINEKEN HOLDING NV		94	122	1,098	135,430	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		145	185	1,831	225,681	素材
ING GROEP NV		3,104	4,034	4,213	519,276	銀行
ASML HOLDING NV		310	425	7,460	919,514	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV-CVA		1,302	1,603	8,481	1,045,352	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		48	83	318	39,309	エネルギー
BOSKALIS WESTMINSTER		82	—	—	—	資本財
NN GROUP NV		244	316	1,176	145,056	保険
ALTICE EUROPE NV		479	—	—	—	メディア・娯楽
ABN AMRO GROUP NV-CVA		340	428	829	102,232	銀行
ADYEN NV		—	11	723	89,152	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	16,659	19,505	54,094	6,667,108	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	24	—	<1.5%>	

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		216	269	403	49,705	資本財
ENDESA SA		243	318	709	87,473	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		195	273	1,030	126,998	資本財
IBERDROLA SA		4,657	6,433	5,141	633,744	公益事業
TELEFONICA SA		3,732	4,838	3,438	423,844	電気通信サービス
BANCO SANTANDER SA		12,896	16,803	6,925	853,558	銀行
BANKINTER SA		515	662	449	55,421	銀行
REPSOL SA		1,001	1,454	2,078	256,139	エネルギー
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA		5,322	6,895	3,501	431,549	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		277	372	966	119,134	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		871	1,128	2,842	350,349	小売
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		558	—	—	—	運輸
MAPFRE SA		969	1,250	327	40,366	保険
FERROVIAL SA		392	516	1,061	130,774	資本財
ENAGAS SA		172	240	609	75,080	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		363	435	823	101,500	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		4,391	5,932	617	76,151	銀行
CAIXABANK SA		2,858	3,668	1,007	124,198	銀行
GRIFOLS SA		241	308	710	87,545	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP SA		350	454	3,012	371,306	ソフトウェア・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		483	—	—	—	運輸
BANKIA SA		911	1,302	303	37,414	銀行
AENA SME SA		54	69	1,138	140,372	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	41,679 23	53,629 21	37,100 —	4,572,629 <1.0%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS		155	198	901	111,063	保険
UCB SA		105	128	875	107,877	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		67	87	722	89,077	各種金融
UMICORE		170	217	662	81,634	素材
COLRUYT SA		53	63	407	50,241	食品・生活必需品小売り
KBC GROUP NV		200	262	1,572	193,769	銀行
SOLVAY SA		57	76	694	85,580	素材
PROXIMUS		107	168	418	51,587	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		35	59	278	34,346	メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		609	790	5,855	721,654	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,562 10	2,052 10	12,388 —	1,526,833 <0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		244	320	1,076	132,719	銀行
VERBUND AG		—	71	314	38,710	公益事業
OMV AG		120	157	691	85,254	エネルギー
VOESTALPINE AG		89	123	326	40,195	素材
ANDRITZ AG		51	73	261	32,171	資本財
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		111	145	336	41,474	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	617 5	890 6	3,006 —	370,525 <0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP		25	42	198	24,465	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		—	818	613	75,584	不動産
TENARIS SA		380	497	580	71,569	エネルギー
SES		317	369	568	70,106	メディア・娯楽

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ルクセンブルク)		百株	百株	千ユーロ	千円	
EUROFINS SCIENTIFIC		10	12	497	61,260	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 素材
ARCELORMITTAL		533	707	1,149	141,671	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,266	2,448	3,607	444,657	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
NOKIA OYJ		4,662	5,834	2,533	312,232	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STORA ENSO OYJ-R SHS		450	552	590	72,763	素材
NOKIAN RENKAAT OYJ		84	112	293	36,148	自動車・自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		426	566	1,377	169,798	素材
FORTUM OYJ		367	455	848	104,592	公益事業
KONE OYJ-B		269	353	1,756	216,526	資本財
METSO OYJ		102	108	336	41,511	資本財
SAMPO OYJ-A SHS		357	465	1,838	226,557	保険
WARTSILA OYJ ABP		368	472	638	78,705	資本財
ELISA OYJ		110	150	578	71,287	電気通信サービス
NESTE OYJ		104	407	1,175	144,846	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		69	99	291	35,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数 ・ 金 額	7,372	9,578	12,258	1,510,910	
	銘 柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		128	168	1,722	212,307	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		—	160	713	87,973	資本財
PADDY POWER BETFAIR PLC		68	80	557	68,708	消費者サービス
BANK OF IRELAND GROUP PLC		761	1,020	540	66,665	銀行
AIB GROUP PLC		667	897	362	44,627	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		—	228	590	72,797	素材
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD		472	472	—	—	銀行
CRH PLC		676	851	2,429	299,435	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	2,775	3,879	6,916	852,515	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	8	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,874	2,590	852	105,061	公益事業
JERONIMO MARTINS		183	243	335	41,341	食品・生活必需品小売り
GALP ENERGIA SGPS SA		412	525	729	89,912	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	2,469	3,359	1,917	236,315	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	158,300	203,649	391,901	48,301,903	
	銘 柄 数 < 比 率 >	240	240	—	<11.0%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC		13,647	17,749	2,795	399,162	銀行
BP PLC		15,849	20,780	10,893	1,555,193	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		57,648	73,795	4,505	643,212	銀行
ASTRAZENECA PLC		1,013	1,314	7,480	1,068,037	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC		328	419	628	89,716	資本財
NEXT PLC		120	149	839	119,816	小売
DIAGEO PLC		1,998	2,518	8,172	1,166,805	食品・飲料・タバコ
SKY PLC		825	—	—	—	メディア・娯楽
BAE SYSTEMS PLC		2,553	3,251	1,526	217,886	資本財
UNILEVER PLC		986	1,152	5,314	758,741	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC		7,792	10,156	2,458	351,065	食品・生活必需品小売り
RELX PLC		856	2,042	3,557	507,866	商業・専門サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		1,211	1,677	455	64,967	小売

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		534	697	4,286	612,019	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC		2,072	2,683	4,326	617,675	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		4,789	6,250	1,693	241,827	保険
SAGE GROUP PLC/THE		893	1,100	786	112,332	ソフトウェア・サービス
HSBC HOLDINGS PLC		16,007	20,786	13,552	1,934,886	銀行
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,835	2,380	6,757	964,703	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC		528	706	563	80,386	公益事業
SCHRODERS PLC		92	119	366	52,369	各種金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		2,880	5,062	1,179	168,332	銀行
BHP GROUP PLC		1,695	2,189	3,816	544,949	素材
IMPERIAL BRANDS PLC		763	990	2,143	306,049	食品・飲料・タバコ
WPP PLC		1,008	1,336	1,286	183,650	メディア・娯楽
CENTRICA PLC		4,515	5,907	546	78,093	公益事業
BT GROUP PLC		6,753	8,750	1,827	260,859	電気通信サービス
SSE PLC		824	1,039	1,156	165,092	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC		2,639	2,919	1,984	283,380	銀行
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		1,327	1,767	1,624	231,864	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT		86,184	125,524	12	1,792	資本財
COMPASS GROUP PLC		1,269	1,645	2,809	401,141	消費者サービス
KINGFISHER PLC		1,819	2,231	542	77,425	小売
PEARSON PLC		662	815	654	93,414	メディア・娯楽
SEVERN TRENT PLC		191	255	500	71,500	公益事業
RIO TINTO PLC		971	1,198	5,286	754,772	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC		3,939	5,148	7,732	1,103,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3I GROUP PLC		782	1,004	1,047	149,568	各種金融
VODAFONE GROUP PLC		21,368	27,677	3,847	549,259	電気通信サービス
WM MORRISON SUPERMARKETS		1,697	2,401	517	73,862	食品・生活必需品小売り
SAINSBURY (J) PLC		1,421	1,772	375	53,579	食品・生活必需品小売り
AVIVA PLC		3,220	3,963	1,645	234,867	保険
JOHNSON MATTHEY PLC		155	201	635	90,671	素材
RSA INSURANCE GROUP PLC		840	1,102	611	87,260	保険
WHITBREAD PLC		148	194	879	125,559	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC		2,727	3,526	2,946	420,713	公益事業
FERGUSON PLC		200	—	—	—	資本財
BUNZL PLC		262	343	730	104,349	資本財
COBHAM PLC		1,705	—	—	—	資本財
ANGLO AMERICAN PLC		1,070	1,092	2,068	295,350	素材
INTERTEK GROUP PLC		132	172	883	126,090	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		346	425	817	116,648	耐久消費財・アパレル
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		146	172	836	119,417	消費者サービス
CARNIVAL PLC		149	174	689	98,394	消費者サービス
PERSIMMON PLC		250	321	672	96,048	耐久消費財・アパレル
MEGGITT PLC		565	810	433	61,849	資本財
ITV PLC		2,817	3,763	449	64,129	メディア・娯楽
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		250	324	1,646	235,037	各種金融
G4S PLC		1,159	1,704	358	51,174	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		99	122	453	64,715	耐久消費財・アパレル
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		781	1,064	640	91,465	耐久消費財・アパレル
IMI PLC		192	—	—	—	資本財
SMITH & NEPHEW PLC		702	907	1,463	208,893	ヘルスケア機器・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		2,655	3,313	587	83,818	耐久消費財・アパレル
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		3,638	4,669	11,331	1,617,803	エネルギー

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
TRAVIS PERKINS PLC		179	—	—	—	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		2,999	3,884	9,451	1,349,334	エネルギー
OLD MUTUAL PLC		3,961	—	—	—	保険
INVESTEC PLC		491	745	355	50,825	各種金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		2,145	2,689	715	102,128	各種金融
EXPERIAN PLC		743	942	2,056	293,668	商業・専門サービス
MONDI PLC		299	384	636	90,874	素材
WEIR GROUP PLC/THE		198	247	397	56,732	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		286	377	946	135,113	食品・飲料・タバコ
ANTOFAGASTA PLC		286	408	341	48,689	素材
SHIRE PLC		726	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADMIRAL GROUP PLC		148	209	430	61,440	保険
FRESNILLO PLC		155	211	153	21,914	素材
RANDGOLD RESOURCES LTD		72	—	—	—	素材
BABCOCK INTL GROUP PLC		227	227	118	16,898	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC		422	543	598	85,399	各種金融
GLENORE PLC		9,805	11,709	3,288	469,501	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC		196	302	695	99,249	各種金融
CRODA INTERNATIONAL PLC		107	132	674	96,242	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC		3,769	5,084	926	132,338	資本財
COCA-COLA HBC AG-DI		139	209	572	81,675	食品・飲料・タバコ
EASYJET PLC		118	192	199	28,430	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		1,067	1,489	466	66,594	保険
ROYAL MAIL PLC		686	980	239	34,139	運輸
ASHTREAD GROUP PLC		400	508	1,032	147,351	資本財
MERLIN ENTERTAINMENT		651	681	251	35,944	消費者サービス
TUI AG-DI		358	469	388	55,473	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		330	368	657	93,820	ソフトウェア・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		339	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NMC HEALTH PLC		—	116	307	43,948	ヘルスケア機器・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		695	959	549	78,391	メディア・娯楽
DCC PLC		71	104	689	98,385	資本財
GVC HOLDINGS PLC		413	618	369	52,761	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC		1,236	1,236	181	25,875	ヘルスケア機器・サービス
JOHN WOOD GROUP PLC		525	695	311	44,423	エネルギー
INFORMA PLC		—	1,275	956	136,608	メディア・娯楽
FERGUSON PLC		—	242	1,338	191,101	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	332,787	435,994	180,925	25,830,778	
	銘柄 数 < 比 率 >	99	93	—	<5.9%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		2,489	3,177	30,978	3,361,774	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		418	540	3,845	417,367	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		1,941	2,648	3,283	356,374	各種金融
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		364	503	2,602	282,420	素材
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		562	729	18,812	2,041,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GIVAUDAN-REG		7	9	2,462	267,254	素材
SONOVA HOLDING AG-REG		40	55	1,147	124,502	ヘルスケア機器・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		121	156	4,952	537,455	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG		8	11	913	99,186	ヘルスケア機器・サービス
LONZA GROUP AG-REG		59	77	2,429	263,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWATCH GROUP AG/THE-REG		39	62	343	37,231	耐久消費財・アパレル
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		34	40	852	92,514	資本財

銘柄		株数	株数	当 期 末		業 種 等
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
GEBERIT AG-REG		29	38	1,760	191,053	資本財
SWISS RE AG		251	315	2,862	310,656	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR		25	31	909	98,717	耐久消費財・アパレル
PARGESA HOLDING SA-BR		26	36	282	30,696	各種金融
NOVARTIS AG-REG		1,779	2,249	18,475	2,004,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG		133	165	937	101,719	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG		21	27	1,280	138,981	電気通信サービス
ABB LTD-REG		1,473	1,907	3,690	400,493	資本財
CLARIANT AG-REG		191	191	371	40,356	素材
SGS SA-REG		4	5	1,475	160,147	商業・専門サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		14	22	458	49,706	資本財
TEMENOS AG - REG		—	60	992	107,689	ソフトウェア・サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		43	56	774	84,003	運輸
BALOISE HOLDING AG - REG		39	49	809	87,864	保険
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		26	35	1,616	175,388	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.08	0.09	678	73,641	食品・飲料・タバコ
JULIUS BAER GROUP LTD		179	237	1,082	117,428	各種金融
SIKA AG-REG		1	133	2,058	223,407	素材
SWISS PRIME SITE-REG		56	82	677	73,574	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.88	1	693	75,261	食品・飲料・タバコ
PARTNERS GROUP HOLDING AG		14	18	1,344	145,940	各種金融
BARRY CALLEBAUT AG-REG		1	2	393	42,673	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		7	8	529	57,416	素材
UBS GROUP AG-REG		2,926	3,997	4,853	526,699	各種金融
DUFREY AG-REG		25	36	344	37,373	小売
VIFOR PHARMA AG		38	45	621	67,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALCON INC		—	449	2,824	306,527	ヘルスケア機器・サービス
小 計		株数・金額	13,398	18,221	125,424	13,611,088
銘柄数<比率>			37	39	—	<3.1%>
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
ELECTROLUX AB-SER B		187	261	5,916	67,447	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS		2,457	3,187	28,193	321,407	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS		314	389	9,947	113,397	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		1,217	1,671	14,926	170,162	銀行
INVESTOR AB-B SHS		363	459	19,793	225,646	各種金融
NORDEA BANK AB		2,432	—	—	—	銀行
GETINGE AB-B SHS		143	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		1,225	1,586	16,049	182,962	銀行
ATLAS COPCO AB-A SHS		535	708	19,759	225,262	資本財
SKF AB-B SHARES		297	403	6,512	74,242	資本財
ASSA ABLOY AB-B		802	1,046	20,465	233,304	資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		758	928	14,765	168,331	小売
SANDVIK AB		903	1,169	18,977	216,344	資本財
SWEDBANK AB - A SHARES		726	958	14,058	160,263	銀行
SECURITAS AB-B SHS		230	333	5,430	61,912	商業・専門サービス
SKANSKA AB-B SHS		250	363	5,816	66,309	資本財
SWEDISH MATCH AB		145	173	8,122	92,597	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		256	518	6,572	74,928	電気通信サービス
TELIA CO AB		2,270	2,919	11,793	134,444	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS		1,249	1,625	22,763	259,503	資本財
ALFA LAVAL AB		226	302	6,337	72,250	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB		164	201	5,698	64,959	エネルギー

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローネ 千円	
BOLIDEN AB	222	283	6,750	76,959	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	381	470	4,045	46,113	耐久消費財・アパレル
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	46	73	4,012	45,737	電気通信サービス
HEXAGON AB-B SHS	208	262	12,637	144,071	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINNEVIK AB - B	185	262	6,924	78,933	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	150	150	3,060	34,889	各種金融
ICA GRUPPEN AB	72	72	2,648	30,188	食品・生活必需品小売り
LUNDBERGS AB-B SHS	33	66	2,061	23,504	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B	484	636	17,836	203,339	家庭用品・パーソナル用品
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	289	—	—	—	資本財
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	494	—	—	—	資本財
EPIROC AB-B	—	440	3,956	45,101	資本財
EPIROC AB-A	—	643	6,020	68,637	資本財
NORDEA BANK ABP	—	3,152	23,226	264,785	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	19,728 33	25,723 32	355,082 —	4,047,937 <0.9%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	785	1,002	15,470	194,468	銀行
NORSK HYDRO ASA	1,047	1,415	4,680	58,835	素材
ORKLA ASA	665	802	6,002	75,455	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA	931	1,200	21,970	276,166	エネルギー
TELENOR ASA	602	777	13,477	169,414	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	139	182	6,643	83,511	素材
MOWI ASA	334	430	8,552	107,503	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	137	193	3,254	40,903	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	80	109	2,334	29,340	メディア・娯楽
AKER BP ASA	—	117	3,021	37,985	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,723 9	6,233 10	85,408 —	1,073,583 <0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	1,491	1,884	60,294	995,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S-B SHARES	185	226	7,341	121,213	素材
DANSKE BANK A/S	598	742	8,321	137,391	銀行
DEMANT A/S	82	104	2,326	38,410	ヘルスケア機器・サービス
H LUNDBECK A/S	62	62	1,701	28,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	172	202	11,557	190,820	資本財
CARLSBERG AS-B	87	108	9,514	157,081	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B	96	123	8,840	145,960	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S	152	189	11,472	189,414	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	5	7	5,993	98,949	運輸
TRYG A/S	87	121	2,484	41,016	保険
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	2	3	2,807	46,357	運輸
PANDORA A/S	86	122	3,385	55,890	耐久消費財・アパレル
ISS A/S	127	183	3,940	65,052	商業・専門サービ
CHR HANSEN HOLDING A/S	79	99	7,058	116,535	素材
GENMAB A/S	47	62	6,795	112,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S	153	193	10,126	167,187	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	3,518 17	4,439 17	163,962 —	2,707,014 <0.6%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
BHP GROUP LTD	2,576	3,059	11,259	862,579	素材
CSL LTD	362	470	9,279	710,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
ALUMINA LTD		2,184	2,703	608	46,604	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		749	976	3,488	267,270	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP		2,355	2,979	8,194	627,802	銀行
RIO TINTO LTD		332	386	3,684	282,252	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		1,123	1,364	1,726	132,275	保険
LENDLEASE GROUP		424	627	799	61,274	不動産
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		1,404	1,838	13,865	1,062,197	銀行
WESTPAC BANKING CORP		2,720	3,570	9,718	744,550	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		2,154	2,846	7,382	565,593	銀行
BRAMBLES LTD		1,296	1,640	2,012	154,199	商業・専門サービス
BORAL LTD		920	1,267	607	46,522	素材
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,047	1,372	4,528	346,900	食品・生活必需品小売り
TELSTRA CORP LTD		3,433	4,389	1,496	114,666	電気通信サービス
AMP LTD		2,446	3,147	698	53,531	各種金融
TABCORP HOLDINGS LTD		1,472	2,062	950	72,853	消費者サービス
AMCOR LIMITED		947	1,197	1,922	147,309	素材
COMPUTERSHARE LTD		359	462	828	63,507	ソフトウェア・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		442	599	1,560	119,547	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD		260	336	4,199	321,707	各種金融
CIMIC GROUP LTD		91	94	427	32,746	資本財
ASX LTD		160	198	1,498	114,798	各種金融
COCA-COLA AMATIL LTD		393	584	516	39,588	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		46	63	1,244	95,313	ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		363	441	812	62,246	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		521	552	219	16,849	小売
NEWCREST MINING LTD		624	789	2,010	154,030	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		1,917	2,355	1,865	142,922	保険
ORIGIN ENERGY LTD		1,418	1,780	1,337	102,465	エネルギー
ORICA LTD		277	399	776	59,497	素材
SONIC HEALTHCARE LTD		318	476	1,254	96,094	ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD		1,469	1,881	1,315	100,775	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD		1,053	1,343	1,836	140,663	保険
TRANSURBAN GROUP		1,793	2,794	3,795	290,742	運輸
WESFARMERS LTD		908	1,179	4,315	330,641	小売
BLUESCOPE STEEL LTD		432	583	775	59,419	素材
CHALLENGER LTD		432	610	490	37,557	各種金融
SYDNEY AIRPORT		851	1,232	950	72,823	運輸
CALTEX AUSTRALIA LTD		204	291	760	58,262	エネルギー
OIL SEARCH LTD		1,098	1,406	1,066	81,678	エネルギー
WORLEYPARSONS LTD		—	363	500	38,338	エネルギー
AGL ENERGY LTD		539	667	1,532	117,384	公益事業
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,146	1,590	1,199	91,895	素材
AUSNET SERVICES		1,869	1,869	346	26,561	公益事業
CROWN RESORTS LTD		266	379	501	38,393	消費者サービス
INCITEC PIVOT LTD		1,244	1,623	531	40,680	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		438	545	576	44,167	銀行
AURIZON HOLDINGS LTD		1,595	2,121	1,054	80,792	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD		596	773	1,167	89,436	食品・飲料・タバコ
RAMSAY HEALTH CARE LTD		115	150	956	73,304	ヘルスケア機器・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L		51	51	206	15,812	消費者サービス
SEEK LTD		300	372	748	57,333	商業・専門サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD		382	376	336	25,766	銀行

銘柄		株数	株数	期末		業種等
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
REA GROUP LTD		49	50	417	31,953	メディア・娯楽
TPG TELECOM LTD		341	341	216	16,614	電気通信サービス
HEALTHSCOPE LTD		1,606	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,135	3,016	868	66,560	保険
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		58	63	259	19,914	消費者サービス
SOUTH32 LTD		4,168	5,138	1,690	129,511	素材
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		—	135	311	23,849	エネルギー
COLES GROUP LTD		—	1,184	1,504	115,275	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	60,303	77,180	131,010	10,036,709	
	銘柄数<比率>	59	61	—	<2.3%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,288	1,923	696	50,319	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		863	993	836	60,459	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		458	576	920	66,483	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		629	862	441	31,899	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD		360	360	422	30,511	ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD		851	1,237	520	37,631	公益事業
MERCURY NZ LTD		643	—	—	—	公益事業
A2 MILK CO LTD		—	738	1,178	85,168	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	5,095	6,693	5,016	362,474	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
WHARF HOLDINGS LTD		920	1,170	2,638	36,884	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		365	510	4,926	68,873	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,163	2,808	22,399	313,141	資本財
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,160	1,660	22,244	310,971	不動産
MTR CORP		1,180	1,635	7,553	105,600	運輸
HONG KONG & CHINA GAS		6,831	9,704	18,167	253,981	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT		4,940	6,570	8,251	115,361	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,155	1,435	8,000	111,841	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		943	1,239	31,222	436,494	各種金融
HANG LUNG GROUP LTD		850	880	1,905	26,634	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD		1,490	2,180	3,723	52,053	不動産
CLP HOLDINGS LTD		1,335	1,725	15,102	211,131	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		935	1,369	6,511	91,035	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		908	1,366	3,299	46,125	銀行
HANG SENG BANK LTD		613	795	16,138	225,616	銀行
HYSAN DEVELOPMENT CO		570	710	3,028	42,333	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,220	1,220	1,288	18,010	消費者サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		244	334	2,904	40,599	半導体・半導体製造装置
SINO LAND CO		2,294	3,334	4,340	60,685	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		480	765	1,897	26,522	耐久消費財・アパレル
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		505	710	4,451	62,234	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		2,965	3,870	12,751	178,268	銀行
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		1,105	1,385	7,243	101,264	耐久消費財・アパレル
PCCW LTD		4,060	4,060	1,940	27,130	電気通信サービス
LI & FUNG LTD		5,420	—	—	—	耐久消費財・アパレル
KERRY PROPERTIES LTD		605	605	1,948	27,234	不動産
MINTH GROUP LTD		540	840	2,032	28,418	自動車・自動車部品
NWS HOLDINGS LTD		1,465	1,785	2,898	40,525	資本財
SANDS CHINA LTD		1,948	2,464	10,213	142,781	消費者サービス
WHEELLOCK & CO LTD		620	840	4,582	64,059	不動産

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

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(イスラエル) FRUTAROM		百株 26	百株 —	千イスラエルシェケル —	千円 —
					素材
小 計	株 数 ・ 金 額	4,644	5,441	14,595	449,845
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	<0.1%>
合 計	株 数 ・ 金 額	1,002,429	1,284,294	—	410,232,624
	銘柄 数 < 比 率 >	1,262	1,253	—	<93.8%>

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

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

外国投資信託証券

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

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダドル	千円	%
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		5	5	192	15,713	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		12	12	283	23,178	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		13	13	360	29,485	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	31	31	837	68,376	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA		3	4	664	81,883	0.0
KLEPIERRE		17	21	657	80,991	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE		7	—	—	—	—
COVIVIO		3	4	484	59,675	0.0
ICADE		3	3	241	29,770	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	35	34	2,047	252,321	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	14	2,108	259,844	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	—	14	2,108	259,844	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	35	48	4,155	512,166	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		79	94	537	76,791	0.0
HAMMERSON PLC		59	75	226	32,308	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		60	75	679	96,992	0.0
SEGRO PLC		79	112	770	110,021	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	277	357	2,214	316,113	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES		258	364	918	70,404	0.0
SCENTRE GROUP		427	564	2,101	160,960	0.0
GPT GROUP		137	199	1,146	87,846	0.0
MIRVAC GROUP		283	389	1,117	85,622	0.0
STOCKLAND		199	264	1,012	77,570	0.0
WESTFIELD CORP		158	—	—	—	—
DEXUS		80	104	1,313	100,654	0.0
GOODMAN GROUP		145	174	2,292	175,630	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,691	2,061	9,903	758,688	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	7	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		176	220	20,561	287,451	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	176	220	20,561	287,451	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SUNTEC REIT		239	249	446	35,868	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		204	278	529	42,579	0.0
CAPITALAND MALL TRUST		176	244	596	47,931	0.0

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		182	278	817	65,767	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	802	1,050	2,389	192,147	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	4,041	5,021	—	10,723,360	
	銘 柄 数 < 比 率 >	64	62	—	<2.5%>	

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	SP EMINI	百万円	百万円
		SP/TSE60	11,500	—
		SWISS IX	654	—
		EURO ST	532	—
		SPI 200	2,303	—
		FTSE100	747	—
			1,024	—

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

○投資信託財産の構成

(2019年5月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
投資証券	410,232,624	93.2
コール・ローン等、その他	10,723,360	2.4
投資信託財産総額	19,225,132	4.4
	440,181,116	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（437,136,138千円）の投資信託財産総額（440,181,116千円）に対する比率は99.3%です。

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	440,971,113,180
コール・ローン等	15,173,443,879
株式(評価額)	410,232,624,351
投資証券(評価額)	10,723,360,397
未収入金	849,774,577
未収配当金	646,527,745
差入委託証拠金	3,345,382,231
(B) 負債	3,602,222,022
未払金	941,654,593
未払解約金	2,660,564,803
未払利息	2,626
(C) 純資産総額(A－B)	437,368,891,158
元本	157,760,668,644
次期繰越損益金	279,608,222,514
(D) 受益権総口数	157,760,668,644口
1万口当たり基準価額(C/D)	27.724円

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2018年5月15日～2019年5月13日)

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

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

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

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

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

日本債券インデックスマザーファンド

《第18期》決算日2019年5月13日

[計算期間：2018年5月15日～2019年5月13日]

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月13日に第18期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2015年5月12日)	12,572	2.2	361.38	2.2	99.4	0.3	343,834
15期(2016年5月12日)	13,473	7.2	387.29	7.2	99.6	—	529,456
16期(2017年5月12日)	13,180	△2.2	378.85	△2.2	99.3	0.2	457,117
17期(2018年5月14日)	13,283	0.8	381.82	0.8	98.4	0.3	544,273
18期(2019年5月13日)	13,503	1.7	388.16	1.7	99.8	0.1	608,830

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
				騰 落 率		
(期 首) 2018年5月14日	円 13,283	% —	381.82	% —	% 98.4	% 0.3
5月末	13,306	0.2	382.50	0.2	99.3	0.4
6月末	13,312	0.2	382.67	0.2	100.9	0.4
7月末	13,288	0.0	381.98	0.0	99.4	0.3
8月末	13,216	△0.5	379.89	△0.5	98.6	0.4
9月末	13,184	△0.7	378.99	△0.7	98.6	0.1
10月末	13,208	△0.6	379.64	△0.6	99.2	0.4
11月末	13,263	△0.2	381.24	△0.2	98.8	0.4
12月末	13,360	0.6	384.13	0.6	99.6	0.1
2019年1月末	13,415	1.0	385.58	1.0	99.6	0.1
2月末	13,443	1.2	386.43	1.2	99.5	0.1
3月末	13,538	1.9	389.14	1.9	99.9	0.1
4月末	13,495	1.6	387.94	1.6	99.8	0.1
(期 末) 2019年5月13日	13,503	1.7	388.16	1.7	99.8	0.1

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

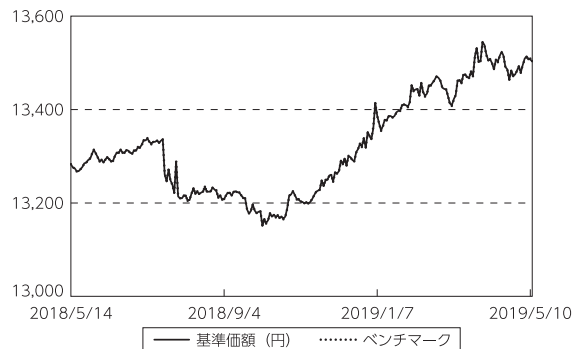
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.7%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

●投資環境について

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは1.7%の上昇になったため、カイ離は△0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ポートフォリオ要因

(主なマイナス要因)

- ・評価時価差異要因※

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

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年5月15日～2019年5月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,322円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2018年5月15日～2019年5月13日)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債券先物取引	百万円 14, 041	百万円 15, 421	百万円 －	百万円 －

○利害関係人との取引状況等

(2018年5月15日～2019年5月13日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	249, 966	70, 625	28. 3	181, 794	26, 887	14. 8

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 1, 000	百万円 802	百万円 1, 741

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 3, 200

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

○組入資産の明細

(2019年5月13日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	463,721,000	506,833,740	83.2	—	54.4	18.2	10.6
地方債証券	30,807,350	32,542,061	5.3	—	3.2	1.6	0.5
	(30,807,350)	(32,542,061)	(5.3)	(—)	(3.2)	(1.6)	(0.5)
特殊債券 (除く金融債)	33,348,097	35,968,864	5.9	—	4.0	1.2	0.8
	(33,348,097)	(35,968,864)	(5.9)	(—)	(4.0)	(1.2)	(0.8)
金融債券	3,200,000	3,214,444	0.5	—	0.1	0.3	0.2
	(3,200,000)	(3,214,444)	(0.5)	(—)	(0.1)	(0.3)	(0.2)
普通社債券	28,573,000	29,238,091	4.8	0.0	2.0	2.5	0.3
	(28,573,000)	(29,238,091)	(4.8)	(0.0)	(2.0)	(2.5)	(0.3)
合 計	559,649,447	607,797,202	99.8	0.0	63.7	23.8	12.4
	(95,928,447)	(100,963,461)	(16.6)	(0.0)	(9.3)	(5.5)	(1.7)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

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

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

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第 6 回利付国債 (30年)		2. 4	169, 000	218, 143	2031/11/20
第 7 回利付国債 (30年)		2. 3	164, 000	210, 900	2032/ 5 /20
第 8 回利付国債 (30年)		1. 8	142, 000	174, 215	2032/11/22
第 9 回利付国債 (30年)		1. 4	116, 000	136, 145	2032/12/20
第10回利付国債 (30年)		1. 1	185, 000	209, 697	2033/ 3 /20
第11回利付国債 (30年)		1. 7	137, 000	166, 898	2033/ 6 /20
第12回利付国債 (30年)		2. 1	220, 000	281, 067	2033/ 9 /20
第13回利付国債 (30年)		2. 0	205, 000	259, 562	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2. 4	493, 000	654, 122	2034/ 3 /20
第15回利付国債 (30年)		2. 5	346, 000	465, 722	2034/ 6 /20
第16回利付国債 (30年)		2. 5	302, 000	407, 591	2034/ 9 /20
第17回利付国債 (30年)		2. 4	327, 000	437, 503	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2. 3	427, 000	566, 056	2035/ 3 /20
第19回利付国債 (30年)		2. 3	303, 000	402, 568	2035/ 6 /20
第20回利付国債 (30年)		2. 5	495, 000	675, 283	2035/ 9 /20
第21回利付国債 (30年)		2. 3	379, 000	505, 673	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2. 5	570, 000	781, 145	2036/ 3 /20
第23回利付国債 (30年)		2. 5	554, 000	760, 919	2036/ 6 /20
第24回利付国債 (30年)		2. 5	411, 000	565, 741	2036/ 9 /20
第25回利付国債 (30年)		2. 3	742, 000	998, 464	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2. 4	884, 000	1, 207, 711	2037/ 3 /20
第27回利付国債 (30年)		2. 5	860, 000	1, 194, 316	2037/ 9 /20
第28回利付国債 (30年)		2. 5	911, 000	1, 270, 817	2038/ 3 /20
第29回利付国債 (30年)		2. 4	1, 450, 000	2, 003, 305	2038/ 9 /20
第30回利付国債 (30年)		2. 3	1, 496, 000	2, 046, 916	2039/ 3 /20
第31回利付国債 (30年)		2. 2	1, 358, 000	1, 840, 578	2039/ 9 /20
第32回利付国債 (30年)		2. 3	1, 739, 000	2, 402, 585	2040/ 3 /20
第33回利付国債 (30年)		2. 0	1, 644, 000	2, 180, 782	2040/ 9 /20
第34回利付国債 (30年)		2. 2	2, 116, 000	2, 904, 654	2041/ 3 /20
第35回利付国債 (30年)		2. 0	2, 549, 000	3, 406, 789	2041/ 9 /20
第36回利付国債 (30年)		2. 0	1, 829, 000	2, 454, 499	2042/ 3 /20
第37回利付国債 (30年)		1. 9	2, 057, 000	2, 724, 722	2042/ 9 /20
第38回利付国債 (30年)		1. 8	1, 185, 000	1, 547, 882	2043/ 3 /20
第39回利付国債 (30年)		1. 9	1, 540, 000	2, 050, 032	2043/ 6 /20
第40回利付国債 (30年)		1. 8	1, 220, 000	1, 599, 029	2043/ 9 /20
第41回利付国債 (30年)		1. 7	1, 150, 000	1, 483, 189	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1. 7	1, 520, 000	1, 962, 183	2044/ 3 /20
第43回利付国債 (30年)		1. 7	1, 320, 000	1, 705, 598	2044/ 6 /20
第44回利付国債 (30年)		1. 7	1, 290, 000	1, 670, 253	2044/ 9 /20
第45回利付国債 (30年)		1. 5	1, 190, 000	1, 485, 381	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1. 5	1, 550, 000	1, 935, 810	2045/ 3 /20
第47回利付国債 (30年)		1. 6	1, 770, 000	2, 255, 971	2045/ 6 /20
第48回利付国債 (30年)		1. 4	1, 310, 000	1, 606, 977	2045/ 9 /20
第49回利付国債 (30年)		1. 4	2, 580, 000	3, 166, 072	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0. 8	970, 000	1, 045, 068	2046/ 3 /20

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

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

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

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

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

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第4回埼玉県公募公債(20年)	2.18	200,000	235,460	2027/9/21
平成23年度第1回埼玉県公募公債	1.37	100,000	102,660	2021/4/27
平成23年度第4回埼玉県公募公債	1.2	100,000	102,624	2021/7/27
平成24年度第6回埼玉県公募公債	0.801	100,000	102,732	2022/10/26
平成26年度第8回埼玉県公募公債	0.335	100,000	101,797	2025/1/28
平成27年度第6回埼玉県公募公債	0.505	200,000	206,180	2025/9/29
平成29年度第8回埼玉県公募公債	0.245	200,000	203,080	2028/1/26
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	70,000	96,492	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	80,000	105,876	2038/9/17
平成22年度第3回福岡県公募公債	1.11	100,000	101,410	2020/8/24
平成22年度第5回福岡県公募公債	0.94	20,000	20,271	2020/10/28
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	1.491	100,000	110,994	2026/11/27
平成26年度第8回福岡県公募公債	0.441	100,000	102,363	2024/12/25
平成26年度第1回福岡県公募公債	0.654	100,000	103,243	2024/6/26
平成27年度第7回福岡県公募公債	0.464	100,000	102,867	2025/12/25
第2回千葉県公募公債(20年)	2.26	100,000	116,356	2026/9/18
第9回千葉県公募公債(20年)	1.84	80,000	94,954	2030/10/11
平成22年度第11回千葉県公募公債	1.26	80,000	81,703	2021/1/25
平成22年度第12回千葉県公募公債	1.28	100,000	102,271	2021/2/25
平成22年度第14回千葉県公募公債	1.33	100,000	102,463	2021/3/25
平成23年度第9回千葉県公募公債	1.0	20,000	20,567	2022/3/25
平成24年度第1回千葉県公募公債	1.05	20,000	20,613	2022/4/25
平成24年度第6回千葉県公募公債	0.81	100,000	102,829	2022/11/25
平成25年度第1回千葉県公募公債	0.58	82,500	84,338	2023/4/25
平成25年度第8回千葉県公募公債	0.67	100,000	102,967	2023/11/24
平成28年度第5回千葉県公募公債	0.15	100,000	100,912	2026/12/25
平成28年度第8回千葉県公募公債	0.22	200,000	202,980	2027/3/25
第7回群馬県公募公債	1.08	400,000	406,572	2020/11/25
第15回群馬県公募公債	0.08	200,000	200,750	2026/11/25
平成28年度第1回岐阜県公募公債	0.06	100,000	100,223	2026/10/30
平成24年度第1回大分県公募公債	0.8	100,260	103,006	2022/10/31
平成27年度第1回大分県公募公債	0.476	203,400	209,388	2025/10/30
第90回共同発行市場公募地方債	1.12	30,000	30,456	2020/9/25
第91回共同発行市場公募地方債	0.9	175,000	177,250	2020/10/23
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	102,095	2021/1/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	102,271	2021/2/25
第99回共同発行市場公募地方債	1.17	200,000	204,912	2021/6/25
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	102,633	2021/7/23
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	102,376	2021/8/25
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	100,000	102,426	2021/10/25
第107回共同発行市場公募地方債	1.01	300,000	308,364	2022/2/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	170,000	175,215	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	102,668	2022/5/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	100,000	102,495	2022/8/25
第114回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	102,722	2022/9/22

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

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
第17回横浜市の公募公債（20年）		2. 07	80, 000	94, 993	2028/12/20
第20回横浜市の公募公債（20年）		2. 1	80, 000	96, 229	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市の公募公債		0. 81	100, 000	103, 003	2023/ 2 /20
第25回横浜市の公募公債（20年）		1. 72	100, 000	118, 903	2032/ 7 /16
平成27年度第2回横浜市の公募公債		0. 568	200, 000	206, 670	2025/ 6 /16
第27回横浜市の公募公債（20年）		1. 599	60, 000	70, 724	2033/ 5 /20
平成22年度第8回札幌市の公募公債（30年）		2. 277	80, 000	107, 232	2040/ 9 /20
平成23年度第3回札幌市の公募公債		1. 944	300, 000	363, 213	2031/ 7 /29
平成26年度第5回札幌市の公募公債		0. 961	100, 000	108, 493	2029/ 9 /20
平成27年度第9回札幌市の公募公債		0. 19	100, 000	101, 054	2025/12/19
第3回川崎市の公募公債（15年）		1. 82	100, 000	102, 910	2020/12/21
第44回川崎市の公募公債（5年）		0. 162	130, 400	130, 616	2020/ 6 /19
第17回北九州市の公募公債（20年）		1. 529	100, 000	117, 576	2034/ 6 /20
平成22年度第2回北九州市の公募公債		1. 26	100, 000	102, 019	2020/12/24
平成25年度第3回北九州市の公募公債		0. 728	300, 000	309, 879	2023/12/26
平成22年度第9回福岡市の公募公債		1. 32	106, 500	109, 102	2021/ 3 /25
平成23年度第6回福岡市の公募公債		1. 0	100, 000	102, 434	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市の公募公債		0. 8	200, 000	205, 478	2022/10/31
平成25年度第4回福岡市の公募公債		0. 68	50, 000	51, 478	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市の公募公債（20年）		1. 371	100, 000	115, 371	2034/ 9 /20
平成25年度第2回広島市の公募公債		0. 72	100, 000	103, 258	2023/12/27
平成28年度第4回広島市の公募公債		0. 165	100, 000	101, 026	2026/12/25
平成29年度第6回広島市の公募公債		0. 23	300, 000	304, 092	2028/ 2 /25
平成22年度第2回千葉市の公募公債		0. 92	100, 000	101, 312	2020/10/22
平成24年度第1回相模原市の公募公債		0. 71	200, 000	205, 046	2022/12/20
平成22年度第1回三重県の公募公債		1. 056	87, 050	88, 460	2020/11/30
平成23年度第1回三重県の公募公債		1. 021	98, 410	100, 946	2021/11/30
平成24年度第4回福井県の公募公債		0. 46	100, 000	101, 755	2023/ 4 /26
平成26年度第4回福井県の公募公債		0. 425	100, 000	102, 406	2025/ 4 /24
平成27年度第4回福井県の公募公債		0. 085	200, 000	200, 762	2026/ 4 /27
平成23年度第1回徳島県の公募公債		1. 02	100, 000	102, 575	2021/11/30
平成27年度第1回徳島県の公募公債		0. 476	300, 000	308, 736	2025/11/27
平成29年度第2回徳島県の公募公債		0. 19	108, 000	109, 193	2027/11/30
平成24年度第1回山梨県の公募公債		0. 8	200, 000	205, 464	2022/10/28
平成24年度第2回岡山県の公募公債		0. 68	100, 000	102, 573	2023/ 3 /29
平成26年度第1回岡山市の公募公債		0. 33	100, 000	101, 770	2025/ 1 /30
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券		0. 06	200, 000	200, 186	2023/ 3 /29
第96回愛知県・名古屋半保証名古屋高速道路債券		2. 34	100, 000	120, 509	2028/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券		0. 704	100, 000	102, 741	2024/ 3 /19
小	計		30, 807, 350	32, 542, 061	
特殊債券(除く金融債)					
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1. 9	100, 000	103, 487	2021/ 2 /26
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2. 1	200, 000	240, 668	2029/ 5 /31
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2. 1	100, 000	120, 796	2029/ 9 /28
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2. 1	100, 000	120, 913	2029/10/31

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.3	100,000	135,299	2040/2/29
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	121,561	2030/4/30
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	544,000	552,274	2020/6/30
第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	354,000	358,927	2020/7/31
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	101,445	2020/9/30
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	300,000	304,152	2020/10/30
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	400,000	405,856	2020/11/30
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.2	571,000	582,562	2020/12/28
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.0	100,000	121,451	2031/1/31
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.3	400,000	410,576	2021/4/30
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	91,000	93,136	2021/5/31
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.1	660,000	676,744	2021/7/30
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	122,000	124,936	2021/8/31
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	100,000	102,575	2021/10/29
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.8	200,000	239,654	2031/10/31
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.0	136,000	139,627	2021/11/30
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	212,000	217,609	2022/2/28
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.9	109,000	111,935	2022/3/18
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.737	100,000	119,496	2032/4/30
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.83	200,000	255,464	2042/5/30
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.895	12,000	12,353	2022/6/30
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.819	301,000	309,810	2022/9/30
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.805	100,000	103,022	2022/11/30
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.834	201,000	207,562	2023/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.668	100,000	102,722	2023/3/17
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.4	100,000	115,745	2033/4/28
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.541	153,000	156,520	2023/4/28
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.882	100,000	103,815	2023/6/30
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.911	223,000	231,953	2023/7/31
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.801	100,000	103,688	2023/9/29
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.66	200,000	206,728	2024/2/29
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	222,000	229,434	2024/3/29
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.601	100,000	103,377	2024/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.39	100,000	116,445	2034/8/31
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.391	200,000	205,214	2025/4/30
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.44	105,000	108,215	2025/8/29
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	130,000	133,196	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.145	100,000	101,294	2026/2/27
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.02	301,000	302,348	2026/3/31
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.02	100,000	100,454	2026/4/30
第344回政府保証道路債券		1.6	100,000	101,929	2020/7/15
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)		0.576	600,000	608,826	2021/9/24
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)		0.502	300,000	304,293	2021/12/24
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)		0.46	300,000	304,227	2022/2/25
第5回政府保証公営企業債券(15年)		2.2	300,000	321,396	2022/7/15

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	100,000	101,348	2020/7/17
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.0	100,000	101,399	2020/9/14
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.3	30,000	30,738	2021/3/12
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.0	21,000	21,534	2021/10/18
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券		1.1	50,000	51,483	2021/12/14
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.801	100,000	102,759	2022/8/15
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.815	100,000	103,229	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.668	17,000	17,462	2023/3/17
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.605	36,000	36,931	2023/5/16
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.693	160,000	165,404	2023/12/18
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.644	100,000	103,511	2024/6/14
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.601	100,000	103,350	2024/7/16
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.544	240,000	247,560	2024/9/13
第89回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.005	203,000	203,755	2026/10/16
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.13	200,000	202,676	2027/6/14
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.155	400,000	405,952	2027/8/13
第2回政府保証公営企業債券(15年)		2.1	100,000	104,134	2021/4/16
第25回政府保証日本政策金融公庫債券		0.815	100,000	103,244	2023/2/24
第31回政府保証日本政策金融公庫債券		0.544	100,000	103,150	2024/9/13
第37回政府保証日本政策金融公庫債券		0.425	100,000	102,990	2025/9/16
第41回政府保証日本政策金融公庫債券		0.01	300,000	301,215	2026/9/15
第211回政府保証預金保険機構債券		0.1	100,000	100,353	2021/10/19
第3回政府保証新関西国際空港債券		0.644	100,000	103,536	2024/6/26
第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債		0.001	400,000	400,556	2022/5/20
第19回政府保証日本政策投資銀行		0.668	400,000	410,876	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行		0.693	20,000	20,675	2023/12/18
第39回政府保証日本政策投資銀行		0.145	106,000	107,583	2027/3/15
第47回政府保証日本政策投資銀行		0.001	700,000	700,595	2021/3/26
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.45	120,000	139,372	2026/3/19
第9回道路債券(財投機関債)		2.9	100,000	133,415	2032/5/20
第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.52	100,000	117,312	2026/6/19
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.35	200,000	233,262	2026/9/18
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.87	30,000	46,298	2046/12/20
第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.75	100,000	151,690	2047/3/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.67	130,000	194,474	2047/3/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.34	100,000	118,694	2027/10/20
第28回道路債券(財投機関債)		2.83	400,000	541,956	2033/12/20
第33回道路債券(財投機関債)		2.91	500,000	687,540	2034/6/20
第42回道路債券(財投機関債)		2.22	200,000	225,138	2025/3/21
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.41	150,000	183,432	2029/4/20
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.14	50,000	60,564	2030/5/10
第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		2.19	100,000	122,827	2031/3/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.9	50,000	60,231	2032/3/19
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.711	100,000	118,230	2032/6/18
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.523	200,000	240,178	2044/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.974	100,000	134,970	2055/3/19
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)		1.284	100,000	114,011	2035/9/20
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.266	50,000	60,615	2029/6/28
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)		1.03	20,000	20,773	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)(財投機関債)		1.176	100,000	109,974	2029/1/26
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.03	100,000	109,224	2023/12/20
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.043	200,000	240,648	2030/6/28
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.33	50,000	56,117	2024/9/24
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.851	300,000	355,680	2030/10/28
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.092	250,000	303,920	2030/12/27
第13回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.278	100,000	101,403	2020/6/26
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		2.187	80,000	98,448	2031/4/28
第16回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.164	100,000	101,568	2020/9/28
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.846	80,000	95,509	2031/8/28
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)		2.39	150,000	173,650	2026/3/24
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.87	100,000	119,727	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.274	50,000	51,019	2020/12/28
第20回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.28	100,000	102,156	2021/1/28
第22回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.687	200,000	236,224	2032/6/28
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.68	300,000	354,177	2032/7/28
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.681	70,000	74,449	2023/3/17
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.785	50,000	59,975	2033/1/28
第30回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.035	300,000	307,725	2021/11/26
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)		1.298	100,000	114,212	2035/6/28
F63回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.579	100,000	109,338	2025/6/20
F77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.519	200,000	221,444	2026/10/20
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.491	100,000	102,839	2025/10/28
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.602	300,000	337,377	2027/8/20
F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.314	100,000	107,361	2025/3/7
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.6	100,000	115,169	2030/3/19
F124回地方公共団体金融機構債券		1.418	200,000	221,518	2027/6/4
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.546	100,000	115,696	2031/7/30
F132回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.09	100,000	106,508	2025/7/30
F149回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.145	100,000	107,276	2025/12/19
F197回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.052	300,000	324,375	2027/10/29
F226回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		1.096	100,000	109,239	2029/2/28
F306回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)		0.605	100,000	104,527	2028/3/22
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)		2.167	80,000	96,966	2030/3/19
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)		1.911	80,000	95,336	2030/10/29
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	14,814	15,475	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.08	15,066	15,808	2037/11/10
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.19	16,087	16,935	2042/6/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.27	15,463	16,363	2037/11/10
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.18	88,468	88,901	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	185,444	186,148	2033/1/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.29	15,482	16,320	2042/8/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		1.76	13,424	13,831	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.26	13,795	14,416	2037/5/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.13	15,230	15,965	2042/10/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.94	16,024	16,841	2038/11/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.25	13,827	14,442	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	10,313	10,363	2037/10/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.99	16,474	17,308	2042/12/10
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.52	10,102	10,145	2037/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.19	14,537	15,257	2037/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		2.24	17,123	18,251	2039/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.43	21,656	21,842	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券		2.15	14,989	15,736	2037/5/10
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.16	17,481	18,465	2043/5/10
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	11,460	11,652	2039/1/10
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.7	15,977	16,332	2032/5/10
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.64	18,480	18,997	2032/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.71	18,609	19,162	2032/11/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券		1.57	56,379	57,884	2032/11/10
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.8	12,964	13,367	2039/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.12	13,009	13,495	2039/7/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		2.28	50,448	54,778	2044/6/10
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.67	13,237	13,590	2040/5/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.7	29,680	30,780	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	15,892	16,538	2040/7/10
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.88	31,601	33,967	2045/2/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.87	33,133	35,485	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.81	33,307	35,534	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.88	15,585	16,318	2040/12/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.61	36,164	38,414	2045/7/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.84	14,914	15,527	2041/2/10
第39回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.15	300,000	361,014	2029/9/20
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.36	37,597	39,596	2045/9/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.09	16,291	17,211	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.34	14,731	15,517	2041/5/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.6	43,613	46,577	2045/12/10
第43回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.29	100,000	122,422	2030/2/18
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.77	42,917	46,143	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.79	36,338	38,904	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.92	32,515	34,844	2046/4/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.89	101,349	108,611	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.76	33,471	35,716	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.67	33,912	36,085	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券		2.21	14,619	15,392	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	36,757	39,172	2046/8/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	39,787	42,232	2046/9/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	41,395	43,929	2046/10/10
第54回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.09	300,000	303,516	2020/6/19
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	45,768	48,570	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	137,271	145,784	2047/2/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	46,867	49,810	2047/4/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	48,803	51,688	2047/5/10
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	50,111	52,791	2047/7/10
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.13	290,000	353,191	2030/12/13
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.11	50,054	52,446	2047/8/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.12	52,441	54,994	2047/11/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.25	47,725	50,239	2048/3/10
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.32	53,046	56,204	2048/7/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.066	80,000	97,321	2031/6/13
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.21	322,035	338,606	2048/9/10
第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.751	30,000	33,527	2026/6/19
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.08	48,601	50,804	2048/11/10
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	105,676	110,524	2049/1/10
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.07	52,341	54,751	2049/2/10
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.04	55,458	57,956	2049/4/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	111,082	115,886	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.02	113,650	118,644	2049/6/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.863	100,000	119,649	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.95	60,612	63,098	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.87	186,129	192,946	2049/11/10
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.84	125,628	130,062	2049/12/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.74	64,257	66,182	2050/1/10
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.6	134,486	137,481	2050/2/10
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.81	230,658	238,707	2050/4/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.9	230,676	240,018	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.88	154,754	160,860	2050/8/10
第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.892	100,000	120,406	2032/4/16
第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.441	300,000	331,977	2027/3/19
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.86	400,755	416,372	2050/12/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.41	268,926	271,790	2051/12/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	272,931	276,896	2052/3/10
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		2.227	130,000	174,556	2042/9/19
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.801	100,000	119,884	2032/9/17
第124回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)		1.428	200,000	222,376	2027/12/20
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	560,022	566,451	2052/10/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	94,339	95,443	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	95,061	96,434	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	95,185	96,317	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	191,334	193,283	2053/4/10
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	191,634	193,582	2053/5/10

銘	柄	当期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	192,584	194,831	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	194,182	195,962	2053/7/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.44	194,944	197,452	2053/9/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	97,784	99,267	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	98,357	100,074	2053/11/10
第174回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		1.129	180,000	200,962	2035/11/20
第177回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)		0.484	200,000	205,238	2025/12/19
第6回沖縄振興開発金融公庫債券 (財投機関債)		2.04	50,000	56,020	2025/6/20
第25回沖縄振興開発金融公庫債券 (財投機関債)		0.22	300,000	303,378	2027/6/18
第7回国際協力機構債券 (財投機関債)		1.991	70,000	84,538	2031/6/13
第11回国際協力機構債券 (財投機関債)		1.14	30,000	30,874	2021/12/20
第33回中日本高速道路		1.084	50,000	51,212	2021/9/17
第27回西日本高速道路		0.58	600,000	619,020	2025/9/2
第29回西日本高速道路		0.31	200,000	202,816	2026/2/12
第30回西日本高速道路		0.17	300,000	301,464	2026/5/22
第17回韓国輸出入銀行		0.16	100,000	100,009	2019/12/27
第18回韓国輸出入銀行		0.27	100,000	100,195	2021/6/28
小	計		33,348,097	35,968,864	
金融債券					
い第781号商工債券		0.24	100,000	100,212	2020/6/26
第310回信金中金債		0.225	200,000	200,504	2020/9/25
第311回信金中金債		0.225	200,000	200,550	2020/10/27
第315回信金中金債		0.075	400,000	400,284	2021/2/26
第322回信金中金債		0.03	300,000	299,892	2021/9/27
第327回信金中金債		0.06	200,000	200,082	2022/2/25
第332回信金中金債		0.09	300,000	300,405	2022/7/27
第336回信金中金債		0.1	300,000	300,555	2022/11/25
第338回信金中金債		0.11	200,000	200,444	2023/1/27
第11号商工債券 (10年)		0.66	100,000	102,573	2024/9/20
第211号商工債券 (3年)		0.07	300,000	300,075	2020/8/27
第223号商工債券 (3年)		0.11	300,000	300,306	2021/8/27
第2回信金中金債 (10年)		0.52	300,000	308,562	2025/9/26
小	計		3,200,000	3,214,444	
普通社債券					
第567回東京電力		1.958	100,000	109,763	2030/7/29
第568回東京電力		1.155	100,000	101,179	2020/9/8
第499回中部電力		1.194	50,000	52,006	2023/6/23
第500回中部電力		0.875	100,000	103,122	2024/5/24
第518回中部電力		0.19	200,000	200,128	2023/1/25
第528回中部電力		0.13	200,000	199,144	2023/11/24
第496回関西電力		0.908	100,000	103,371	2025/2/25
第499回関西電力		0.68	200,000	204,252	2026/1/23
第508回関西電力		0.455	200,000	201,000	2027/4/23
第510回関西電力		0.49	100,000	100,714	2027/7/23
第512回関西電力		0.32	200,000	200,320	2024/10/25

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

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第48回日本精工		0.16	200,000	200,266	2023/11/29
第15回パナソニック		0.19	300,000	300,600	2021/9/17
第17回パナソニック		0.47	100,000	101,167	2026/9/18
第18回デンソー		0.315	200,000	200,866	2028/3/17
第1回村田製作所		0.08	300,000	300,042	2022/1/24
第29回三菱重工業		0.662	300,000	306,876	2024/9/3
第34回三菱重工業		0.104	100,000	99,914	2022/8/29
第1回明治安田生命2014基金		0.51	100,000	100,062	2019/8/7
第7回J A三井リース		0.2	200,000	200,198	2022/9/15
第9回J A三井リース		0.22	100,000	100,147	2023/1/26
第1回日本生命2015基金		0.406	100,000	100,049	2019/8/5
第1回日本生命2017基金		0.304	100,000	100,165	2021/8/2
第2回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス		0.25	200,000	200,344	2022/10/31
第13回アイシン精機		0.827	100,000	103,107	2023/9/20
第1回明治安田生命2018基金		0.315	300,000	299,994	2023/9/25
第15回バン・パシフィック・インターナショナル		0.11	300,000	299,622	2022/3/7
第78回三菱商事		1.155	100,000	102,983	2022/3/9
第33回丸井		0.04	200,000	199,732	2021/10/25
第48回クレディセゾン		1.038	200,000	206,778	2023/10/20
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ		0.535	300,000	299,298	2028/5/31
第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）		1.62	100,000	103,532	2021/10/29
第9回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）		2.2	100,000	112,987	2026/10/30
第28回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）		1.56	100,000	102,402	2021/1/20
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）		2.46	100,000	120,518	2031/1/20
第57回三菱東京UFJ銀行		2.22	200,000	214,756	2022/10/27
第6回住友信託銀行（劣後特約付）		2.78	100,000	116,165	2026/4/27
第13回住友信託銀行（劣後特約付）		2.341	100,000	113,362	2026/6/15
第22回三井住友銀行（劣後特約付）		1.43	100,000	101,816	2020/9/28
第23回三井住友銀行（劣後特約付）		1.61	100,000	102,400	2020/12/17
第25回三井住友銀行（劣後特約付）		2.21	200,000	224,788	2026/6/1
第5回みずほ銀行（劣後特約付）		2.49	100,000	113,692	2026/1/30
第9回みずほ銀行（劣後特約付）		2.52	100,000	115,924	2027/4/27
第18回みずほ銀行（劣後特約付）		2.14	100,000	112,333	2026/9/11
第15回芙蓉総合リース		0.33	100,000	100,376	2024/12/6
第47回日産フィナンシャルサービス		0.23	200,000	199,358	2022/12/20
第20回東京センチュリーリース		0.19	100,000	100,102	2022/10/18
第23回東京センチュリーリース		0.2	200,000	200,154	2023/4/13
第26回東京センチュリーリース		0.04	100,000	99,843	2021/10/15
第29回ホンダファイナンス		0.428	200,000	201,324	2021/3/19
第38回ホンダファイナンス		0.01	300,000	299,670	2021/3/19
第42回ホンダファイナンス		0.05	100,000	99,814	2022/6/20
第77回トヨタファイナンス		0.145	200,000	199,844	2024/7/25
第87回トヨタファイナンス		0.04	300,000	299,955	2022/4/19
第23回リコーリース		0.05	200,000	199,742	2021/9/24
第27回リコーリース		0.16	100,000	100,031	2022/7/20

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

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第39回電源開発		0.929	100,000	103,079	2024/2/20
第40回電源開発		0.889	200,000	206,170	2024/6/20
第50回電源開発		0.415	200,000	200,278	2027/7/20
第57回電源開発		0.355	200,000	198,462	2028/7/20
第4回東京電力パワーグリッド		0.69	400,000	401,364	2024/6/20
第6回東京電力パワーグリッド		0.85	100,000	99,981	2027/8/31
第7回東京電力パワーグリッド		0.46	300,000	300,255	2022/10/24
第13回東京電力パワーグリッド		0.77	200,000	198,470	2028/4/19
第15回東京電力パワーグリッド		0.89	200,000	197,742	2030/7/24
第23回東京ガス		1.01	200,000	207,804	2023/6/9
第13回広島ガス		0.405	200,000	201,048	2028/9/13
第6回SCSK		0.14	100,000	99,873	2022/7/21
第3回ファーストリテイリング		0.491	100,000	101,183	2022/12/16
第4回ファーストリテイリング		0.749	100,000	103,090	2025/12/18
第7回ファーストリテイリング		0.405	200,000	200,928	2028/6/6
第14回フランス相互信用連合銀行		0.563	300,000	302,517	2021/10/15
第19回フランス相互信用連合銀行		0.999	200,000	207,768	2025/10/15
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー		0.217	300,000	298,539	2023/1/25
第1回韓国石油公社債		0.24	100,000	100,065	2022/1/21
第10回ゴールドマン・サックス・グループ・インク		2.45	200,000	211,156	2021/12/28
第11回ナショナル・オーストラリア銀行		0.284	100,000	100,075	2020/1/16
第17回ナショナル・オーストラリア銀行		0.44	100,000	100,096	2024/1/23
第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション		0.32	300,000	300,501	2023/7/6
小 計			28,573,000	29,238,091	
合 計			559,649,447	607,797,202	

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	債券先物取引	10年国債標準物	百万円	百万円
			458	—

○投資信託財産の構成 (2019年5月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
	607,797,202	99.3
コール・ローン等、その他	4,499,513	0.7
投資信託財産総額	612,296,715	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月13日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2018年5月15日～2019年5月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,899,494,952
受取利息	4,902,112,559
支払利息	△ 2,617,607
(B) 有価証券売買損益	4,919,444,412
売買益	7,030,554,959
売買損	△ 2,111,110,547
(C) 先物取引等取引損益	28,949,400
取引益	36,985,800
取引損	△ 8,036,400
(D) 保管費用等	△ 38,290
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	9,847,850,475
(F) 前期繰越損益金	134,522,690,774
(G) 追加信託差損益金	55,556,167,569
(H) 解約差損益金	△ 41,991,139,389
(I) 計(E+F+G+H)	157,935,569,429
次期繰越損益金(I)	157,935,569,429

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

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

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

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

《第11期》決算日2020年1月27日

[計算期間：2019年1月29日～2020年1月27日]

「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」は、1月27日に第11期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
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	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		FTSE世界国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%	(除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%	百万円
7期(2016年1月26日)	12,613	△0.2	381.71	△0.1	95.6	—	57,354
8期(2017年1月26日)	12,509	△0.8	378.81	△0.8	96.9	—	92,179
9期(2018年1月26日)	12,633	1.0	382.76	1.0	98.5	—	183,523
10期(2019年1月28日)	12,706	0.6	385.22	0.6	98.0	—	226,657
11期(2020年1月27日)	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—	237,847

(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	F T S E 世界国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	(除く日本、円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率		
(期 首) 2019年 1 月28日	円	%		%	%	%
	12,706	—	385.22	—	98.0	—
1 月末	12,728	0.2	385.88	0.2	97.9	—
2 月末	12,714	0.1	385.50	0.1	100.1	—
3 月末	12,951	1.9	392.62	1.9	98.2	—
4 月末	12,862	1.2	389.98	1.2	98.1	—
5 月末	13,049	2.7	395.72	2.7	95.1	—
6 月末	13,260	4.4	401.98	4.4	97.4	—
7 月末	13,318	4.8	403.79	4.8	96.9	—
8 月末	13,732	8.1	416.34	8.1	95.7	—
9 月末	13,633	7.3	413.28	7.3	99.7	—
10月末	13,465	6.0	408.17	6.0	100.5	—
11月末	13,456	5.9	407.93	5.9	98.6	—
12月末	13,373	5.2	405.42	5.2	99.4	—
(期 末) 2020年 1 月27日	13,512	6.3	409.73	6.4	97.8	—

(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6.3%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(6.4%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

●投資環境について

◎債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・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F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。
- ・組入外貨建資産については、ベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行いました。

●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6.4%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・評価時価差異要因※によるものです。

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

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・組入外貨建資産については、原則としてベンチマークとの連動を維持するため、為替ヘッジを行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019 年 1 月 29 日～2020 年 1 月 27 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) そ の 他 費 用	1	0.011	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.010)	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	1	0.011	
期中の平均基準価額は、13,234円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年1月29日～2020年1月27日)

公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 380,260	千アメリカドル 344,703
	カナダ	国債証券	千カナダドル 15,458	千カナダドル 19,740
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 80,479	千メキシコペソ 69,848
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	30,332	32,109
	イタリア	国債証券	44,205	44,608
	フランス	国債証券	50,975	49,330
	オランダ	国債証券	7,401	9,410
	スペイン	国債証券	33,256	32,399
	ベルギー	国債証券	10,745	11,449
	オーストリア	国債証券	7,793	8,367
	フィンランド	国債証券	1,503	2,917
	アイルランド	国債証券	2,635	5,198
	国	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 31,092
スウェーデン		国債証券	千スウェーデンクローネ 3,007	千スウェーデンクローネ 13,315
ノルウェー		国債証券	千ノルウェークローネ 5,115	千ノルウェークローネ 1,550
デンマーク		国債証券	千デンマーククローネ 11,635	千デンマーククローネ 14,614
ポーランド		国債証券	千ポーランドズロチ 7,868	千ポーランドズロチ 9,495
オーストラリア		国債証券	千オーストラリアドル 10,748	千オーストラリアドル 12,782
シンガポール		国債証券	千シンガポールドル 7,355	千シンガポールドル 3,732
南アフリカ		国債証券	千南アフリカランド 36,276	千南アフリカランド 22,060

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2019年 1 月29日～2020年 1 月27日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	2,814,608	690,127	24.5	2,822,336	683,467	24.2
為替直物取引	52,690	12,879	24.4	56,324	22,555	40.0

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

○組入資産の明細

(2020年1月27日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 977,180	千アメリカドル 1,037,803	千円 113,182,842	% 47.6	% —	% 21.2	% 18.1	% 8.3
カナダ	千カナダドル 45,450	千カナダドル 51,746	4,291,864	1.8	—	0.9	0.6	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 323,300	千メキシコペソ 343,256	1,987,456	0.8	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	97,630	119,529	14,379,388	6.0	—	3.7	1.5	0.9
イタリア	144,940	171,164	20,591,118	8.7	—	5.2	2.4	1.0
フランス	154,340	189,675	22,817,966	9.6	—	6.6	2.1	0.9
オランダ	29,230	35,835	4,311,013	1.8	—	1.2	0.5	0.2
スペイン	87,450	109,300	13,148,827	5.5	—	3.8	1.4	0.4
ベルギー	35,930	45,378	5,459,042	2.3	—	1.7	0.5	0.1
オーストリア	21,530	26,886	3,234,424	1.4	—	0.9	0.3	0.1
フィンランド	9,240	10,373	1,247,938	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	9,890	11,777	1,416,839	0.6	—	0.5	0.1	—
イギリス	千イギリスポンド 81,400	千イギリスポンド 109,057	15,541,775	6.5	—	5.1	1.2	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 52,400	千スウェーデンクローネ 59,551	678,888	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 42,350	千ノルウェークローネ 43,846	528,350	0.2	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 54,950	千デンマーククローネ 71,917	1,157,864	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 44,150	千ポーランドズロチ 46,158	1,304,905	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 52,750	千オーストラリアドル 61,414	4,563,092	1.9	—	1.4	0.3	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 17,170	千シンガポールドル 18,616	1,500,529	0.6	—	0.4	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 196,350	千南アフリカランド 179,238	1,355,045	0.6	—	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	232,699,174	97.8	—	54.7	30.0	13.1

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

(注) 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	銘柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	1.125 T-NOTE 210228	1.125	3,100	3,085	336,488	2021/2/28
	1.125 T-NOTE 210630	1.125	16,000	15,907	1,734,871	2021/6/30
	1.125 T-NOTE 210731	1.125	2,600	2,583	281,761	2021/7/31
	1.125 T-NOTE 210831	1.125	2,800	2,782	303,411	2021/8/31
	1.125 T-NOTE 210930	1.125	700	695	75,852	2021/9/30
	1.25 T-NOTE 210331	1.25	5,400	5,381	586,853	2021/3/31
	1.25 T-NOTE 211031	1.25	3,100	3,086	336,580	2021/10/31
	1.375 T-NOTE 210131	1.375	1,600	1,597	174,182	2021/1/31
	1.375 T-NOTE 210430	1.375	7,000	6,986	761,928	2021/4/30
	1.375 T-NOTE 210531	1.375	2,500	2,494	272,010	2021/5/31
	1.375 T-NOTE 221015	1.375	8,000	7,980	870,332	2022/10/15
	1.375 T-NOTE 230630	1.375	4,100	4,087	445,783	2023/6/30
	1.375 T-NOTE 230831	1.375	3,700	3,687	402,197	2023/8/31
	1.375 T-NOTE 230930	1.375	7,000	6,975	760,795	2023/9/30
	1.5 T-NOTE 220131	1.5	800	800	87,268	2022/1/31
	1.5 T-NOTE 220815	1.5	5,500	5,504	600,368	2022/8/15
	1.5 T-NOTE 220915	1.5	14,000	14,012	1,528,211	2022/9/15
	1.5 T-NOTE 230228	1.5	10,000	10,012	1,091,963	2023/2/28
	1.5 T-NOTE 230331	1.5	6,700	6,707	731,501	2023/3/31
	1.5 T-NOTE 241031	1.5	6,000	5,999	654,308	2024/10/31
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	8,300	8,255	900,389	2026/8/15
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	8,400	8,436	920,076	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	6,350	6,377	695,533	2022/11/15
	1.625 T-NOTE 230430	1.625	7,850	7,888	860,267	2023/4/30
	1.625 T-NOTE 230531	1.625	4,900	4,925	537,149	2023/5/31
	1.625 T-NOTE 231031	1.625	6,700	6,736	734,698	2023/10/31
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	8,800	8,824	962,427	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 260515	1.625	9,200	9,226	1,006,252	2026/5/15
	1.625 T-NOTE 260930	1.625	3,900	3,908	426,264	2026/9/30
	1.625 T-NOTE 261031	1.625	5,000	5,009	546,322	2026/10/31
	1.625 T-NOTE 261130	1.625	2,500	2,504	273,139	2026/11/30
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	4,400	4,379	477,652	2029/8/15
	1.75 T-NOTE 201231	1.75	1,700	1,703	185,756	2020/12/31
	1.75 T-NOTE 211130	1.75	6,600	6,629	723,057	2021/11/30
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	12,750	12,822	1,398,445	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,400	1,408	153,602	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	3,100	3,119	340,225	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	9,200	9,258	1,009,701	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220531	1.75	3,800	3,824	417,082	2022/5/31
	1.75 T-NOTE 220715	1.75	4,000	4,027	439,188	2022/7/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	4,900	4,937	538,485	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	2,400	2,421	264,095	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,700	2,718	296,497	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220131	1.875	2,000	2,015	219,755	2022/1/31
	1.875 T-NOTE 220228	1.875	12,500	12,599	1,374,113	2022/2/28
	1.875 T-NOTE 220430	1.875	12,000	12,105	1,320,273	2022/4/30

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券	1.875 T-NOTE 220531	1.875	3,700	3,734	407,305	2022/5/31
		1.875 T-NOTE 220831	1.875	3,750	3,788	413,128	2022/8/31
		1.875 T-NOTE 221031	1.875	6,300	6,369	694,646	2022/10/31
		2 T-NOTE 210228	2.0	4,800	4,822	525,941	2021/2/28
		2 T-NOTE 210831	2.0	1,000	1,007	109,916	2021/8/31
		2 T-NOTE 211031	2.0	3,800	3,832	418,021	2021/10/31
		2 T-NOTE 211231	2.0	10,000	10,095	1,100,994	2021/12/31
		2 T-NOTE 220215	2.0	8,900	8,994	980,984	2022/2/15
		2 T-NOTE 221130	2.0	10,700	10,859	1,184,354	2022/11/30
		2 T-NOTE 230215	2.0	8,900	9,043	986,330	2023/2/15
		2 T-NOTE 240430	2.0	2,500	2,550	278,166	2024/4/30
		2 T-NOTE 240531	2.0	12,000	12,255	1,336,530	2024/5/31
		2 T-NOTE 250215	2.0	7,000	7,166	781,610	2025/2/15
		2 T-NOTE 250815	2.0	12,300	12,592	1,373,297	2025/8/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	7,300	7,490	816,912	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 210131	2.125	700	704	76,783	2021/1/31
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	6,400	6,456	704,118	2021/8/15
		2.125 T-NOTE 210930	2.125	1,000	1,010	110,176	2021/9/30
		2.125 T-NOTE 211231	2.125	3,700	3,743	408,313	2021/12/31
		2.125 T-NOTE 220630	2.125	6,350	6,450	703,514	2022/6/30
		2.125 T-NOTE 231130	2.125	7,700	7,885	860,034	2023/11/30
		2.125 T-NOTE 240229	2.125	2,700	2,766	301,754	2024/2/29
		2.125 T-NOTE 240331	2.125	4,600	4,717	514,531	2024/3/31
		2.125 T-NOTE 241130	2.125	6,300	6,481	706,885	2024/11/30
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	10,650	10,967	1,196,061	2025/5/15
		2.25 T-BOND 460815	2.25	2,550	2,606	284,229	2046/8/15
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	1,800	1,814	197,910	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	6,100	6,153	671,061	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	700	707	77,171	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 231231	2.25	8,800	9,057	987,845	2023/12/31
		2.25 T-NOTE 240131	2.25	4,150	4,273	466,106	2024/1/31
		2.25 T-NOTE 241031	2.25	9,400	9,721	1,060,243	2024/10/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	10,300	10,653	1,161,844	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 241231	2.25	4,100	4,244	462,865	2024/12/31
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	7,000	7,266	792,465	2025/11/15
		2.25 T-NOTE 260331	2.25	9,500	9,882	1,077,836	2026/3/31
		2.25 T-NOTE 270815	2.25	6,500	6,795	741,066	2027/8/15
		2.25 T-NOTE 271115	2.25	5,000	5,230	570,434	2027/11/15
		2.375 T-BOND 491115	2.375	4,350	4,586	500,170	2049/11/15
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	700	705	76,911	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 210315	2.375	14,000	14,129	1,540,975	2021/3/15
		2.375 T-NOTE 240229	2.375	10,000	10,350	1,128,771	2024/2/29
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	9,200	9,555	1,042,075	2024/8/15
		2.375 T-NOTE 270515	2.375	9,800	10,322	1,125,817	2027/5/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	5,050	5,397	588,703	2045/2/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	5,100	5,468	596,357	2046/2/15
		2.5 T-BOND 460515	2.5	5,250	5,631	614,165	2046/5/15

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	2.5 T-NOTE 230815	2.5	14,550	15,069	1,643,477	2023/8/15	
	2.5 T-NOTE 240515	2.5	9,100	9,481	1,034,004	2024/5/15	
	2.5 T-NOTE 250131	2.5	2,000	2,095	228,548	2025/1/31	
	2.625 T-NOTE 210515	2.625	15,500	15,714	1,713,871	2021/5/15	
	2.625 T-NOTE 210615	2.625	3,000	3,044	332,049	2021/6/15	
	2.625 T-NOTE 211215	2.625	9,000	9,188	1,002,052	2021/12/15	
	2.625 T-NOTE 230630	2.625	5,600	5,814	634,163	2023/6/30	
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	11,900	12,553	1,369,092	2025/3/31	
	2.625 T-NOTE 290215	2.625	8,800	9,509	1,037,106	2029/2/15	
	2.75 T-BOND 420815	2.75	6,150	6,863	748,480	2042/8/15	
	2.75 T-BOND 421115	2.75	2,000	2,232	243,467	2042/11/15	
	2.75 T-BOND 471115	2.75	6,600	7,456	813,200	2047/11/15	
	2.75 T-NOTE 210815	2.75	18,000	18,336	1,999,811	2021/8/15	
	2.75 T-NOTE 230531	2.75	13,500	14,060	1,533,387	2023/5/31	
	2.75 T-NOTE 231115	2.75	8,800	9,211	1,004,640	2023/11/15	
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	15,000	15,745	1,717,183	2024/2/15	
	2.75 T-NOTE 250630	2.75	11,500	12,220	1,332,772	2025/6/30	
	2.75 T-NOTE 250831	2.75	5,000	5,323	580,574	2025/8/31	
	2.75 T-NOTE 280215	2.75	11,000	11,919	1,299,944	2028/2/15	
	2.875 T-BOND 450815	2.875	6,100	6,986	761,937	2045/8/15	
	2.875 T-BOND 461115	2.875	6,600	7,604	829,396	2046/11/15	
	2.875 T-NOTE 211015	2.875	11,500	11,764	1,283,046	2021/10/15	
	2.875 T-NOTE 211115	2.875	8,000	8,193	893,576	2021/11/15	
	2.875 T-NOTE 231031	2.875	8,500	8,930	974,012	2023/10/31	
	2.875 T-NOTE 250430	2.875	13,400	14,313	1,561,076	2025/4/30	
	2.875 T-NOTE 250731	2.875	6,000	6,420	700,165	2025/7/31	
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	13,700	15,008	1,636,880	2028/5/15	
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	6,200	6,805	742,257	2028/8/15	
	3 T-BOND 420515	3.0	5,150	5,978	652,050	2042/5/15	
	3 T-BOND 441115	3.0	8,450	9,854	1,074,765	2044/11/15	
	3 T-BOND 450515	3.0	6,000	7,011	764,629	2045/5/15	
	3 T-BOND 451115	3.0	3,450	4,042	440,837	2045/11/15	
	3 T-BOND 470215	3.0	3,250	3,836	418,411	2047/2/15	
	3 T-BOND 480215	3.0	5,700	6,745	735,674	2048/2/15	
	3 T-BOND 480815	3.0	5,600	6,640	724,247	2048/8/15	
	3 T-BOND 490215	3.0	6,100	7,255	791,250	2049/2/15	
	3.125 T-BOND 411115	3.125	2,500	2,959	322,770	2041/11/15	
	3.125 T-BOND 420215	3.125	4,300	5,091	555,238	2042/2/15	
	3.125 T-BOND 430215	3.125	3,600	4,265	465,219	2043/2/15	
	3.125 T-BOND 440815	3.125	6,600	7,851	856,332	2044/8/15	
	3.125 T-BOND 480515	3.125	3,800	4,603	502,105	2048/5/15	
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	1,300	1,326	144,641	2021/5/15	
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	15,900	17,805	1,941,869	2028/11/15	
	3.375 T-BOND 440515	3.375	14,200	17,563	1,915,488	2044/5/15	
	3.375 T-BOND 481115	3.375	6,000	7,623	831,395	2048/11/15	
	3.5 T-BOND 390215	3.5	2,000	2,494	272,070	2039/2/15	
	3.625 T-BOND 430815	3.625	3,000	3,839	418,764	2043/8/15	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券	3.625 T-BOND 440215	3.625	5,700	7,311	797,401	2044/2/15
		3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,200	2,246	245,039	2021/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,293	141,104	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	6,600	8,614	939,446	2043/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	800	1,050	114,526	2040/8/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	800	1,102	120,211	2040/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	940	1,295	141,288	2038/2/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	2,000	2,786	303,936	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	2,050	2,863	312,268	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,100	1,542	168,214	2041/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	3,260	4,457	486,083	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	1,300	1,818	198,323	2038/5/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	1,400	2,011	219,399	2040/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,700	2,494	272,033	2041/2/15
		5 T-BOND 370515	5.0	1,050	1,535	167,430	2037/5/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	1,580	2,164	236,071	2031/2/15
		6 T-BOND 260215	6.0	2,000	2,516	274,439	2026/2/15
		6.125 T-BOND 271115	6.125	13,850	18,456	2,012,833	2027/11/15
		6.25 T-BOND 230815	6.25	3,000	3,494	381,151	2023/8/15
		6.25 T-BOND 300515	6.25	1,300	1,862	203,108	2030/5/15
8 T-BOND 211115	8.0	1,300	1,449	158,110	2021/11/15		
小 計						113,182,842	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	0.5	1,200	1,175	97,522	2022/3/1
		0.75 CAN GOVT 210301	0.75	5,900	5,846	484,917	2021/3/1
		0.75 CAN GOVT 210901	0.75	150	148	12,291	2021/9/1
		1 CAN GOVT 220901	1.0	1,800	1,778	147,546	2022/9/1
		1 CAN GOVT 270601	1.0	1,500	1,460	121,118	2027/6/1
		1.5 CAN GOVT 230601	1.5	3,250	3,256	270,091	2023/6/1
		1.5 CAN GOVT 260601	1.5	3,150	3,174	263,264	2026/6/1
		1.75 CAN GOVT 230301	1.75	1,000	1,009	83,722	2023/3/1
		2 CAN GOVT 280601	2.0	1,500	1,573	130,539	2028/6/1
		2 CAN GOVT 511201	2.0	500	565	46,885	2051/12/1
		2.25 CAN GOVT 240301	2.25	1,200	1,241	102,964	2024/3/1
		2.5 CAN GOVT 240601	2.5	4,700	4,920	408,073	2024/6/1
		2.75 CAN GOVT 220601	2.75	3,000	3,087	256,075	2022/6/1
		2.75 CAN GOVT 481201	2.75	1,750	2,261	187,541	2048/12/1
		2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	800	1,133	94,022	2064/12/1
		3.25 CAN GOVT 210601	3.25	3,100	3,169	262,878	2021/6/1
		3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,950	2,779	230,521	2045/12/1
		4 CAN GOVT 410601	4.0	1,850	2,690	223,115	2041/6/1
		5 CAN GOVT 370601	5.0	1,450	2,229	184,941	2037/6/1
		5.75 CAN GOVT 290601	5.75	2,350	3,241	268,851	2029/6/1
5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,800	2,743	227,540	2033/6/1		
8 CAN GOVT 270601	8.0	1,550	2,259	187,437	2027/6/1		
小 計						4,291,864	

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	34,750	39,481	228,600	2024/12/ 5
		10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	9,000	11,682	67,643	2036/11/20
		5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	21,350	20,305	117,569	2026/ 3 / 5
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	29,150	29,064	168,283	2021/ 6 /10
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	35,000	34,850	201,782	2022/ 6 / 9
		7.25 MEXICAN BONO 211209	7.25	10,000	10,103	58,496	2021/12/ 9
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	45,750	47,685	276,100	2027/ 6 / 3
		7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	19,300	20,656	119,598	2031/ 5 /29
		7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	10,800	11,637	67,382	2034/11/23
		7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	24,100	25,897	149,948	2042/11/13
		8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	21,500	22,425	129,845	2023/12/ 7
		8 MEXICAN BONOS 240905	8.0	15,000	15,764	91,278	2024/ 9 / 5
		8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	15,000	16,666	96,498	2047/11/ 7
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	14,400	16,084	93,127	2029/ 5 /31
8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	18,200	20,950	121,300	2038/11/18		
小 計						1,987,456	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	4,550	4,707	566,333	2026/ 8 /15
		0 BUND 500815	—	550	519	62,494	2050/ 8 /15
		0 OBL 210409	—	2,800	2,820	339,289	2021/ 4 / 9
		0 OBL 211008	—	3,500	3,536	425,465	2021/10/ 8
		0 OBL 220408	—	800	811	97,583	2022/ 4 / 8
		0 OBL 231013	—	1,500	1,535	184,682	2023/10/13
		0 SCHATS 211210	—	5,000	5,057	608,473	2021/12/10
		0.25 BUND 270215	0.25	3,600	3,793	456,403	2027/ 2 /15
		0.25 BUND 280815	0.25	4,000	4,237	509,755	2028/ 8 /15
		0.25 BUND 290215	0.25	2,350	2,491	299,704	2029/ 2 /15
		0.5 BUND 250215	0.5	3,050	3,219	387,277	2025/ 2 /15
		0.5 BUND 260215	0.5	1,800	1,915	230,444	2026/ 2 /15
		0.5 BUND 280215	0.5	3,300	3,558	428,127	2028/ 2 /15
		1 BUND 240815	1.0	1,600	1,718	206,720	2024/ 8 /15
		1 BUND 250815	1.0	2,700	2,938	353,458	2025/ 8 /15
		1.25 BUND 480815	1.25	1,300	1,696	204,138	2048/ 8 /15
		1.5 BUND 220904	1.5	2,800	2,956	355,726	2022/ 9 / 4
		1.5 BUND 230215	1.5	6,800	7,249	872,096	2023/ 2 /15
		1.5 BUND 230515	1.5	3,700	3,963	476,828	2023/ 5 /15
		1.5 BUND 240515	1.5	2,900	3,167	380,998	2024/ 5 /15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,750	2,910	350,165	2022/ 7 / 4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,950	2,139	257,404	2024/ 2 /15
		2 BUND 220104	2.0	3,400	3,575	430,181	2022/ 1 / 4
		2 BUND 230815	2.0	1,600	1,751	210,675	2023/ 8 /15
		2.25 BUND 210904	2.25	250	261	31,462	2021/ 9 / 4
		2.5 BUND 440704	2.5	2,900	4,596	552,943	2044/ 7 / 4
		2.5 BUND 460815	2.5	2,600	4,213	506,921	2046/ 8 /15
		3.25 BUND 210704	3.25	1,800	1,900	228,589	2021/ 7 / 4
		3.25 BUND 420704	3.25	2,500	4,296	516,888	2042/ 7 / 4
		4 BUND 370104	4.0	2,300	3,911	470,560	2037/ 1 / 4

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	4.25 BUND 390704	4.25	1,900	3,491	420,085	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	2,100	3,036	365,344	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	2,670	4,607	554,273	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	2,510	4,965	597,324	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,700	2,805	337,447	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	2,200	3,283	395,039	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,273	153,238	2024/1/4
		6.25 BUND 300104	6.25	1,250	2,089	251,422	2030/1/4
		6.5 BUND 270704	6.5	1,650	2,522	303,416	2027/7/4
イタリア	国債証券	0.05 ITALY GOVT 210415	0.05	3,500	3,510	422,294	2021/4/15
		0.35 ITALY GOVT 211101	0.35	400	402	48,469	2021/11/1
		0.35 ITALY GOVT 250201	0.35	1,000	988	118,886	2025/2/1
		0.45 ITALY GOVT 210601	0.45	1,950	1,966	236,523	2021/6/1
		0.65 ITALY GOVT 231015	0.65	1,200	1,217	146,412	2023/10/15
		0.95 ITALY GOVT 230315	0.95	2,500	2,558	307,728	2023/3/15
		1.25 ITALY GOVT 261201	1.25	1,300	1,337	160,892	2026/12/1
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	4,850	4,990	600,373	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	450	466	56,060	2022/9/15
		1.45 ITALY GOVT 241115	1.45	1,800	1,879	226,120	2024/11/15
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,580	1,651	198,680	2025/6/1
		1.6 ITALY GOVT 260601	1.6	2,100	2,209	265,802	2026/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,750	1,801	216,755	2032/3/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	1,000	1,059	127,503	2024/5/15
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	3,450	3,705	445,760	2025/12/1
		2 ITALY GOVT 280201	2.0	4,050	4,373	526,167	2028/2/1
		2.05 ITALY GOVT 270801	2.05	1,850	1,999	240,509	2027/8/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	2,600	2,707	325,750	2021/12/15
		2.2 ITALY GOVT 270601	2.2	3,550	3,873	466,004	2027/6/1
		2.25 ITALY GOVT 360901	2.25	750	805	96,846	2036/9/1
		2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,150	2,387	287,264	2033/9/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	3,000	3,280	394,601	2024/12/1
		2.5 ITALY GOVT 251115	2.5	3,200	3,523	423,844	2025/11/15
		2.7 ITALY GOVT 470301	2.7	2,700	2,988	359,562	2047/3/1
		2.8 ITALY GOVT 281201	2.8	3,800	4,354	523,881	2028/12/1
		2.8 ITALY GOVT 670301	2.8	1,300	1,413	170,100	2067/3/1
		2.95 ITALY GOVT 380901	2.95	3,700	4,306	518,129	2038/9/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	2,100	2,551	306,964	2046/9/1
		3.35 ITALY GOVT 350301	3.35	500	609	73,340	2035/3/1
		3.45 ITALY GOVT 480301	3.45	1,800	2,261	271,998	2048/3/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	3,000	3,647	438,839	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	3,950	4,145	498,731	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,300	2,434	292,871	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,408	289,762	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	3,150	4,149	499,239	2037/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	2,600	2,959	355,969	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,900	3,379	406,611	2024/3/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	4,400	4,739	570,196	2021/9/1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	3,430	3,966	477,158	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	900	1,174	141,233	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	2,470	3,678	442,517	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	3,650	4,033	485,277	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	6,600	8,059	969,531	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,900	4,152	499,586	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	2,540	3,788	455,707	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	3,500	5,226	628,691	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	4,600	6,320	760,320	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	3,800	4,333	521,377	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	5,300	6,081	731,649	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	2,450	3,668	441,375	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	3,820	5,680	683,372	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	4,050	5,726	688,904	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	700	994	119,645	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	3,950	5,231	629,314	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O.A.T 210225	—	7,900	7,949	956,311	2021/2/25
		0 O.A.T 210525	—	4,800	4,837	581,906	2021/5/25
		0 O.A.T 220525	—	4,100	4,155	499,933	2022/5/25
		0 O.A.T 230325	—	2,900	2,951	355,086	2023/3/25
		0.25 O.A.T 261125	0.25	4,700	4,878	586,843	2026/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	4,100	4,304	517,851	2025/5/25
		0.5 O.A.T 260525	0.5	5,300	5,582	671,583	2026/5/25
		0.5 O.A.T 290525	0.5	5,600	5,924	712,764	2029/5/25
		0.75 O.A.T 280525	0.75	3,350	3,617	435,164	2028/5/25
		0.75 O.A.T 281125	0.75	4,250	4,594	552,764	2028/11/25
		1 O.A.T 251125	1.0	2,000	2,161	260,080	2025/11/25
		1 O.A.T 270525	1.0	3,700	4,046	486,791	2027/5/25
		1.25 O.A.T 360525	1.25	5,410	6,214	747,630	2036/5/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	6,850	8,000	962,478	2031/5/25
		1.5 O.A.T 500525	1.5	1,820	2,192	263,765	2050/5/25
		1.75 O.A.T 230525	1.75	4,900	5,278	635,059	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	4,400	4,874	586,442	2024/11/25
		1.75 O.A.T 390625	1.75	1,020	1,272	153,129	2039/6/25
		1.75 O.A.T 660525	1.75	1,480	1,963	236,180	2066/5/25
		2 O.A.T 480525	2.0	2,800	3,749	451,028	2048/5/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	4,600	4,959	596,587	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	7,350	8,234	990,658	2024/5/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	6,150	7,779	935,930	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	3,100	3,830	460,799	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,000	3,243	390,144	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	4,050	4,322	520,008	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	3,120	5,058	608,555	2045/5/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	3,200	3,979	478,714	2026/4/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	1,200	1,264	152,172	2021/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,900	4,807	578,348	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	2,170	4,307	518,208	2055/4/25

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	4 O.A.T 600425	4.0	1,700	3,537	425,570	2060/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	4,700	5,552	667,922	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	4,100	7,447	895,937	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	3,350	5,628	677,072	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	5,100	7,794	937,651	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	4,100	7,062	849,642	2032/10/25
		6 O.A.T 251025	6.0	7,420	10,171	1,223,616	2025/10/25
		8.5 O.A.T 230425	8.5	1,650	2,141	257,624	2023/4/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 220115	—	900	910	109,551	2022/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,350	1,403	168,889	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 260715	0.5	2,000	2,120	255,098	2026/7/15
		0.5 NETH GOVT 400115	0.5	950	1,017	122,460	2040/1/15
		0.75 NETH GOVT 270715	0.75	2,600	2,817	338,892	2027/7/15
		0.75 NETH GOVT 280715	0.75	2,150	2,345	282,190	2028/7/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	2,350	2,542	305,898	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	2,200	2,451	294,916	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	2,550	2,732	328,709	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	1,500	2,007	241,482	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	1,600	2,681	322,624	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	2,250	2,378	286,093	2021/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	1,350	1,526	183,636	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,780	3,185	383,182	2042/1/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,800	3,008	361,881	2037/1/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,500	2,208	265,648	2028/1/15
		7.5 NETH GOVT 230115	7.5	400	497	59,858	2023/1/15
スペイン	国債証券	0.35 SPAIN GOVT 230730	0.35	800	816	98,250	2023/7/30
		0.4 SPAIN GOVT 220430	0.4	3,150	3,204	385,530	2022/4/30
		0.45 SPAIN GOVT 221031	0.45	1,500	1,532	184,359	2022/10/31
		0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	4,400	4,478	538,802	2021/7/30
		1.3 SPAIN GOVT 261031	1.3	2,850	3,086	371,280	2026/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 280730	1.4	1,400	1,536	184,797	2028/7/30
		1.45 SPAIN GOVT 271031	1.45	4,450	4,888	588,144	2027/10/31
		1.45 SPAIN GOVT 290430	1.45	4,200	4,634	557,547	2029/4/30
		1.5 SPAIN GOVT 270430	1.5	3,450	3,793	456,335	2027/4/30
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	2,350	2,558	307,744	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	2,500	2,800	336,919	2026/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	1,900	2,200	264,691	2030/7/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	3,300	3,713	446,782	2025/10/31
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	2,600	3,177	382,206	2033/7/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	3,000	3,413	410,671	2024/10/31
		2.9 SPAIN GOVT 461031	2.9	1,740	2,412	290,253	2046/10/31
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	1,300	2,109	253,766	2066/7/30
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,650	1,929	232,129	2024/4/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	3,170	4,888	588,036	2037/1/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	4,000	4,697	565,121	2023/10/31
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,640	2,064	248,322	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	2,650	4,542	546,424	2041/7/30

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	2,400	2,882	346,722	2024/ 1 /31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	2,950	5,117	615,584	2040/ 7 /30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	2,800	3,984	479,323	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	2,200	4,118	495,479	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	4,450	5,214	627,260	2023/ 1 /31
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	3,600	3,868	465,323	2021/ 4 /30
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	2,700	4,414	531,013	2032/ 7 /30
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,750	3,095	372,372	2022/ 1 /31
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	2,500	3,448	414,833	2026/ 7 /30
		6 SPAIN GOVT 290131	6.0	3,100	4,678	562,797	2029/ 1 /31
ベルギー	国債証券	0.2 BEL GOVT 231022	0.2	1,900	1,950	234,703	2023/10/22
		0.5 BEL GOVT 241022	0.5	1,800	1,879	226,123	2024/10/22
		0.8 BEL GOVT 250622	0.8	2,600	2,767	332,899	2025/ 6 /22
		0.8 BEL GOVT 270622	0.8	1,350	1,454	174,932	2027/ 6 /22
		0.8 BEL GOVT 280622	0.8	2,900	3,137	377,486	2028/ 6 /22
		1 BEL GOVT 260622	1.0	900	976	117,435	2026/ 6 /22
		1 BEL GOVT 310622	1.0	1,200	1,330	160,006	2031/ 6 /22
		1.25 BEL GOVT 330422	1.25	850	973	117,141	2033/ 4 /22
		1.45 BEL GOVT 370622	1.45	250	294	35,432	2037/ 6 /22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	1,600	1,974	237,553	2047/ 6 /22
		1.9 BEL GOVT 380622	1.9	1,200	1,512	181,942	2038/ 6 /22
		2.15 BEL GOVT 660622	2.15	930	1,367	164,565	2066/ 6 /22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,500	1,644	197,794	2023/ 6 /22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	600	870	104,737	2057/ 6 /22
		3 BEL GOVT 340622	3.0	800	1,119	134,665	2034/ 6 /22
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	550	957	115,186	2045/ 6 /22
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,500	1,650	198,565	2022/ 3 /28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	1,080	1,596	192,064	2032/ 3 /28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	2,100	2,270	273,162	2021/ 9 /28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,800	2,033	244,654	2022/ 9 /28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	2,450	4,289	515,976	2041/ 3 /28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	980	1,275	153,500	2026/ 3 /28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	2,390	4,079	490,785	2035/ 3 /28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	2,700	3,971	477,726	2028/ 3 /28
オーストリア	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	—	1,400	1,426	171,629	2023/ 7 /15
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	0.5	1,400	1,481	178,220	2027/ 4 /20
		0.5 AUSTRIA GOVT 290220	0.5	850	901	108,410	2029/ 2 /20
		0.75 AUSTRIA GOVT 261020	0.75	950	1,019	122,638	2026/10/20
		0.75 AUSTRIA GOVT 280220	0.75	650	701	84,445	2028/ 2 /20
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	2,100	2,294	276,013	2025/10/20
		1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1.5	750	950	114,323	2047/ 2 /20
		1.5 AUSTRIA GOVT 861102	1.5	250	337	40,550	2086/11/ 2
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	1,100	1,211	145,773	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	950	1,031	124,148	2023/10/20
		2.1 AUSTRIA GOVT 170920	2.1	480	843	101,494	2117/ 9 /20
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	900	1,191	143,354	2034/ 5 /23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	850	1,403	168,846	2044/ 6 /20

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	
オーストリア	国債証券	3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,600	1,707	205,453	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	2,950	3,231	388,804	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	650	1,420	170,899	2062/1/26
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,950	3,251	391,145	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	800	1,059	127,438	2026/3/15
		6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	950	1,420	170,834	2027/7/15
フィンランド	国債証券	0 FINNISH GOVT 220415	—	500	506	60,941	2022/4/15
		0 FINNISH GOVT 230915	—	650	662	79,738	2023/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 260415	0.5	700	737	88,684	2026/4/15
		0.5 FINNISH GOVT 270915	0.5	500	529	63,645	2027/9/15
		0.5 FINNISH GOVT 280915	0.5	200	212	25,525	2028/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	750	816	98,169	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	1,100	1,179	141,852	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 340415	1.125	650	743	89,502	2034/4/15
		1.375 FINNISH GOV 470415	1.375	350	439	52,915	2047/4/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	550	586	70,593	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	550	582	70,045	2022/9/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	1,050	1,162	139,811	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	550	830	99,950	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	540	676	81,410	2028/7/4
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	200	210	25,266	2021/4/15
4 FINNISH GOVT 250704	4.0	400	497	59,884	2025/7/4		
アイルランド	国債証券	0.9 IRISH GOVT 280515	0.9	700	761	91,587	2028/5/15
		1 IRISH GOVT 260515	1.0	950	1,026	123,518	2026/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	950	1,054	126,819	2029/5/15
		1.3 IRISH GOVT 330515	1.3	1,000	1,143	137,621	2033/5/15
		1.5 IRISH GOVT 500515	1.5	600	721	86,840	2050/5/15
		1.7 IRISH GOVT 370515	1.7	650	790	95,119	2037/5/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	1,000	1,326	159,583	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	1,190	1,484	178,642	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	750	869	104,647	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	800	911	109,608	2023/3/20
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,300	1,686	202,850	2025/3/13
小 計						86,606,558	
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	3,380	3,391	483,285	2022/7/22
		0.75 GILT 230722	0.75	2,650	2,683	382,459	2023/7/22
		1 GILT 240422	1.0	1,200	1,230	175,421	2024/4/22
		1.25 GILT 270722	1.25	5,380	5,702	812,643	2027/7/22
		1.5 GILT 210122	1.5	1,100	1,111	158,334	2021/1/22
		1.5 GILT 260722	1.5	3,150	3,373	480,699	2026/7/22
		1.5 GILT 470722	1.5	2,600	2,870	409,069	2047/7/22
		1.625 GILT 281022	1.625	1,950	2,139	304,950	2028/10/22
		1.625 GILT 711022	1.625	1,420	1,825	260,085	2071/10/22
		1.75 GILT 220907	1.75	4,950	5,128	730,841	2022/9/7
		1.75 GILT 370907	1.75	2,270	2,560	364,836	2037/9/7
		1.75 GILT 490122	1.75	700	819	116,803	2049/1/22

銘 柄			当 期 末						
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日		
					外貨建金額	邦貨換算金額			
			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円			
イギリス	国債証券	1. 75 GILT 570722	1. 75	2, 170	2, 704	385, 475	2057/ 7 / 22		
		2. 25 GILT 230907	2. 25	3, 650	3, 894	555, 064	2023/ 9 / 7		
		2. 5 GILT 650722	2. 5	1, 480	2, 325	331, 447	2065/ 7 / 22		
		2. 75 GILT 240907	2. 75	1, 300	1, 440	205, 256	2024/ 9 / 7		
		3. 25 GILT 440122	3. 25	4, 200	6, 144	875, 611	2044/ 1 / 22		
		3. 5 GILT 450122	3. 5	2, 350	3, 606	513, 895	2045/ 1 / 22		
		3. 5 GILT 680722	3. 5	2, 040	4, 049	577, 126	2068/ 7 / 22		
		3. 75 GILT 210907	3. 75	1, 650	1, 738	247, 710	2021/ 9 / 7		
		3. 75 GILT 520722	3. 75	1, 240	2, 178	310, 451	2052/ 7 / 22		
		4 GILT 220307	4. 0	1, 650	1, 775	253, 027	2022/ 3 / 7		
		4 GILT 600122	4. 0	1, 900	3, 820	544, 398	2060/ 1 / 22		
		4. 25 GILT 271207	4. 25	850	1, 100	156, 853	2027/ 12 / 7		
		4. 25 GILT 320607	4. 25	2, 000	2, 840	404, 858	2032/ 6 / 7		
		4. 25 GILT 360307	4. 25	2, 550	3, 840	547, 335	2036/ 3 / 7		
		4. 25 GILT 390907	4. 25	2, 000	3, 167	451, 455	2039/ 9 / 7		
		4. 25 GILT 401207	4. 25	890	1, 431	204, 063	2040/ 12 / 7		
		4. 25 GILT 461207	4. 25	1, 900	3, 314	472, 343	2046/ 12 / 7		
		4. 25 GILT 491207	4. 25	800	1, 454	207, 305	2049/ 12 / 7		
		4. 25 GILT 551207	4. 25	3, 660	7, 263	1, 035, 114	2055/ 12 / 7		
		4. 5 GILT 340907	4. 5	1, 300	1, 961	279, 533	2034/ 9 / 7		
		4. 5 GILT 421207	4. 5	2, 350	4, 007	571, 119	2042/ 12 / 7		
		4. 75 GILT 301207	4. 75	1, 800	2, 588	368, 865	2030/ 12 / 7		
		4. 75 GILT 381207	4. 75	1, 550	2, 569	366, 194	2038/ 12 / 7		
		5 GILT 250307	5. 0	2, 750	3, 391	483, 253	2025/ 3 / 7		
		6 GILT 281207	6. 0	1, 920	2, 839	404, 588	2028/ 12 / 7		
		8 GILT 210607	8. 0	700	771	109, 996	2021/ 6 / 7		
		小 計						15, 541, 775	
		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	5, 600	5, 975	68, 119	2028/ 5 / 12		
		0. 75 SWD GOVT 291112	0. 75	4, 500	4, 802	54, 746	2029/ 11 / 12		
		1 SWD GOVT 261112	1. 0	6, 150	6, 623	75, 509	2026/ 11 / 12		
		1. 5 SWD GOVT 231113	1. 5	11, 800	12, 597	143, 605	2023/ 11 / 13		
		2. 5 SWD GOVT 250512	2. 5	7, 200	8, 239	93, 935	2025/ 5 / 12		
		3. 5 SWD GOVT 220601	3. 5	11, 550	12, 588	143, 513	2022/ 6 / 1		
		3. 5 SWD GOVT 390330	3. 5	5, 600	8, 724	99, 458	2039/ 3 / 30		
小 計						678, 888			
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ				
	国債証券	1. 5 NORWE GOVT 260219	1. 5	2, 850	2, 887	34, 798	2026/ 2 / 19		
		1. 75 NORWE GOVT 250313	1. 75	4, 800	4, 916	59, 238	2025/ 3 / 13		
		1. 75 NORWE GOVT 270217	1. 75	4, 250	4, 380	52, 788	2027/ 2 / 17		
		1. 75 NORWE GOVT 290906	1. 75	3, 000	3, 110	37, 476	2029/ 9 / 6		
		2 NORWE GOVT 230524	2. 0	7, 250	7, 417	89, 385	2023/ 5 / 24		
		2 NORWE GOVT 280426	2. 0	5, 050	5, 318	64, 093	2028/ 4 / 26		
		3 NORWE GOVT 240314	3. 0	4, 950	5, 290	63, 754	2024/ 3 / 14		
		3. 75 NORWE GOVT 210525	3. 75	10, 200	10, 523	126, 813	2021/ 5 / 25		
小 計						528, 350			

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	
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	千円	
	国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	0.5	10,700	11,508	185,280	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	4,000	4,327	69,664	2029/11/15
		1.5 DMK GOVT 231115	1.5	8,100	8,757	140,993	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	7,600	8,623	138,834	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	9,650	10,291	165,686	2021/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	14,900	28,410	457,404	2039/11/15
小 計						1,157,864	
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	5,750	5,771	163,146	2021/ 7 /25
		2.25 POLAND 220425	2.25	5,400	5,477	154,860	2022/ 4 /25
		2.5 POLAND 230125	2.5	800	817	23,123	2023/ 1 /25
		2.5 POLAND 240425	2.5	6,000	6,159	174,129	2024/ 4 /25
		2.5 POLAND 260725	2.5	3,500	3,577	101,144	2026/ 7 /25
		2.5 POLAND 270725	2.5	4,500	4,589	129,736	2027/ 7 /25
		2.75 POLAND 280425	2.75	3,700	3,838	108,505	2028/ 4 /25
		2.75 POLAND 291025	2.75	1,000	1,043	29,509	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	3,550	3,774	106,707	2025/ 7 /25
		4 POLAND 231025	4.0	4,150	4,479	126,630	2023/10/25
		5.75 POLAND 211025	5.75	1,900	2,037	57,592	2021/10/25
		5.75 POLAND 220923	5.75	2,500	2,763	78,118	2022/ 9 /23
		5.75 POLAND 290425	5.75	1,400	1,828	51,700	2029/ 4 /25
小 計						1,304,905	
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	2 AUST GOVT 211221	2.0	2,450	2,507	186,285	2021/12/21
		2.25 AUST GOVT 221121	2.25	800	833	61,956	2022/11/21
		2.25 AUST GOVT 280521	2.25	3,300	3,619	268,892	2028/ 5 /21
		2.5 AUST GOVT 300521	2.5	3,000	3,407	253,185	2030/ 5 /21
		2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,400	2,595	192,866	2024/ 4 /21
		2.75 AUST GOVT 271121	2.75	2,650	2,996	222,667	2027/11/21
		2.75 AUST GOVT 281121	2.75	3,050	3,482	258,756	2028/11/21
		2.75 AUST GOVT 291121	2.75	2,950	3,405	253,039	2029/11/21
		2.75 AUST GOVT 350621	2.75	1,000	1,201	89,253	2035/ 6 /21
		3 AUST GOVT 470321	3.0	1,900	2,440	181,332	2047/ 3 /21
		3.25 AUST GOVT 250421	3.25	4,550	5,109	379,627	2025/ 4 /21
		3.25 AUST GOVT 290421	3.25	3,500	4,166	309,605	2029/ 4 /21
		3.25 AUST GOVT 390621	3.25	900	1,166	86,644	2039/ 6 /21
		3.75 AUST GOVT 370421	3.75	1,750	2,380	176,859	2037/ 4 /21
		4.25 AUST GOVT 260421	4.25	3,250	3,907	290,332	2026/ 4 /21
		4.5 AUST GOVT 330421	4.5	2,400	3,372	250,602	2033/ 4 /21
		4.75 AUST GOVT 270421	4.75	3,500	4,423	328,665	2027/ 4 /21
		5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,600	2,993	222,442	2023/ 4 /21
		5.75 AUST GOVT 210515	5.75	3,900	4,148	308,220	2021/ 5 /15
		5.75 AUST GOVT 220715	5.75	2,900	3,255	241,856	2022/ 7 /15
小 計						4,563,092	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 211001	1.25	150	149	12,060	2021/10/ 1
		1.75 SINGAPORGOVT 220401	1.75	650	654	52,784	2022/ 4 / 1

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

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	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
国債証券	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	550	570	45,992	2026/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	1,150	1,162	93,736	2021/6/1	
	2.25 SINGAPORGOVT 360801	2.25	1,150	1,217	98,098	2036/8/1	
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	1,000	1,046	84,365	2025/6/1	
	2.625 SINGAPORGOV 280501	2.625	1,000	1,080	87,055	2028/5/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	1,400	1,462	117,873	2023/7/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	1,150	1,313	105,903	2042/4/1	
	2.75 SINGAPORGOVT 460301	2.75	650	744	59,972	2046/3/1	
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	450	498	40,150	2029/7/1	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	800	890	71,807	2030/9/1	
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	2,650	2,832	228,289	2024/9/1	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	1,200	1,252	100,961	2022/9/1	
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	1,600	1,907	153,777	2033/9/1	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	1,620	1,832	147,699	2027/3/1	
小 計					1,500,529		
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	28,400	31,938	241,452	2026/12/21	
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	4,700	3,357	25,385	2036/3/31	
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	17,900	12,442	94,065	2041/2/28	
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	5,800	5,813	43,948	2021/3/31	
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	18,000	15,275	115,483	2031/2/28	
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	8,200	8,404	63,535	2023/2/28	
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	15,200	14,193	107,304	2030/1/31	
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	7,800	7,150	54,056	2032/3/31	
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	20,250	17,848	134,932	2037/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	11,100	9,714	73,443	2044/1/31	
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	23,200	20,228	152,924	2048/2/28	
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	15,600	14,502	109,638	2035/2/28	
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	20,200	18,369	138,874	2040/1/31	
小 計					1,355,045		
合 計					232,699,174		

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

○投資信託財産の構成

(2020年 1 月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 232,699,174	% 97.7
コール・ローン等、その他	5,432,700	2.3
投資信託財産総額	238,131,874	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（234,687,280千円）の投資信託財産総額（238,131,874千円）に対する比率は98.6%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル＝109.06円	1 カナダドル＝82.94円	1 メキシコペソ＝5.79円	1 ユーロ＝120.30円
1 イギリスポンド＝142.51円	1 スウェーデンクローネ＝11.40円	1 ノルウェークローネ＝12.05円	1 デンマーククローネ＝16.10円
1 ポーランドズロチ＝28.27円	1 オーストラリアドル＝74.30円	1 シンガポールドル＝80.60円	1 南アフリカランド＝7.56円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	469,686,945,334
コール・ローン等	1,758,041,455
公社債(評価額)	232,699,174,814
未収入金	233,322,496,240
未収利息	1,842,332,451
前払費用	64,900,374
(B) 負債	231,839,535,253
未払金	231,837,921,263
未払解約金	1,613,367
未払利息	623
(C) 純資産総額(A－B)	237,847,410,081
元本	176,023,402,374
次期繰越損益金	61,824,007,707
(D) 受益権総口数	176,023,402,374口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,512円

<注記事項>

- ①期首元本額 178,385,096,188円
 期中追加設定元本額 37,696,590,522円
 期中一部解約元本額 40,058,284,336円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,512円です。

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

MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	105,594,306,529円
三菱UFJ バランスファンド2 OVA(適格機関投資家限定)	11,256,999,335円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	10,143,150,689円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,260,836,149円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	7,563,319,070円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	6,557,849,487円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,729,500,636円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,520,168,461円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,940,734,688円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	3,286,827,948円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,152,392,978円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	1,590,562,187円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	1,250,760,089円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	1,079,737,354円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	551,522,821円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	171,262,988円
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	134,194,556円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	89,342,059円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	76,119,162円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	73,815,188円
合計	176,023,402,374円

○損益の状況 (2019年1月29日～2020年1月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,536,844,307
受取利息	5,538,406,134
支払利息	△ 1,561,827
(B) 有価証券売買損益	8,802,018,090
売買益	35,628,164,545
売買損	△26,826,146,455
(C) 保管費用等	△ 25,045,357
(D) 当期損益金(A+B+C)	14,313,817,040
(E) 前期繰越損益金	48,272,350,615
(F) 追加信託差損益金	11,747,061,443
(G) 解約差損益金	△12,509,221,391
(H) 計(D+E+F+G)	61,824,007,707
次期繰越損益金(H)	61,824,007,707

- (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。