

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	無期限（2014年5月30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、株式組入れを比較的抑えつつ、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、原則として、先進国債券を一定の比率とし、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。
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。	
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	TOPIXマザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	外国株式インデックスマザーファンド	株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
	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。
	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。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ
DCバランス・イノベーション
(KAKUSHIN)

第6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 DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）」は、去る3月25日に第6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 組入比率	純資産 総額
		税 分	込 配	み 金						
	円	円	円	%	%	%	%	%	百万円	
2期(2016年3月25日)	10,742		0	△0.1	2.9	0.0	76.8	0.1	0.1	807
3期(2017年3月27日)	10,697		0	△0.4	32.7	0.9	55.9	—	0.4	1,403
4期(2018年3月26日)	11,120		0	4.0	29.1	0.4	67.0	0.1	0.3	2,639
5期(2019年3月25日)	11,294		0	1.6	6.4	0.3	75.0	0.0	0.1	6,301
6期(2020年3月25日)	11,178		0	△1.0	—	—	70.3	0.1	—	8,770

(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
	円	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2019年3月25日	11,294	—	6.4	0.3	75.0	0.0	0.1
3月末	11,310	0.1	4.5	0.3	75.5	0.0	0.1
4月末	11,302	0.1	19.3	0.8	75.3	0.0	0.3
5月末	11,258	△0.3	8.2	0.3	74.5	0.0	0.1
6月末	11,348	0.5	6.5	0.2	75.3	0.0	0.1
7月末	11,368	0.7	7.6	0.2	75.0	0.1	0.1
8月末	11,476	1.6	1.8	0.2	74.7	0.0	0.1
9月末	11,397	0.9	5.9	0.1	75.7	0.0	0.1
10月末	11,363	0.6	11.5	0.4	75.8	0.0	0.2
11月末	11,387	0.8	17.8	0.7	75.3	0.0	0.3
12月末	11,420	1.1	26.4	1.1	70.0	0.3	0.4
2020年1月末	11,456	1.4	25.3	0.5	70.3	0.0	0.4
2月末	11,277	△0.2	13.3	0.2	72.0	0.3	0.3
(期 末)							
2020年3月25日	11,178	△1.0	—	—	70.3	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6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6期首	11,294円
第6期末	11,178円
既払分配金	0円
騰落率	-1.0%

※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1.0%の下落となりました。

▶ 基準価額の変動要因

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。

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コロナウイルスの感染拡大を受け、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、新型コロナウイルス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コロナウイルス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、新型コロナウイルス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、新型コロナウイルス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。

株式部分以外への投資については、先進国債券に一定の比率で投資を行い、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%~22.0%

先進国株式 (外国株式インデックスマザーファンド)

0.0%~22.0%

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%

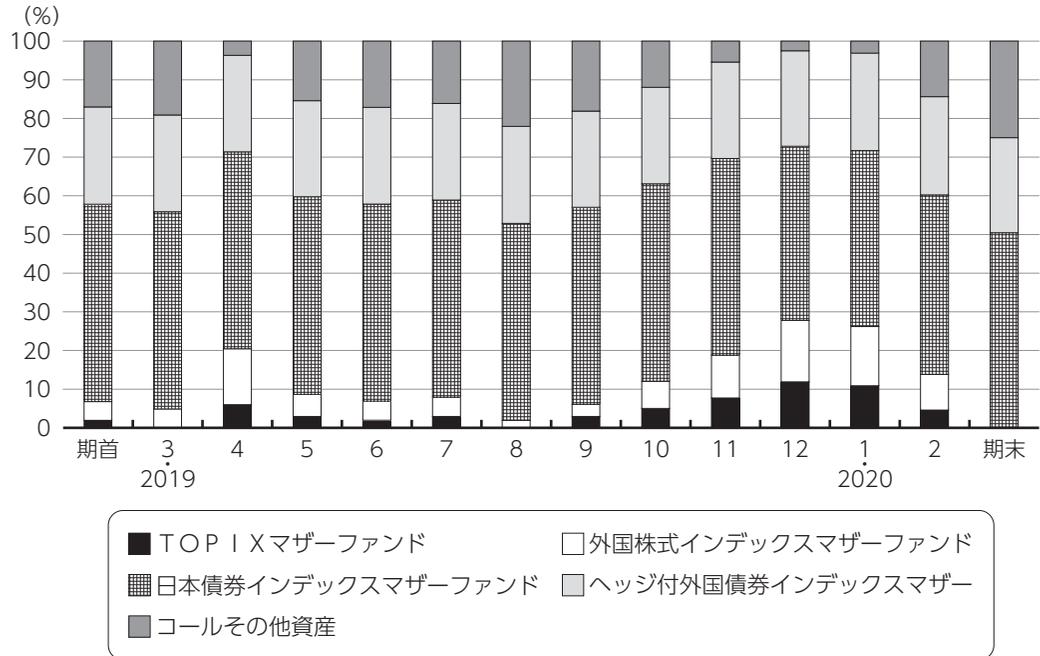
先進国債券 (ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド)
0.0%~25.0%
(原則、25.0%固定とします。)

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6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	1,177

(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。

株式部分以外への投資については、先進国債券に一定の比率で投資を行い、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	74	0.654	(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)	(50)	(0.436)	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)	(21)	(0.185)	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)	(4)	(0.033)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.004	(c) 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.004)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.008	(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)	(0)	(0.004)	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	75	0.667	

期中の平均基準価額は、11,357円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

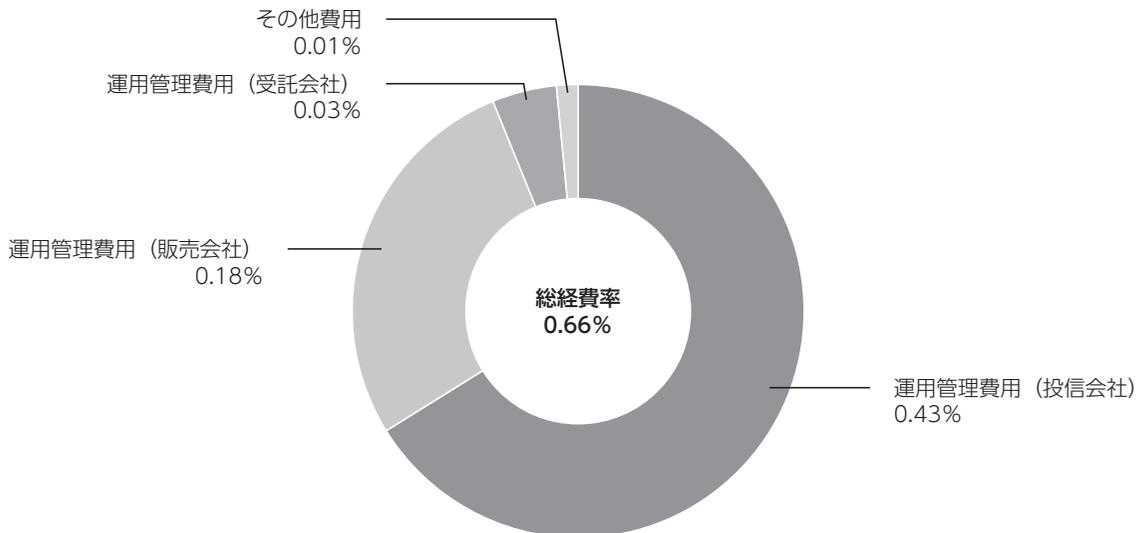
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.66%**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	381,833	509,000	51,512	71,000
TOPIXマザーファンド	2,110,838	3,799,000	2,182,889	3,794,837
外国株式インデックスマザーファンド	1,498,297	4,340,000	1,611,064	4,610,394
日本債券インデックスマザーファンド	2,972,476	4,050,000	2,074,887	2,817,000

○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 DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）>

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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
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 0.8%

※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	$\frac{D}{C}$
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 0.1%

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

<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	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 0.1%

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

<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	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 0.6%

※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まません。

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)	56千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.201千円
(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、a u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	1,227,192	1,557,513	2,155,443
TOPIXマザーファンド	72,051	—	—
外国株式インデックスマザーファンド	112,767	—	—
日本債券インデックスマザーファンド	2,376,785	3,274,375	4,424,336

○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	2,155,443	24.4
日本債券インデックスマザーファンド	4,424,336	50.1
コール・ローン等、その他	2,253,383	25.5
投資信託財産総額	8,833,162	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	8,833,162,257
コール・ローン等	2,253,382,444
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,155,443,396
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	4,424,336,417
(B) 負債	63,150,935
未払解約金	36,094,380
未払信託報酬	26,894,106
未払利息	1,145
その他未払費用	161,304
(C) 純資産総額(A-B)	8,770,011,322
元本	7,845,809,675
次期繰越損益金	924,201,647
(D) 受益権総口数	7,845,809.675口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,178円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,579,614,397円
 期中追加設定元本額 3,243,919,150円
 期中一部解約元本額 977,723,872円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,178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	40,894,657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	803,578,766円
分配準備積立金額	79,728,224円
当ファンドの分配対象収益額	924,201,647円
1万口当たり収益分配対象額	1,177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	△ 415,392
受取利息	3,627
支払利息	△ 419,019
(B) 有価証券売買損益	△ 58,792,664
売買益	209,809,771
売買損	△268,602,435
(C) 信託報酬等	△ 49,731,969
(D) 当期損益金(A+B+C)	△108,940,025
(E) 前期繰越損益金	79,728,224
(F) 追加信託差損益金	953,413,448
(配当等相当額)	(488,014,844)
(売買損益相当額)	(465,398,604)
(G) 計(D+E+F)	924,201,647
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	924,201,647
追加信託差損益金	953,413,448
(配当等相当額)	(490,109,628)
(売買損益相当額)	(463,303,820)
分配準備積立金	120,622,881
繰越損益金	△149,834,682

- (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 DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)」の運用報告書 (全体版) の「第5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 DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) 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			売付額等C		
	うち利害関係人との取引状況B	B — A	%	うち利害関係人との取引状況D	D — C	%
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	176,465	71,101	40.3	190,442	79,523	41.8
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			売付額等C		
	うち利害関係人との取引状況B	B — A	%	うち利害関係人との取引状況D	D — C	%
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	176,465	71,101	40.3	190,442	79,523	41.8
貸付有価証券(株式)	347,867	347,867	100.0	345,950	345,950	100.0

(正) 三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) 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			売付額等C		
	うち利害関係人との取引状況B	B — A	%	うち利害関係人との取引状況D	D — C	%
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	176,465	71,101	40.3	190,442	79,523	41.8
新株予約権証券	—	—	—	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	347,867	347,867	100.0	345,950	345,950	100.0

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

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
	円	騰 落 率	(T O P I X) (配当込み)	騰 落 率			
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といひます）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		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	(TOPIX) (配当込み)	騰 落 率	(TOPIX) (配当込み)		
(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

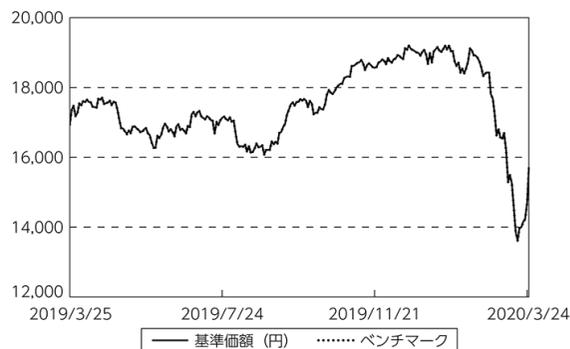
◎基準価額の動き

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、新型肺炎の世界的流行（パンデミック）を受けて投資家心理が冷え込み、国内株式市況は下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

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

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは7.4%の下落になったため、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 (株 式) (先物・オプション)	円 0 (0) (0)	% 0.002 (0.001) (0.002)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、17,480円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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 内	上場	千株 184,176 (3,018)	千円 357,845,063 (-)	千株 174,898	千円 331,603,466

(注) 金額は受渡代金。

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

新株予約権証券

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

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株主割当および権利行使等による増減分です。

先物取引の種類別取引状況

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

○株式売買比率

(2019年3月26日～2020年3月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年3月26日～2020年3月25日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	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	株 数	評 価 額
	千株	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	
ベストセラ	2.8	2.7	2,419	
TATERU	17.8	32.5	3,802	
キャンディル	—	1.4	610	
スペースバリューホールディングス	17.8	19.2	8,064	
ダイセキ環境ソリューション	2.8	3	2,583	
第一 Cutter 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	株 数	評 価 額
	千株	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	
ナカノフド一建設	9.2	9.9	3,672	
奥村組	19.8	19.7	47,398	
東鉄工業	14.5	15.6	44,709	
イチケン	2.2	2.6	3,694	
富士ビー・エス	3.7	5.4	2,592	
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
NIPPPO	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
高砂熟学工業	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
ダイダシ	8.1	8.7	24,499
日比谷総合設備	11.5	11.7	21,481
東芝プラントシステム	26.1	—	—
フィル・カンパニー	—	1.6	4,395
OSJBホールディングス	53.2	57.4	13,833
東洋エンジニアリング	14.2	15.3	5,263
千代田化工建設	86.9	—	—
レイズネクスト	21.6	19.5	23,088
食料品 (4.1%)			
日本製粉	35.8	34.1	55,037
日清製粉グループ本社	121.9	131.6	231,089
日東富士製粉	0.8	0.8	4,584
昭和産業	9.9	10.7	33,651
鳥越製粉	9.6	10.3	8,106
中部飼料	13.2	14.2	18,332
フィード・ワン	72.5	78.2	12,042
東洋精糖	1.6	2	2,200
日本甜菜製糖	6.1	6.1	10,888
三井製糖	8.5	10.2	20,665
塩水港精糖	11.7	12.6	2,658
日新製糖	5.1	5.5	11,088
森永製菓	27.1	27.3	115,069
中村屋	2.8	3	11,865
江崎グリコ	32.4	34.5	149,040
名糖産業	5.2	5.6	7,784
井村屋グループ	4.6	5	9,100
不二家	6	6.5	12,668
山崎製パン	88.2	87.3	172,766
第一屋製パン	1.9	2	1,800
モロゾフ	1.8	2	10,160
亀田製菓	6.7	6.6	30,393
寿スピリッツ	11.4	11.2	55,440
カルビー	49.2	53.1	146,821

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	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	
ブリマハム	15.2	18.2	41,459	
日本ハム	46.6	44.5	167,765	
林兼産業	3.6	3.9	2,074	
丸大食品	11.5	12.4	23,684	
S Foods	9.7	9.3	20,311	
柿安本店	—	4	8,924	
伊藤ハム米久ホールディングス	69.5	75	47,325	
サッポロホールディングス	39.4	39.7	78,447	
アサヒグループホールディングス	225.9	243.9	890,235	
キリンホールディングス	488	494	1,123,109	
宝ホールディングス	80.8	86.3	69,298	
オエノンホールディングス	30.6	30.7	11,635	
養命酒製造	3.3	3.6	6,976	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	82.6	81.7	179,740	
サントリー食品インターナショナル	72.2	77.9	318,611	
ダイドーグループホールディングス	6.1	6	21,000	
伊藤園	32.8	35.4	177,000	
キーコーヒー	10.6	11.4	26,790	
ユニカフェ	3	3	2,682	
ジャパンフーズ	1.5	1.7	2,080	
日清オイリオグループ	13.9	15	49,950	
不二製油グループ本社	26.3	28.4	72,618	
かどや製油	1.2	1.3	5,174	
J-オイルミルズ	5.6	6	25,740	
キッコーマン	71.2	83.8	387,994	
味の素	238.3	257.2	480,835	
キュービー	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	株 数	評 価 額
	千株	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	
イトアンド	3.7	4	7,172	
大冷	1.2	1.5	2,787	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2.9	6.4	5,977	
日清食品ホールディングス	45.9	49.5	412,335	
永谷園ホールディングス	5.7	5.7	12,540	
一正蒲鉾	4.2	4.5	4,153	
フジッコ	11.7	12.6	24,544	
ロック・フィールド	11.6	12.5	17,375	
日本たばこ産業	623	672.5	1,387,367	
ケンコーマヨネーズ	6	6.5	13,325	
わらべや日洋ホールディングス	7.1	7.6	12,129	
なとり	6	6.5	11,485	
イフジ産業	1.9	2	1,552	
ピクルスコーポレーション	2.6	2.5	5,440	
北の達人コーポレーション	42.4	40.7	22,995	
ユグレナ	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	
日本フェルト	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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日東製網	1.2	1.3	1,623	
アツギ	8.7	9.4	5,931	
ダイニック	4.3	4.4	3,000	
セーレン	25.9	27.9	34,763	
ソトー	4.2	4.5	4,275	
東海染工	1.4	1.6	1,822	
小松マテーレ	17.3	18.7	12,884	
ワコールホールディングス	30.7	29.7	71,131	
ホギメディカル	13.1	13	40,690	
レナウン	30.4	29.2	2,277	
クラウディアホールディングス	2.6	2.8	1,041	
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	
レンゾー	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	株 数	評 価 額
	千株	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	
日本パーカライズン	57.5	57.3	60,967	
高圧ガス工業	16.7	18	12,420	
チタン工業	1.3	1.4	2,398	
四国化成工業	17.7	17.5	17,587	
戸田工業	2.2	2.6	3,393	
ステラ ケミファ	6.2	6.2	15,376	
保土谷化学工業	3.7	4.2	12,339	
日本触媒	17.7	17.6	91,520	
大日精化工業	8.7	10.1	21,199	
カネカ	28	29.4	79,497	
三菱瓦斯化学	108.3	105.7	133,287	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	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	
積水化成製品工業	15.7	15.2	8,542	
群栄化学工業	2.7	2.6	6,237	
タイガースポリマー	5.5	6	2,706	
ミライアル	3	4	3,664	
ダイキアクシス	3.7	4	3,112	
ダイキョーニシカワ	22.2	24	12,504	
竹本容器	3.8	4.1	2,722	
森六ホールディングス	5.7	6.1	9,363	
日本化薬	67	70.3	72,479	
カーリットホールディングス	11.2	12.1	5,687	
日本精化	8.5	9.1	12,476	
扶桑化学工業	10.7	11.5	34,419	
トリケミカル研究所	2.3	2.5	19,950	
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	株 数	評 価 額
	千株	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S C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	
富士フィ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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
タカラバイオ	28.1	30.4	62,897	
JCU	13.9	14.1	33,219	
新田ゼラチン	6.7	7.3	4,066	
OATアグリオ	1.5	2	1,990	
デクセリアルズ	27.7	29.9	21,258	
アース製薬	8.1	8.7	45,849	
北興化学工業	11	11.9	6,283	
大成ラミック	3.5	3.8	9,450	
クミアイ化学工業	44.4	48	36,240	
日本農業	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	
JSP	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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ビオフェルミン製薬	1.8	2	4,558	
中外製薬	112.1	121	1,395,130	
科研製薬	19.4	19.9	97,410	
エーザイ	128.7	138.9	1,054,667	
ロート製薬	55.1	59.6	183,270	
小野薬品工業	253.9	266.5	609,219	
久光製薬	31.8	30.7	152,732	
持田製薬	8.1	16.1	66,895	
参天製薬	203.8	216.2	394,565	
扶桑薬品工業	3.8	4.1	7,974	
日本ケミファ	1.4	1.5	3,487	
ツムラ	33.3	36	93,996	
日医工	27.6	32.9	42,770	
キッセイ薬品工業	19	20.5	50,922	
生化学工業	20.9	22.5	24,030	
栄研化学	18.9	20.4	37,332	
日水製薬	4.5	4.9	6,125	
鳥居薬品	5.8	7.3	18,257	
JCRファーマ	7.6	8.2	71,750	
東和薬品	5.2	14.8	32,412	
富士製薬工業	7.3	7.9	9,061	
沢井製薬	22.1	23.8	135,660	
ゼリア新薬工業	21.3	21.1	41,166	
第一三共	307.6	332.1	2,399,090	
キョーリン製薬ホールディングス	23.7	25.6	49,792	
大幸薬品	4.8	4.7	20,492	
ダイト	6.3	6.9	19,389	
大塚ホールディングス	204.8	221.1	873,345	
大正製薬ホールディングス	24.1	24.5	155,330	
ペプチドリーム	53.6	58.7	238,028	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	90.8	98	6,076	
昭和シェル石油	51.5	—	—	
ニチレキ	13.7	13.7	18,851	
ユシロ化学工業	5.6	6.5	7,559	
ビービー・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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
JXTGホールディングス	1,808	1,745.8		674,577
コスモエネルギーホールディングス	31.1	33.6		54,028
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	62.2	67.2		98,582
TOYO TIRE	55.2	66.6		80,785
ブリヂストン	330.4	334.3	1,139,963	
住友ゴム工業	96.6	104.2		108,889
藤倉コンポジット	9.4	10.1		3,747
オカモト	7.5	7.1		26,412
フコク	4.7	5.1		3,411
ニッタ	12.1	13.1		26,750
住友理工	20.8	22.5		13,207
三ツ星ベルト	14.1	15.3		19,721
バンドー化学	20.5	20.4		12,852
ガラス・土石製品 (0.8%)				
日東紡績	16	17.3		79,493
AGC	106.3	114.7		320,013
日本板硝子	51.4	55.5		21,201
石塚硝子	1.8	2.1		4,269
日本山村硝子	4.5	4.8		4,243
日本電気硝子	46.5	46.6		70,645
オハラ	4.2	4.6		4,107
住友大阪セメント	21.7	22		77,000
太平洋セメント	67.9	73.3		155,615
日本ヒューム	10.8	11.6		7,180
日本コンクリート工業	23.1	25		6,600
三谷セキサン	5	5.4		22,032
アジアパイルホールディングス	15.2	16.5		6,864
東海カーボン	97.6	121.6		109,804
日本カーボン	5.1	6		19,230
東洋炭素	6.3	6.8		10,710
ノリタケカンパニーリミテド	6.4	6.4		21,696
TOTO	82.7	82.9		314,191
日本碍子	131.2	141.6		215,940
日本特殊陶業	90.6	90.3		141,951
ダントーホールディングス	9	8.6		645
MARUWA	3.7	4.5		29,115
品川リフラクトリーズ	2.8	3.1		7,281
黒崎播磨	2.1	2.3		10,304

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	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
日本鑄鉄管	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	株 数	評 価 額
	千株	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	
RS Technologies	2.1	3.2	6,896	
信和	4.3	4.9	3,934	
東洋製織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	株 数	評 価 額
	千株	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	
LIXIL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	
高周波熱練	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	
バイオラックス	17	17	25,483	
エイチワン	10.4	11.3	5,898	
日本発條	105.9	123.1	89,863	
中央発條	1.3	1.4	3,547	
アドバネクス	1.4	1.6	2,188	
立川ブラインド工業	4.7	5	5,155	
三益半導体工業	9.5	9	15,426	
機械 (5.0%)				
日本ドライケミカル	2.9	2.8	3,987	
日本製鋼所	32.2	34.8	43,813	
三浦工業	46	49.7	174,695	
タクマ	38.8	38.9	44,501	
ツガミ	23.9	23.8	18,183	
オークマ	13.5	13.4	50,451	
東芝機械	12	13	29,055	

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	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			
ブリュール	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	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			
オカダアイオン	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	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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
大豊工業	8.8	9.5	5,101	
日本精工	220.8	218.5	162,564	
NTN	231	268.6	56,674	
ジェイテクト	103.1	111.3	91,377	
不二越	10	10.8	31,568	
日本トムソン	31.9	34.4	13,209	
THK	67	67.5	155,452	
ユーシン精機	8.3	9	6,075	
前澤給装工業	4.2	4.2	8,295	
イーグル工業	13.3	14.3	10,796	
前澤工業	7.2	7.7	2,340	
日本ビラー工業	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	
IHI	82.6	83.6	127,322	
スター精密	18.3	17.9	19,922	
電気機器 (14.2%)				
日清紡ホールディングス	59.7	77.3	55,192	
イビデン	65.8	71.1	162,108	
コニカミノルタ	234.9	253.5	121,680	
ブラザー工業	140	141.7	236,213	
ミネベアミツミ	199.5	215.4	354,763	
日立製作所	483.9	557.6	1,788,223	
三菱電機	1,074.9	1,160.4	1,544,492	
富士電機	69.8	69.9	172,583	
東洋電機製造	4.2	4.2	4,872	
安川電機	124.6	124.9	384,067	
シンフォニアテクノロジー	14.9	15	14,325	
明電舎	21.3	21.3	34,506	
オリジン	2.9	3.1	4,333	
山洋電気	5.2	5.6	23,016	
デンヨー	9.9	9.9	18,582	
東芝テック	13.5	14.5	50,387	
芝浦メカトロニクス	1.9	2.1	5,420	
マブチモーター	29.7	32.1	103,522	
日本電産	129.3	139.6	1,563,520	
ユニー・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	株 数	評 価 額
	千株	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	
テクノメディカ	2.4	2.6	4,737	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	—	1.9	921	
日本電気	139.1	140.8	558,272	
富士通	103.6	111.9	1,066,183	
沖電気工業	46.6	47.1	50,302	
岩崎通信機	5	5.1	4,131	
電気興業	5.6	5.6	14,134	
サンケン電気	12.6	12.7	27,635	
ナカヨ	2.1	2.2	3,229	
アイホン	6.1	6.6	9,893	
ルネサスエレクトロニクス	111.4	554.6	240,141	
セイコーエプソン	133.4	144	181,440	
ワコム	77.8	78	24,024	
アルバック	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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
能美防災	14.2	15.3	28,978	
ホーチキ	6.8	8.4	10,458	
星和電機	4.3	5.7	3,117	
エレコム	10	12.8	47,744	
パナソニック	1,228	1,325.9	1,117,601	
シャープ	106.6	134.3	155,922	
アンリツ	69.2	74.7	149,400	
富士通ゼネラル	32.8	31.5	59,346	
ソニー	721	733.9	4,770,350	
TDK	56.2	56	501,200	
帝国通信工業	4.7	5.1	5,865	
タムラ製作所	41.4	38.8	15,636	
アルプスアルパイン	111.9	102.7	114,715	
池上通信機	3.4	3.7	3,189	
日本電波工業	9.7	10.5	3,612	
鈴木	5.8	5.7	3,534	
日本トリム	2	1.6	4,681	
ローランド ディー. ジー.	5.5	6.4	7,692	
フォスター電機	12.6	12.2	13,432	
SMK	3	3	6,876	
ヨコオ	7.7	7.5	17,992	
ティアック	7.7	8.3	1,369	
ホシデン	31.6	31.7	23,870	
ヒロセ電機	15.4	18	199,980	
日本航空電子工業	24.6	26.6	34,260	
TOA	11.5	12.4	9,647	
マクセルホールディングス	23.1	25	29,675	
古野電気	13.8	14.9	12,083	
ユニデンホールディングス	3.2	3.2	5,884	
スミダコーポレーション	9.2	8.9	6,141	
アイコム	5.9	6.4	16,083	
リオン	4.9	4.9	11,000	
本多通信工業	9.2	9.9	3,920	
船井電機	10.9	11.7	5,370	
横河電機	107.6	106.5	141,112	
新電元工業	3.8	4.1	10,389	
アズビル	69.4	73.2	198,079	
東亜ディーケーケー	5.3	5.7	5,158	
日本光電工業	47.4	48	159,600	

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	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	株 数	評 価 額
	千株	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	
ブイ・テクノロジー	2.5	5.4	18,603	
東京計器	6.8	7.4	5,298	
愛知時計電機	1.4	1.5	6,067	
インターアクション	5	6.2	13,534	
オーバル	10.5	10.4	2,444	
東京精密	19.4	21	63,840	
マニー	13.1	46.2	118,595	
ニコン	187.3	187.8	193,997	
トプコン	57.7	58.4	48,238	
オリンパス	160.1	642.1	1,028,323	
理研計器	9.5	10.2	22,083	
タムロン	9.5	9.3	17,279	
HOYA	216.4	231.7	2,080,434	
シード	4.6	4.9	3,959	
ノーリツ鋼機	8.5	7.8	7,269	
エー・アンド・デイ	9.8	10.6	7,049	
朝日インテック	45.6	98.5	262,207	
シチズン時計	117.6	135.9	50,826	
リズム時計工業	3.6	3.6	2,404	
大研医器	8.5	8	4,408	
メニコン	14.7	16.4	66,174	
シンシア	1.6	1.2	384	

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ツツミ	3.4	3.6	3.6	6,552
小松ウオール工業	3.3	3.5	3.5	6,737
ヤマハ	63.9	69	69	313,605
河合楽器製作所	3.3	3.6	3.6	8,740
クリナップ	10	10.8	10.8	5,886
ビジョン	65	70.1	70.1	266,029
オリバー	—	2.5	2.5	8,000
兼松サステック	0.7	0.7	0.7	1,038
キングジム	8.9	9.6	9.6	7,728
リンテック	25.6	27.6	27.6	59,698
イトーキ	19.8	24.7	24.7	8,027
任天堂	66.2	71.2	71.2	2,822,368
三菱鉛筆	17.7	19.1	19.1	25,059
タカラスタンダード	22.2	24	24	37,944
コクヨ	51.6	55.7	55.7	80,319
ナカバヤシ	10.6	11.4	11.4	6,042
グローブライド	5.2	5.2	5.2	9,765
オカムラ	37.5	40.5	40.5	34,911
美津濃	10.6	10.5	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	926.4	353,884
中部電力	328.9	355	355	501,437
関西電力	438.6	439.7	439.7	492,683
中国電力	148.6	167.4	167.4	244,236
北陸電力	105.3	106.1	106.1	76,392
東北電力	251.7	289.9	289.9	285,551
四国電力	96.8	104.5	104.5	86,839
九州電力	221.5	239.2	239.2	205,951
北海道電力	100.6	108.6	108.6	48,652
神縄電力	19.9	21.5	21.5	39,044
電源開発	85.5	92.3	92.3	199,275
エフオン	5.1	6.2	6.2	3,050
イーレックス	18.7	16.5	16.5	19,981
レノバ	13.2	19.3	19.3	17,099
東京瓦斯	210.9	223.2	223.2	537,800
大阪瓦斯	208.6	225.2	225.2	428,780
東邦瓦斯	53.2	57.1	57.1	263,802
北海道瓦斯	5.8	6.2	6.2	9,672
広島ガス	22.1	23.9	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
N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	株 数	評 価 額
	千株	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	
ポルトゥウィン・ビットクルーホールディング	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	株 数	評 価 額
	千株	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	
ベリサーブ	0.9	—	—	
ティーガイア	10.6	10.1	20,351	
セック	1.7	1.7	4,681	
日本アジアグループ	11.1	12	3,108	
豆蔵ホールディングス	7.2	7.2	13,572	
テクマトリックス	7.4	8	17,192	
プロシップ	3	3.3	3,623	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	254.2	27.4	42,497	
GMOペイメントゲートウェイ	17.4	18.7	140,063	
ザッパラス	5.5	4.9	1,582	
システムリサーチ	1.4	3	4,410	
インターネットイニシアティブ	17.2	16.8	52,080	
さくらインターネット	12.6	12.2	5,416	
ヴェインクス	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	
Minor 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	
eBASE	3.1	6.8	10,234	
アバント	3.8	8.1	6,698	
アドソル日進	3.7	4	8,716	

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

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サインポスト	—	1.8	2,626
ソルクシーズ	4.5	4.8	2,764
フェイス	4.2	4	2,344
プロトコーポレーション	3.3	10.2	9,241
ハイマックス	1.3	1.3	2,471
野村総合研究所	67.1	161.4	374,932
サイバネットシステム	8.7	8.1	4,584
CEホールディングス	2.8	6.5	2,697
日本システム技術	1.7	1.8	1,737
インテージホールディングス	13.5	14.2	10,990
東邦システムサイエンス	3.1	3	2,595
ソースネクスト	40.9	54	15,822
インフォコム	8.7	12.5	28,362
HEROZ	—	1.1	3,498
ラクスル	—	6.1	14,017
FIG	9.3	12.3	2,829
システムサポート	—	1	2,124
イーソル	—	4.1	4,182
アルテリア・ネットワークス	8.8	12.6	22,604
東海ソフト	—	0.7	781
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	2.4	2.6	1,963
フォーカスシステムズ	7.1	7	5,096
クレスコ	3.2	6.9	9,549
フジ・メディア・ホールディングス	109.4	109.7	120,560
オービック	36.6	39.5	505,995
ジャストシステム	15	18.5	91,852
TDCソフト	9.2	10	7,490
Zホールディングス	687.7	1,563.7	537,912
トレンドマイクロ	56.2	50.6	267,168
IDホールディングス	3	4.3	5,869
日本オラクル	21.4	23.1	210,210
アルファシステムズ	3.3	3.5	9,765
フューチャー	14.3	13.7	18,741
CAC Holdings	7.5	7.4	6,948
SBテクノロジー	4.5	4.1	8,200
トーセ	2.8	3.1	2,256
オービックビジネスコンサルティング	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	株 数	評 価 額
	千株	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 SATホールディングス	80.5	74.9	29,136	
テレビ東京ホールディングス	8.6	9.3	20,525	
日本BS放送	3.6	3.8	3,750	
ビジョン	3.3	9.9	7,524	
スマートバリュー	2.3	3	2,523	
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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
KDDI	929.5	848.6	2,751,161	
ソフトバンク	838.7	1,034.9	1,468,523	
光通信	12.4	11.7	218,790	
NTTドコモ	757.4	841.2	2,676,698	
エムティーアイ	12.2	11	5,643	
GMOインターネット	38.4	44.9	77,632	
ファイバークラウド	—	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・ピー	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	
JBC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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
高千穂交易	4.1	4.4	4,408	
カワニシホールディングス	—	1	1,038	
伊藤忠食品	2.6	2.8	12,012	
エレマテック	4.9	10.7	7,960	
JALUX	3	3.2	5,321	
あらた	5.9	9.1	40,677	
トーメンデバイス	1.6	1.7	5,822	
東京エレクトロン デバイス	3.8	4.1	9,364	
フィールズ	9.3	8.8	2,772	
双日	584.7	631.3	175,501	
アルフレッサ ホールディングス	117.6	127	247,142	
横浜冷凍	27.7	32	28,512	
神栄	1.5	1.6	713	
ラサ商事	5.6	6	5,262	
ラクーンホールディングス	5	4.6	2,267	
アルコニックス	11.2	12.1	12,426	
神戸物産	16	39.4	154,251	
ハイパー	—	1.2	486	
あい ホールディングス	15.1	16.3	21,108	
ディーブイエックス	4.1	4.1	3,763	
ダイワボウホールディングス	9.6	9.7	52,089	
マクニカ・富士エレホールディングス	29.3	27.3	38,356	
ラクト・ジャパン	2.3	4.3	12,943	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19.9	21.5	23,499	
八洲電機	8.2	8.8	7,198	
メディアスホールディングス	6	6.5	4,933	
レスターホールディングス	6.8	11.9	18,766	
ジュ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	株 数	評 価 額
	千株	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	
コンドートテック	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	
メディバルホールディングス	114.2	123.3	237,599	
S PK	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	
I DOM	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	株 数	評 価 額
	千株	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	
キャ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	株 数	評 価 額
	千株	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	
フォーパル	4.6	5	5,835	
PAL TAC	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	株 数	評 価 額
	千株	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	—	—	
東テック	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・バイエリア	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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
エディオン	44.9	52.5	48,720	
サーラコーポレーション	21.5	23.2	12,203	
ワッツ	3.5	5	2,675	
ハローズ	4	4.3	10,625	
フジオフードシステム	4.4	9.6	13,267	
あみやき亭	2.3	2.5	7,925	
ひらまつ	21.1	21	3,717	
大黒天物産	2.5	2.7	7,719	
ハニーズホールディングス	9.3	10.1	11,958	
ファーマライズホールディングス	2.5	2.8	1,741	
アルペン	8.1	8.8	14,291	
ハブ	3.4	3.2	2,300	
クオールホールディングス	15.6	16.8	21,218	
ジンズホールディングス	7.2	6	37,320	
ビックカメラ	56.5	67.8	64,071	
DCMホールディングス	57.1	61.8	60,069	
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CHIホールディングス	12.4	13.3	4,894	
ミサワ	1.9	2.3	956	
ティールライフ	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)		
	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
ウイルプラスホールディングス	1.2	1.4	726
JMホールディングス	4	5.8	11,484
サツドラホールディングス	1.6	1.7	3,148
デファクトスタンダード	0.7	—	—
アレンザホールディングス	5.7	5.7	3,961
串カツ田中ホールディングス	—	1.8	2,514
ブロックジャパนม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ピバ	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)		
	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・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・バシフィック・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
ポブラ	2.8	3	1,326
フジ・コーポレーション	2.1	3	5,397
ユナイテッドアローズ	12.1	12	22,440
ハイデイ日高	15.3	16.5	26,119
京都きもの友禅	6.7	7.3	1,846
コロワイド	35.2	38	66,500
ピーシーデポコーポレーション	14	15.2	5,821
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
チョダ	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
テナアライド	9.8	10.5	4,389
AOKIホールディングス	21.2	22.9	18,640
オークワ	15.1	17.9	27,476
コメリ	16.3	17.6	33,334
青山商事	18.5	23.6	24,803
しまむら	12.3	13.3	96,558
はせがわ	5.6	6	2,394
高島屋	83.1	83.3	84,382
松屋	21.3	23	15,686
エイチ・ツー・オー リテイリング	54.3	54.1	47,283
近鉄百貨店	4	4.4	11,440
パルコ	10.2	—	—
丸井グループ	89.6	104.8	219,765
アクシアル リテイリング	8.8	9.5	34,342
井筒屋	5.4	6.2	1,035
イオン	407.4	439.8	1,022,095
イズミ	21.5	23.2	63,985
平和堂	21.5	23.2	41,249
フジ	12.8	13.8	24,370
ヤオコー	12	13	80,340
ゼビオホールディングス	12.8	13.8	12,571

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ケーズホールディングス	110	110.3	122,984
Olympicグループ	6.2	5.9	3,404
日産東京販売ホールディングス	15.6	16.8	3,813
シルバーライフ	—	1.1	2,072
一家ダイニングプロジェクト	—	0.8	548
Genky DrugStores	5.2	5	9,585
ナルミヤ・インターナショナル	—	1.9	1,121
総合メディカルホールディングス	9.2	9.3	23,715
ブックオフグループホールディングス	5.5	6.7	6,097
アインホールディングス	14.2	14	83,720
元気寿司	3	2.9	7,183
ヤマダ電機	322.5	348.2	164,698
アークランドサカモト	18	17.9	17,040
ニトリホールディングス	45.8	49.5	721,710
グルメ杵屋	7.5	8.1	8,829
愛眼	8.4	9.1	1,965
ケーユーホールディングス	5.5	6	4,776
吉野家ホールディングス	37	37.5	83,287
松屋フーズホールディングス	5.1	5.5	23,375
サガミホールディングス	14.2	15.3	19,890
関西スーパーマーケット	8	9.5	9,671
王将フードサービス	7.8	8.4	49,980
ブレナス	11.9	12.8	23,833
ミニストップ	7.8	8.5	12,554
アークス	19.9	23.4	41,886
バローホールディングス	22.8	25.3	43,490
藤久	0.8	0.9	539
ベルク	5.2	5.6	29,736
大庄	5.7	6.1	7,698
ファーストリテイリング	14.2	15.3	771,732
サンドラッグ	39.8	43	144,050
サックスパー 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	株 数	評 価 額
	千株	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	株 数	評 価 額
	千株	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	株 数	評 価 額
	千株	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	
藍澤証券	19.8	20.5	15,580	
マネーパートナーズグループ	12.4	12.2	2,257	
スパークス・グループ	25	39.6	7,603	
小林洋行	3	3.3	801	
保険業 (2.2%)				
かんぽ生命保険	40	40.5	56,416	
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	株 数	評 価 額
	千株	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
ブレサンスコーポレーション	16.8	18.8	19,533
ユニゾホールディングス	16	17.3	103,108
THEグローバル社	5.4	5.4	1,684
ハウスコム	—	1.5	1,813
日本管理センター	7	7.5	8,355
サンセイランディック	2.8	3.4	2,301
エストラスト	1.4	1.6	848
フージャースホールディングス	23	22.8	14,728
オープンハウス	17.3	33.2	74,832
東急不動産ホールディングス	285.2	311.2	188,587
飯田グループホールディングス	88.4	95.5	142,868
イーグランド	1.5	1.8	1,164
ムゲンエステート	7.3	7.9	3,476
ビーロット	1.6	2.7	3,385
ファーストブラザーズ	2.9	2.6	1,804
ハウスドゥ	5.8	5.6	3,936
シーアールイー	3.5	2.8	2,912
プロパティエージェント	1.1	1.8	1,537
ケイアイスター不動産	2.8	3.6	4,536
アグレ都市デザイン	1.3	1.8	871
グッドコムアセット	1.8	2.6	3,159
ジェイ・エス・ビー	0.4	1.2	4,932
テンポイノベーション	0.9	2.6	1,866
グローバル・リンク・マネジメント	0.8	1.9	1,054
パーク24	62	61.4	111,318
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
テーオーシー	24.3	22.5	13,050
東京楽天地	1.5	1.9	7,714
レオパレス21	130.8	150	42,750
スターツコーポレーション	14.4	15.6	30,591
フジ住宅	13.5	13.3	7,328

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	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DYホールディングス	142.8	154.2	179,334	
ぐるなび	14.6	19.3	11,425	
タカミヤ	10.6	11.7	5,218	
ジャパンバスターズシステム	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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
エスプール	—	19.9	10,765	
WDBホールディングス	4.7	5.1	10,710	
手間いらず	—	0.5	2,087	
ティア	5.2	6.5	3,380	
CDG	0.9	1.2	1,674	
バリュエコマース	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	株 数	評 価 額
	千株	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	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	
リゾ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	
Ke e P e r 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	
I B J	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	
バリュウ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	
ER I ホールディングス	2.9	3.1	1,847	
アピスト	1.6	1.7	3,468	
シグマクシス	4.9	7.6	9,750	

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

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
乃村工藝社	24	47.5	40,090	
藤田観光	4.1	4.8	8,668	
KNT-CTホールディングス	5.5	6.9	5,547	
日本管財	11	11.9	20,920	
トーカイ	9.9	10.7	28,141	
白洋舎	1.2	1.3	3,208	
セコム	109	117.7	1,040,468	
セントラル警備保障	4.9	5.3	21,703	
丹青社	19.4	20.9	14,713	
メイテック	13	13.7	60,828	
応用地質	11	11.9	14,149	
船井総研ホールディングス	21.2	22.9	51,273	
進学会ホールディングス	4.7	4.3	2,038	
オオバ	8.1	8	4,176	
いであ	2.1	2	3,082	
学究社	3.4	3.2	3,884	
ベネッセホールディングス	37.6	36.9	98,855	
イオンディライト	12.7	13.7	43,292	
ナック	6.5	6.1	4,800	
ニチイ学館	14.6	15.8	16,969	
ダイセキ	17.2	18.6	41,161	
ステップ	3.8	4.1	5,740	
合 計	株 数 ・ 金 額	125,044	137,340	232,815,716
	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）	1,531,370,129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（FOF s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・イヤヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	46,177,528円

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

[お知らせ]

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

(2019年7月1日)

外国株式インデックスマザーファンド

《第18期》決算日2019年5月13日

[計算期間：2018年5月15日～2019年5月13日]

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

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	(円換算ベース)	期 騰 落				
	円	%		%	%	%	%	百万円
14期(2015年5月12日)	23,063	26.9	162.29	24.2	96.5	1.2	2.2	227,514
15期(2016年5月12日)	19,726	△14.5	135.59	△16.4	94.4	2.8	2.7	270,065
16期(2017年5月12日)	24,302	23.2	163.31	20.4	92.9	1.9	2.4	332,985
17期(2018年5月14日)	26,785	10.2	176.07	7.8	94.4	3.4	2.2	337,226
18期(2019年5月13日)	27,724	3.5	178.38	1.3	93.8	3.8	2.5	437,368

(注) MSCI Kokusai Index (MSCI コクサイ インデックス) とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCI Kokusai Index (円換算ベース) は、MSCI Kokusai Index (米ドルベース) をもとに委託会社が計算したものです。また、MSCI Kokusai Index に対する著作権及びその他の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 (M S C I コ ク サ イ インデックス)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2018年5月14日	26,785	—	176.07	—	94.4	3.4	2.2
5月末	26,344	△1.6	172.74	△ 1.9	93.9	3.1	2.2
6月末	26,558	△0.8	174.02	△ 1.2	94.9	3.0	2.3
7月末	27,606	3.1	180.76	2.7	94.8	3.0	2.2
8月末	28,202	5.3	184.18	4.6	92.8	5.5	2.2
9月末	28,916	8.0	188.72	7.2	93.6	4.6	2.1
10月末	26,374	△1.5	171.88	△ 2.4	94.8	2.9	2.4
11月末	26,984	0.7	175.40	△ 0.4	92.8	4.7	2.4
12月末	24,170	△9.8	156.81	△10.9	92.2	6.4	2.4
2019年1月末	25,738	△3.9	166.68	△ 5.3	93.6	3.9	2.5
2月末	27,280	1.8	176.62	0.3	92.8	4.8	2.4
3月末	27,471	2.6	177.42	0.8	91.5	6.2	2.5
4月末	28,697	7.1	185.03	5.1	92.9	4.8	2.4
(期 末) 2019年5月13日	27,724	3.5	178.38	1.3	93.8	3.8	2.5

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

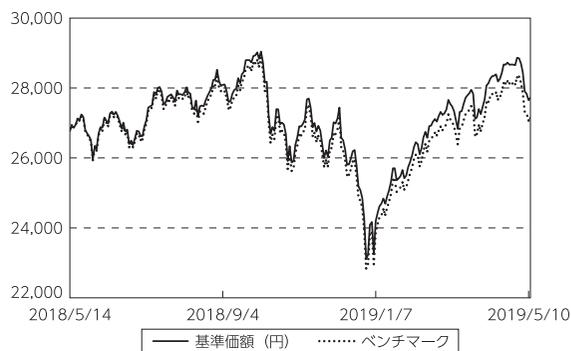
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.5%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

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

基準価額等の推移



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

●投資環境について

◎外国株式市況

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

◎為替市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

(注) マルチファクターモデル

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

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは1.3%の上昇になったため、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	%	(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)	(2)	(0.008)	
(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	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
国	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)	千イスラエルシケル 6,066 (-)	899 (-)	千イスラエルシケル 3,457 (920)

(注) 金額は受渡代金。

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

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HCP INC	20	590	10	275
MACERICH CO/THE	5	256	3	175
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6	880	2	371
PROLOGIS INC	40	2,719	17	1,114
CAMDEN PROPERTY TRUST	5	497	3	279
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7	350	1	86
DIGITAL REALTY TRUST INC	11	1,316	6	719
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	912	1	460
EXTRA SPACE STORAGE INC	4	469	2	185
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5	663	3	455
WELLTOWER INC	22	1,522	12	816
BOSTON PROPERTIES INC	8	1,068	4	543
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4	470	1	186
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
GGP INC	(21)	(513)	—	—
			(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
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)

外

国

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	LINK REIT	94	7,870	50	3,636
	小計	94	7,870	50	3,636
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	76 (-)	147 (△ 2)	66	118
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	153	285	79	137
	CAPITALAND MALL TRUST	247	543	180	381
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	141 (-)	388 (△ 4)	45	116
	小計	619 (-)	1,364 (△ 7)	371	753

(注) 金額は受渡代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 242,816	百万円 238,585	百万円 -	百万円 -

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

○株式売買比率

(2018年5月15日～2019年5月13日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2018年5月15日～2019年5月13日)

利害関係人との取引状況

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ILLINOIS TOOL WORKS	246	309	4,731	519,278	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	316	403	930	102,099	メディア・娯楽
IDEX CORP	62	81	1,258	138,071	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	65	89	1,218	133,673	素材
JOHNSON & JOHNSON	2,149	2,783	38,698	4,246,798	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	84	103	1,248	137,006	運輸
KELLOGG CO	207	274	1,611	176,857	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	281	359	4,585	503,203	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,194	1,508	7,825	858,727	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	704	827	2,137	234,590	食品・生活必需品小売り
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	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NUCOR CORP	255	327	1,859	204,094	素材
NEWELL BRANDS INC	392	474	727	79,852	耐久消費財・アパレル
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	350	—	—	—	メディア・娯楽
NOBLE ENERGY INC	369	483	1,164	127,833	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	612	782	4,303	472,289	エネルギー
OMNICOM GROUP	183	235	1,876	205,884	メディア・娯楽
PEPSICO INC	1,137	1,464	18,752	2,057,935	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	76	95	938	102,944	素材
ALTRIA GROUP INC	1,526	1,949	10,159	1,114,957	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	94	114	1,085	119,069	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,028	2,585	27,407	3,007,746	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	380	478	6,332	694,883	銀行
PFIZER INC	4,768	5,998	24,424	2,680,349	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	338	428	4,334	475,707	保険
PULTEGROUP INC	198	266	841	92,382	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	106	137	2,382	261,407	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	135	176	2,673	293,383	エネルギー
CITIGROUP INC	2,114	2,533	17,203	1,887,947	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	230	299	1,692	185,683	保険
PPG INDUSTRIES INC	203	248	2,794	306,674	素材
PENTAIR PLC	146	174	663	72,861	資本財
PRAXAIR INC	229	—	—	—	素材
P G & E CORP	412	—	—	—	公益事業
PPL CORP	554	758	2,354	258,393	公益事業
PROGRESSIVE CORP	465	604	4,437	486,957	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	407	525	3,113	341,725	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	136	173	2,188	240,146	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	231	295	5,326	584,485	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	187	236	1,985	217,875	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	926	1,094	1,646	180,726	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	30	42	703	77,156	保険
ROPER TECHNOLOGIES INC	81	107	3,817	418,920	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	338	532	1,578	173,254	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	98	127	737	80,903	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	102	125	2,084	228,748	資本財
SCHLUMBERGER LTD	1,108	1,422	5,625	617,356	エネルギー
STRYKER CORP	269	349	6,547	718,475	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	964	1,261	5,785	634,869	各種金融
SEMPRA ENERGY	192	284	3,673	403,080	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	67	87	3,845	422,035	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	122	159	2,263	248,383	資本財
SUNTRUST BANKS INC	380	464	2,963	325,160	銀行
TRAVELERS COS INC/THE	218	274	3,953	433,880	保険
SOUTHERN CO/THE	806	1,068	5,703	625,877	公益事業
AT&T INC	4,911	7,550	23,119	2,537,181	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	236	306	1,407	154,442	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	296	394	2,554	280,293	各種金融
SYSCO CORP	396	512	3,793	416,270	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	135	158	688	75,511	素材
SCANA CORP	98	—	—	—	公益事業
TEXAS INSTRUMENTS INC	788	995	11,207	1,229,864	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	100	113	1,191	130,768	小売

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
LEIDOS HOLDINGS INC	118	151	1,141	125,266	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	113	134	684	75,118	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	93	106	896	98,399	資本財
AVNET INC	90	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPG PHOTONICS CORP	31	37	570	62,640	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	267	374	894	98,160	素材
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	190	253	563	61,879	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	41	49	2,345	257,406	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	94	121	1,443	158,450	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	100	135	2,390	262,364	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	261	388	667	73,237	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	281	356	3,237	355,301	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	290	348	2,769	303,881	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	82	103	1,804	198,067	耐久消費財・アパレル
WABCO HOLDINGS INC	39	54	722	79,251	資本財
MERCADOLIBRE INC	33	44	2,482	272,478	小売
VMWARE INC-CLASS A	57	87	1,743	191,321	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	229	272	1,401	153,769	保険
SEATTLE GENETICS INC	91	116	785	86,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ULTA BEAUTY INC	46	58	2,019	221,595	小売
LKQ CORP	256	323	884	97,057	小売
HORMEL FOODS CORP	237	307	1,224	134,372	食品・飲料・タバコ
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	71	—	—	—	運輸
EASTMAN CHEMICAL CO	115	148	1,126	123,568	素材
HARRIS CORP	95	122	2,220	243,703	資本財
HUMANA INC	114	142	3,476	381,472	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	—	303	1,131	124,211	公益事業
INVESCO LTD	331	426	909	99,830	各種金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	140	185	1,529	167,900	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	112	136	720	79,019	各種金融
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	132	172	1,732	190,164	ソフトウェア・サービス
CONCHO RESOURCES INC	118	210	2,363	259,417	エネルギー
MSCI INC	72	91	2,048	224,761	各種金融
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	69	90	380	41,724	エネルギー
MOLSON COORS BREWING CO -B	153	201	1,183	129,925	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,242	1,613	13,636	1,496,512	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,450	1,825	29,337	3,219,527	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	144	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CABOT OIL & GAS CORP	379	455	1,183	129,899	エネルギー
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	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
EVERSOURCE ENERGY	256	329	2,367	259,786	公益事業
INGREDION INC	59	73	631	69,319	食品・飲料・タバコ
ALLERGAN PLC	265	350	4,905	538,340	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWN HOLDINGS INC	105	138	833	91,489	素材
EATON VANCE CORP	86	126	500	54,872	各種金融
DELTA AIR LINES INC	150	182	1,032	113,277	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	144	188	2,038	223,753	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	125	164	2,310	253,572	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	218	274	3,350	367,654	小売
FORTINET INC	120	146	1,213	133,132	ソフトウェア・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	58	71	607	66,613	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	20	26	1,917	210,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIT GROUP INC	113	108	566	62,132	銀行
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	-	20	143	15,785	運輸
GENERAL MOTORS CO	1,022	1,317	4,991	547,818	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	270	356	3,571	391,976	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	268	338	2,797	306,957	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	37	44	920	100,969	資本財
HCA HEALTHCARE INC	226	286	3,539	388,465	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	135	173	762	83,729	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	391	720	3,830	420,367	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	85	124	1,272	139,652	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	122	142	771	84,637	資本財
DEXCOM INC	-	91	1,088	119,409	ヘルスケア機器・サービス
MIDDLEBY CORP	44	60	822	90,288	資本財
XYLEM INC	143	190	1,486	163,173	資本財
ABIOMED INC	-	44	1,163	127,720	ヘルスケア機器・サービス
TRIPADVISOR INC	82	114	544	59,793	メディア・娯楽
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	48	63	880	96,644	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	126	172	1,786	196,020	銀行
ALLEGHANY CORP	12	15	1,053	115,625	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	63	82	2,590	284,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	348	456	3,958	434,388	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	1,908	2,492	46,937	5,150,924	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	229	300	1,669	183,230	公益事業
ALBEMARLE CORP	88	110	799	87,730	素材
PVH CORP	62	78	935	102,613	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	1,609	2,097	4,131	453,352	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	291	372	917	100,635	商業・専門サービス
APTIV PLC	212	274	2,120	232,729	自動車・自動車部品
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	140	163	798	87,679	資本財
SPLUNK INC	111	151	2,026	222,340	ソフトウェア・サービス
OGE ENERGY CORP	154	204	850	93,324	公益事業
POLARIS INDUSTRIES INC	46	62	558	61,297	耐久消費財・アパレル
ABBVIE INC	1,277	1,561	12,091	1,326,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC	107	133	3,199	351,061	自動車・自動車部品
CHEMIEERE 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	株数	当期		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	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
FORTTIVE 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	株数	当 期		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 銘柄 数 < 比 率 >	244,756 601	314,557 598	2,558,910 —	280,814,854 <64.2%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ROYAL BANK OF CANADA	1,166	1,491	15,718	1,283,856	銀行	
IMPERIAL OIL LTD	231	298	1,130	92,372	エネルギー	
THOMSON REUTERS CORP	232	212	1,823	148,970	商業・専門サービス	
TC ENERGY CORP	699	955	6,011	491,037	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	291	377	2,604	212,720	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	490	621	3,335	272,434	保険	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	457	520	1,528	124,872	素材	
BARRICK GOLD CORP	944	1,812	2,915	238,138	素材	
BCE INC	115	162	968	79,128	電気通信サービス	
BOMBARDIER INC-B	1,756	2,265	482	39,406	資本財	
BANK OF MONTREAL	518	662	6,895	563,215	銀行	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	673	875	5,612	458,408	各種金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	959	1,271	9,193	750,895	銀行	
BAUSCH HEALTH COS INC	243	329	1,117	91,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAE INC	192	280	875	71,538	資本財	
CAMECO CORP	350	412	570	46,608	エネルギー	
CI FINANCIAL CORP	239	261	541	44,214	各種金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	348	458	5,073	414,384	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	973	1,246	4,729	386,331	エネルギー	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	598	755	9,368	765,181	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	52	62	895	73,141	小売	
ENBRIDGE INC	1,324	2,103	10,390	848,730	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	22	29	1,788	146,123	保険	
CGI INC	204	260	2,502	204,425	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	257	347	466	38,121	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	78	78	286	23,394	各種金融	
LOBLAW COMPANIES LTD	174	190	1,291	105,484	食品・生活必需品小売り	
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,583	2,054	4,888	399,294	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	275	328	2,081	169,989	自動車・自動車部品	
NATIONAL BANK OF CANADA	273	354	2,243	183,261	銀行	
ONEX CORPORATION	63	90	679	55,501	各種金融	
POWER CORP OF CANADA	278	358	1,068	87,314	保険	
POWER FINANCIAL CORP	192	274	855	69,871	保険	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	329	475	1,296	105,879	メディア・娯楽	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC	1,325	1,658	7,089	579,079	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	36	81	817	66,800	食品・生活必需品小売り
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	116	148	4,357	355,889	運輸
ENCANA CORP	788	1,584	1,401	114,502	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	189	252	1,365	111,541	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	150	162	367	30,037	資本財
GOLDCORP INC	704	—	—	—	素材
KINROSS GOLD CORP	901	1,314	536	43,789	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	134	165	448	36,617	資本財
GREAT-WEST 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	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
SHOPIFY INC - CLASS A	71	94	3,264	266,631	ソフトウェア・サービス	
NUTRIEN LTD	515	638	4,465	364,702	素材	
WSP GLOBAL INC	—	102	714	58,352	資本財	
AURORA CANNABIS INC	—	741	834	68,151	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CANOPY GROWTH CORP	—	219	1,394	113,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
STARS GROUP INC/THE	—	199	526	43,008	消費者サービス	
IA FINANCIAL CORP INC	—	121	618	50,503	保険	
CRONOS GROUP INC	—	199	410	33,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数	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	株数	当 期		期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	99	125	431	53,155		電気通信サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	40	53	323	39,891		自動車・自動車部品	
HANNOVER RUECK SE	48	61	791	97,593		保険	
BRENNTAG AG	130	167	753	92,827		資本財	
AXEL SPRINGER SE	33	49	235	28,967		メディア・娯楽	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	63	67	238	29,363		素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	679	679	193	23,884		電気通信サービス	
OSRAM LICHT AG	83	104	299	36,863		資本財	
VONOVIA SE	389	511	2,453	302,343		不動産	
EVONIK INDUSTRIES AG	122	180	473	58,306		素材	
ZALANDO SE	85	122	477	58,901		小売	
COVESTRO AG	154	194	854	105,328		素材	
SCHAEFFLER AG - PREF	161	—	—	—		自動車・自動車部品	
UNIPER SE	162	197	519	64,085		公益事業	
INNOGY SE	108	145	582	71,850		公益事業	
METRO AG	118	183	255	31,475		食品・生活必需品小売り	
KION GROUP AG	53	68	376	46,366		資本財	
LINDE AG - TENDER	148	—	—	—		素材	
I&I 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	426	67,660		食品・飲料・タバコ	
POSTE ITALIANE SPA	373	573	515	63,578		保険	
MONCLER SPA	—	181	665	82,071		耐久消費財・アパレル	
PIRELLI & C SPA	—	430	246	30,356		自動車・自動車部品	
小 計	株 数	金 額	42,860	55,628	23,816	2,935,362	
	銘柄 数	< 比 率 >	19	18	—	< 0.7% >	
(ユーロ…フランス)							
MICHELIN (CGDE)	137	176	1,941	239,235		自動車・自動車部品	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	223	288	9,607	1,184,092	耐久消費財・アパレル
PEUGEOT SA	471	618	1,308	161,237	自動車・自動車部品
AXA SA	1,551	2,006	4,433	546,475	保険
DANONE	482	639	4,465	550,335	食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	474	625	1,096	135,120	食品・生活必需品小売り
VIVENDI	826	1,081	2,676	329,888	メディア・娯楽
INGENICO GROUP	43	67	481	59,328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOCIETE GENERALE SA	613	801	2,090	257,594	銀行
AIR LIQUIDE SA	343	444	5,041	621,379	素材
TOTAL SA	1,922	2,501	11,722	1,444,817	エネルギー
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	399	515	1,752	215,968	資本財
VINCI SA	405	526	4,520	557,141	資本財
SANOFI	909	1,168	8,500	1,047,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	392	565	1,170	144,297	公益事業
L'OREAL	201	261	6,143	757,141	家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	154	199	701	86,454	消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	453	569	4,058	500,241	資本財
BNP PARIBAS	898	1,164	5,298	652,983	銀行
ESSILORLUXOTTICA	166	298	3,289	405,400	耐久消費財・アパレル
CAPGEMINI SE	128	166	1,733	213,622	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	52	52	174	21,561	食品・生活必需品小売り
VALEO SA	191	245	702	86,534	自動車・自動車部品
HERMES INTERNATIONAL	25	32	2,004	247,007	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA	75	91	911	112,361	消費者サービス
KERING	60	78	3,980	490,563	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	104	135	1,839	226,757	ソフトウェア・サービス
ATOS SE	76	97	664	81,842	ソフトウェア・サービス
ORANGE	1,599	2,066	2,837	349,767	電気通信サービス
CNP ASSURANCES	126	177	354	43,721	保険
IMERY S 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	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			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	
WORLDDLINE 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	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	216	269	403	49,705	資本財	
ENDESA SA	243	318	709	87,473	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	195	273	1,030	126,998	資本財	
IBERDROLA SA	4,657	6,433	5,141	633,744	公益事業	
TELEFONICA SA	3,732	4,838	3,438	423,844	電気通信サービス	
BANCO SANTANDER SA	12,896	16,803	6,925	853,558	銀行	
BANKINTER SA	515	662	449	55,421	銀行	
REPSOL SA	1,001	1,454	2,078	256,139	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,322	6,895	3,501	431,549	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	277	372	966	119,134	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	871	1,128	2,842	350,349	小売	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	558	—	—	—	運輸	
MAPFRE SA	969	1,250	327	40,366	保険	
FERROVIAL SA	392	516	1,061	130,774	資本財	
ENAGAS SA	172	240	609	75,080	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	363	435	823	101,500	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	4,391	5,932	617	76,151	銀行	
CAIXABANK SA	2,858	3,668	1,007	124,198	銀行	
GRIFOLS SA	241	308	710	87,545	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMADEUS IT GROUP SA	350	454	3,012	371,306	ソフトウェア・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	483	—	—	—	運輸	
BANKIA SA	911	1,302	303	37,414	銀行	
AENA SME SA	54	69	1,138	140,372	運輸	
小 計	株数・金額	41,679	53,629	37,100	4,572,629	
	銘柄数<比率>	23	21	—	<1.0%>	
(ユーロ…ベルギー)						
AGEAS	155	198	901	111,063	保険	
UCB SA	105	128	875	107,877	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	67	87	722	89,077	各種金融	
UMICORE	170	217	662	81,634	素材	
COLRUYT SA	53	63	407	50,241	食品・生活必需品小売り	
KBC GROUP NV	200	262	1,572	193,769	銀行	
SOLVAY SA	57	76	694	85,580	素材	
PROXIMUS	107	168	418	51,587	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	35	59	278	34,346	メディア・娯楽	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	609	790	5,855	721,654	食品・飲料・タバコ	
小 計	株数・金額	1,562	2,052	12,388	1,526,833	
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	244	320	1,076	132,719	銀行	
VERBUND AG	—	71	314	38,710	公益事業	
OMV AG	120	157	691	85,254	エネルギー	
VOESTALPINE AG	89	123	326	40,195	素材	
ANDRITZ AG	51	73	261	32,171	資本財	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	111	145	336	41,474	銀行	
小 計	株数・金額	617	890	3,006	370,525	
	銘柄数<比率>	5	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
RTL GROUP	25	42	198	24,465	メディア・娯楽	
AROUNDTOWN SA	—	818	613	75,584	不動産	
TENARIS SA	380	497	580	71,569	エネルギー	
SES	317	369	568	70,106	メディア・娯楽	

銘柄	株数	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…ルクセンブルク)	百株	百株	千ユーロ	千円		
EUROFINS SCIENTIFIC	10	12	497	61,260	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCELORMITTAL	533	707	1,149	141,671	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,266	2,448	3,607	444,657	
		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 銘柄数<比率>	7,372	9,578	12,258	1,510,910	
		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	
ATB 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 銘柄数<比率>	2,775	3,879	6,916	852,515	
		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 銘柄数<比率>	2,469	3,359	1,917	236,315	
		3	3	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	158,300	203,649	391,901	48,301,903	
		240	240	—	<11.0%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BARCLAYS PLC	13,647	17,749	2,795	399,162	銀行	
BP PLC	15,849	20,780	10,893	1,555,193	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	57,648	73,795	4,505	643,212	銀行	
ASTRAZENECA PLC	1,013	1,314	7,480	1,068,037	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SMITHS GROUP PLC	328	419	628	89,716	資本財	
NEXT PLC	120	149	839	119,816	小売	
DIAGEO PLC	1,998	2,518	8,172	1,166,805	食品・飲料・タバコ	
SKY PLC	825	—	—	—	メディア・娯楽	
BAE SYSTEMS PLC	2,553	3,251	1,526	217,886	資本財	
UNILEVER PLC	986	1,152	5,314	758,741	家庭用品・パーソナル用品	
TESCO PLC	7,792	10,156	2,458	351,065	食品・生活必需品小売り	
RELX PLC	856	2,042	3,557	507,866	商業・専門サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,211	1,677	455	64,967	小売	

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

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		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	
RANGOLD RESOURCES LTD	72	—	—	—	素材	
BABCOCK INTL GROUP PLC	227	227	118	16,898	商業・専門サービス	
ST JAMES'S PLACE PLC	422	543	598	85,399	各種金融	
GLENCORE PLC	9,805	11,709	3,288	469,501	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	196	302	695	99,249	各種金融	
CRODA INTERNATIONAL PLC	107	132	674	96,242	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,769	5,084	926	132,338	資本財	
COCA-COLA HBC AG-DI	139	209	572	81,675	食品・飲料・タバコ	
EASYJET PLC	118	192	199	28,430	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,067	1,489	466	66,594	保険	
ROYAL MAIL PLC	686	980	239	34,139	運輸	
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-GENUSSCHEIN	562	729	18,812	2,041,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	7	9	2,462	267,254	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	40	55	1,147	124,502	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	121	156	4,952	537,455	保険	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8	11	913	99,186	ヘルスケア機器・サービス	
LONZA GROUP AG-REG	59	77	2,429	263,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	39	62	343	37,231	耐久消費財・アパレル	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	34	40	852	92,514	資本財	

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
ALUMINA LTD	2,184	2,703	608	46,604	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	749	976	3,488	267,270	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,355	2,979	8,194	627,802	銀行
RIO TINTO LTD	332	386	3,684	282,252	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,123	1,364	1,726	132,275	保険
LENLEASE 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	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			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 銘柄数<比率>	60,303 59	77,180 61	131,010 —	10,036,709 <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 銘柄数<比率>	5,095 7	6,693 7	5,016 —	362,474 <0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
WHARF HOLDINGS LTD	920	1,170	2,638	36,884	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	365	510	4,926	68,873	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,163	2,808	22,399	313,141	資本財	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,160	1,660	22,244	310,971	不動産	
MTR CORP	1,180	1,635	7,553	105,600	運輸	
HONG KONG & CHINA GAS	6,831	9,704	18,167	253,981	公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,940	6,570	8,251	115,361	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,155	1,435	8,000	111,841	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	943	1,239	31,222	436,494	各種金融	
HANG LUNG GROUP LTD	850	880	1,905	26,634	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,490	2,180	3,723	52,053	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	1,335	1,725	15,102	211,131	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	935	1,369	6,511	91,035	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	908	1,366	3,299	46,125	銀行	
HANG SENG BANK LTD	613	795	16,138	225,616	銀行	
HYSAN DEVELOPMENT CO	570	710	3,028	42,333	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,220	1,220	1,288	18,010	消費者サービス	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	244	334	2,904	40,599	半導体・半導体製造装置	
SINO LAND CO	2,294	3,334	4,340	60,685	不動産	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	480	765	1,897	26,522	耐久消費財・アパレル	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	505	710	4,451	62,234	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,965	3,870	12,751	178,268	銀行	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	1,105	1,385	7,243	101,264	耐久消費財・アパレル	
PCCW LTD	4,060	4,060	1,940	27,130	電気通信サービス	
LI & FUNG LTD	5,420	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
KERRY PROPERTIES LTD	605	605	1,948	27,234	不動産	
MINTH GROUP LTD	540	840	2,032	28,418	自動車・自動車部品	
NWS HOLDINGS LTD	1,465	1,785	2,898	40,525	資本財	
SANDS CHINA LTD	1,948	2,464	10,213	142,781	消費者サービス	
WHEELOCK & CO LTD	620	840	4,582	64,059	不動産	

銘柄	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	
ATA 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	
SEBACORP 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 HAPUALIM 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	株数	当 期 末		業 種 等	
		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	株 数 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	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) ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	千口 182	千口 278	千シンガポールドル 817	千円 65,767	% 0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	802 4	1,050 4	2,389 —	192,147 < 0.0% >
合 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,041 64	5,021 62	— —	10,723,360 < 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	百万円	百万円
株式先物取引		
SP EMINI	11,500	—
SP/TSE60	654	—
SWISS IX	532	—
EURO ST	2,303	—
SPI 200	747	—
FTSE100	1,024	—

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

○投資信託財産の構成

(2019年5月13日現在)

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

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月13日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○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VA20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VA40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VA45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VA30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 券 組 入 比 率	債 券 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		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	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 $\Delta 0.0\%$ 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
		千円	千円
国 内	国債証券	213,627,146	155,720,266 (100,000)
	地方債証券	8,762,826	6,473,202
	特殊債券	14,732,314	13,122,127 (598,998)
	社債券	12,843,825	6,478,771 (400,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

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

○利害関係人との取引状況等

(2018年5月15日～2019年5月13日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$

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

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

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
第17回横浜市公募公債 (20年)	2.07	80,000	94,993	2028/12/20
第20回横浜市公募公債 (20年)	2.1	80,000	96,229	2029/10/19
平成24年度第4回横浜市公募公債	0.81	100,000	103,003	2023/2/20
第25回横浜市公募公債 (20年)	1.72	100,000	118,903	2032/7/16
平成27年度第2回横浜市公募公債	0.568	200,000	206,670	2025/6/16
第27回横浜市公募公債 (20年)	1.599	60,000	70,724	2033/5/20
平成22年度第8回札幌市公募公債 (30年)	2.277	80,000	107,232	2040/9/20
平成23年度第3回札幌市公募公債	1.944	300,000	363,213	2031/7/29
平成26年度第5回札幌市公募公債	0.961	100,000	108,493	2029/9/20
平成27年度第9回札幌市公募公債	0.19	100,000	101,054	2025/12/19
第3回川崎市公募公債 (15年)	1.82	100,000	102,910	2020/12/21
第44回川崎市公募公債 (5年)	0.162	130,400	130,616	2020/6/19
第17回北九州市公募公債 (20年)	1.529	100,000	117,576	2034/6/20
平成22年度第2回北九州市公募公債	1.26	100,000	102,019	2020/12/24
平成25年度第3回北九州市公募公債	0.728	300,000	309,879	2023/12/26
平成22年度第9回福岡市公募公債	1.32	106,500	109,102	2021/3/25
平成23年度第6回福岡市公募公債	1.0	100,000	102,434	2021/10/28
平成24年度第4回福岡市公募公債	0.8	200,000	205,478	2022/10/31
平成25年度第4回福岡市公募公債	0.68	50,000	51,478	2023/10/24
平成26年度第6回福岡市公募公債 (20年)	1.371	100,000	115,371	2034/9/20
平成25年度第2回広島市公募公債	0.72	100,000	103,258	2023/12/27
平成28年度第4回広島市公募公債	0.165	100,000	101,026	2026/12/25
平成29年度第6回広島市公募公債	0.23	300,000	304,092	2028/2/25
平成22年度第2回千葉市公募公債	0.92	100,000	101,312	2020/10/22
平成24年度第1回相模原市公募公債	0.71	200,000	205,046	2022/12/20
平成22年度第1回三重県公募公債	1.056	87,050	88,460	2020/11/30
平成23年度第1回三重県公募公債	1.021	98,410	100,946	2021/11/30
平成24年度第4回福井県公募公債	0.46	100,000	101,755	2023/4/26
平成26年度第4回福井県公募公債	0.425	100,000	102,406	2025/4/24
平成27年度第4回福井県公募公債	0.085	200,000	200,762	2026/4/27
平成23年度第1回徳島県公募公債	1.02	100,000	102,575	2021/11/30
平成27年度第1回徳島県公募公債	0.476	300,000	308,736	2025/11/27
平成29年度第2回徳島県公募公債	0.19	108,000	109,193	2027/11/30
平成24年度第1回山梨県公募公債	0.8	200,000	205,464	2022/10/28
平成24年度第2回岡山県公募公債	0.68	100,000	102,573	2023/3/29
平成26年度第1回岡山市公募公債	0.33	100,000	101,770	2025/1/30
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券	0.06	200,000	200,186	2023/3/29
第96回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	2.34	100,000	120,509	2028/12/20
第132回福岡北九州高速道路債券	0.704	100,000	102,741	2024/3/19
小 計		30,807,350	32,542,061	
特殊債券(除く金融債)				
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	103,487	2021/2/26
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	240,668	2029/5/31
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	120,796	2029/9/28
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	120,913	2029/10/31

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

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

先物取引の銘柄別期末残高

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

○投資信託財産の構成

(2019年5月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
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)	9,847,850,474
(F) 前期繰越損益金	134,522,690,775
(G) 追加信託差損益金	55,556,167,569
(H) 解約差損益金	△ 41,991,139,389
(I) 計(E+F+G+H)	157,935,569,429
次期繰越損益金(I)	157,935,569,429

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

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

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

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oward)	57,585,505円
eMAXIS 最適化バランス (マイストラライカー)	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VA20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VA40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VA50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VA75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VA45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VA30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 (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		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	%		%	%	%	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いません。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 (<small>除く日本、円ヘッジ円ベース</small>)		債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	券 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	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	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(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	千アメリカドル 380,260	千アメリカドル 344,703
	カナダ	千カナダドル 15,458	千カナダドル 19,740
	メキシコ	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
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 31,092	千イギリスポンド 35,730
	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	利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.125 T-NOTE 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	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	1.875 T-NOTE 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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	2.5 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	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	3.625 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	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	銘柄		利 率	当 額面金額	期 末		償還年月日	
					評 価 額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	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				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
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				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	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

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				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	
			千ユーロ	千ユーロ	千円		
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		

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				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		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ								
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	

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				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
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	

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

銘柄	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		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	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	

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				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 SINGAPOREGOVT 211001	1.25	150	149	12,060	2021/10/1
		1.75 SINGAPOREGOVT 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	銘柄	利 率	当 期		末		償還年月日
			額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
	国債証券	2.125 SINGAPORGOV 260601	2.125	550	570	45,992	2026/6/1
		2.25 SINGAPORGOV 210601	2.25	1,150	1,162	93,736	2021/6/1
		2.25 SINGAPORGOV 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 SINGAPORGOV 230701	2.75	1,400	1,462	117,873	2023/7/1
		2.75 SINGAPORGOV 420401	2.75	1,150	1,313	105,903	2042/4/1
		2.75 SINGAPORGOV 460301	2.75	650	744	59,972	2046/3/1
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	450	498	40,150	2029/7/1
		2.875SINGAPORGOV 300901	2.875	800	890	71,807	2030/9/1
		3 SINGAPORGOV 240901	3.0	2,650	2,832	228,289	2024/9/1
		3.125SINGAPORGOV 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 SINGAPORGOV 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。