

## 当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商 品 分 類 |                                                                                                               | 追加型投信／内外／資産複合／インデックス型                                                                                                                                                                               |  |
|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| 信 託 期 間 |                                                                                                               | 無期限（2016年3月30日設定）                                                                                                                                                                                   |  |
| 運 用 方 針 |                                                                                                               | 各マザーファンド受益証券への投資を通じて、最適化バランス（6％）指数に連動する成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。<br>対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 |  |
| 主要運用対象  | ベビーファンド                                                                                                       | T O P I X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、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証R E I T指数マザーファンド受益証券およびM U A M G - R E I Tマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。                 |  |
|         | T O P I X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                                                                                             | M S C I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                                                                                             | N O M U R A - B P I総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。                                                                                                                                                        |  |
|         | 外国債券インデックスマザーファンド                                                                                             | F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。                                                                                                                                                |  |
|         | 東証R E I T指数マザーファンド                                                                                            | 東証R E I T指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。                                                                                                                                                      |  |
|         | M U A M G - R E I Tマザーファンド                                                                                    | S & P先進国R E I Tインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。                                                                                                                                |  |
| 主な組入制限  | ベビーファンド                                                                                                       | 株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。                                                                                                                                                         |  |
|         | T O P I X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。                                                                                                                                                                                    |  |
|         | 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。                                                                                                                                                                               |  |
|         | 東証R E I T指数マザーファンド                                                                                            | 株式および外貨建資産への投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。                                                                                                                                                         |  |
|         | M U A M G - R E I Tマザーファンド                                                                                    | 株式への直接投資は行いません。投資信託証券および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。                                                                                                                                                       |  |
| 分 配 方 針 | 経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 |                                                                                                                                                                                                     |  |
|         | 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）                                    |                                                                                                                                                                                                     |  |

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

## 運用報告書（全体版）



## eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)

第5期（決算日：2021年1月26日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
 さて、お手持ちの「eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）」は、去る1月26日に第5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）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

## 本資料の表記にあたって

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

## ○設定以来の運用実績

| 決算期            | 基準価額<br>(分配落) |           |      | 最適化バランス<br>(6%) 指数 |      | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 債券<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|----------------|---------------|-----------|------|--------------------|------|------------|------------|------------|------------|--------------------|-----------|
|                | 税込み<br>分配金    | 期中<br>騰落率 | 騰落率  | 期中<br>騰落率          | 騰落率  |            |            |            |            |                    |           |
| (設定日)          | 円             | 円         | %    |                    | %    | %          | %          | %          | %          | %                  | 百万円       |
| 2016年3月30日     | 10,000        | —         | —    | 144.00             | —    | —          | —          | —          | —          | —                  | 10        |
| 1期(2017年1月26日) | 9,992         | 0         | △0.1 | 144.00             | 0.0  | 15.8       | 0.4        | 77.1       | —          | 5.1                | 79        |
| 2期(2018年1月26日) | 10,536        | 0         | 5.4  | 151.90             | 5.5  | 16.4       | 0.4        | 76.5       | 0.1        | 5.1                | 578       |
| 3期(2019年1月28日) | 10,279        | 0         | △2.4 | 148.30             | △2.4 | 17.4       | 0.5        | 75.3       | 0.0        | 5.2                | 913       |
| 4期(2020年1月27日) | 10,891        | 0         | 6.0  | 157.20             | 6.0  | 17.1       | 0.6        | 74.9       | 0.0        | 5.2                | 1,722     |
| 5期(2021年1月26日) | 11,132        | 0         | 2.2  | 160.90             | 2.4  | 17.5       | 0.4        | 75.1       | 0.0        | 5.1                | 2,301     |

- (注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
- (注) 最適化バランス指数は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンがeMAXISシリーズのファンド\*を参照して算出する指数であり、5つの目標リスク水準別指数の総称です。目標リスク水準別の指数は、eMAXISシリーズにおける各ファンドのベンチマークの長期間にわたるデータを用いて期待収益率、リスク（標準偏差）等をそれぞれ推計した上で最適化（目標リスク水準に対してリターンが最大化される）を行い決定される資産クラス別比率に応じて、eMAXISシリーズのファンドの基準価額（分配金再投資）の騰落率を乗じることで算出されます。指数の資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。
- \*最適化バランス（6%）指数を算出するために参照したファンド  
eMAXIS TOPIXインデックス、eMAXIS 先進国株式インデックス、eMAXIS 国内債券インデックス、  
eMAXIS 先進国債券インデックス、eMAXIS 国内リートインデックスおよびeMAXIS 先進国リートインデックス
- (注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。
- (注) 株式先物比率には、不動産投信指数先物を含めて表示しております。
- (注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- (注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。
- (注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | 最 適 化 バ ラ ン ス<br>( 6 % ) 指 数 |       | 株 式<br>組 入 比 率 | 株 式<br>先 物 比 率 | 債 券<br>組 入 比 率 | 債 券<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 券 組 入 比 率 |
|---------------------|---------|-------|------------------------------|-------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------------|
|                     |         | 騰 落 率 |                              | 騰 落 率 |                |                |                |                |                        |
| (期 首)<br>2020年1月27日 | 円       | %     |                              | %     | %              | %              | %              | %              | %                      |
|                     | 10,891  | —     | 157.20                       | —     | 17.1           | 0.6            | 74.9           | 0.0            | 5.2                    |
| 1月末                 | 10,900  | 0.1   | 157.40                       | 0.1   | 17.4           | 0.4            | 75.7           | 0.0            | 5.2                    |
| 2月末                 | 10,759  | △1.2  | 155.30                       | △1.2  | 16.4           | 0.3            | 77.6           | 0.3            | 4.8                    |
| 3月末                 | 10,379  | △4.7  | 149.80                       | △4.7  | 17.4           | 0.8            | 75.0           | 0.0            | 5.3                    |
| 4月末                 | 10,489  | △3.7  | 151.50                       | △3.6  | 17.9           | 0.5            | 74.5           | 0.0            | 5.4                    |
| 5月末                 | 10,631  | △2.4  | 153.50                       | △2.4  | 17.2           | 1.0            | 74.7           | 0.0            | 5.4                    |
| 6月末                 | 10,674  | △2.0  | 154.20                       | △1.9  | 17.2           | 0.4            | 75.6           | 0.0            | 5.1                    |
| 7月末                 | 10,717  | △1.6  | 154.80                       | △1.5  | 17.1           | 0.4            | 75.6           | 0.0            | 5.2                    |
| 8月末                 | 10,857  | △0.3  | 156.90                       | △0.2  | 17.6           | 0.6            | 74.8           | 0.0            | 5.2                    |
| 9月末                 | 10,842  | △0.4  | 156.60                       | △0.4  | 17.3           | 0.6            | 75.0           | 0.1            | 5.2                    |
| 10月末                | 10,709  | △1.7  | 154.70                       | △1.6  | 17.0           | 0.3            | 75.6           | 0.1            | 5.0                    |
| 11月末                | 11,003  | 1.0   | 159.00                       | 1.1   | 17.5           | 0.5            | 75.1           | 0.1            | 5.1                    |
| 12月末                | 11,098  | 1.9   | 160.40                       | 2.0   | 17.5           | 0.6            | 75.0           | 0.1            | 5.2                    |
| (期 末)<br>2021年1月26日 | 11,132  | 2.2   | 160.90                       | 2.4   | 17.5           | 0.4            | 75.1           | 0.0            | 5.1                    |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 株式先物比率には、不動産投信指数先物を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第5期：2020年1月28日～2021年1月26日

## 当期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



|       |         |
|-------|---------|
| 第5期首  | 10,891円 |
| 第5期末  | 11,132円 |
| 既払分配金 | 0円      |
| 騰落率   | 2.2%    |

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

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

**基準価額の動き**

基準価額は期首に比べ2.2%の上昇となりました。

**ベンチマークとの差異**

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（2.4%）を0.2%下回りました。

**基準価額の主な変動要因****上昇要因**

主に外国株式市況が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

| 組入ファンド            | 騰落率    | 組入比率（対純資産総額） |
|-------------------|--------|--------------|
| TOPIXマザーファンド      | 11.2%  | 9.0%         |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 11.5%  | 9.0%         |
| 日本債券インデックスマザーファンド | -1.1%  | 48.0%        |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 4.3%   | 28.0%        |
| 東証REIT指数マザーファンド   | -14.8% | 2.0%         |
| MUAMG-REITマザーファンド | -13.9% | 3.0%         |

第5期：2020年1月28日～2021年1月26日

## 投資環境について

### ▶ 国内株式市況

**国内株式市況は上昇しました。**

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

### ▶ 外国株式市況

**外国株式市況は上昇しました。**

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

### ▶ 国内債券市況

**国内債券市況は下落しました。**

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

### ▶ 外国債券市況

**先進国の債券市況は上昇しました。**

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

### ▶ 国内REIT市況

**国内REIT市況は下落しました。**

新型コロナウイルスの世界的流行を受け、国内REIT市況は下落しました。

### ▶ 外国REIT市況

**外国REIT市況は下落しました。**

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

### ▶ 為替市況

**米ドルは対円で下落、ユーロは対円で上昇しました。**

期首に比べて米ドルは対円で下落、ユーロは対円で上昇しました。

## ▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ eMAXIS 最適化バランス （マイゴールキーパー）

日本を含む先進国の株式、公社債および不動産投資信託証券市場の値動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

資産配分方針は、最適化バランス（6％）指数の資産クラス別比率を維持しました。資産クラス別比率は以下の通りです。目標リスク水準に沿うように原則年1回資産クラス別比率の変更を行います。

（ご参考）

#### ■ ベンチマークの資産クラス別比率

| マザーファンド           | アセット    | 期首  | 期末  |
|-------------------|---------|-----|-----|
| TOPIXマザーファンド      | 国内株式    | 9%  | 9%  |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 先進国株式   | 9%  | 9%  |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 国内債券    | 49% | 49% |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 先進国債券   | 28% | 28% |
| 東証REIT指数マザーファンド   | 国内REIT  | 2%  | 2%  |
| MUAMG-REITマザーファンド | 先進国REIT | 3%  | 3%  |

### ▶ TOPIXマザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

### ▶ 外国株式インデックスマザーファンド

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

株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチ

ファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

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

### ▶ 日本債券インデックスマザーファンド

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

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

### ▶ 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

### ▶ 東証REIT指数マザーファンド

資産のほぼ全額を不動産投資信託証券（REIT）（先物を含む）に投資しました。

ポートフォリオはベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

### ▶ MUAMG-REITマザーファンド

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

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

## ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

### ▶ eMAXIS 最適化バランス （マイゴールキーパー）

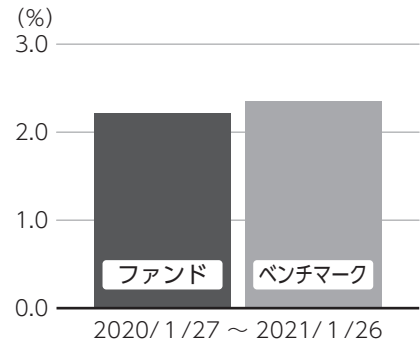
基準価額の騰落率は2.2%の上昇となり、ベンチマークの騰落率（2.4%）を0.2%下回りました。

差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

|            |         |
|------------|---------|
| 資産配分要因     | △0.0%程度 |
| その他（信託報酬等） | △0.2%程度 |

### 基準価額（ベビーファンド）と ベンチマークの対比（騰落率）



### ▶ TOPIXマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**組入要因によるものです。

**主なマイナス要因：**取引要因によるものです。

### ▶ 外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**その他の要因※によるものです。

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

**主なマイナス要因：**組入要因によるものです。

### ▶ 日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**ポートフォリオ要因によるものです。

**主なマイナス要因：**ありません。

▶ **外国債券インデックスマザーファンド**

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**ポートフォリオ要因によるものです。

**主なマイナス要因：**評価時価差異要因\*によるものです。

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

▶ **東証REIT指数マザーファンド**

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**その他の要因\*によるものです。

※留保金等が含まれます。

**主なマイナス要因：**取引要因によるものです。

▶ **MUAMG-REITマザーファンド**

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**その他の要因\*によるものです。

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

**主なマイナス要因：**取引要因によるものです。

## 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。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5期<br>2020年1月28日～2021年1月26日 |
|----------------|------------------------------|
| 当期分配金（対基準価額比率） | －（－％）                        |
| 当期の収益          | －                            |
| 当期の収益以外        | －                            |
| 翌期繰越分配対象額      | 1,131                        |

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

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

# 今後の運用方針（作成対象期間末での見解です。）

## ▶ eMAXIS 最適化バランス （マイゴールキーパー）

資産配分方針は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが算出する最適化バランス（6％）指数の資産クラス別比率を維持します。また、目標リスク水準に沿うように原則年1回資産クラス別比率の変更を行い、各資産の組入比率は、期を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

## ▶ TOPIXマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 東証REIT指数マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ MUAMG-REITマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2020年1月28日～2021年1月26日

## 1 万口当たりの費用明細

| 項目          | 当期     |         | 項目の概要                                                                 |
|-------------|--------|---------|-----------------------------------------------------------------------|
|             | 金額 (円) | 比率 (%)  |                                                                       |
| (a) 信託報酬    | 59     | 0.549   | (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）      | (26)   | (0.241) | 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）      | (26)   | (0.241) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価                                  |
| （受託会社）      | (7)    | (0.066) | 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      | 0.002   | (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<br>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) |                                                                       |
| （新株予約権証券）   | (0)    | (0.000) |                                                                       |
| （投資信託証券）    | (0)    | (0.001) |                                                                       |
| （先物・オプション）  | (0)    | (0.001) |                                                                       |
| (c) 有価証券取引税 | 0      | 0.003   | (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<br>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)    | (0.002) |                                                                       |
| （新株予約権証券）   | (0)    | (0.000) |                                                                       |
| （投資信託証券）    | (0)    | (0.001) |                                                                       |
| (d) その他費用   | 1      | 0.012   | (d) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数                                     |
| （保管費用）      | (1)    | (0.006) | 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)    | (0.002) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用                                                    |
| 合 計         | 60     | 0.566   |                                                                       |

期中の平均基準価額は、10,764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。

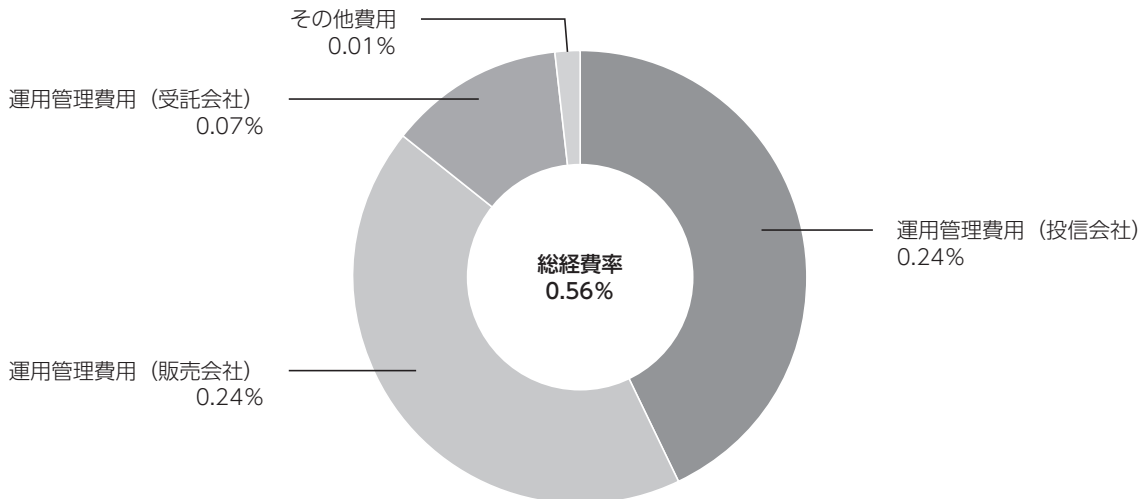
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.56%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## ○売買及び取引の状況

(2020年1月28日～2021年1月26日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄                | 設 定     |         | 解 約     |         |
|--------------------|---------|---------|---------|---------|
|                    | 口 数     | 金 額     | 口 数     | 金 額     |
|                    | 千口      | 千円      | 千口      | 千円      |
| MUAM G-REITマザーファンド | 45,261  | 66,129  | 29,946  | 46,543  |
| 東証REIT指数マザーファンド    | 13,847  | 38,202  | 8,537   | 24,830  |
| TOPIXマザーファンド       | 75,551  | 131,983 | 58,030  | 105,949 |
| 外国株式インデックスマザーファンド  | 54,126  | 154,079 | 43,485  | 130,538 |
| 日本債券インデックスマザーファンド  | 414,208 | 559,387 | 204,119 | 276,006 |
| 外国債券インデックスマザーファンド  | 127,113 | 278,811 | 63,603  | 140,112 |

## ○株式売買比率

(2020年1月28日～2021年1月26日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目                 | 当 期              |                       |
|---------------------|------------------|-----------------------|
|                     | TOPIX<br>マザーファンド | 外国株式インデックス<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 564,091,408千円    | 635,291,979千円         |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 327,925,976千円    | 523,370,020千円         |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.72             | 1.21                  |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年1月28日～2021年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

&lt; eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー） &gt;

該当事項はございません。

## &lt; MUAM G-REITマザーファンド &gt;

| 区 分    | 買付額等<br>A |                    |               | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |               |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        |           | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ |           |                    | $\frac{D}{C}$ |
|        | 百万円       | 百万円                | %             | 百万円       | 百万円                | %             |
| 為替直物取引 | 17,212    | 778                | 4.5           | 3,611     | 21                 | 0.6           |

平均保有割合 0.2%

※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。

## &lt;東証REIT指数マザーファンド&gt;

| 区 分         | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C    | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-------------|---------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
|             |               |                    |               |              |                    |               |
| 投資信託証券      | 百万円<br>19,708 | 百万円<br>7,595       | %<br>38.5     | 百万円<br>7,821 | 百万円<br>3,853       | %<br>49.3     |
| 不動産投信指数先物取引 | 14,004        | 11,154             | 79.6          | 13,572       | 10,223             | 75.3          |

平均保有割合 0.1%

※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。

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

| 区 分        | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|------------|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|            |                |                    |               |                |                    |               |
| 株式         | 百万円<br>340,894 | 百万円<br>27,112      | %<br>8.0      | 百万円<br>223,196 | 百万円<br>7,861       | %<br>3.5      |
| 貸付有価証券(株式) | 563,098        | 246,699            | 43.8          | 539,549        | 242,116            | 44.9          |

平均保有割合 0.1%

※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。

## &lt;外国株式インデックスマザーファンド&gt;

| 区 分    | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|        |                |                    |               |                |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>482,630 | 百万円<br>439,205     | %<br>91.0     | 百万円<br>363,666 | 百万円<br>333,455     | %<br>91.7     |

平均保有割合 0.0%

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

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

| 区 分 | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|     |                |                    |               |                |                    |               |
| 公社債 | 百万円<br>364,188 | 百万円<br>128,992     | %<br>35.4     | 百万円<br>659,555 | 百万円<br>143,082     | %<br>21.7     |

平均保有割合 0.2%

※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。

## ＜外国債券インデックスマザーファンド＞

| 区 分    | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|        |               |                    |               |               |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>49,019 | 百万円<br>26,037      | %<br>53.1     | 百万円<br>25,077 | 百万円<br>15,758      | %<br>62.8     |

平均保有割合 0.3%

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

## 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<br>5,134 | 百万円<br>3,607 | 百万円<br>6,883 |

## ＜日本債券インデックスマザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額        | 売 付 額        | 当 期 末 保 有 額  |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| 公社債 | 百万円<br>2,718 | 百万円<br>3,331 | 百万円<br>1,847 |

## 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

## ＜東証REIT指数マザーファンド＞

| 種 類    | 買 付 額      |
|--------|------------|
| 投資信託証券 | 百万円<br>732 |

## ＜TOPIXマザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額      |
|-----|------------|
| 株式  | 百万円<br>266 |

## ＜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<br>11,300 |

### 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目              | 当 期  |
|------------------|------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 36千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 1千円  |
| (B) / (A)        | 4.9% |

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

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

### ○組入資産の明細

(2021年1月26日現在)

### 親投資信託残高

| 銘 柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|-----------------------|---------|---------|-----------|
|                       | 口 数     | 口 数     | 評 価 額     |
|                       | 千口      | 千口      | 千円        |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド | 27,102  | 42,418  | 69,638    |
| 東証REIT指数マザーファンド       | 9,514   | 14,824  | 46,029    |
| T O P I Xマザーファンド      | 81,568  | 99,089  | 206,532   |
| 外国株式インデックスマザーファンド     | 48,717  | 59,358  | 208,305   |
| 日本債券インデックスマザーファンド     | 610,144 | 820,233 | 1,104,034 |
| 外国債券インデックスマザーファンド     | 225,751 | 289,261 | 644,417   |

### ○有価証券の貸付及び借入の状況

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

## ○投資信託財産の構成

(2021年1月26日現在)

| 項 目                | 当 期 末     |       |
|--------------------|-----------|-------|
|                    | 評 価 額     | 比 率   |
|                    | 千円        | %     |
| MUAM G－REITマザーファンド | 69,638    | 3.0   |
| 東証REIT指数マザーファンド    | 46,029    | 2.0   |
| TOPIXマザーファンド       | 206,532   | 8.9   |
| 外国株式インデックスマザーファンド  | 208,305   | 9.0   |
| 日本債券インデックスマザーファンド  | 1,104,034 | 47.8  |
| 外国債券インデックスマザーファンド  | 644,417   | 27.9  |
| コール・ローン等、その他       | 30,462    | 1.4   |
| 投資信託財産総額           | 2,309,417 | 100.0 |

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

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

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

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

|                    |                   |                      |                     |
|--------------------|-------------------|----------------------|---------------------|
| 1 アメリカドル＝103.77円   | 1 カナダドル＝81.40円    | 1 メキシコペソ＝5.16円       | 1 ユーロ＝125.90円       |
| 1 イギリスポンド＝141.88円  | 1 スイスフラン＝116.81円  | 1 スウェーデンクローネ＝12.52円  | 1 ノルウェークローネ＝12.14円  |
| 1 デンマーククローネ＝16.93円 | 1 ポーランドズロチ＝27.73円 | 1 オーストラリアドル＝79.98円   | 1 ニュージーランドドル＝74.60円 |
| 1 香港ドル＝13.39円      | 1 シンガポールドル＝78.18円 | 1 マレーシアリングgit＝25.66円 | 100韓国ウォン＝9.43円      |
| 1 イスラエルシェケル＝31.68円 |                   |                      |                     |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年1月26日現在）

| 項 目                        | 当 期 末          |
|----------------------------|----------------|
|                            | 円              |
| (A) 資産                     | 2,309,417,173  |
| コール・ローン等                   | 30,459,374     |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド(評価額) | 69,638,346     |
| 東証REIT指数マザーファンド(評価額)       | 46,029,760     |
| T O P I Xマザーファンド(評価額)      | 206,532,974    |
| 外国株式インデックスマザーファンド(評価額)     | 208,305,039    |
| 日本債券インデックスマザーファンド(評価額)     | 1,104,034,494  |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額)     | 644,417,186    |
| (B) 負債                     | 7,603,303      |
| 未払解約金                      | 1,658,361      |
| 未払信託報酬                     | 5,902,495      |
| 未払利息                       | 6              |
| その他未払費用                    | 42,441         |
| (C) 純資産総額(A-B)             | 2,301,813,870  |
| 元本                         | 2,067,756,033  |
| 次期繰越損益金                    | 234,057,837    |
| (D) 受益権総口数                 | 2,067,756,033口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)            | 11,132円        |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 1,581,652,250円  
期中追加設定元本額 1,457,352,249円  
期中一部解約元本額 971,248,466円  
また、1口当たり純資産額は、期末11,132円です。

## ②分配金の計算過程

| 項 目                       | 2020年1月28日～<br>2021年1月26日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | 25,541,736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 | 31,620,423円               |
| 収益調整金額                    | 151,921,174円              |
| 分配準備積立金額                  | 24,974,504円               |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 234,057,837円              |
| 1万口当たり収益分配対象額             | 1,131円                    |
| 1万口当たり分配金額                | —円                        |
| 収益分配金金額                   | —円                        |

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

## ○損益の状況（2020年1月28日～2021年1月26日）

| 項 目              | 当 期            |
|------------------|----------------|
|                  | 円              |
| (A) 配当等収益        | △ 5,722        |
| 受取利息             | 152            |
| 支払利息             | △ 5,874        |
| (B) 有価証券売買損益     | 68,283,733     |
| 売買益              | 98,500,649     |
| 売買損              | △ 30,216,916   |
| (C) 信託報酬等        | △ 11,115,852   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 57,162,159     |
| (E) 前期繰越損益金      | 24,974,504     |
| (F) 追加信託差損益金     | 151,921,174    |
| (配当等相当額)         | ( 100,130,687) |
| (売買損益相当額)        | ( 51,790,487)  |
| (G) 計(D+E+F)     | 234,057,837    |
| (H) 収益分配金        | 0              |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 234,057,837    |
| 追加信託差損益金         | 151,921,174    |
| (配当等相当額)         | ( 101,195,922) |
| (売買損益相当額)        | ( 50,725,252)  |
| 分配準備積立金          | 82,136,663     |

- (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。

## T O P I X マザーファンド

## 《第19期》決算日2020年3月25日

[計算期間：2019年3月26日～2020年3月25日]

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

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

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

## ○最近5期の運用実績

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

(注) 東証株価指数（T O P I X）（配当込み）とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。東証株価指数（T O P I X）（配当込み）（T O P I Xといいます）の指数値およびT O P I Xの商標は、東京証券取引所の知的財産権であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | 東 証 株 価 指 数<br>(TOPIX)<br>(配当込み) | 騰 落 率 | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|----------------------------------|-------|-----------|-----------|
|                     |         | 騰 落 率 |                                  |       |           |           |
| (期 首)<br>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)<br>2020年3月25日 |         |       |                                  |       |           |           |
|                     | 15,695  | △ 7.3 | 2,174.58                         | △ 7.4 | 95.4      | 4.2       |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

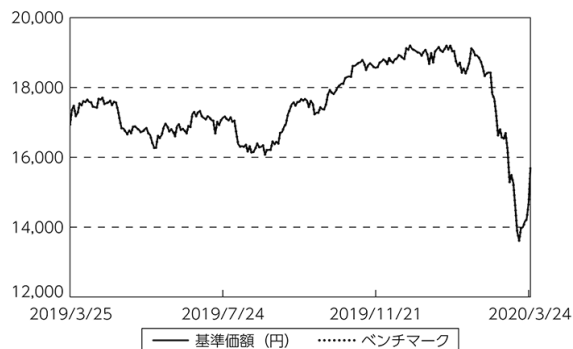
#### ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ7.3%の下落となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

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

## 基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因  
(下落要因)

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

●投資環境について

◎国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・組入要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年3月26日～2020年3月25日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2019年3月26日～2020年3月25日)

## 株式

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

(注) 金額は受渡代金。

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

## 新株予約権証券

|    | 買 付                  |                | 売 付           |           |
|----|----------------------|----------------|---------------|-----------|
|    | 証 券 数                | 金 額            | 証 券 数         | 金 額       |
| 国内 | 証券<br>—<br>(176,300) | 千円<br>—<br>(—) | 証券<br>176,300 | 千円<br>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<br>71,009 | 百万円<br>64,308 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

## ○株式売買比率

(2019年3月26日～2020年3月25日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年3月26日～2020年3月25日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分        | 買付額等           |                    |               | 売付額等           |                    |               |
|------------|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|            | A              | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C              | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式         | 百万円<br>357,845 | 百万円<br>36,155      | %<br>10.1     | 百万円<br>331,603 | 百万円<br>45,912      | %<br>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<br>6,260 | 百万円<br>5,730 | 百万円<br>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<br>30 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

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

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

## ○組入資産の明細

(2020年3月25日現在)

## 国内株式

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|----------------------|---------|-------|---------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                      | 千株      | 千株    | 千円      |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |         |       |         |
| 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   |
| <b>鉱業 (0.2%)</b>     |         |       |         |
| 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  |
| <b>建設業 (2.7%)</b>    |         |       |         |
| ヒノキヤグループ             | 3.1     | 3.9   | 5,534   |
| ショーボンドホールディングス       | 10.4    | 24.5  | 98,122  |
| ミライト・ホールディングス        | 41.1    | 46.8  | 62,010  |
| タマホーム                | 7       | 8.5   | 9,877   |
| サンヨーホームズ             | 2.1     | 1.4   | 957     |
| 日本アクア                | 3.5     | 6.3   | 3,817   |
| ファーストコーポレーション        | 4.5     | 4.8   | 2,208   |
| ベステラ                 | 2.8     | 2.7   | 2,419   |
| TATERU               | 17.8    | 32.5  | 3,802   |
| キャンディル               | —       | 1.4   | 610     |
| スペースバリューホールディングス     | 17.8    | 19.2  | 8,064   |
| ダイセキ環境ソリューション        | 2.8     | 3     | 2,583   |
| 第一カッター興業             | 1.8     | 1.9   | 3,030   |
| 明豊ファシリティワークス         | —       | 3.8   | 1,926   |
| 安藤・間                 | 93.4    | 93.8  | 65,191  |
| 東急建設                 | 42.8    | 46.2  | 26,657  |
| コムシスホールディングス         | 51.8    | 55.9  | 149,420 |
| ミサワホーム               | 11.5    | —     | —       |

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

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

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

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

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|-------------------|---------|-------|-----------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                   | 千株      | 千株    | 千円        |
| ニチレイ              | 56      | 55.5  | 143,911   |
| 東洋水産              | 55.5    | 59.9  | 283,027   |
| イートアンド            | 3.7     | 4     | 7,172     |
| 大冷                | 1.2     | 1.5   | 2,787     |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 2.9     | 6.4   | 5,977     |
| 日清食品ホールディングス      | 45.9    | 49.5  | 412,335   |
| 永谷園ホールディングス       | 5.7     | 5.7   | 12,540    |
| 一正蒲鉾              | 4.2     | 4.5   | 4,153     |
| フジッコ              | 11.7    | 12.6  | 24,544    |
| ロック・フィールド         | 11.6    | 12.5  | 17,375    |
| 日本たばこ産業           | 623     | 672.5 | 1,387,367 |
| ケンコーマヨネーズ         | 6       | 6.5   | 13,325    |
| わらべや日洋ホールディングス    | 7.1     | 7.6   | 12,129    |
| なとり               | 6       | 6.5   | 11,485    |
| イフジ産業             | 1.9     | 2     | 1,552     |
| ビックルスコーポレーション     | 2.6     | 2.5   | 5,440     |
| 北の達人コーポレーション      | 42.4    | 40.7  | 22,995    |
| ユーグレナ             | 46      | 49.7  | 35,038    |
| ミヨシ油脂             | 4.1     | 4.5   | 4,405     |
| 理研ビタミン            | 5.1     | 5.5   | 23,045    |
| 繊維製品 (0.5%)       |         |       |           |
| 片倉工業              | 12.9    | 16.5  | 15,196    |
| グンゼ               | 7.1     | 8.3   | 30,502    |
| 東洋紡               | 44.6    | 44.9  | 52,712    |
| ユニチカ              | 30.8    | 33.3  | 8,957     |
| 富士紡ホールディングス       | 5.5     | 5.5   | 15,114    |
| 倉敷紡績              | 10      | 11.3  | 26,069    |
| シキボウ              | 5.5     | 6     | 6,090     |
| 日本毛織              | 34.6    | 37.4  | 32,425    |
| ダイトウボウ            | 17      | 18.4  | 2,042     |
| トーア紡コーポレーション      | 4.5     | 4.5   | 1,912     |
| ダイドーリミテッド         | 12.6    | 14.9  | 3,203     |
| 帝国繊維              | 11.8    | 12.7  | 24,701    |
| 帝人                | 85.9    | 92.7  | 162,595   |
| 東レ                | 816.7   | 822.9 | 404,043   |
| サカイオーベックス         | 2.6     | 3     | 5,262     |
| 住江織物              | 3.1     | 2.5   | 4,377     |
| 日本フェルト            | 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   | 評 価 額   |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |
| 日東製綱                | 1.2     | 1.3   | 1,623   |
| アツギ                 | 8.7     | 9.4   | 5,931   |
| ダイニツク               | 4.3     | 4.4   | 3,000   |
| セーレン                | 25.9    | 27.9  | 34,763  |
| ソトー                 | 4.2     | 4.5   | 4,275   |
| 東海染工                | 1.4     | 1.6   | 1,822   |
| 小松マテール              | 17.3    | 18.7  | 12,884  |
| ワコールホールディングス        | 30.7    | 29.7  | 71,131  |
| ホギメディカル             | 13.1    | 13    | 40,690  |
| レナウン                | 30.4    | 29.2  | 2,277   |
| クラウドシアホールディングス      | 2.6     | 2.8   | 1,041   |
| T S I ホールディングス      | 38.8    | 38.1  | 15,316  |
| マツオカコーポレーション        | 3.3     | 3.3   | 5,520   |
| ワールド                | 10.3    | 16.1  | 27,031  |
| 三陽商会                | 6.3     | 5.9   | 8,602   |
| ナイガイ                | 3.8     | 4.1   | 1,693   |
| オンワードホールディングス       | 63.2    | 68.3  | 32,032  |
| ルックホールディングス         | 3.8     | 3.9   | 3,088   |
| キムラタン               | 51.9    | 59.3  | 1,304   |
| ゴールドウイン             | 9.5     | 20.6  | 132,252 |
| デサント                | 23.3    | 22.2  | 28,438  |
| キング                 | 5.6     | 5.4   | 2,797   |
| ヤマトインターナショナル        | 6.9     | 6.9   | 1,849   |
| <b>パルプ・紙 (0.2%)</b> |         |       |         |
| 特種東海製紙              | 6.7     | 7.2   | 25,380  |
| 王子ホールディングス          | 473.9   | 475.1 | 254,653 |
| 日本製紙                | 50.4    | 50.3  | 77,763  |
| 三菱製紙                | 17.1    | 12.9  | 4,515   |
| 北越コーポレーション          | 69.8    | 75.4  | 30,310  |
| 中越パルプ工業             | 4.5     | 4.8   | 6,220   |
| 巴川製紙所               | 3.5     | 3.4   | 2,278   |
| 大王製紙                | 51.3    | 49.8  | 72,210  |
| 阿波製紙                | 2.7     | 2.9   | 1,284   |
| レンゴー                | 108.6   | 107.4 | 83,879  |
| トーモク                | 6.5     | 7     | 10,227  |
| ザ・バック               | 8       | 8.6   | 29,369  |
| <b>化学 (7.3%)</b>    |         |       |         |
| クラレ                 | 177.6   | 179   | 194,752 |
| 旭化成                 | 749     | 753.3 | 567,762 |

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

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |  |
|----------------|---------|-------|-----------|--|
|                | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |  |
|                | 千株      | 千株    | 千円        |  |
| 三井化学           | 95.6    | 103.2 | 224,150   |  |
| J S R          | 105.7   | 105.9 | 194,008   |  |
| 東京応化工業         | 18.1    | 19.5  | 75,952    |  |
| 大阪有機化学工業       | 9.7     | 10.5  | 15,267    |  |
| 三菱ケミカルホールディングス | 703.8   | 759.8 | 516,360   |  |
| KHネオケム         | 16      | 20    | 31,340    |  |
| ダイセル           | 163.5   | 155.5 | 123,622   |  |
| 住友ベークライト       | 18.2    | 17.9  | 44,087    |  |
| 積水化学工業         | 230.1   | 244.4 | 344,604   |  |
| 日本ゼオン          | 94.9    | 102.5 | 84,460    |  |
| アイカ工業          | 31.6    | 34.1  | 99,640    |  |
| 宇部興産           | 53.2    | 57.4  | 100,564   |  |
| 積水樹脂           | 17.4    | 20.5  | 41,451    |  |
| タキロンシーアイ       | 22.8    | 24.6  | 14,784    |  |
| 旭有機材           | 7.3     | 6.4   | 8,742     |  |
| 日立化成           | 48.7    | 48.9  | 224,206   |  |
| ニチバン           | 5.5     | 6     | 9,282     |  |
| リケンテクノス        | 28.7    | 28.6  | 10,839    |  |
| 大倉工業           | 5.4     | 5.4   | 8,375     |  |
| 積水化成品工業        | 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   | 評 価 額     |  |
|                  | 千株      | 千株    | 千円        |  |
| 日華化学             | 3.5     | 3.8   | 2,751     |  |
| ニイタカ             | 1.6     | 1.8   | 4,300     |  |
| 三洋化成工業           | 7.1     | 6.8   | 27,132    |  |
| 有機合成薬品工業         | 8.1     | 8.7   | 2,053     |  |
| 大日本塗料            | 11.9    | 12.8  | 10,496    |  |
| 日本ペイントホールディングス   | 86.9    | 93.8  | 483,070   |  |
| 関西ペイント           | 118.3   | 127.7 | 261,529   |  |
| 神東塗料             | 8.3     | 8.9   | 1,370     |  |
| 中国塗料             | 34.6    | 32.4  | 27,313    |  |
| 日本特殊塗料           | 7.9     | 8.5   | 6,647     |  |
| 藤倉化成             | 14.2    | 15.3  | 7,344     |  |
| 太陽ホールディングス       | 8.7     | 8.3   | 33,366    |  |
| D I C            | 47.6    | 48    | 111,840   |  |
| サカタインクス          | 23      | 24.8  | 21,204    |  |
| 東洋インキSCホールディングス  | 22.3    | 24    | 47,136    |  |
| T & K T O K A    | 8.2     | 8.8   | 6,476     |  |
| 富士フイルムホールディングス   | 223.3   | 222.5 | 1,092,030 |  |
| 資生堂              | 213.6   | 230.6 | 1,497,285 |  |
| ライオン             | 149.7   | 150.9 | 307,081   |  |
| 高砂香料工業           | 7.4     | 7.3   | 13,519    |  |
| マンダム             | 24.2    | 26.1  | 52,539    |  |
| ミルボン             | 13.3    | 15.5  | 82,150    |  |
| ファンケル            | 47.9    | 47    | 117,970   |  |
| コーセー             | 18.2    | 21.8  | 296,698   |  |
| コタ               | 5.1     | 6.1   | 8,826     |  |
| シーズ・ホールディングス     | 2.9     | —     | —         |  |
| シーボン             | 1.3     | 1.5   | 3,480     |  |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 45.9    | 49.5  | 102,217   |  |
| ノエビアホールディングス     | 6.8     | 11.1  | 59,052    |  |
| アジupanコスメジャパン    | 2.4     | 2.6   | 2,407     |  |
| エステー             | 7.7     | 7.5   | 11,580    |  |
| アグロ カネショウ        | 4.4     | 3.6   | 5,032     |  |
| コニシ              | 19      | 19.1  | 25,574    |  |
| 長谷川香料            | 12.8    | 15.4  | 29,044    |  |
| 星光PMC            | 7.2     | 6.6   | 4,224     |  |
| 小林製薬             | 30.1    | 32.5  | 293,800   |  |
| 荒川化学工業           | 9.6     | 10.4  | 12,168    |  |
| メック              | 7.4     | 8     | 11,336    |  |
| 日本高純度化学          | 3       | 3.2   | 7,792     |  |

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

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|-----------------|---------|-------|-----------|
|                 | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                 | 千株      | 千株    | 千円        |
| 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    |
| 白水製薬            | 4.5     | 4.9   | 6,125     |
| 鳥居薬品            | 5.8     | 7.3   | 18,257    |
| J C Rファーマ       | 7.6     | 8.2   | 71,750    |
| 東和薬品            | 5.2     | 14.8  | 32,412    |
| 富士製薬工業          | 7.3     | 7.9   | 9,061     |
| 沢井製薬            | 22.1    | 23.8  | 135,660   |
| ゼリア新薬工業         | 21.3    | 21.1  | 41,166    |
| 第一三共            | 307.6   | 332.1 | 2,399,090 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 23.7    | 25.6  | 49,792    |
| 大幸薬品            | 4.8     | 4.7   | 20,492    |
| ダイト             | 6.3     | 6.9   | 19,389    |
| 大塚ホールディングス      | 204.8   | 221.1 | 873,345   |
| 大正製薬ホールディングス    | 24.1    | 24.5  | 155,330   |
| ペプチドリーム         | 53.6    | 58.7  | 238,028   |
| 石油・石炭製品 (0.5%)  |         |       |           |
| 日本コークス工業        | 90.8    | 98    | 6,076     |
| 昭和シェル石油         | 51.5    | —     | —         |
| ニチレキ            | 13.7    | 13.7  | 18,851    |
| ユシロ化学工業         | 5.6     | 6.5   | 7,559     |
| ビービー・カストロール     | 3.8     | 4.1   | 4,879     |
| 富士石油            | 26.1    | 31    | 6,231     |
| MORESCO         | 3.9     | 4.2   | 3,603     |
| 出光興産            | 103.9   | 130.5 | 346,347   |

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

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

| 銘柄                            | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------------------------|---------|-------|---------|
|                               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                               | 千株      | 千株    | 千円      |
| シンニッタン                        | 16.5    | 17.8  | 4,165   |
| 新家工業                          | 2.4     | 2.6   | 3,049   |
| 非鉄金属 (0.7%)                   |         |       |         |
| 大紀アルミニウム工業所                   | 17.5    | 18.9  | 10,962  |
| 日本軽金属ホールディングス                 | 289.6   | 290.4 | 51,400  |
| 三井金属鉱業                        | 28.7    | 31    | 59,055  |
| 東邦亜鉛                          | 5.9     | 5.9   | 7,864   |
| 三菱マテリアル                       | 70.2    | 75.8  | 170,777 |
| 住友金属鉱山                        | 145.6   | 146.7 | 350,759 |
| DOWAホールディングス                  | 24.8    | 29    | 86,072  |
| 古河機械金属                        | 17.5    | 20.4  | 22,970  |
| エス・サイエンス                      | 47      | 50.7  | 1,723   |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ                | 12.3    | 11.9  | 11,888  |
| 東邦チタニウム                       | 19      | 20.5  | 13,940  |
| UACJ                          | 16.1    | 17.4  | 28,918  |
| CKサンエツ                        | 2       | 2.4   | 6,624   |
| 古河電気工業                        | 30.7    | 35.6  | 71,627  |
| 住友電気工業                        | 397.4   | 429.1 | 502,261 |
| フジクラ                          | 128.4   | 138.6 | 43,104  |
| 昭和電線ホールディングス                  | 12.3    | 13.3  | 14,191  |
| 東京特殊電線                        | 1.4     | 1.7   | 4,309   |
| タツタ電線                         | 21.1    | 22.7  | 10,669  |
| カナレ電気                         | 1.8     | 1.9   | 2,831   |
| 平河ヒューテック                      | 4.4     | 4.3   | 3,870   |
| リョービ                          | 13.1    | 14.1  | 18,033  |
| アーレスティ                        | 13.1    | 15    | 5,535   |
| アサヒホールディングス                   | 20      | 20.1  | 47,817  |
| 金属製品 (0.5%)                   |         |       |         |
| 稲葉製作所                         | 6       | 6.5   | 7,865   |
| 宮地エンジニアリンググループ                | 3.2     | 3.5   | 5,943   |
| トーカロ                          | 27.4    | 31.9  | 30,655  |
| アルファC o                       | 3.7     | 4     | 3,884   |
| SUMCO                         | 117.5   | 137.4 | 194,970 |
| 川田テクノロジーズ                     | 2.4     | 2.3   | 12,604  |
| R S   T e c h n o l o g i e s | 2.1     | 3.2   | 6,896   |
| 信和                            | 4.3     | 4.9   | 3,934   |
| 東洋製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   | 評 価 額   |
|                | 千株      | 千株    | 千円      |
| 横河ブリッジホールディングス | 19.8    | 21.3  | 38,318  |
| 駒井ハルテック        | 2       | 2.1   | 3,103   |
| 高田機工           | 1       | 1     | 2,360   |
| 三和ホールディングス     | 109.8   | 110.1 | 93,034  |
| 文化シャッター        | 31.3    | 33.8  | 26,735  |
| 三協立山           | 14.7    | 14.8  | 15,332  |
| アルインコ          | 8.4     | 8.3   | 7,669   |
| 東洋シャッター        | 2.6     | 2.8   | 1,708   |
| L I X I Lグループ  | 156.8   | 169.3 | 224,999 |
| 日本ファイルコン       | 8.1     | 8.8   | 3,986   |
| ノーリツ           | 23.7    | 23.8  | 26,037  |
| 長府製作所          | 10.8    | 11.7  | 26,617  |
| リンナイ           | 18.9    | 22.3  | 163,013 |
| ダイニチ工業         | 5.7     | 6.2   | 3,862   |
| 日東精工           | 14.7    | 15.8  | 7,236   |
| 三洋工業           | 1.4     | 1.5   | 2,550   |
| 岡部             | 21.5    | 23.3  | 16,426  |
| ジーテクト          | 11.7    | 14.2  | 16,159  |
| 中国工業           | 1.6     | —     | —       |
| 東ブレ            | 19.8    | 21.4  | 26,578  |
| 高周波熱錬          | 20.5    | 22.1  | 14,563  |
| 東京製網           | 6.5     | 8.2   | 4,920   |
| サンコール          | 6       | 6.4   | 2,822   |
| モリテック スチール     | 8.3     | 8.9   | 2,429   |
| パイオラックス        | 17      | 17    | 25,483  |
| エイチワン          | 10.4    | 11.3  | 5,898   |
| 日本発條           | 105.9   | 123.1 | 89,863  |
| 中央発條           | 1.3     | 1.4   | 3,547   |
| アドパネクス         | 1.4     | 1.6   | 2,188   |
| 立川ブラインド工業      | 4.7     | 5     | 5,155   |
| 三益半導体工業        | 9.5     | 9     | 15,426  |
| 機械 (5.0%)      |         |       |         |
| 日本ドライケミカル      | 2.9     | 2.8   | 3,987   |
| 日本製鋼所          | 32.2    | 34.8  | 43,813  |
| 三浦工業           | 46      | 49.7  | 174,695 |
| タクマ            | 38.8    | 38.9  | 44,501  |
| ツガミ            | 23.9    | 23.8  | 18,183  |
| オークマ           | 13.5    | 13.4  | 50,451  |
| 東芝機械           | 12      | 13    | 29,055  |

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |  |
|-------------------|---------|-------|-----------|--|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |  |
|                   | 千株      | 千株    | 千円        |  |
| 西部瓦斯              | 12.1    | 13.1  | 32,854    |  |
| 静岡ガス              | 33.1    | 32.9  | 27,504    |  |
| メタウォーター           | 5.2     | 5.6   | 20,608    |  |
| <b>陸運業 (4.5%)</b> |         |       |           |  |
| 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 |  |
| <b>海運業 (0.1%)</b>      |         |       |         |  |
| 日本郵船                   | 85.1    | 91.9  | 132,427 |  |
| 商船三井                   | 60.4    | 69.5  | 136,081 |  |
| 川崎汽船                   | 31.4    | 33.8  | 31,231  |  |
| NSユナイテッド海運             | 5.6     | 6     | 9,090   |  |
| 明治海運                   | 10.8    | 11.7  | 3,919   |  |
| 飯野海運                   | 48.2    | 52    | 16,120  |  |
| 共栄タンカー                 | 0.9     | 1.9   | 1,727   |  |
| 乾汽船                    | 9.1     | 6.3   | 8,001   |  |
| <b>空運業 (0.4%)</b>      |         |       |         |  |
| 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   |  |
| <b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b> |         |       |         |  |
| トランコム                  | 2.8     | 3.1   | 20,491  |  |
| 日新                     | 8.8     | 9.5   | 14,896  |  |
| 三菱倉庫                   | 35.2    | 34.9  | 79,676  |  |
| 三井倉庫ホールディングス           | 12.5    | 12.6  | 18,207  |  |
| 住友倉庫                   | 38.3    | 40.5  | 49,126  |  |
| 澁澤倉庫                   | 5.6     | 6     | 11,748  |  |
| 東陽倉庫                   | 18.4    | 19.8  | 6,633   |  |
| 日本トランスシティ              | 22.4    | 24.2  | 10,188  |  |
| ケイヒン                   | 2       | 2.1   | 2,402   |  |
| 中央倉庫                   | 6.2     | 6.5   | 7,988   |  |
| 川西倉庫                   | 2.1     | 2     | 1,832   |  |
| 安田倉庫                   | 8.4     | 9     | 7,893   |  |
| ファイズホールディングス           | 1.4     | 2.3   | 2,139   |  |
| 東洋埠頭                   | 3.1     | 3.3   | 4,365   |  |
| 宇徳                     | 8.7     | 9.4   | 4,916   |  |
| 上組                     | 62.8    | 62.9  | 120,013 |  |
| サンリツ                   | 2.4     | 2.6   | 1,406   |  |

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

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |  |
|----------------------|---------|-------|---------|--|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |  |
|                      | 千株      | 千株    | 千円      |  |
| コロブラ                 | 30.2    | 37.3  | 31,182  |  |
| オルトプラス               | 6.5     | 8.4   | 8,500   |  |
| ブロードリーフ              | 52.3    | 56.4  | 26,169  |  |
| クロス・マーケティンググループ      | 2.9     | 5     | 1,345   |  |
| デジタルハーツホールディングス      | 4.8     | 6     | 4,392   |  |
| システム情報               | 2.1     | 5.8   | 3,636   |  |
| メディアドゥホールディングス       | 3.2     | 3.6   | 10,281  |  |
| じげん                  | 11.2    | 28.2  | 8,093   |  |
| ブイキューブ               | 5.6     | 7     | 5,390   |  |
| エンカレッジ・テクノロジー        | 1       | 1.9   | 1,187   |  |
| サイバーリンクス             | 1.6     | 1.7   | 1,558   |  |
| ディー・エル・イー            | 7.4     | 9.2   | 1,085   |  |
| フィックスターズ             | 10.1    | 12.1  | 12,644  |  |
| CARTA HOLDINGS       | 5.6     | 5.5   | 4,680   |  |
| オブティム                | 2.3     | 3     | 11,100  |  |
| セレス                  | 3.4     | 3.7   | 2,719   |  |
| SHIFT                | —       | 3     | 20,670  |  |
| ベリサーブ                | 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   |  |
| ヴァインクス               | 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   |  |
| e B A S E            | 3.1     | 6.8   | 10,234  |  |
| アバント                 | 3.8     | 8.1   | 6,698   |  |
| アドソル日進               | 3.7     | 4     | 8,716   |  |

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

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

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

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

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

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

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

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

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| ヤマタネ              | 5.3     | 5.7   | 6,093   |
| 丸紅建材リース           | 1       | 1.1   | 1,772   |
| 日鉄物産              | 7.5     | 8.1   | 29,970  |
| 泉州電業              | 3.5     | 3.5   | 8,519   |
| トラスコ中山            | 22      | 23.8  | 55,763  |
| オートバックスセブン        | 42.1    | 42.4  | 54,229  |
| モリト               | 7.7     | 8.3   | 5,038   |
| 加藤産業              | 16.6    | 17.9  | 60,144  |
| 北恵                | 2       | 2.2   | 1,447   |
| イノテック             | 6.3     | 6.8   | 5,861   |
| イエローハット           | 10      | 21.6  | 33,674  |
| J Kホールディングス       | 9.6     | 10.3  | 7,220   |
| 日伝                | 8.8     | 10.3  | 20,085  |
| 北沢産業              | 7.9     | 8.6   | 2,476   |
| 杉本商事              | 5.7     | 6.2   | 11,277  |
| 因幡電機産業            | 15      | 32.5  | 76,635  |
| バイテックホールディングス     | 4.8     | —     | —       |
| 東テク               | 3.5     | 3.8   | 7,326   |
| ミスミグループ本社         | 132.5   | 143.2 | 314,180 |
| アルテック             | 7.8     | 9.1   | 1,628   |
| タキヒヨー             | 3.2     | 3.5   | 4,973   |
| 蔵王産業              | 1.7     | 2.2   | 3,179   |
| スズケン              | 48.3    | 48.4  | 183,920 |
| ジェコス              | 7.3     | 7.9   | 6,288   |
| グローセル             | 9.7     | 11.4  | 4,753   |
| <b>小売業 (4.8%)</b> |         |       |         |
| ローソン              | 26.8    | 28.9  | 167,042 |
| サンエー              | 8       | 9.5   | 41,990  |
| カワチ薬品             | 8.2     | 8.9   | 20,345  |
| エービーシー・マート        | 16.5    | 17.8  | 97,366  |
| ハードオフコーポレーション     | 4.2     | 4.5   | 3,289   |
| アスクル              | 11.1    | 11.9  | 37,544  |
| ゲオホールディングス        | 16.1    | 20.6  | 27,027  |
| アダストリア            | 14.7    | 15.8  | 23,305  |
| ジーフット             | 6.4     | 6.9   | 2,898   |
| シー・ヴィ・エス・ペイエリア    | 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   | 評 価 額   |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |
| エディオン              | 44.9    | 52.5  | 48,720  |
| サーラコーポレーション        | 21.5    | 23.2  | 12,203  |
| ワッツ                | 3.5     | 5     | 2,675   |
| ハローズ               | 4       | 4.3   | 10,625  |
| フジオフードシステム         | 4.4     | 9.6   | 13,267  |
| あみやき亭              | 2.3     | 2.5   | 7,925   |
| ひらまつ               | 21.1    | 21    | 3,717   |
| 大黒天物産              | 2.5     | 2.7   | 7,719   |
| ハニーズホールディングス       | 9.3     | 10.1  | 11,958  |
| ファーマライズホールディングス    | 2.5     | 2.8   | 1,741   |
| アルペン               | 8.1     | 8.8   | 14,291  |
| ハブ                 | 3.4     | 3.2   | 2,300   |
| クオールホールディングス       | 15.6    | 16.8  | 21,218  |
| ジンズホールディングス        | 7.2     | 6     | 37,320  |
| ビックカメラ             | 56.5    | 67.8  | 64,071  |
| DCMホールディングス        | 57.1    | 61.8  | 60,069  |
| 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CH1ホールディングス      | 12.4    | 13.3  | 4,894   |
| ミサワ                | 1.9     | 2.3   | 956     |
| ティーライフ             | 1.4     | 1.5   | 1,422   |
| エー・ビーカンパニー         | 2       | 2.1   | 1,014   |
| チムニー               | 3.2     | 3.5   | 6,573   |

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

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

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

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

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

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

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

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|--------------------|---------|-------|-----------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                    | 千株      | 千株    | 千円        |
| ジェイリース             | 2.2     | 3.2   | 841       |
| イントラスト             | 3       | 4     | 2,052     |
| 日本モーゲージサービス        | 1.4     | 2.3   | 4,459     |
| C a s a            | 3.6     | 4     | 4,092     |
| アルヒ                | 9.6     | 18.2  | 20,893    |
| プレミアグループ           | 2.3     | 6.2   | 9,436     |
| クレディセゾン            | 74.3    | 80.2  | 104,099   |
| 芙蓉総合リース            | 12.1    | 12    | 67,080    |
| みずほリース             | 19.9    | 17.7  | 39,878    |
| 東京センチュリー           | 21.4    | 23    | 84,295    |
| 日本証券金融             | 46.7    | 50.4  | 24,897    |
| アイフル               | 161.7   | 174.6 | 40,507    |
| リコーリース             | 8.3     | 9     | 26,946    |
| イオンフィナンシャルサービス     | 67.7    | 70    | 81,900    |
| アコム                | 213.1   | 230.1 | 99,403    |
| ジャックス              | 11.7    | 12.6  | 23,070    |
| オリエントコーポレーション      | 286.7   | 309.6 | 38,390    |
| 日立キャピタル            | 25      | 27    | 55,593    |
| アプラスフィナンシャル        | 50.9    | 54.9  | 3,403     |
| オリックス              | 707.3   | 715.9 | 1,000,470 |
| 三菱UFJ リース          | 239.2   | 290.5 | 160,356   |
| 九州リースサービス          | 5.2     | 5.6   | 2,710     |
| 日本取引所グループ          | 286.4   | 328.5 | 592,285   |
| イー・ギャランティ          | 9.9     | 12.3  | 16,629    |
| アサックス              | 4.4     | 5.9   | 3,746     |
| NECキャピタルソリューション    | 4.3     | 4.7   | 9,038     |
| <b>不動産業 (2.2%)</b> |         |       |           |
| 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     |  |
| テンボイノベーション       | 0.9     | 2.6   | 1,866     |  |
| グローバル・リンク・マネジメント | 0.8     | 1.9   | 1,054     |  |
| パーク 2 4          | 62      | 61.4  | 111,318   |  |
| バラカ              | 2.7     | 2.9   | 4,872     |  |
| 三井不動産            | 562.5   | 564.5 | 1,092,307 |  |
| 三菱地所             | 742.8   | 802   | 1,359,390 |  |
| 平和不動産            | 20.1    | 21    | 55,440    |  |
| 東京建物             | 115.9   | 120.6 | 149,182   |  |
| ダイビル             | 31.2    | 29.5  | 27,228    |  |
| 京阪神ビルディング        | 18.9    | 18.6  | 21,966    |  |
| 住友不動産            | 238.3   | 257.3 | 780,648   |  |
| テアオーシー           | 24.3    | 22.5  | 13,050    |  |
| 東京楽天地            | 1.5     | 1.9   | 7,714     |  |
| レオパレス 2 1        | 130.8   | 150   | 42,750    |  |
| スターツコーポレーション     | 14.4    | 15.6  | 30,591    |  |
| フジ住宅             | 13.5    | 13.3  | 7,328     |  |

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

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

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

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

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

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

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

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

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 別 |        |       | 当 期 末               |
|------|--------|-------|---------------------|
|      |        |       | 買 建 額 売 建 額         |
| 国内   | 株式先物取引 | TOPIX | 百万円 百万円<br>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<br>(モルガン・スタンレーMUFG証券) | 株<br>11,620,100<br>(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       |
| 株式           | 千円<br>232,815,716 | %<br>83.1 |
| コール・ローン等、その他 | 47,464,184        | 16.9      |
| 投資信託財産総額     | 280,279,900       | 100.0     |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年3月25日現在)

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

## ○損益の状況 (2019年3月26日～2020年3月25日)

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

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

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

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

<注記事項>

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

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

# 【お知らせ】

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

(2019年7月1日)

## 外国株式インデックスマザーファンド

### 《第19期》決算日2020年5月12日

[計算期間：2019年5月14日～2020年5月12日]

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

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

### ○最近5期の運用実績

| 決 算 期           | 基 準 価 額 |       | MSCI コクサイ・インデックス<br>(配当込み、円換算ベース) |              | 株<br>組 入 比 率 | 株<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 書 組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|-----------------|---------|-------|-----------------------------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|--------------|
|                 | 円       | 騰 落 率 | 期 中<br>騰 落 率                      | 期 中<br>騰 落 率 |              |              |                        |              |
| 15期(2016年5月12日) | 19,726  | △14.5 | 550,129.14                        | △14.8        | 94.4         | 2.8          | 2.7                    | 270,065      |
| 16期(2017年5月12日) | 24,302  | 23.2  | 675,952.24                        | 22.9         | 92.9         | 1.9          | 2.4                    | 332,985      |
| 17期(2018年5月14日) | 26,785  | 10.2  | 742,711.39                        | 9.9          | 94.4         | 3.4          | 2.2                    | 337,226      |
| 18期(2019年5月13日) | 27,724  | 3.5   | 767,126.93                        | 3.3          | 93.8         | 3.8          | 2.5                    | 437,368      |
| 19期(2020年5月12日) | 26,834  | △3.2  | 740,810.97                        | △3.4         | 93.7         | 4.0          | 2.4                    | 449,841      |

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

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | MSCIコクサイ・インデックス<br>(配当込み、<br>円換算ベース) |       | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|---------------------|---------|-------|--------------------------------------|-------|-------------|-------------|---------------------|
|                     | 騰 落 率   | 騰 落 率 | 騰 落 率                                | 騰 落 率 | 騰 落 率       | 騰 落 率       | 騰 落 率               |
| (期 首)<br>2019年5月13日 | 円       | %     | 円                                    | %     | %           | %           | %                   |
|                     | 27,724  | —     | 767,126.93                           | —     | 93.8        | 3.8         | 2.5                 |
| 5月末                 | 26,891  | △ 3.0 | 743,484.51                           | △ 3.1 | 92.8        | 4.7         | 2.5                 |
| 6月末                 | 27,859  | 0.5   | 770,156.42                           | 0.4   | 93.8        | 3.7         | 2.5                 |
| 7月末                 | 28,618  | 3.2   | 790,836.41                           | 3.1   | 95.2        | 2.6         | 2.5                 |
| 8月末                 | 27,204  | △ 1.9 | 751,785.28                           | △ 2.0 | 88.9        | 8.6         | 2.5                 |
| 9月末                 | 28,077  | 1.3   | 775,713.31                           | 1.1   | 95.5        | 1.8         | 2.7                 |
| 10月末                | 29,192  | 5.3   | 805,459.07                           | 5.0   | 92.6        | 4.8         | 2.6                 |
| 11月末                | 30,277  | 9.2   | 835,911.03                           | 9.0   | 91.8        | 5.6         | 2.6                 |
| 12月末                | 31,190  | 12.5  | 860,793.53                           | 12.2  | 93.3        | 4.6         | 2.5                 |
| 2020年1月末            | 31,228  | 12.6  | 861,985.05                           | 12.4  | 94.5        | 3.2         | 2.6                 |
| 2月末                 | 28,777  | 3.8   | 794,123.11                           | 3.5   | 95.5        | 2.2         | 2.7                 |
| 3月末                 | 24,454  | △11.8 | 675,468.96                           | △11.9 | 92.7        | 5.0         | 2.5                 |
| 4月末                 | 26,849  | △ 3.2 | 740,391.09                           | △ 3.5 | 94.6        | 2.8         | 2.5                 |
| (期 末)<br>2020年5月12日 | 26,834  | △ 3.2 | 740,810.97                           | △ 3.4 | 93.7        | 4.0         | 2.4                 |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

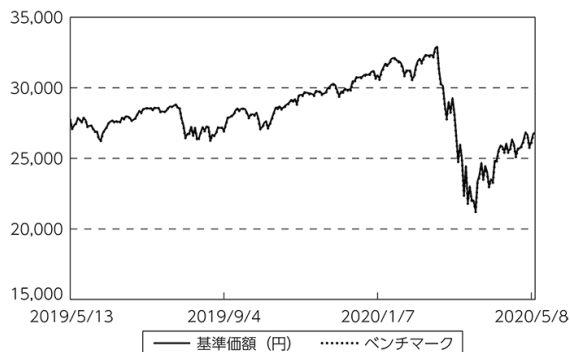
#### ○基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.2%の下落となりました。

#### ○ベンチマークとの差異

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

## 基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

●投資環境について

◎外国株式市況

外国株式市況は下落しました。

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

◎為替市況

米ドル、ユーロは円に対して下落しました。

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

（注）マルチファクターモデル

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは3.4%の下落になったため、乖離は0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・その他の要因によるものです。

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

（主なマイナス要因）

- ・組入要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月14日～2020年5月12日)

| 項 目                   | 当 期  |         | 項 目 の 概 要                                                                              |
|-----------------------|------|---------|----------------------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額  | 比 率     |                                                                                        |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円 2  | % 0.008 | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料                      |
| (株 式)                 | (1)  | (0.005) |                                                                                        |
| (投資信託証券)              | (0)  | (0.000) |                                                                                        |
| (先物・オプション)            | (1)  | (0.003) |                                                                                        |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 10   | 0.036   | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                            |
| (株 式)                 | (10) | (0.035) |                                                                                        |
| (投資信託証券)              | (0)  | (0.001) |                                                                                        |
| (c) そ の 他 費 用         | 7    | 0.025   | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>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<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (7)  | (0.024) |                                                                                        |
| (そ の 他)               | (0)  | (0.001) |                                                                                        |
| 合 計                   | 19   | 0.069   |                                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、28,248円です。 |      |         |                                                                                        |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2019年5月14日～2020年5月12日)

## 株式

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

|        |          | 買 付                |                              | 売 付         |                      |
|--------|----------|--------------------|------------------------------|-------------|----------------------|
|        |          | 株 数                | 金 額                          | 株 数         | 金 額                  |
| 外<br>国 | ニュージーランド | 百株<br>3,846        | 千ニュージーランドドル<br>3,259         | 百株<br>3,268 | 千ニュージーランドドル<br>2,781 |
|        | 香港       | 74,550<br>( 1,107) | 千香港ドル<br>291,698<br>( —)     | 68,258      | 千香港ドル<br>258,400     |
|        | シンガポール   | 27,989             | 千シンガポールドル<br>17,273          | 31,699      | 千シンガポールドル<br>15,199  |
|        | イスラエル    | 4,568<br>( 68)     | 千イスラエルシェケル<br>13,124<br>( —) | 4,767       | 千イスラエルシェケル<br>9,623  |

(注) 金額は受渡代金。

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

## 投資信託証券

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

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

| 銘 柄 |                              | 買 付            |                   | 売 付   |           |
|-----|------------------------------|----------------|-------------------|-------|-----------|
|     |                              | 口 数            | 金 額               | 口 数   | 金 額       |
| 外 国 | 香港                           | 千口             | 千香港ドル             | 千口    | 千香港ドル     |
|     | LINK REIT                    | 181            | 14,948            | 161   | 13,243    |
|     | 小 計                          | 181            | 14,948            | 161   | 13,243    |
|     | シンガポール                       |                | 千シンガポールドル         |       | 千シンガポールドル |
|     | SUNTEC REIT                  | 269<br>( — )   | 494<br>(△ 1)      | 324   | 588       |
|     | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 245            | 446               | 160   | 326       |
|     | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | 400<br>( — )   | 963<br>(△0.06294) | 184   | 422       |
|     | CAPITALAND MALL TRUST        | 122            | 308               | 104   | 242       |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 245<br>( — )   | 752<br>(△ 4)      | 204   | 635       |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT | —<br>( 40)     | —<br>( — )        | 40    | 10        |
|     | 小 計                          | 1,283<br>( 40) | 2,964<br>(△ 5)    | 1,018 | 2,225     |

(注) 金額は受渡代金。

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

## 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 |        | 買 建            |                | 売 建      |          |
|-------|--------|----------------|----------------|----------|----------|
|       |        | 新規買付額          | 決 済 額          | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 外 国   | 株式先物取引 | 百万円<br>371,227 | 百万円<br>371,693 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

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

## ○株式売買比率

(2019年5月14日～2020年5月12日)

### 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月14日～2020年5月12日)

利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|---------------------|---------------|-----------|---------------------|---------------|
|        | 百万円       | 百万円                 | %             | 百万円       | 百万円                 | %             |
| 為替直物取引 | 427,884   | 378,738             | 88.5          | 389,771   | 362,161             | 92.9          |

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

## ○組入資産の明細

(2020年5月12日現在)

## 外国株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

| 銘柄                            | 株数               | 株数             | 期末             |              | 業 種 等                  |
|-------------------------------|------------------|----------------|----------------|--------------|------------------------|
|                               |                  |                | 評価額            | 金額           |                        |
| (ユーロ…オーストリア)                  | 百株               | 百株             | 千ユーロ           | 千円           |                        |
| ANDRITZ AG                    | 73               | 66             | 204            | 23,756       | 資本財                    |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL | 145              | 210            | 334            | 38,774       | 銀行                     |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 890<br>6       | 939<br>6       | 2,171<br>—   | 251,961<br><0.1%>      |
| (ユーロ…ルクセンブルク)                 |                  |                |                |              |                        |
| RTL GROUP                     | 42               | —              | —              | —            | メディア・娯楽                |
| AROUNDTOWN SA                 | 818              | 1,363          | 683            | 79,318       | 不動産                    |
| TENARIS SA                    | 497              | 486            | 297            | 34,540       | エネルギー                  |
| SES                           | 369              | 375            | 221            | 25,693       | メディア・娯楽                |
| EUROFINS SCIENTIFIC           | 12               | 12             | 691            | 80,186       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ARCELORMITTAL                 | 707              | 697            | 602            | 69,850       | 素材                     |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,448<br>6     | 2,935<br>5     | 2,496<br>—   | 289,589<br><0.1%>      |
| (ユーロ…フィンランド)                  |                  |                |                |              |                        |
| NOKIA OYJ                     | 5,834            | 6,385          | 2,117          | 245,702      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| STORA ENSO OYJ-R SHS          | 552              | 689            | 716            | 83,170       | 素材                     |
| NOKIAN RENKAAT OYJ            | 112              | 121            | 223            | 25,918       | 自動車・自動車部品              |
| UPM-KYMMENE OYJ               | 566              | 580            | 1,443          | 167,501      | 素材                     |
| FORTUM OYJ                    | 455              | 486            | 749            | 86,974       | 公益事業                   |
| KONE OYJ-B                    | 353              | 391            | 2,215          | 257,019      | 資本財                    |
| METSO OYJ                     | 108              | 101            | 260            | 30,227       | 資本財                    |
| SAMPO OYJ-A SHS               | 465              | 513            | 1,514          | 175,672      | 保険                     |
| WARTSILA OYJ ABP              | 472              | 469            | 311            | 36,132       | 資本財                    |
| ELISA OYJ                     | 150              | 166            | 918            | 106,560      | 電気通信サービス               |
| NESTE OYJ                     | 407              | 480            | 1,534          | 178,054      | エネルギー                  |
| ORION OYJ-CLASS B             | 99               | 107            | 510            | 59,201       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 9,578<br>12    | 10,493<br>12   | 12,516<br>—  | 1,452,135<br><0.3%>    |
| (ユーロ…アイルランド)                  |                  |                |                |              |                        |
| KERRY GROUP PLC-A             | 168              | 184            | 1,919          | 222,715      | 食品・飲料・タバコ              |
| KINGSPAN GROUP PLC            | 160              | 166            | 828            | 96,122       | 資本財                    |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC     | 80               | 92             | 1,033          | 119,884      | 消費者サービス                |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW | —                | 1              | 15             | 1,741        | 消費者サービス                |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC     | 1,020            | 926            | 129            | 15,031       | 銀行                     |
| AIB GROUP PLC                 | 897              | 1,193          | 110            | 12,799       | 銀行                     |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC       | 228              | 259            | 744            | 86,417       | 素材                     |
| IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD  | 472              | 472            | —              | —            | 銀行                     |
| CRH PLC                       | 851              | 866            | 2,301          | 267,054      | 素材                     |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,879<br>8     | 4,163<br>9     | 7,082<br>—   | 821,766<br><0.2%>      |
| (ユーロ…ポルトガル)                   |                  |                |                |              |                        |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA   | 2,590            | 2,863          | 1,175          | 136,357      | 公益事業                   |
| JERONIMO MARTINS              | 243              | 268            | 422            | 48,992       | 食品・生活必需品小売り            |
| GALP ENERGIA SGPS SA          | 525              | 647            | 656            | 76,166       | エネルギー                  |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,359<br>3     | 3,779<br>3     | 2,254<br>—   | 261,515<br><0.1%>      |
| ユーロ計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 203,649<br>240 | 221,926<br>238 | 371,880<br>— | 43,145,558<br><9.6%>   |
| (イギリス)                        |                  |                | 千ギリスポンド        |              |                        |
| BARCLAYS PLC                  | 17,749           | 18,737         | 1,922          | 254,249      | 銀行                     |
| BP PLC                        | 20,780           | 22,852         | 7,172          | 948,546      | エネルギー                  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC      | 73,795           | 78,426         | 2,385          | 315,461      | 銀行                     |

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

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

| 銘柄                           |               | 期首(前期末) | 当 期 末   |             | 業 種 等        |                        |
|------------------------------|---------------|---------|---------|-------------|--------------|------------------------|
|                              |               | 株 数     | 株 数     | 評 価 額       |              |                        |
|                              |               |         |         | 外貨建金額       |              | 邦貨換算金額                 |
| (スイス)                        |               | 百株      | 百株      | 千スイスフラン     | 千円           |                        |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG        |               | 503     | 561     | 2, 193      | 242, 010     | 素材                     |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN |               | 729     | 792     | 27, 318     | 3, 013, 796  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GIVAUDAN-REG                 |               | 9       | 10      | 3, 449      | 380, 500     | 素材                     |
| SONOVA HOLDING AG-REG        |               | 55      | 62      | 1, 199      | 132, 294     | ヘルスケア機器・サービス           |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    |               | 156     | 165     | 4, 823      | 532, 128     | 保険                     |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     |               | 11      | 11      | 837         | 92, 362      | ヘルスケア機器・サービス           |
| LONZA GROUP AG-REG           |               | 77      | 83      | 3, 762      | 415, 055     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG      |               | 62      | 110     | 392         | 43, 354      | 耐久消費財・アパレル             |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  |               | 40      | 45      | 972         | 107, 276     | 資本財                    |
| GEBERIT AG-REG               |               | 38      | 42      | 1, 849      | 204, 059     | 資本財                    |
| SWISS RE AG                  |               | 315     | 323     | 2, 135      | 235, 605     | 保険                     |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       |               | 31      | 25      | 459         | 50, 638      | 耐久消費財・アパレル             |
| PARGESA HOLDING SA-BR        |               | 36      | 39      | 271         | 29, 905      | 各種金融                   |
| NOVARTIS AG-REG              |               | 2, 249  | 2, 422  | 20, 262     | 2, 235, 363  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADECCO GROUP AG-REG          |               | 165     | 182     | 751         | 82, 897      | 商業・専門サービス              |
| SWISSCOM AG-REG              |               | 27      | 28      | 1, 408      | 155, 424     | 電気通信サービス               |
| ABB LTD-REG                  |               | 1, 907  | 2, 066  | 3, 671      | 405, 025     | 資本財                    |
| CLARIANT AG-REG              |               | 191     | 200     | 354         | 39, 137      | 素材                     |
| SGS SA-REG                   |               | 5       | 7       | 1, 531      | 168, 944     | 商業・専門サービス              |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG     |               | 22      | 26      | 563         | 62, 154      | 資本財                    |
| TEMENOS AG - REG             |               | 60      | 70      | 928         | 102, 410     | ソフトウェア・サービス            |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   |               | 56      | 61      | 839         | 92, 654      | 運輸                     |
| BALOISE HOLDING AG - REG     |               | 49      | 56      | 775         | 85, 540      | 保険                     |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    |               | 35      | 40      | 1, 328      | 146, 532     | 保険                     |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  |               | 0. 09   | 0. 11   | 907         | 100, 115     | 食品・飲料・タバコ              |
| JULIUS BAER GROUP LTD        |               | 237     | 242     | 892         | 98, 451      | 各種金融                   |
| SIKA AG-REG                  |               | 133     | 144     | 2, 394      | 264, 185     | 素材                     |
| SWISS PRIME SITE-REG         |               | 82      | 80      | 748         | 82, 569      | 不動産                    |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   |               | 1       | 1       | 1, 032      | 113, 953     | 食品・飲料・タバコ              |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    |               | 18      | 20      | 1, 591      | 175, 553     | 各種金融                   |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       |               | 2       | 3       | 618         | 68, 248      | 食品・飲料・タバコ              |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    |               | 8       | 8       | 570         | 62, 897      | 素材                     |
| UBS GROUP AG-REG             |               | 3, 997  | 4, 313  | 4, 090      | 451, 228     | 各種金融                   |
| DUFREY AG-REG                |               | 36      | 41      | 112         | 12, 360      | 小売                     |
| VIFOR PHARMA AG              |               | 45      | 58      | 897         | 99, 028      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALCON INC                    |               | 449     | 469     | 2, 462      | 271, 638     | ヘルスケア機器・サービス           |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 18, 221 | 19, 679 | 139, 403    | 15, 379, 009 |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 39      | 39      | —           | < 3. 4% >    |                        |
| (スウェーデン)                     |               |         |         | 千スウェーデンクローネ |              |                        |
| ELECTROLUX AB-SER B          |               | 261     | 237     | 3, 272      | 35, 537      | 耐久消費財・アパレル             |
| ERICSSON LM-B SHS            |               | 3, 187  | 3, 442  | 28, 820     | 312, 985     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         |               | 389     | 406     | 12, 742     | 138, 387     | 資本財                    |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A |               | 1, 671  | 1, 957  | 14, 553     | 158, 047     | 銀行                     |
| INVESTOR AB-B SHS            |               | 459     | 520     | 24, 779     | 269, 104     | 各種金融                   |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  |               | 1, 586  | 1, 777  | 15, 763     | 171, 191     | 銀行                     |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         |               | 708     | 782     | 27, 055     | 293, 817     | 資本財                    |
| SKF AB-B SHARES              |               | 403     | 445     | 6, 912      | 75, 071      | 資本財                    |
| ASSA ABLOY AB-B              |               | 1, 046  | 1, 132  | 20, 983     | 227, 882     | 資本財                    |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    |               | 928     | 920     | 12, 036     | 130, 715     | 小売                     |
| SANDVIK AB                   |               | 1, 169  | 1, 296  | 19, 174     | 208, 239     | 資本財                    |
| SWEDBANK AB - A SHARES       |               | 958     | 1, 011  | 10, 751     | 116, 761     | 銀行                     |
| SECURITAS AB-B SHS           |               | 333     | 323     | 3, 737      | 40, 585      | 商業・専門サービス              |

| 銘柄                         |         | 株数     | 期首(前期末) | 当 期 末       |           | 業 種 等                  |
|----------------------------|---------|--------|---------|-------------|-----------|------------------------|
|                            |         |        | 株数      | 評 価 額       |           |                        |
|                            |         |        |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                        |
| (スウェーデン)                   |         | 百株     | 百株      | 千スウェーデンクローネ | 千円        |                        |
| SKANSKA AB-B SHS           |         | 363    | 395     | 7,224       | 78,455    | 資本財                    |
| SWEDISH MATCH AB           |         | 173    | 186     | 11,595      | 125,931   | 食品・飲料・タバコ              |
| TELE2 AB-B SHS             |         | 518    | 572     | 7,292       | 79,200    | 電気通信サービス               |
| TELIA CO AB                |         | 2,919  | 3,299   | 10,765      | 116,912   | 電気通信サービス               |
| VOLVO AB-B SHS             |         | 1,625  | 1,606   | 19,949      | 216,654   | 資本財                    |
| ALFA LAVAL AB              |         | 302    | 412     | 7,671       | 83,312    | 資本財                    |
| LUNDIN ENERGY AB           |         | 201    | 211     | 4,753       | 51,624    | エネルギー                  |
| BOLIDEN AB                 |         | 283    | 308     | 6,063       | 65,850    | 素材                     |
| HUSQVARNA AB-B SHS         |         | 470    | 406     | 2,352       | 25,542    | 耐久消費財・アパレル             |
| MILLICOM INTL CELLULAR-SDR |         | 73     | 103     | 2,379       | 25,839    | 電気通信サービス               |
| HEXAGON AB-B SHS           |         | 262    | 294     | 14,023      | 152,294   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KINNEVIK AB - B            |         | 262    | 253     | 5,593       | 60,745    | 各種金融                   |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS    |         | 150    | 159     | 3,165       | 34,375    | 各種金融                   |
| ICA GRUPPEN AB             |         | 72     | 96      | 4,042       | 43,899    | 食品・生活必需品小売り            |
| LUNDBERGS AB-B SHS         |         | 66     | 74      | 3,104       | 33,709    | 各種金融                   |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B        |         | 636    | 684     | 21,552      | 234,063   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EPIROC AB-B                |         | 440    | 417     | 4,265       | 46,320    | 資本財                    |
| EPIROC AB-A                |         | 643    | 793     | 8,144       | 88,449    | 資本財                    |
| NORDEA BANK ABP            |         | 3,152  | 3,709   | 21,892      | 237,748   | 銀行                     |
| 小 計                        | 株数・金額   | 25,723 | 28,240  | 366,414     | 3,979,260 |                        |
|                            | 銘柄数<比率> | 32     | 32      | —           | <0.9%>    |                        |
| (ノルウェー)                    |         |        |         | 千ノルウェークローネ  |           |                        |
| DNB ASA                    |         | 1,002  | 1,105   | 12,883      | 133,856   | 銀行                     |
| NORSK HYDRO ASA            |         | 1,415  | 1,281   | 2,993       | 31,104    | 素材                     |
| ORKLA ASA                  |         | 802    | 812     | 6,850       | 71,179    | 食品・飲料・タバコ              |
| EQUINOR ASA                |         | 1,200  | 1,134   | 16,023      | 166,487   | エネルギー                  |
| TELENOR ASA                |         | 777    | 872     | 13,169      | 136,833   | 電気通信サービス               |
| YARA INTERNATIONAL ASA     |         | 182    | 195     | 6,485       | 67,385    | 素材                     |
| MOWI ASA                   |         | 430    | 461     | 8,312       | 86,364    | 食品・飲料・タバコ              |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA  |         | 193    | 221     | 3,905       | 40,573    | 保険                     |
| SCHIBSTED ASA-B SHS        |         | 109    | 97      | 2,006       | 20,847    | メディア・娯楽                |
| AKER BP ASA                |         | 117    | 102     | 1,765       | 18,340    | エネルギー                  |
| 小 計                        | 株数・金額   | 6,233  | 6,284   | 74,395      | 772,973   |                        |
|                            | 銘柄数<比率> | 10     | 10      | —           | <0.2%>    |                        |
| (デンマーク)                    |         |        |         | 千デンマーククローネ  |           |                        |
| NOVO NORDISK A/S-B         |         | 1,884  | 1,993   | 87,531      | 1,361,987 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES     |         | 226    | 235     | 8,268       | 128,660   | 素材                     |
| DANSKE BANK A/S            |         | 742    | 710     | 5,390       | 83,869    | 銀行                     |
| DEMANT A/S                 |         | 104    | 118     | 2,056       | 31,992    | ヘルスケア機器・サービス           |
| H LUNDBECK A/S             |         | 62     | 63      | 1,573       | 24,481    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S    |         | 202    | 218     | 13,265      | 206,408   | 資本財                    |
| CARLSBERG AS-B             |         | 108    | 127     | 10,740      | 167,129   | 食品・飲料・タバコ              |
| COLOPLAST-B                |         | 123    | 135     | 14,098      | 219,367   | ヘルスケア機器・サービス           |
| DSV PANALPINA A/S          |         | 189    | 239     | 17,000      | 264,531   | 運輸                     |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B     |         | 7      | 7       | 4,844       | 75,380    | 運輸                     |
| TRYG A/S                   |         | 121    | 147     | 2,710       | 42,180    | 保険                     |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A    |         | 3      | 3       | 2,235       | 34,780    | 運輸                     |
| PANDORA A/S                |         | 122    | 105     | 2,939       | 45,744    | 耐久消費財・アパレル             |
| ISS A/S                    |         | 183    | 213     | 2,061       | 32,074    | 商業・専門サービス              |
| CHR HANSEN HOLDING A/S     |         | 99     | 117     | 7,372       | 114,715   | 素材                     |
| GENMAB A/S                 |         | 62     | 75      | 14,362      | 223,474   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

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

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

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

| 銘柄                           |               | 期首(前期末)   |           | 当 期 末      |             | 業 種 等    |
|------------------------------|---------------|-----------|-----------|------------|-------------|----------|
|                              |               | 株 数       | 株 数       | 評 価 額      |             |          |
|                              |               |           |           | 外貨建金額      | 邦貨換算金額      |          |
| (イスラエル)                      |               | 百株        | 百株        | 千イスラエルシェケル | 千円          |          |
| ELBIT SYSTEMS LTD            |               | 22        | 32        | 1,555      | 47,670      | 資本財      |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A       |               | —         | 1,244     | 1,427      | 43,747      | 銀行       |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO |               | 1,865     | —         | —          | —           | 電気通信サービス |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     |               | 159       | 140       | 987        | 30,269      | 銀行       |
| AZRIELI GROUP LTD            |               | 37        | 52        | 1,014      | 31,089      | 不動産      |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 5,441     | 5,311     | 16,254     | 498,046     |          |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8         | 8         | —          | <0.1%>      |          |
| 合 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 1,284,294 | 1,245,065 | —          | 421,655,664 |          |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1,253     | 1,254     | —          | <93.7%>     |          |

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

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

## 外国投資信託証券

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

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

| 銘 柄                          |               | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |            |     |
|------------------------------|---------------|---------|-------|-----------|------------|-----|
|                              |               | 口 数     | 口 数   | 評 価 額     |            | 比 率 |
|                              |               |         |       | 外貨建金額     | 邦貨換算金額     |     |
| (シンガポール)                     |               | 千口      | 千口    | 千シンガポールドル | 千円         | %   |
| SUNTEC REIT                  |               | 249     | 194   | 270       | 20,452     | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  |               | 278     | 363   | 581       | 44,020     | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   |               | —       | 216   | 419       | 31,777     | 0.0 |
| CAPITALAND MALL TRUST        |               | 244     | 262   | 486       | 36,818     | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT |               | 278     | 318   | 955       | 72,382     | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 1,050   | 1,355 | 2,712     | 205,452    |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 5     | —         | <0.0%>     |     |
| 合 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 5,021   | 5,574 | —         | 10,778,567 |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 62      | 65    | —         | <2.4%>     |     |

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

## 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別      | 当 期 末  |       |
|----------|--------|-------|
|          | 買 建 額  | 売 建 額 |
| 外 国      | 百万円    | 百万円   |
| 株式先物取引   | 12,837 | —     |
| SP EMINI | 572    | —     |
| SP/TSE60 | 629    | —     |
| SWISS IX | 2,215  | —     |
| EURO ST  | 710    | —     |
| SPI 200  | 908    | —     |
| FTSE100  |        |       |

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

## ○投資信託財産の構成

(2020年5月12日現在)

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
| 株式           | 千円          | %     |
|              | 421,655,664 | 93.7  |
| 投資証券         | 10,778,567  | 2.4   |
| コール・ローン等、その他 | 17,484,321  | 3.9   |
| 投資信託財産総額     | 449,918,552 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産(449,768,670千円)の投資信託財産総額(449,918,552千円)に対する比率は100.0%です。

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月12日現在)

| 項 目             | 当 期 末            |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 451,053,773,434  |
| コール・ローン等        | 11,358,349,528   |
| 株式(評価額)         | 421,655,664,074  |
| 投資証券(評価額)       | 10,778,567,605   |
| 未収入金            | 2,073,819,005    |
| 未収配当金           | 462,895,406      |
| 差入委託証拠金         | 4,724,477,816    |
| (B) 負債          | 1,212,025,293    |
| 未払金             | 1,138,716,670    |
| 未払解約金           | 73,308,537       |
| 未払利息            | 86               |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 449,841,748,141  |
| 元本              | 167,638,526,747  |
| 次期繰越損益金         | 282,203,221,394  |
| (D) 受益権総口数      | 167,638,526,747口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 26.834円          |

<注記事項>

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

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

|                                       |                 |
|---------------------------------------|-----------------|
| MUAM 外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)        | 36,745,576,449円 |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス               | 34,030,298,802円 |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド                | 16,631,581,978円 |
| eMAXIS 先進国株式インデックス                    | 14,627,097,963円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)         | 9,413,706,485円  |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)       | 8,641,501,255円  |
| eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)          | 7,810,974,582円  |
| eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)               | 5,584,895,740円  |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド              | 5,210,904,253円  |
| つみたて先進国株式                             | 4,307,022,934円  |
| MAXIS 海外株式(MSC I コクサイ) 上場投信           | 3,195,879,198円  |
| eMAXIS 全世界株式インデックス                    | 2,630,772,978円  |
| MUKAM 外国株式インデックスファンド2(適格機関投資家限定)      | 2,536,144,437円  |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)              | 2,267,404,126円  |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド                  | 2,067,853,494円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)       | 1,623,766,188円  |
| eMAXIS バランス(8資産均等型)                   | 1,334,052,226円  |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)         | 1,324,147,410円  |
| 海外株式セレクション(ラップ向け)                     | 1,090,837,580円  |
| つみたて8資産均等バランス                         | 915,340,278円    |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型) | 656,073,592円    |

○損益の状況 (2019年5月14日～2020年5月12日)

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

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

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

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

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

【お知らせ】

- ①株式等インデックスファンドのベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2019年7月1日)
- ②外国株式の貸付に関する指図権限を三菱UFJ アセット・マネジメント (UK) に委託するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2019年7月1日)

# 日本債券インデックスマザーファンド

## 《第19期》決算日2020年5月12日

[計算期間：2019年5月14日～2020年5月12日]

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

|             |                                                                                                                                                                                                   |
|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運 用 方 針     | NOMURA-BP I 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-BP I 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-BP I 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-BP I 総合 |      | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|---------|------|----------------|------|-----------|-----------|---------|
|                 | 期 騰 落   | 中 率  | 期 騰 落          | 中 率  |           |           |         |
|                 | 円       | %    |                | %    | %         | %         | 百万円     |
| 15期(2016年5月12日) | 13,473  | 7.2  | 387.29         | 7.2  | 99.6      | —         | 529,456 |
| 16期(2017年5月12日) | 13,180  | △2.2 | 378.85         | △2.2 | 99.3      | 0.2       | 457,117 |
| 17期(2018年5月14日) | 13,283  | 0.8  | 381.82         | 0.8  | 98.4      | 0.3       | 544,273 |
| 18期(2019年5月13日) | 13,503  | 1.7  | 388.16         | 1.7  | 99.8      | 0.1       | 608,830 |
| 19期(2020年5月12日) | 13,524  | 0.2  | 388.75         | 0.2  | 99.6      | 0.1       | 630,705 |

(注) NOMURA-BP I 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<br>円 | 騰 落 率<br>% | N O M U R A - B P I 総 合 |            | 債 組 入 比 率<br>% | 債 先 物 比 率<br>% |
|---------------------|--------------|------------|-------------------------|------------|----------------|----------------|
|                     |              |            |                         | 騰 落 率<br>% |                |                |
| (期 首)<br>2019年5月13日 | 13,503       | —          | 388.16                  | —          | 99.8           | 0.1            |
| 5月末                 | 13,581       | 0.6        | 390.32                  | 0.6        | 99.6           | 0.1            |
| 6月末                 | 13,663       | 1.2        | 392.69                  | 1.2        | 99.8           | 0.1            |
| 7月末                 | 13,679       | 1.3        | 393.15                  | 1.3        | 99.6           | 0.1            |
| 8月末                 | 13,863       | 2.7        | 398.50                  | 2.7        | 99.6           | 0.1            |
| 9月末                 | 13,716       | 1.6        | 394.27                  | 1.6        | 99.8           | 0.1            |
| 10月末                | 13,660       | 1.2        | 392.61                  | 1.1        | 99.4           | 0.1            |
| 11月末                | 13,612       | 0.8        | 391.33                  | 0.8        | 99.5           | 0.1            |
| 12月末                | 13,571       | 0.5        | 390.14                  | 0.5        | 100.9          | 0.6            |
| 2020年1月末            | 13,629       | 0.9        | 391.77                  | 0.9        | 100.2          | 0.1            |
| 2月末                 | 13,736       | 1.7        | 394.74                  | 1.7        | 101.1          | 0.6            |
| 3月末                 | 13,513       | 0.1        | 388.45                  | 0.1        | 99.8           | 0.1            |
| 4月末                 | 13,559       | 0.4        | 389.79                  | 0.4        | 99.6           | 0.1            |
| (期 末)<br>2020年5月12日 | 13,524       | 0.2        | 388.75                  | 0.2        | 99.6           | 0.1            |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

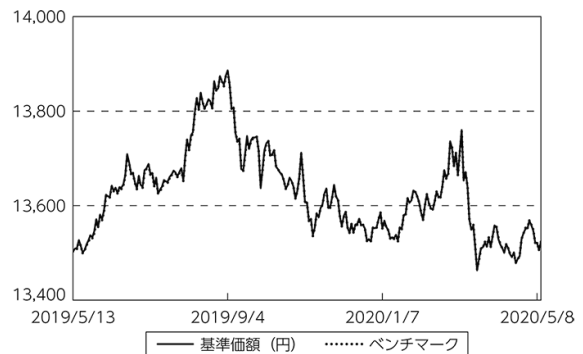
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.2%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(0.2%)とほぼ同程度となりました。

## 基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因  
(上昇要因)

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

●投資環境について

◎国内債券市況

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

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・評価時価差異要因※によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月14日～2020年5月12日)

| 項 目                                      | 当 期           |                       | 項 目 の 概 要                                                         |
|------------------------------------------|---------------|-----------------------|-------------------------------------------------------------------|
|                                          | 金 額           | 比 率                   |                                                                   |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ) | 円<br>0<br>(0) | %<br>0.000<br>(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<br>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<br>( そ の 他 )               | 0<br>(0)      | 0.000<br>(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<br><br>信託事務の処理等に要するその他諸費用           |
| 合 計                                      | 0             | 0.000                 |                                                                   |
| 期中の平均基準価額は、13,628円です。                    |               |                       |                                                                   |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○ 売買及び取引の状況

(2019年5月14日～2020年5月12日)

## 公社債

|                |       | 買 付 額       | 売 付 額                    |
|----------------|-------|-------------|--------------------------|
| 国<br><br><br>内 |       | 千円          | 千円                       |
|                | 国債証券  | 367,425,827 | 343,804,522              |
|                | 地方債証券 | 24,378,782  | 24,530,720               |
|                | 特殊債券  | 33,388,897  | 31,003,810<br>( 752,447) |
|                | 社債券   | 14,599,007  | 14,254,870<br>( 100,000) |

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別  |        | 買 建           |               | 売 建      |          |
|--------|--------|---------------|---------------|----------|----------|
|        |        | 新規買付額         | 決 済 額         | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 国<br>内 | 債券先物取引 | 百万円<br>14,144 | 百万円<br>13,990 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月14日～2020年5月12日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|----------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|---------------|
|     |                |                     |               |                |                     |               |
| 公社債 | 百万円<br>439,792 | 百万円<br>162,091      | %<br>36.9     | 百万円<br>413,593 | 百万円<br>126,506      | %<br>30.6     |

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額        | 売 付 額      | 当 期 末 保 有 額  |
|-----|--------------|------------|--------------|
| 公社債 | 百万円<br>2,946 | 百万円<br>302 | 百万円<br>4,337 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額        |
|-----|--------------|
| 公社債 | 百万円<br>4,900 |

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

## ○組入資産の明細

(2020年5月12日現在)

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分     | 当 期 末         |               |         |                    |           |        |        |
|---------|---------------|---------------|---------|--------------------|-----------|--------|--------|
|         | 額 面 金 額       | 評 価 額         | 組 入 比 率 | うちBB格以下<br>組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 |        |        |
|         |               |               |         |                    | 5年以上      | 2年以上   | 2年未満   |
|         | 千円            | 千円            | %       | %                  | %         | %      | %      |
| 国債証券    | 484,304,000   | 526,406,617   | 83.5    | —                  | 56.8      | 18.2   | 8.4    |
| 地方債証券   | 30,568,420    | 32,031,730    | 5.1     | —                  | 2.6       | 1.7    | 0.8    |
|         | ( 30,568,420) | ( 32,031,730) | ( 5.1)  | ( —)               | ( 2.6)    | ( 1.7) | ( 0.8) |
| 特殊債券    | 35,182,562    | 37,218,986    | 5.9     | —                  | 3.7       | 1.2    | 1.0    |
| (除く金融債) | ( 35,182,562) | ( 37,218,986) | ( 5.9)  | ( —)               | ( 3.7)    | ( 1.2) | ( 1.0) |
| 金融債券    | 3,300,000     | 3,306,410     | 0.5     | —                  | 0.0       | 0.3    | 0.2    |
|         | ( 3,300,000)  | ( 3,306,410)  | ( 0.5)  | ( —)               | ( 0.0)    | ( 0.3) | ( 0.2) |
| 普通社債券   | 29,000,000    | 29,200,369    | 4.6     | 0.0                | 1.4       | 2.9    | 0.3    |
|         | ( 29,000,000) | ( 29,200,369) | ( 4.6)  | (0.0)              | ( 1.4)    | ( 2.9) | ( 0.3) |
| 合 計     | 582,354,982   | 628,164,115   | 99.6    | 0.0                | 64.6      | 24.4   | 10.6   |
|         | ( 98,050,982) | (101,757,497) | (16.1)  | (0.0)              | ( 7.7)    | ( 6.2) | ( 2.2) |

(注) ( )内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

## (B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘              | 柄 | 当 期 末 |           |           |            |
|----------------|---|-------|-----------|-----------|------------|
|                |   | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券           |   | %     | 千円        | 千円        |            |
| 第404回利付国債（2年）  |   | 0.1   | 1,150,000 | 1,154,209 | 2021/9/1   |
| 第405回利付国債（2年）  |   | 0.1   | 700,000   | 702,968   | 2021/10/1  |
| 第407回利付国債（2年）  |   | 0.1   | 150,000   | 150,666   | 2021/12/1  |
| 第408回利付国債（2年）  |   | 0.1   | 8,150,000 | 8,187,490 | 2022/1/1   |
| 第409回利付国債（2年）  |   | 0.1   | 6,300,000 | 6,330,492 | 2022/2/1   |
| 第128回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 3,850,000 | 3,861,896 | 2021/6/20  |
| 第129回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 3,100,000 | 3,111,563 | 2021/9/20  |
| 第130回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 4,950,000 | 4,971,879 | 2021/12/20 |
| 第131回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 5,010,000 | 5,035,551 | 2022/3/20  |
| 第132回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 3,850,000 | 3,872,330 | 2022/6/20  |
| 第133回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 4,900,000 | 4,931,850 | 2022/9/20  |
| 第134回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 9,360,000 | 9,427,298 | 2022/12/20 |
| 第135回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 880,000   | 886,934   | 2023/3/20  |
| 第136回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 3,250,000 | 3,277,365 | 2023/6/20  |
| 第137回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 7,400,000 | 7,466,156 | 2023/9/20  |
| 第138回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 5,150,000 | 5,198,513 | 2023/12/20 |
| 第139回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 600,000   | 605,928   | 2024/3/20  |
| 第140回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 3,960,000 | 4,000,867 | 2024/6/20  |
| 第141回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 4,640,000 | 4,689,833 | 2024/9/20  |
| 第142回利付国債（5年）  |   | 0.1   | 7,070,000 | 7,146,992 | 2024/12/20 |
| 第1回利付国債（40年）   |   | 2.4   | 475,000   | 717,563   | 2048/3/20  |
| 第2回利付国債（40年）   |   | 2.2   | 870,000   | 1,281,701 | 2049/3/20  |
| 第3回利付国債（40年）   |   | 2.2   | 733,000   | 1,090,667 | 2050/3/20  |
| 第4回利付国債（40年）   |   | 2.2   | 1,098,000 | 1,649,832 | 2051/3/20  |
| 第5回利付国債（40年）   |   | 2.0   | 1,195,000 | 1,742,560 | 2052/3/20  |
| 第6回利付国債（40年）   |   | 1.9   | 1,060,000 | 1,526,103 | 2053/3/20  |
| 第7回利付国債（40年）   |   | 1.7   | 1,280,000 | 1,776,115 | 2054/3/20  |
| 第8回利付国債（40年）   |   | 1.4   | 1,280,000 | 1,666,419 | 2055/3/20  |
| 第9回利付国債（40年）   |   | 0.4   | 1,950,000 | 1,908,114 | 2056/3/20  |
| 第10回利付国債（40年）  |   | 0.9   | 2,400,000 | 2,750,064 | 2057/3/20  |
| 第11回利付国債（40年）  |   | 0.8   | 2,010,000 | 2,241,150 | 2058/3/20  |
| 第12回利付国債（40年）  |   | 0.5   | 1,690,000 | 1,709,451 | 2059/3/20  |
| 第315回利付国債（10年） |   | 1.2   | 3,633,000 | 3,688,257 | 2021/6/20  |
| 第316回利付国債（10年） |   | 1.1   | 2,280,000 | 2,312,148 | 2021/6/20  |
| 第317回利付国債（10年） |   | 1.1   | 1,957,000 | 1,990,914 | 2021/9/20  |
| 第318回利付国債（10年） |   | 1.0   | 2,480,000 | 2,519,605 | 2021/9/20  |
| 第319回利付国債（10年） |   | 1.1   | 1,719,000 | 1,754,411 | 2021/12/20 |
| 第320回利付国債（10年） |   | 1.0   | 1,980,000 | 2,017,600 | 2021/12/20 |
| 第321回利付国債（10年） |   | 1.0   | 2,515,000 | 2,569,902 | 2022/3/20  |
| 第322回利付国債（10年） |   | 0.9   | 1,470,000 | 1,499,355 | 2022/3/20  |
| 第323回利付国債（10年） |   | 0.9   | 1,675,000 | 1,713,206 | 2022/6/20  |
| 第324回利付国債（10年） |   | 0.8   | 2,800,000 | 2,857,932 | 2022/6/20  |
| 第325回利付国債（10年） |   | 0.8   | 3,835,000 | 3,923,435 | 2022/9/20  |
| 第326回利付国債（10年） |   | 0.7   | 730,000   | 746,614   | 2022/12/20 |

| 銘               | 柄 | 当 期 末 |           |           |             |
|-----------------|---|-------|-----------|-----------|-------------|
|                 |   | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日   |
| 国債証券            |   | %     | 千円        | 千円        |             |
| 第327回利付国債 (10年) |   | 0.8   | 2,540,000 | 2,604,465 | 2022/12/20  |
| 第328回利付国債 (10年) |   | 0.6   | 3,700,000 | 3,782,177 | 2023/ 3 /20 |
| 第329回利付国債 (10年) |   | 0.8   | 5,860,000 | 6,036,386 | 2023/ 6 /20 |
| 第330回利付国債 (10年) |   | 0.8   | 3,330,000 | 3,438,424 | 2023/ 9 /20 |
| 第331回利付国債 (10年) |   | 0.6   | 1,060,000 | 1,087,358 | 2023/ 9 /20 |
| 第332回利付国債 (10年) |   | 0.6   | 5,040,000 | 5,178,902 | 2023/12/20  |
| 第333回利付国債 (10年) |   | 0.6   | 6,550,000 | 6,741,587 | 2024/ 3 /20 |
| 第334回利付国債 (10年) |   | 0.6   | 4,330,000 | 4,464,100 | 2024/ 6 /20 |
| 第335回利付国債 (10年) |   | 0.5   | 4,470,000 | 4,596,366 | 2024/ 9 /20 |
| 第336回利付国債 (10年) |   | 0.5   | 3,880,000 | 3,994,149 | 2024/12/20  |
| 第337回利付国債 (10年) |   | 0.3   | 940,000   | 958,724   | 2024/12/20  |
| 第338回利付国債 (10年) |   | 0.4   | 3,580,000 | 3,672,614 | 2025/ 3 /20 |
| 第339回利付国債 (10年) |   | 0.4   | 6,660,000 | 6,841,351 | 2025/ 6 /20 |
| 第340回利付国債 (10年) |   | 0.4   | 2,250,000 | 2,314,305 | 2025/ 9 /20 |
| 第341回利付国債 (10年) |   | 0.3   | 4,270,000 | 4,373,675 | 2025/12/20  |
| 第342回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 8,240,000 | 8,349,262 | 2026/ 3 /20 |
| 第343回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 6,010,000 | 6,093,118 | 2026/ 6 /20 |
| 第344回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 6,170,000 | 6,258,909 | 2026/ 9 /20 |
| 第345回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 4,440,000 | 4,506,511 | 2026/12/20  |
| 第346回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 3,390,000 | 3,441,494 | 2027/ 3 /20 |
| 第347回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 4,920,000 | 4,997,539 | 2027/ 6 /20 |
| 第348回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 5,700,000 | 5,790,915 | 2027/ 9 /20 |
| 第349回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 3,790,000 | 3,851,019 | 2027/12/20  |
| 第350回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 5,070,000 | 5,150,207 | 2028/ 3 /20 |
| 第351回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 5,510,000 | 5,595,460 | 2028/ 6 /20 |
| 第352回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 4,300,000 | 4,365,102 | 2028/ 9 /20 |
| 第353回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 4,460,000 | 4,525,606 | 2028/12/20  |
| 第354回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 6,290,000 | 6,376,676 | 2029/ 3 /20 |
| 第355回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 5,350,000 | 5,420,887 | 2029/ 6 /20 |
| 第356回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 6,400,000 | 6,478,016 | 2029/ 9 /20 |
| 第357回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 4,950,000 | 5,007,123 | 2029/12/20  |
| 第358回利付国債 (10年) |   | 0.1   | 2,970,000 | 3,002,194 | 2030/ 3 /20 |
| 第 1 回利付国債 (30年) |   | 2.8   | 76,000    | 96,089    | 2029/ 9 /20 |
| 第 2 回利付国債 (30年) |   | 2.4   | 98,000    | 121,169   | 2030/ 2 /20 |
| 第 3 回利付国債 (30年) |   | 2.3   | 117,000   | 143,961   | 2030/ 5 /20 |
| 第 4 回利付国債 (30年) |   | 2.9   | 127,000   | 165,408   | 2030/11/20  |
| 第 5 回利付国債 (30年) |   | 2.2   | 108,000   | 133,591   | 2031/ 5 /20 |
| 第 6 回利付国債 (30年) |   | 2.4   | 169,000   | 214,256   | 2031/11/20  |
| 第 7 回利付国債 (30年) |   | 2.3   | 164,000   | 207,341   | 2032/ 5 /20 |
| 第 8 回利付国債 (30年) |   | 1.8   | 142,000   | 171,869   | 2032/11/22  |
| 第 9 回利付国債 (30年) |   | 1.4   | 116,000   | 134,687   | 2032/12/20  |
| 第10回利付国債 (30年)  |   | 1.1   | 185,000   | 208,076   | 2033/ 3 /20 |
| 第11回利付国債 (30年)  |   | 1.7   | 137,000   | 164,819   | 2033/ 6 /20 |
| 第12回利付国債 (30年)  |   | 2.1   | 220,000   | 276,896   | 2033/ 9 /20 |
| 第13回利付国債 (30年)  |   | 2.0   | 205,000   | 255,907   | 2033/12/20  |

| 銘              | 柄 | 当 期 末 |           |           |            |
|----------------|---|-------|-----------|-----------|------------|
|                |   | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券           |   | %     | 千円        | 千円        |            |
| 第14回利付国債 (30年) |   | 2.4   | 493,000   | 643,522   | 2034/3/20  |
| 第15回利付国債 (30年) |   | 2.5   | 346,000   | 457,986   | 2034/6/20  |
| 第16回利付国債 (30年) |   | 2.5   | 302,000   | 401,173   | 2034/9/20  |
| 第17回利付国債 (30年) |   | 2.4   | 327,000   | 430,923   | 2034/12/20 |
| 第18回利付国債 (30年) |   | 2.3   | 427,000   | 557,943   | 2035/3/20  |
| 第19回利付国債 (30年) |   | 2.3   | 303,000   | 397,160   | 2035/6/20  |
| 第20回利付国債 (30年) |   | 2.5   | 495,000   | 665,611   | 2035/9/20  |
| 第21回利付国債 (30年) |   | 2.3   | 379,000   | 499,442   | 2035/12/20 |
| 第22回利付国債 (30年) |   | 2.5   | 570,000   | 770,839   | 2036/3/20  |
| 第23回利付国債 (30年) |   | 2.5   | 554,000   | 751,622   | 2036/6/20  |
| 第24回利付国債 (30年) |   | 2.5   | 411,000   | 558,943   | 2036/9/20  |
| 第25回利付国債 (30年) |   | 2.3   | 742,000   | 987,661   | 2036/12/20 |
| 第26回利付国債 (30年) |   | 2.4   | 884,000   | 1,194,230 | 2037/3/20  |
| 第27回利付国債 (30年) |   | 2.5   | 860,000   | 1,181,872 | 2037/9/20  |
| 第28回利付国債 (30年) |   | 2.5   | 911,000   | 1,259,129 | 2038/3/20  |
| 第29回利付国債 (30年) |   | 2.4   | 1,450,000 | 1,990,154 | 2038/9/20  |
| 第30回利付国債 (30年) |   | 2.3   | 1,496,000 | 2,037,118 | 2039/3/20  |
| 第31回利付国債 (30年) |   | 2.2   | 1,358,000 | 1,835,051 | 2039/9/20  |
| 第32回利付国債 (30年) |   | 2.3   | 1,739,000 | 2,397,368 | 2040/3/20  |
| 第33回利付国債 (30年) |   | 2.0   | 1,644,000 | 2,182,262 | 2040/9/20  |
| 第34回利付国債 (30年) |   | 2.2   | 2,116,000 | 2,904,971 | 2041/3/20  |
| 第35回利付国債 (30年) |   | 2.0   | 2,349,000 | 3,144,136 | 2041/9/20  |
| 第36回利付国債 (30年) |   | 2.0   | 1,829,000 | 2,459,072 | 2042/3/20  |
| 第37回利付国債 (30年) |   | 1.9   | 2,757,000 | 3,661,985 | 2042/9/20  |
| 第38回利付国債 (30年) |   | 1.8   | 1,145,000 | 1,501,060 | 2043/3/20  |
| 第39回利付国債 (30年) |   | 1.9   | 1,040,000 | 1,389,024 | 2043/6/20  |
| 第40回利付国債 (30年) |   | 1.8   | 1,560,000 | 2,052,819 | 2043/9/20  |
| 第41回利付国債 (30年) |   | 1.7   | 1,450,000 | 1,878,852 | 2043/12/20 |
| 第42回利付国債 (30年) |   | 1.7   | 1,100,000 | 1,426,909 | 2044/3/20  |
| 第43回利付国債 (30年) |   | 1.7   | 2,100,000 | 2,730,168 | 2044/6/20  |
| 第44回利付国債 (30年) |   | 1.7   | 110,000   | 143,166   | 2044/9/20  |
| 第45回利付国債 (30年) |   | 1.5   | 1,850,000 | 2,324,062 | 2044/12/20 |
| 第46回利付国債 (30年) |   | 1.5   | 1,900,000 | 2,388,623 | 2045/3/20  |
| 第47回利付国債 (30年) |   | 1.6   | 1,880,000 | 2,411,156 | 2045/6/20  |
| 第48回利付国債 (30年) |   | 1.4   | 1,760,000 | 2,175,184 | 2045/9/20  |
| 第49回利付国債 (30年) |   | 1.4   | 1,760,000 | 2,176,363 | 2045/12/20 |
| 第50回利付国債 (30年) |   | 0.8   | 1,260,000 | 1,374,861 | 2046/3/20  |
| 第51回利付国債 (30年) |   | 0.3   | 2,230,000 | 2,159,420 | 2046/6/20  |
| 第52回利付国債 (30年) |   | 0.5   | 1,660,000 | 1,687,506 | 2046/9/20  |
| 第53回利付国債 (30年) |   | 0.6   | 1,880,000 | 1,958,621 | 2046/12/20 |
| 第54回利付国債 (30年) |   | 0.8   | 1,250,000 | 1,364,612 | 2047/3/20  |
| 第55回利付国債 (30年) |   | 0.8   | 1,310,000 | 1,429,393 | 2047/6/20  |
| 第56回利付国債 (30年) |   | 0.8   | 2,170,000 | 2,369,423 | 2047/9/20  |
| 第57回利付国債 (30年) |   | 0.8   | 1,110,000 | 1,211,343 | 2047/12/20 |
| 第58回利付国債 (30年) |   | 0.8   | 2,640,000 | 2,882,959 | 2048/3/20  |

| 銘              | 柄 | 当 期 末 |           |           |            |
|----------------|---|-------|-----------|-----------|------------|
|                |   | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券           |   | %     | 千円        | 千円        |            |
| 第59回利付国債 (30年) |   | 0.7   | 730,000   | 778,442   | 2048/6/20  |
| 第60回利付国債 (30年) |   | 0.9   | 2,440,000 | 2,729,823 | 2048/9/20  |
| 第61回利付国債 (30年) |   | 0.7   | 2,340,000 | 2,494,557 | 2048/12/20 |
| 第62回利付国債 (30年) |   | 0.5   | 200,000   | 202,552   | 2049/3/20  |
| 第63回利付国債 (30年) |   | 0.4   | 30,000    | 29,575    | 2049/6/20  |
| 第64回利付国債 (30年) |   | 0.4   | 3,410,000 | 3,361,407 | 2049/9/20  |
| 第65回利付国債 (30年) |   | 0.4   | 1,400,000 | 1,379,910 | 2049/12/20 |
| 第66回利付国債 (30年) |   | 0.4   | 210,000   | 206,963   | 2050/3/20  |
| 第51回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 200,000   | 204,846   | 2021/6/21  |
| 第52回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 214,000   | 220,644   | 2021/9/21  |
| 第54回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 480,000   | 498,350   | 2021/12/20 |
| 第55回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 241,000   | 250,753   | 2022/3/21  |
| 第56回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 449,000   | 469,671   | 2022/6/20  |
| 第58回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 147,000   | 154,216   | 2022/9/20  |
| 第59回利付国債 (20年) |   | 1.7   | 589,000   | 617,902   | 2022/12/20 |
| 第61回利付国債 (20年) |   | 1.0   | 289,000   | 298,730   | 2023/3/20  |
| 第63回利付国債 (20年) |   | 1.8   | 442,000   | 469,094   | 2023/6/20  |
| 第64回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 441,000   | 471,653   | 2023/9/20  |
| 第65回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 318,000   | 341,691   | 2023/12/20 |
| 第66回利付国債 (20年) |   | 1.8   | 500,000   | 535,440   | 2023/12/20 |
| 第68回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 846,000   | 923,019   | 2024/3/20  |
| 第70回利付国債 (20年) |   | 2.4   | 422,000   | 466,339   | 2024/6/20  |
| 第71回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 160,000   | 175,489   | 2024/6/20  |
| 第72回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 534,000   | 586,422   | 2024/9/20  |
| 第73回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 620,000   | 681,181   | 2024/12/20 |
| 第74回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 318,000   | 350,855   | 2024/12/20 |
| 第75回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 575,000   | 637,450   | 2025/3/20  |
| 第76回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 200,000   | 219,770   | 2025/3/20  |
| 第77回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 210,000   | 231,783   | 2025/3/20  |
| 第78回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 410,000   | 452,648   | 2025/6/20  |
| 第79回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 50,000    | 55,457    | 2025/6/20  |
| 第80回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 315,000   | 351,001   | 2025/6/20  |
| 第81回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 350,000   | 390,103   | 2025/9/20  |
| 第82回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 662,000   | 741,420   | 2025/9/20  |
| 第83回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 413,000   | 464,872   | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 670,000   | 750,366   | 2025/12/20 |
| 第85回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 490,000   | 554,106   | 2026/3/20  |
| 第86回利付国債 (20年) |   | 2.3   | 515,000   | 588,449   | 2026/3/20  |
| 第87回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 450,000   | 511,524   | 2026/3/20  |
| 第88回利付国債 (20年) |   | 2.3   | 804,000   | 923,635   | 2026/6/20  |
| 第89回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 410,000   | 468,490   | 2026/6/20  |
| 第90回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 1,100,000 | 1,263,449 | 2026/9/20  |
| 第91回利付国債 (20年) |   | 2.3   | 468,000   | 540,540   | 2026/9/20  |
| 第92回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 1,432,000 | 1,643,663 | 2026/12/20 |
| 第93回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 390,000   | 446,967   | 2027/3/20  |

| 銘               | 柄 | 当 期 末 |           |           |            |
|-----------------|---|-------|-----------|-----------|------------|
|                 |   | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券            |   | %     | 千円        | 千円        |            |
| 第94回利付国債 (20年)  |   | 2.1   | 615,000   | 709,076   | 2027/3/20  |
| 第95回利付国債 (20年)  |   | 2.3   | 1,017,000 | 1,192,910 | 2027/6/20  |
| 第96回利付国債 (20年)  |   | 2.1   | 320,000   | 370,768   | 2027/6/20  |
| 第97回利付国債 (20年)  |   | 2.2   | 343,000   | 401,759   | 2027/9/20  |
| 第98回利付国債 (20年)  |   | 2.1   | 470,000   | 547,028   | 2027/9/20  |
| 第99回利付国債 (20年)  |   | 2.1   | 1,345,000 | 1,572,372 | 2027/12/20 |
| 第100回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 1,060,000 | 1,252,443 | 2028/3/20  |
| 第101回利付国債 (20年) |   | 2.4   | 573,000   | 686,098   | 2028/3/20  |
| 第102回利付国債 (20年) |   | 2.4   | 530,000   | 637,473   | 2028/6/20  |
| 第103回利付国債 (20年) |   | 2.3   | 640,000   | 764,556   | 2028/6/20  |
| 第104回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 300,000   | 353,490   | 2028/6/20  |
| 第105回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 870,000   | 1,029,114 | 2028/9/20  |
| 第106回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 711,000   | 847,014   | 2028/9/20  |
| 第107回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 567,000   | 673,227   | 2028/12/20 |
| 第108回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 800,000   | 936,032   | 2028/12/20 |
| 第109回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 800,000   | 938,704   | 2029/3/20  |
| 第110回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 1,096,000 | 1,305,511 | 2029/3/20  |
| 第111回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 711,000   | 856,520   | 2029/6/20  |
| 第112回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 1,340,000 | 1,602,023 | 2029/6/20  |
| 第113回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 1,182,000 | 1,418,210 | 2029/9/20  |
| 第114回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 1,520,000 | 1,830,110 | 2029/12/20 |
| 第115回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 1,154,000 | 1,400,552 | 2029/12/20 |
| 第116回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 246,000   | 299,613   | 2030/3/20  |
| 第117回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 1,090,000 | 1,316,807 | 2030/3/20  |
| 第118回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 1,076,000 | 1,292,781 | 2030/6/20  |
| 第119回利付国債 (20年) |   | 1.8   | 660,000   | 779,638   | 2030/6/20  |
| 第120回利付国債 (20年) |   | 1.6   | 760,000   | 882,413   | 2030/6/20  |
| 第121回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 1,139,000 | 1,361,002 | 2030/9/20  |
| 第122回利付国債 (20年) |   | 1.8   | 1,160,000 | 1,374,101 | 2030/9/20  |
| 第123回利付国債 (20年) |   | 2.1   | 1,368,000 | 1,668,248 | 2030/12/20 |
| 第124回利付国債 (20年) |   | 2.0   | 900,000   | 1,088,010 | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債 (20年) |   | 2.2   | 3,104,000 | 3,830,491 | 2031/3/20  |
| 第127回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 350,000   | 420,567   | 2031/3/20  |
| 第128回利付国債 (20年) |   | 1.9   | 744,000   | 896,482   | 2031/6/20  |
| 第130回利付国債 (20年) |   | 1.8   | 2,652,000 | 3,174,258 | 2031/9/20  |
| 第131回利付国債 (20年) |   | 1.7   | 280,000   | 331,979   | 2031/9/20  |
| 第132回利付国債 (20年) |   | 1.7   | 187,000   | 222,215   | 2031/12/20 |
| 第133回利付国債 (20年) |   | 1.8   | 3,040,000 | 3,647,513 | 2031/12/20 |
| 第134回利付国債 (20年) |   | 1.8   | 3,205,000 | 3,854,461 | 2032/3/20  |
| 第137回利付国債 (20年) |   | 1.7   | 1,482,000 | 1,768,752 | 2032/6/20  |
| 第138回利付国債 (20年) |   | 1.5   | 400,000   | 467,808   | 2032/6/20  |
| 第139回利付国債 (20年) |   | 1.6   | 400,000   | 472,600   | 2032/6/20  |
| 第140回利付国債 (20年) |   | 1.7   | 2,397,000 | 2,866,835 | 2032/9/20  |
| 第141回利付国債 (20年) |   | 1.7   | 420,000   | 503,340   | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債 (20年) |   | 1.8   | 4,110,000 | 4,976,675 | 2032/12/20 |

| 銘                  | 柄 | 当 期 末 |             |             |             |
|--------------------|---|-------|-------------|-------------|-------------|
|                    |   | 利 率   | 額 面 金 額     | 評 価 額       | 償 還 年 月 日   |
| 国債証券               |   | %     | 千円          | 千円          |             |
| 第143回利付国債 (20年)    |   | 1.6   | 2,010,000   | 2,388,020   | 2033/ 3 /20 |
| 第144回利付国債 (20年)    |   | 1.5   | 350,000     | 411,390     | 2033/ 3 /20 |
| 第145回利付国債 (20年)    |   | 1.7   | 3,310,000   | 3,982,128   | 2033/ 6 /20 |
| 第146回利付国債 (20年)    |   | 1.7   | 2,740,000   | 3,302,576   | 2033/ 9 /20 |
| 第147回利付国債 (20年)    |   | 1.6   | 3,740,000   | 4,466,008   | 2033/12/20  |
| 第148回利付国債 (20年)    |   | 1.5   | 2,280,000   | 2,695,849   | 2034/ 3 /20 |
| 第149回利付国債 (20年)    |   | 1.5   | 3,560,000   | 4,217,959   | 2034/ 6 /20 |
| 第150回利付国債 (20年)    |   | 1.4   | 2,910,000   | 3,411,596   | 2034/ 9 /20 |
| 第151回利付国債 (20年)    |   | 1.2   | 3,090,000   | 3,538,513   | 2034/12/20  |
| 第152回利付国債 (20年)    |   | 1.2   | 2,420,000   | 2,773,029   | 2035/ 3 /20 |
| 第153回利付国債 (20年)    |   | 1.3   | 2,860,000   | 3,323,663   | 2035/ 6 /20 |
| 第154回利付国債 (20年)    |   | 1.2   | 2,310,000   | 2,652,180   | 2035/ 9 /20 |
| 第155回利付国債 (20年)    |   | 1.0   | 2,910,000   | 3,254,893   | 2035/12/20  |
| 第156回利付国債 (20年)    |   | 0.4   | 2,530,000   | 2,593,781   | 2036/ 3 /20 |
| 第157回利付国債 (20年)    |   | 0.2   | 2,090,000   | 2,075,411   | 2036/ 6 /20 |
| 第158回利付国債 (20年)    |   | 0.5   | 2,860,000   | 2,972,340   | 2036/ 9 /20 |
| 第159回利付国債 (20年)    |   | 0.6   | 2,170,000   | 2,289,263   | 2036/12/20  |
| 第160回利付国債 (20年)    |   | 0.7   | 2,670,000   | 2,859,650   | 2037/ 3 /20 |
| 第161回利付国債 (20年)    |   | 0.6   | 3,680,000   | 3,878,536   | 2037/ 6 /20 |
| 第162回利付国債 (20年)    |   | 0.6   | 1,550,000   | 1,632,088   | 2037/ 9 /20 |
| 第163回利付国債 (20年)    |   | 0.6   | 2,360,000   | 2,484,608   | 2037/12/20  |
| 第164回利付国債 (20年)    |   | 0.5   | 3,100,000   | 3,207,756   | 2038/ 3 /20 |
| 第165回利付国債 (20年)    |   | 0.5   | 2,330,000   | 2,410,012   | 2038/ 6 /20 |
| 第166回利付国債 (20年)    |   | 0.7   | 2,080,000   | 2,224,747   | 2038/ 9 /20 |
| 第167回利付国債 (20年)    |   | 0.5   | 2,860,000   | 2,952,978   | 2038/12/20  |
| 第168回利付国債 (20年)    |   | 0.4   | 2,070,000   | 2,099,435   | 2039/ 3 /20 |
| 第169回利付国債 (20年)    |   | 0.3   | 1,300,000   | 1,294,150   | 2039/ 6 /20 |
| 第170回利付国債 (20年)    |   | 0.3   | 3,080,000   | 3,065,955   | 2039/ 9 /20 |
| 第171回利付国債 (20年)    |   | 0.3   | 2,140,000   | 2,130,134   | 2039/12/20  |
| 第172回利付国債 (20年)    |   | 0.4   | 200,000     | 202,796     | 2040/ 3 /20 |
| 小 計                |   |       | 484,304,000 | 526,406,617 |             |
| 地方債証券              |   |       |             |             |             |
| 第 1 回東京都公募公債 (20年) |   | 1.54  | 20,000      | 20,937      | 2023/ 6 /20 |
| 第 4 回東京都公募公債 (20年) |   | 2.22  | 200,000     | 219,114     | 2024/ 9 /20 |
| 第 7 回東京都公募公債 (20年) |   | 2.16  | 560,000     | 622,944     | 2025/ 9 /19 |
| 第 7 回東京都公募公債 (30年) |   | 2.51  | 10,000      | 13,707      | 2038/ 9 /17 |
| 第 8 回東京都公募公債 (30年) |   | 2.23  | 80,000      | 105,627     | 2038/ 9 /17 |
| 第20回東京都公募公債 (20年)  |   | 2.09  | 80,000      | 94,628      | 2029/ 9 /20 |
| 第21回東京都公募公債 (20年)  |   | 2.19  | 80,000      | 95,728      | 2029/12/20  |
| 第22回東京都公募公債 (20年)  |   | 1.92  | 120,000     | 141,145     | 2030/ 6 /20 |
| 第28回東京都公募公債 (20年)  |   | 1.59  | 100,000     | 116,539     | 2033/ 3 /18 |
| 第33回東京都公募公債 (20年)  |   | 0.18  | 100,000     | 97,109      | 2036/ 6 /20 |
| 第700回東京都公募公債       |   | 1.02  | 200,000     | 202,672     | 2021/ 9 /17 |
| 第705回東京都公募公債       |   | 1.06  | 170,000     | 173,223     | 2022/ 3 /18 |
| 第709回東京都公募公債       |   | 0.78  | 200,000     | 203,134     | 2022/ 6 /20 |

| 銘柄                    | 利 率   | 当 期 末   |         |            |
|-----------------------|-------|---------|---------|------------|
|                       |       | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券                 | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第722回東京都公募公債          | 0.8   | 100,000 | 102,390 | 2023/6/20  |
| 第729回東京都公募公債          | 0.69  | 100,000 | 102,539 | 2024/3/19  |
| 第750回東京都公募公債          | 0.444 | 200,000 | 204,346 | 2025/12/19 |
| 第765回東京都公募公債          | 0.21  | 300,000 | 302,760 | 2027/3/19  |
| 第768回東京都公募公債          | 0.185 | 100,000 | 100,705 | 2027/6/18  |
| 平成25年度第4回北海道公募公債      | 0.85  | 100,000 | 102,499 | 2023/6/28  |
| 平成25年度第7回北海道公募公債      | 0.8   | 150,000 | 153,708 | 2023/8/30  |
| 平成25年度第9回北海道公募公債      | 0.7   | 300,000 | 306,756 | 2023/10/31 |
| 平成28年度第12回北海道公募公債     | 0.165 | 600,000 | 602,568 | 2026/12/28 |
| 平成29年度第15回北海道公募公債     | 0.23  | 117,000 | 118,085 | 2028/2/28  |
| 第29回1号宮城県公募公債         | 0.68  | 100,000 | 102,243 | 2023/10/25 |
| 第1回神奈川県公募公債（30年）      | 2.54  | 200,000 | 264,702 | 2035/6/20  |
| 第2回神奈川県公募公債（20年）      | 2.23  | 80,000  | 87,680  | 2024/9/20  |
| 第2回神奈川県公募公債（30年）      | 2.87  | 80,000  | 111,278 | 2036/6/20  |
| 第27回神奈川県公募公債（20年）     | 1.398 | 100,000 | 115,052 | 2034/9/20  |
| 第191回神奈川県公募公債         | 0.83  | 100,000 | 101,672 | 2022/6/20  |
| 第232回神奈川県公募公債         | 0.185 | 200,000 | 201,558 | 2028/3/17  |
| 第11回大阪府公募公債（20年）      | 1.693 | 200,000 | 235,988 | 2033/9/27  |
| 第348回大阪府公募公債          | 1.32  | 10,000  | 10,112  | 2021/3/30  |
| 第351回大阪府公募公債          | 1.19  | 100,000 | 101,392 | 2021/7/28  |
| 第358回大阪府公募公債          | 0.97  | 56,000  | 56,933  | 2022/2/28  |
| 第359回大阪府公募公債          | 0.99  | 56,000  | 56,994  | 2022/3/29  |
| 第363回大阪府公募公債          | 0.77  | 500,000 | 508,330 | 2022/8/30  |
| 第376回大阪府公募公債          | 0.82  | 106,000 | 108,788 | 2023/9/27  |
| 第385回大阪府公募公債          | 0.65  | 200,000 | 205,028 | 2024/6/27  |
| 第388回大阪府公募公債          | 0.54  | 400,000 | 408,820 | 2024/9/27  |
| 第393回大阪府公募公債          | 0.468 | 110,000 | 112,252 | 2025/2/26  |
| 第394回大阪府公募公債          | 0.489 | 200,000 | 204,374 | 2025/3/28  |
| 第419回大阪府公募公債          | 0.196 | 700,000 | 705,131 | 2027/4/27  |
| 第429回大阪府公募公債          | 0.197 | 103,000 | 103,771 | 2028/2/25  |
| 平成23年度第9回京都府公募公債      | 1.01  | 140,000 | 142,517 | 2022/3/16  |
| 平成24年度第10回京都府公募公債     | 0.67  | 100,000 | 101,829 | 2023/3/22  |
| 平成27年度第5回京都府公募公債（20年） | 1.23  | 100,000 | 113,085 | 2035/8/17  |
| 第2回兵庫県公募公債（20年）       | 2.37  | 300,000 | 349,677 | 2027/9/17  |
| 第2回兵庫県公募公債（30年）       | 2.36  | 40,000  | 54,746  | 2040/3/19  |
| 第4回兵庫県公募公債（15年）       | 1.31  | 100,000 | 109,146 | 2027/12/24 |
| 第5回兵庫県公募公債（15年）       | 1.31  | 100,000 | 109,514 | 2028/5/26  |
| 第10回兵庫県公募公債（20年）      | 2.24  | 300,000 | 360,924 | 2030/2/22  |
| 平成28年度第2回兵庫県公募公債      | 0.08  | 400,000 | 400,236 | 2026/4/24  |
| 平成28年度第3回兵庫県公募公債      | 0.08  | 700,000 | 699,370 | 2026/5/22  |
| 平成29年度第14回兵庫県公募公債     | 0.164 | 300,000 | 301,431 | 2027/11/17 |
| 第29回兵庫県公募公債（20年）      | 0.443 | 200,000 | 201,658 | 2036/11/7  |
| 第3回静岡県公募公債（15年）       | 1.368 | 100,000 | 109,515 | 2027/10/29 |
| 平成25年度第1回静岡県公募公債      | 0.581 | 100,000 | 101,616 | 2023/4/19  |
| 平成25年度第5回静岡県公募公債      | 0.926 | 100,000 | 102,866 | 2023/7/25  |

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

| 銘                       | 柄 | 当 期 末 |         |         |            |
|-------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
|                         |   | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券                   |   | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第130回共同発行市場公募地方債        |   | 0.76  | 100,000 | 102,703 | 2024/1/25  |
| 第132回共同発行市場公募地方債        |   | 0.66  | 200,000 | 204,868 | 2024/3/25  |
| 第135回共同発行市場公募地方債        |   | 0.659 | 300,000 | 307,767 | 2024/6/25  |
| 第138回共同発行市場公募地方債        |   | 0.554 | 500,000 | 511,545 | 2024/9/25  |
| 第140回共同発行市場公募地方債        |   | 0.505 | 200,000 | 204,318 | 2024/11/25 |
| 第142回共同発行市場公募地方債        |   | 0.345 | 200,000 | 202,958 | 2025/1/24  |
| 第144回共同発行市場公募地方債        |   | 0.47  | 200,000 | 204,280 | 2025/3/25  |
| 第145回共同発行市場公募地方債        |   | 0.406 | 100,000 | 101,869 | 2025/4/25  |
| 第146回共同発行市場公募地方債        |   | 0.553 | 200,000 | 204,980 | 2025/5/23  |
| 第153回共同発行市場公募地方債        |   | 0.469 | 100,000 | 102,320 | 2025/12/25 |
| 第162回共同発行市場公募地方債        |   | 0.105 | 300,000 | 300,570 | 2026/9/25  |
| 第163回共同発行市場公募地方債        |   | 0.06  | 300,000 | 299,709 | 2026/10/23 |
| 第170回共同発行市場公募地方債        |   | 0.18  | 400,000 | 402,656 | 2027/5/25  |
| 第178回共同発行市場公募地方債        |   | 0.23  | 200,000 | 202,220 | 2028/1/25  |
| 平成24年度第2回堺市公募公債         |   | 0.715 | 200,000 | 203,434 | 2022/12/19 |
| 平成25年度第1回長崎県公募公債        |   | 0.81  | 200,000 | 205,264 | 2023/9/27  |
| 平成28年度第2回島根県公募公債 (20年)  |   | 0.506 | 100,000 | 102,028 | 2036/9/30  |
| 平成30年度第1回福島県公募公債        |   | 0.264 | 100,000 | 101,390 | 2028/11/30 |
| 平成23年度第1回滋賀県公募公債        |   | 1.02  | 100,000 | 101,536 | 2021/11/30 |
| 平成25年度第1回栃木県公募公債        |   | 0.65  | 100,000 | 102,199 | 2023/11/29 |
| 平成24年度第2回熊本県公募公債        |   | 0.8   | 50,000  | 50,939  | 2022/10/26 |
| 平成23年度第1回浜松市公募公債        |   | 1.045 | 238,200 | 241,918 | 2021/11/25 |
| 平成24年度第1回浜松市公募公債        |   | 0.844 | 100,000 | 102,193 | 2023/1/25  |
| 平成25年度第1回浜松市公募公債        |   | 0.761 | 161,000 | 165,353 | 2024/1/24  |
| 第5回大阪市公募公債 (20年)        |   | 2.47  | 100,000 | 119,645 | 2028/9/21  |
| 平成23年度第10回大阪市公募公債       |   | 0.956 | 10,000  | 10,158  | 2022/1/27  |
| 第1回名古屋市公募公債 (20年)       |   | 1.99  | 200,000 | 214,130 | 2023/12/20 |
| 第1回名古屋市公募公債 (30年)       |   | 2.53  | 200,000 | 263,200 | 2035/3/20  |
| 第9回名古屋市公募公債 (20年)       |   | 2.07  | 400,000 | 467,228 | 2028/12/20 |
| 第10回名古屋市公募公債 (20年)      |   | 2.26  | 80,000  | 95,815  | 2029/8/17  |
| 第477回名古屋市公募公債           |   | 1.034 | 100,000 | 101,613 | 2021/12/20 |
| 第1回京都市公募公債 (20年)        |   | 2.14  | 200,000 | 219,420 | 2024/12/20 |
| 第5回京都市公募公債 (20年)        |   | 2.36  | 50,000  | 57,504  | 2026/12/18 |
| 平成23年度第2回京都市公募公債        |   | 1.049 | 100,000 | 101,314 | 2021/8/26  |
| 平成23年度第4回京都市公募公債        |   | 1.067 | 350,000 | 355,848 | 2021/12/22 |
| 平成24年度第4回京都市公募公債        |   | 0.801 | 100,000 | 101,870 | 2022/10/21 |
| 平成20年度第24回神戸市公募公債 (20年) |   | 2.08  | 300,000 | 350,676 | 2028/12/20 |
| 平成22年度第4回神戸市公募公債        |   | 1.895 | 100,000 | 117,587 | 2030/9/13  |
| 第7回横浜市公募公債 (20年)        |   | 2.06  | 200,000 | 222,406 | 2025/12/19 |
| 第20回横浜市公募公債 (20年)       |   | 2.1   | 80,000  | 94,825  | 2029/10/19 |
| 平成24年度第2回横浜市公募公債        |   | 0.815 | 100,000 | 101,896 | 2022/10/17 |
| 平成24年度第4回横浜市公募公債        |   | 0.81  | 100,000 | 102,160 | 2023/2/20  |
| 平成24年度第3回横浜市公募公債        |   | 0.729 | 100,000 | 101,812 | 2022/12/22 |
| 平成27年度第2回横浜市公募公債        |   | 0.568 | 200,000 | 205,210 | 2025/6/16  |
| 平成27年度第3回横浜市公募公債        |   | 0.524 | 500,000 | 512,315 | 2025/8/18  |

| 銘                          | 柄 | 当 期 末 |            |            |            |
|----------------------------|---|-------|------------|------------|------------|
|                            |   | 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券                      |   | %     | 千円         | 千円         |            |
| 第27回横浜市の公募公債（20年）          |   | 1.599 | 60,000     | 70,075     | 2033/5/20  |
| 第33回横浜市の公募公債（20年）          |   | 0.323 | 100,000    | 99,220     | 2036/4/28  |
| 第35回横浜市の公募公債（20年）          |   | 0.443 | 300,000    | 302,952    | 2036/10/28 |
| 平成22年度第8回札幌市の公募公債（30年）     |   | 2.277 | 80,000     | 109,199    | 2040/9/20  |
| 平成23年度第3回札幌市の公募公債          |   | 1.944 | 300,000    | 357,390    | 2031/7/29  |
| 平成26年度第5回札幌市の公募公債          |   | 0.961 | 100,000    | 107,788    | 2029/9/20  |
| 平成27年度第9回札幌市の公募公債          |   | 0.19  | 100,000    | 100,754    | 2025/12/19 |
| 第17回北九州市の公募公債（20年）         |   | 1.529 | 100,000    | 116,333    | 2034/6/20  |
| 平成25年度第3回北九州市の公募公債         |   | 0.728 | 300,000    | 307,359    | 2023/12/26 |
| 平成23年度第6回福岡市の公募公債          |   | 1.0   | 100,000    | 101,418    | 2021/10/28 |
| 平成24年度第4回福岡市の公募公債          |   | 0.8   | 200,000    | 203,776    | 2022/10/31 |
| 平成25年度第4回福岡市の公募公債          |   | 0.68  | 50,000     | 51,120     | 2023/10/24 |
| 平成26年度第6回福岡市の公募公債（20年）     |   | 1.371 | 100,000    | 114,681    | 2034/9/20  |
| 平成25年度第2回広島市の公募公債          |   | 0.72  | 100,000    | 102,500    | 2023/12/27 |
| 平成29年度第6回広島市の公募公債          |   | 0.23  | 300,000    | 303,366    | 2028/2/25  |
| 平成24年度第1回相模原市の公募公債         |   | 0.71  | 200,000    | 203,518    | 2022/12/20 |
| 平成23年度第1回三重県の公募公債          |   | 1.021 | 98,410     | 99,923     | 2021/11/30 |
| 平成24年度第4回福井県の公募公債          |   | 0.46  | 100,000    | 101,270    | 2023/4/26  |
| 平成26年度第4回福井県の公募公債          |   | 0.425 | 100,000    | 101,962    | 2025/4/24  |
| 平成23年度第1回徳島県の公募公債          |   | 1.02  | 100,000    | 101,536    | 2021/11/30 |
| 平成24年度第1回山梨県の公募公債          |   | 0.8   | 200,000    | 203,764    | 2022/10/28 |
| 平成30年度第1回山梨県の公募公債          |   | 0.289 | 100,000    | 101,586    | 2028/10/30 |
| 平成24年度第2回岡山県の公募公債          |   | 0.68  | 100,000    | 101,869    | 2023/3/29  |
| 平成26年度第1回岡山市の公募公債          |   | 0.33  | 100,000    | 101,414    | 2025/1/30  |
| 平成28年度第1回岡山県の公募公債          |   | 0.18  | 300,000    | 302,103    | 2027/1/29  |
| 第4回京都市保証京都市土地開発公社債券        |   | 0.06  | 200,000    | 199,684    | 2023/3/29  |
| 第96回愛知県・名古屋市の折半保証名古屋高速道路債券 |   | 2.34  | 100,000    | 117,655    | 2028/12/20 |
| 第132回福岡北九州高速道路債券           |   | 0.704 | 100,000    | 102,180    | 2024/3/19  |
| 小                          | 計 |       | 30,568,420 | 32,031,730 |            |
| 特殊債券(除く金融債)                |   |       |            |            |            |
| 第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  |   | 2.2   | 400,000    | 473,572    | 2028/11/28 |
| 第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 2.3   | 100,000    | 136,425    | 2040/2/29  |
| 第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 1.1   | 91,000     | 92,081     | 2021/5/31  |
| 第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 1.0   | 122,000    | 123,638    | 2021/8/31  |
| 第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 1.0   | 200,000    | 203,018    | 2021/10/29 |
| 第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 1.8   | 200,000    | 237,346    | 2031/10/31 |
| 第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 1.0   | 136,000    | 138,174    | 2021/11/30 |
| 第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 0.9   | 300,000    | 304,797    | 2022/1/31  |
| 第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 0.9   | 212,000    | 215,536    | 2022/2/28  |
| 第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 0.9   | 109,000    | 110,867    | 2022/3/18  |
| 第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 0.977 | 433,000    | 441,517    | 2022/4/28  |
| 第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 1.737 | 100,000    | 118,449    | 2032/4/30  |
| 第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 1.83  | 200,000    | 256,692    | 2042/5/30  |
| 第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 0.895 | 512,000    | 521,661    | 2022/6/30  |
| 第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |   | 0.791 | 430,000    | 438,294    | 2022/10/31 |

| 銘柄                         | 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177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.805 | 400,000 | 408,116 | 2022/11/30  |
| 第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.834 | 201,000 | 205,522 | 2023/ 1 /31 |
| 第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.668 | 170,700 | 173,921 | 2023/ 3 /17 |
| 第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.4   | 100,000 | 115,018 | 2033/ 4 /28 |
| 第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.541 | 153,000 | 155,428 | 2023/ 4 /28 |
| 第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.882 | 100,000 | 102,748 | 2023/ 6 /30 |
| 第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.911 | 223,000 | 229,504 | 2023/ 7 /31 |
| 第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.801 | 100,000 | 102,693 | 2023/ 9 /29 |
| 第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.66  | 200,000 | 204,976 | 2024/ 2 /29 |
| 第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.645 | 332,000 | 340,243 | 2024/ 3 /29 |
| 第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.601 | 124,000 | 127,129 | 2024/ 7 /31 |
| 第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.39  | 100,000 | 115,678 | 2034/ 8 /31 |
| 第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.495 | 283,000 | 289,322 | 2024/11/29  |
| 第256回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.425 | 213,000 | 217,698 | 2025/ 9 /30 |
| 第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.01  | 100,000 | 99,872  | 2026/ 9 /30 |
| 第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.174 | 106,000 | 107,034 | 2027/ 2 /26 |
| 第318回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.16  | 100,000 | 100,935 | 2027/ 7 /30 |
| 第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)    | 0.502 | 300,000 | 302,580 | 2021/12/24  |
| 第5回政府保証公営企業債券(15年)         | 2.2   | 300,000 | 314,286 | 2022/ 7 /15 |
| 第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)   | 0.001 | 240,000 | 239,954 | 2022/ 5 /30 |
| 第22回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 1.3   | 30,000  | 30,332  | 2021/ 3 /12 |
| 第29回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 1.0   | 21,000  | 21,310  | 2021/10/18  |
| 第30回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 1.0   | 401,000 | 407,243 | 2021/11/15  |
| 第31回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 1.1   | 50,000  | 50,899  | 2021/12/14  |
| 第35回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.977 | 200,000 | 203,900 | 2022/ 4 /22 |
| 第39回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.801 | 100,000 | 101,787 | 2022/ 8 /15 |
| 第45回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.815 | 100,000 | 102,239 | 2023/ 2 /17 |
| 第46回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.668 | 17,000  | 17,320  | 2023/ 3 /17 |
| 第48回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.605 | 36,000  | 36,650  | 2023/ 5 /16 |
| 第55回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.693 | 160,000 | 163,964 | 2023/12/18  |
| 第59回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.669 | 315,000 | 323,193 | 2024/ 4 /12 |
| 第61回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.644 | 100,000 | 102,613 | 2024/ 6 /14 |
| 第62回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.601 | 100,000 | 102,496 | 2024/ 7 /16 |
| 第64回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.544 | 240,000 | 245,678 | 2024/ 9 /13 |
| 第73回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.484 | 302,000 | 309,193 | 2025/ 6 /13 |
| 第74回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.557 | 113,000 | 116,166 | 2025/ 7 /15 |
| 第78回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.381 | 150,000 | 153,027 | 2025/11/18  |
| 第82回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.02  | 174,000 | 174,050 | 2026/ 3 /13 |
| 第92回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.115 | 206,000 | 207,168 | 2027/ 1 /19 |
| 第99回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.155 | 100,000 | 100,904 | 2027/ 8 /13 |
| 第105回政府保証地方公共団体金融機構債券      | 0.195 | 100,000 | 101,277 | 2028/ 2 /15 |
| 第106回政府保証地方公共団体金融機構債券      | 0.145 | 116,000 | 117,042 | 2028/ 3 /14 |
| 第25回政府保証日本政策金融公庫債券         | 0.815 | 100,000 | 102,255 | 2023/ 2 /24 |
| 第17回政府保証民間都市開発債券           | 0.145 | 200,000 | 201,504 | 2026/ 2 /26 |
| 第211回政府保証預金保険機構債券          | 0.1   | 100,000 | 100,186 | 2021/10/19  |

| 銘                             | 柄 | 当 期 末 |           |         |            |
|-------------------------------|---|-------|-----------|---------|------------|
|                               |   | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 特殊債券(除く金融債)                   |   | %     | 千円        | 千円      |            |
| 第3回政府保証新関西国際空港債券              |   | 0.644 | 100,000   | 102,636 | 2024/6/26  |
| 第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債      |   | 0.001 | 400,000   | 399,924 | 2022/5/20  |
| 第19回政府保証日本政策投資銀行              |   | 0.668 | 400,000   | 407,528 | 2023/3/15  |
| 第22回政府保証日本政策投資銀行              |   | 0.693 | 20,000    | 20,495  | 2023/12/18 |
| 第60回政府保証日本政策投資銀行債券            |   | 0.001 | 1,000,000 | 998,050 | 2027/1/29  |
| 第18回政府保証中部国際空港債券              |   | 0.668 | 558,000   | 568,579 | 2023/3/22  |
| 第94回日本政策投資銀行債券(財投機関債)         |   | 0.001 | 200,000   | 199,908 | 2021/9/17  |
| 第9回道路債券(財投機関債)                |   | 2.9   | 100,000   | 131,534 | 2032/5/20  |
| 第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 2.35  | 200,000   | 228,616 | 2026/9/18  |
| 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 2.87  | 30,000    | 46,776  | 2046/12/20 |
| 第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 2.75  | 100,000   | 153,205 | 2047/3/20  |
| 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 2.67  | 130,000   | 196,939 | 2047/3/20  |
| 第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 2.39  | 500,000   | 581,285 | 2027/7/20  |
| 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 2.34  | 200,000   | 232,906 | 2027/10/20 |
| 第33回道路債券(財投機関債)               |   | 2.91  | 500,000   | 677,040 | 2034/6/20  |
| 第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 2.14  | 50,000    | 59,792  | 2030/5/10  |
| 第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 1.9   | 50,000    | 59,773  | 2032/3/19  |
| 第87回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 0.893 | 200,000   | 203,654 | 2022/6/20  |
| 第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |   | 1.711 | 100,000   | 117,576 | 2032/6/18  |
| 第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |   | 1.038 | 200,000   | 205,808 | 2023/3/20  |
| 第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |   | 1.523 | 200,000   | 243,258 | 2044/12/20 |
| 第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |   | 1.133 | 200,000   | 222,598 | 2035/3/20  |
| 第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |   | 1.974 | 100,000   | 138,919 | 2055/3/19  |
| 第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |   | 1.284 | 100,000   | 113,866 | 2035/9/20  |
| 第167回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |   | 1.11  | 200,000   | 222,676 | 2035/12/20 |
| 第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)   |   | 2.266 | 50,000    | 59,603  | 2029/6/28  |
| 第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)         |   | 1.03  | 20,000    | 20,577  | 2023/3/22  |
| 第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)         |   | 2.03  | 100,000   | 107,228 | 2023/12/20 |
| 第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)   |   | 2.043 | 200,000   | 237,652 | 2030/6/28  |
| 第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)         |   | 2.33  | 50,000    | 55,006  | 2024/9/24  |
| 第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)  |   | 1.851 | 300,000   | 352,386 | 2030/10/28 |
| 第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)  |   | 2.187 | 80,000    | 97,311  | 2031/4/28  |
| 第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)  |   | 1.846 | 80,000    | 94,651  | 2031/8/28  |
| F17回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)       |   | 1.625 | 400,000   | 411,028 | 2022/1/28  |
| 第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)        |   | 2.39  | 150,000   | 170,277 | 2026/3/24  |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)  |   | 1.68  | 300,000   | 351,876 | 2032/7/28  |
| F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)       |   | 1.681 | 70,000    | 73,306  | 2023/3/17  |
| 第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)  |   | 1.785 | 50,000    | 59,494  | 2033/1/28  |
| 第33回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)       |   | 1.035 | 400,000   | 407,316 | 2022/2/28  |
| 第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)  |   | 1.298 | 100,000   | 114,034 | 2035/6/28  |
| F67回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)       |   | 1.805 | 300,000   | 335,628 | 2027/6/4   |
| F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)       |   | 1.602 | 300,000   | 332,289 | 2027/8/20  |
| F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)       |   | 1.609 | 300,000   | 334,389 | 2028/1/28  |
| F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      |   | 1.314 | 100,000   | 106,127 | 2025/3/7   |
| F122回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)      |   | 1.412 | 300,000   | 327,513 | 2027/6/18  |

| 銘                          | 柄 | 当 期 末  |          |          |             |
|----------------------------|---|--------|----------|----------|-------------|
|                            |   | 利 率    | 額 面 金 額  | 評 価 額    | 償 還 年 月 日   |
| 特殊債券(除く金融債)                |   | %      | 千円       | 千円       |             |
| F 123回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) |   | 1. 6   | 100, 000 | 114, 058 | 2030/ 3 /19 |
| 第128回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債)  |   | 0. 155 | 400, 000 | 400, 388 | 2030/ 1 /28 |
| F 149回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) |   | 1. 145 | 100, 000 | 105, 972 | 2025/12/19  |
| F 197回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) |   | 1. 052 | 300, 000 | 320, 919 | 2027/10/29  |
| F 234回地方公共団体金融機構債券 (財投機関債) |   | 1. 605 | 100, 000 | 118, 342 | 2035/ 4 /27 |
| 第10回日本政策金融公庫 (財投機関債)       |   | 2. 167 | 80, 000  | 95, 647  | 2030/ 3 /19 |
| 第15回日本政策金融公庫 (財投機関債)       |   | 1. 911 | 80, 000  | 94, 467  | 2030/10/29  |
| 第48回福祉医療機構債券 (財投機関債)       |   | 0. 175 | 700, 000 | 703, 444 | 2026/12/18  |
| 第54回福祉医療機構債券 (財投機関債)       |   | 0. 225 | 300, 000 | 302, 286 | 2028/ 6 /20 |
| 第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |   | 2. 13  | 12, 945  | 13, 354  | 2042/ 5 /10 |
| 第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券  |   | 2. 08  | 13, 434  | 13, 955  | 2037/11/10  |
| 第 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |   | 2. 19  | 14, 327  | 14, 997  | 2042/ 6 /10 |
| 第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券  |   | 2. 27  | 13, 750  | 14, 381  | 2037/11/10  |
| 第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券  |   | 0. 18  | 72, 110  | 72, 156  | 2032/ 5 /10 |
| 第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券  |   | 0. 16  | 152, 482 | 152, 692 | 2033/ 1 /10 |
| 第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |   | 2. 29  | 13, 623  | 14, 185  | 2042/ 8 /10 |
| 第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券  |   | 0. 08  | 184, 134 | 183, 861 | 2033/ 4 /10 |
| 第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券    |   | 1. 76  | 11, 864  | 12, 092  | 2036/11/10  |
| 第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券    |   | 2. 26  | 12, 279  | 12, 665  | 2037/ 5 /10 |
| 第 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |   | 2. 13  | 13, 641  | 14, 163  | 2042/10/10  |
| 第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券  |   | 1. 94  | 14, 300  | 14, 875  | 2038/11/10  |
| 第 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券    |   | 2. 25  | 12, 327  | 12, 710  | 2037/ 5 /10 |
| 第 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |   | 1. 99  | 14, 532  | 15, 131  | 2042/12/10  |
| 第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券    |   | 2. 19  | 12, 925  | 13, 405  | 2037/ 5 /10 |
| 第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券  |   | 2. 24  | 15, 205  | 16, 058  | 2039/ 5 /10 |
| 第10回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券     |   | 2. 15  | 13, 318  | 13, 816  | 2037/ 5 /10 |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |   | 2. 16  | 15, 251  | 15, 972  | 2043/ 5 /10 |
| 第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券         |   | 1. 7   | 10, 243  | 10, 305  | 2039/ 1 /10 |
| 第14回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券   |   | 1. 7   | 12, 106  | 12, 251  | 2032/ 5 /10 |
| 第16回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券   |   | 1. 64  | 14, 673  | 14, 964  | 2032/11/10  |
| 第17回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券   |   | 1. 71  | 14, 733  | 15, 032  | 2032/11/10  |
| 第18回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券   |   | 1. 57  | 44, 502  | 45, 369  | 2032/11/10  |
| 第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券         |   | 1. 8   | 11, 566  | 11, 791  | 2039/ 6 /10 |
| 第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券         |   | 2. 12  | 11, 725  | 12, 004  | 2039/ 7 /10 |
| 第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |   | 2. 28  | 46, 208  | 50, 040  | 2044/ 6 /10 |
| 第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券         |   | 1. 67  | 11, 723  | 11, 953  | 2040/ 5 /10 |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券         |   | 1. 7   | 25, 786  | 26, 469  | 2040/ 6 /10 |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券         |   | 1. 69  | 14, 048  | 14, 496  | 2040/ 7 /10 |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |   | 1. 88  | 27, 786  | 29, 802  | 2045/ 2 /10 |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |   | 1. 87  | 28, 785  | 30, 689  | 2045/ 4 /10 |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |   | 1. 81  | 28, 700  | 30, 461  | 2045/ 5 /10 |
| 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券         |   | 1. 88  | 13, 981  | 14, 545  | 2040/12/10  |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |   | 1. 61  | 31, 547  | 33, 353  | 2045/ 7 /10 |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券         |   | 1. 84  | 13, 240  | 13, 706  | 2041/ 2 /10 |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |   | 1. 36  | 32, 933  | 34, 530  | 2045/ 9 /10 |

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

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

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

| 銘                        | 柄 | 当 期 末 |         |         |            |
|--------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
|                          |   | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 普通社債券                    |   | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第11回ブリヂストン               |   | 0.295 | 300,000 | 298,740 | 2027/4/21  |
| 第13回ブリヂストン               |   | 0.23  | 200,000 | 198,750 | 2026/4/17  |
| 第10回日本特殊陶業               |   | 0.11  | 100,000 | 99,415  | 2024/6/20  |
| 第1回日本製鉄                  |   | 0.14  | 400,000 | 396,696 | 2024/6/20  |
| 第4回新日本製鐵                 |   | 0.375 | 200,000 | 198,146 | 2027/5/20  |
| 第19回豊田自動織機               |   | 1.109 | 100,000 | 101,299 | 2021/9/17  |
| 第48回日本精工                 |   | 0.16  | 200,000 | 199,472 | 2023/11/29 |
| 第51回日本精工                 |   | 0.19  | 100,000 | 98,785  | 2026/9/2   |
| 第19回日立製作所                |   | 0.16  | 300,000 | 295,215 | 2027/3/12  |
| 第53回日本電気                 |   | 0.26  | 200,000 | 199,732 | 2023/9/21  |
| 第56回日本電気                 |   | 0.28  | 300,000 | 300,216 | 2023/4/21  |
| 第17回パナソニック               |   | 0.47  | 100,000 | 100,171 | 2026/9/18  |
| 第18回デンソー                 |   | 0.315 | 500,000 | 498,285 | 2028/3/17  |
| 第29回三菱重工業                |   | 0.662 | 300,000 | 304,221 | 2024/9/3   |
| 第1回日本生命2017基金            |   | 0.304 | 100,000 | 99,702  | 2021/8/2   |
| 第2回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス |   | 0.25  | 200,000 | 199,964 | 2022/10/31 |
| 第60回日産自動車                |   | 0.22  | 200,000 | 195,446 | 2023/3/20  |
| 第13回アイシン精機               |   | 0.827 | 100,000 | 102,005 | 2023/9/20  |
| 第1回明治安田生命2018基金          |   | 0.315 | 300,000 | 296,730 | 2023/9/25  |
| 第1回明治安田生命2019基金          |   | 0.29  | 200,000 | 197,496 | 2024/8/2   |
| 第48回クレディセゾン              |   | 1.038 | 200,000 | 204,676 | 2023/10/20 |
| 第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ     |   | 0.724 | 300,000 | 300,012 | 2025/3/5   |
| 第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ    |   | 0.535 | 300,000 | 293,529 | 2028/5/31  |
| 第8回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)   |   | 1.62  | 100,000 | 101,958 | 2021/10/29 |
| 第9回みずほコーポレート銀行 (劣後特約付)   |   | 2.2   | 100,000 | 109,334 | 2026/10/30 |
| 第28回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)    |   | 1.56  | 100,000 | 100,853 | 2021/1/20  |
| 第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付       |   | 2.16  | 200,000 | 216,282 | 2026/1/20  |
| 第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)    |   | 2.46  | 100,000 | 116,243 | 2031/1/20  |
| 第57回三菱東京UFJ銀行            |   | 2.22  | 200,000 | 210,224 | 2022/10/27 |
| 第8回三菱UFJ信託銀行 (劣後特約付)     |   | 1.92  | 200,000 | 212,918 | 2025/10/28 |
| 第23回三井住友銀行 (劣後特約付)       |   | 1.61  | 100,000 | 100,778 | 2020/12/17 |
| 第15回芙蓉総合リース              |   | 0.33  | 100,000 | 99,447  | 2024/12/6  |
| 第47回日産フィナンシャルサービス        |   | 0.23  | 200,000 | 195,554 | 2022/12/20 |
| 第20回東京センチュリーリース          |   | 0.19  | 100,000 | 99,801  | 2022/10/18 |
| 第23回東京センチュリーリース          |   | 0.2   | 200,000 | 199,414 | 2023/4/13  |
| 第42回ホンダファイナンス            |   | 0.05  | 100,000 | 99,731  | 2022/6/20  |
| 第91回トヨタファイナンス            |   | 0.19  | 300,000 | 300,087 | 2023/4/27  |
| 第23回リコーリース               |   | 0.05  | 200,000 | 199,620 | 2021/9/24  |
| 第27回リコーリース               |   | 0.16  | 100,000 | 99,874  | 2022/7/20  |
| 第30回リコーリース               |   | 0.16  | 200,000 | 199,852 | 2022/1/21  |
| 第35回リコーリース               |   | 0.04  | 100,000 | 99,638  | 2022/7/12  |
| 第37回リコーリース               |   | 0.02  | 300,000 | 298,470 | 2022/10/11 |
| 第7回イオンフィナンシャルサービス        |   | 0.19  | 200,000 | 198,358 | 2023/3/20  |
| 第79回アコム                  |   | 0.29  | 300,000 | 294,039 | 2025/2/28  |
| 第47回日立キャピタル              |   | 0.874 | 100,000 | 101,448 | 2023/3/20  |

| 銘柄                  | 利 率   | 当 期 末   |         |            |
|---------------------|-------|---------|---------|------------|
|                     |       | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| 普通社債券               | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第70回日立キャピタル         | 0.2   | 200,000 | 199,704 | 2022/12/20 |
| 第78回日立キャピタル         | 0.02  | 300,000 | 298,344 | 2022/10/20 |
| 第82回日立キャピタル         | 0.09  | 300,000 | 298,167 | 2023/2/20  |
| 第194回オリックス          | 0.19  | 400,000 | 398,684 | 2023/11/8  |
| 第16回三井住友ファイナンス&リース  | 0.25  | 100,000 | 99,684  | 2024/9/13  |
| 第21回三井住友ファイナンス&リース  | 0.18  | 200,000 | 199,472 | 2023/11/27 |
| 第63回三菱UFJリース        | 0.19  | 400,000 | 398,976 | 2023/10/18 |
| 第66回三菱UFJリース        | 0.21  | 400,000 | 398,772 | 2024/4/11  |
| 第74回三菱UFJリース        | 0.09  | 400,000 | 398,372 | 2023/1/23  |
| 第75回三菱UFJリース        | 0.22  | 200,000 | 198,950 | 2025/1/23  |
| 第77回三菱UFJリース        | 0.29  | 300,000 | 300,333 | 2023/4/7   |
| 第27回野村ホールディングス      | 2.107 | 100,000 | 108,785 | 2025/9/24  |
| 第50回野村ホールディングス      | 0.22  | 200,000 | 199,988 | 2022/8/10  |
| 第76回三井不動産           | 0.21  | 100,000 | 100,040 | 2023/4/28  |
| 第116回三菱地所           | 0.643 | 100,000 | 101,589 | 2024/9/19  |
| 第125回三菱地所           | 0.19  | 300,000 | 298,380 | 2025/3/14  |
| 第95回住友不動産           | 0.987 | 100,000 | 102,616 | 2024/1/26  |
| 第99回住友不動産           | 0.836 | 300,000 | 306,387 | 2024/7/29  |
| 第12回イオンモール          | 0.36  | 200,000 | 199,840 | 2023/7/3   |
| 第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス | 0.61  | 100,000 | 101,580 | 2024/9/20  |
| 第12回森トラスト総合リート投資法人  | 0.1   | 100,000 | 99,637  | 2023/2/20  |
| 第36回京王電鉄            | 0.325 | 100,000 | 99,703  | 2027/9/17  |
| 第38回京王電鉄            | 0.295 | 100,000 | 99,512  | 2027/11/29 |
| 第19回東日本旅客鉄道         | 2.36  | 100,000 | 104,092 | 2022/2/25  |
| 第26回東日本旅客鉄道         | 1.19  | 100,000 | 102,835 | 2022/12/20 |
| 第100回東日本旅客鉄道        | 1.981 | 100,000 | 128,147 | 2044/1/29  |
| 第9回東海旅客鉄道           | 1.74  | 100,000 | 103,896 | 2022/9/20  |
| 第11回東海旅客鉄道          | 1.15  | 100,000 | 102,718 | 2022/12/20 |
| 第53回東海旅客鉄道          | 1.797 | 100,000 | 114,655 | 2030/10/25 |
| 第56回東海旅客鉄道          | 2.083 | 100,000 | 118,110 | 2031/5/26  |
| 第74回東海旅客鉄道          | 1.685 | 100,000 | 122,263 | 2045/3/6   |
| 第11回東京地下鉄           | 1.16  | 100,000 | 101,733 | 2021/12/9  |
| 第50回阪急阪神ホールディングス    | 0.345 | 200,000 | 199,264 | 2028/9/13  |
| 第16回三菱倉庫            | 0.21  | 200,000 | 198,978 | 2024/12/6  |
| 第63回日本電信電話          | 0.69  | 100,000 | 101,376 | 2023/3/20  |
| 第21回KDDI            | 0.669 | 100,000 | 101,528 | 2024/9/20  |
| 第27回KDDI            | 0.23  | 300,000 | 297,078 | 2026/4/24  |
| 第1回ソフトバンク           | 0.13  | 300,000 | 299,562 | 2023/3/17  |
| 第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ    | 0.73  | 100,000 | 101,614 | 2023/9/20  |
| 第38回電源開発            | 0.978 | 100,000 | 102,824 | 2023/12/20 |
| 第39回電源開発            | 0.929 | 100,000 | 102,677 | 2024/2/20  |
| 第40回電源開発            | 0.889 | 200,000 | 205,412 | 2024/6/20  |
| 第57回電源開発            | 0.355 | 200,000 | 198,254 | 2028/7/20  |
| 第4回東京電力パワーグリッド      | 0.69  | 400,000 | 404,132 | 2024/6/20  |
| 第6回東京電力パワーグリッド      | 0.85  | 100,000 | 99,955  | 2027/8/31  |

| 銘                        | 柄 | 当 期 末 |             |             |            |
|--------------------------|---|-------|-------------|-------------|------------|
|                          |   | 利 率   | 額 面 金 額     | 評 価 額       | 償 還 年 月 日  |
| 普通社債券                    |   | %     | 千円          | 千円          |            |
| 第13回東京電力パワーグリッド          |   | 0.77  | 200,000     | 197,844     | 2028/4/19  |
| 第15回東京電力パワーグリッド          |   | 0.89  | 200,000     | 196,360     | 2030/7/24  |
| 第27回東京電力パワーグリッド          |   | 0.6   | 200,000     | 201,276     | 2024/7/10  |
| 第28回東京電力パワーグリッド          |   | 1.01  | 200,000     | 200,346     | 2029/7/10  |
| 第30回東京電力パワーグリッド          |   | 0.58  | 100,000     | 100,373     | 2024/10/9  |
| 第31回東京電力パワーグリッド          |   | 0.98  | 200,000     | 199,500     | 2029/10/9  |
| 第23回東京ガス                 |   | 1.01  | 200,000     | 205,582     | 2023/6/9   |
| 第13回広島ガス                 |   | 0.405 | 200,000     | 199,992     | 2028/9/13  |
| 第6回SCSK                  |   | 0.14  | 100,000     | 99,667      | 2022/7/21  |
| 第4回ファーストリテイリング           |   | 0.749 | 100,000     | 102,261     | 2025/12/18 |
| 第7回ファーストリテイリング           |   | 0.405 | 200,000     | 199,442     | 2028/6/6   |
| 第14回フランス相互信用連合銀行         |   | 0.563 | 300,000     | 299,712     | 2021/10/15 |
| 第19回フランス相互信用連合銀行         |   | 0.999 | 200,000     | 202,516     | 2025/10/15 |
| 第29回フランス相互信用連合銀行         |   | 0.25  | 200,000     | 196,376     | 2024/10/10 |
| 第8回新韓銀行                  |   | 0.52  | 300,000     | 300,030     | 2022/11/2  |
| 第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー    |   | 0.217 | 300,000     | 298,422     | 2023/1/25  |
| 第1回韓国石油公社債               |   | 0.24  | 300,000     | 298,290     | 2022/1/21  |
| 第10回ゴールドマン・サックス・グループ・インク |   | 2.45  | 200,000     | 204,786     | 2021/12/28 |
| 第17回ナショナル・オーストラリア銀行      |   | 0.44  | 100,000     | 99,751      | 2024/1/23  |
| 小 計                      |   |       | 29,000,000  | 29,200,369  |            |
| 合 計                      |   |       | 582,354,982 | 628,164,115 |            |

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 |        |          | 当 期 末 |       |
|-------|--------|----------|-------|-------|
|       |        |          | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内    | 債券先物取引 | 10年国債標準物 | 百万円   | 百万円   |
|       |        |          | 609   | —     |

○投資信託財産の構成

(2020年5月12日現在)

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 公社債          | 628,164,115 | 99.2  |
| コール・ローン等、その他 | 4,794,763   | 0.8   |
| 投資信託財産総額     | 632,958,878 | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月12日現在)

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

## &lt;注記事項&gt;

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

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

|                                          |                  |
|------------------------------------------|------------------|
| MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)           | 153,625,622,366円 |
| ファンド・マネジャー(国内債券)                         | 142,596,390,869円 |
| MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)  | 20,033,909,074円  |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)        | 18,818,550,250円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)                | 10,874,556,648円  |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)            | 10,786,112,703円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)                | 10,738,572,510円  |
| eMAXIS 国内債券インデックス                        | 9,250,306,767円   |
| MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付) | 8,092,807,743円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セクション(適格機関投資家転売制限付)     | 6,558,376,000円   |
| eMAXIS Slim 国内債券インデックス                   | 6,284,417,616円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セクション2(適格機関投資家限定)       | 6,164,882,979円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)                | 6,138,188,078円   |
| MUKAM 日本債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)         | 5,653,052,954円   |
| 三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)           | 4,686,187,121円   |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)            | 4,547,763,138円   |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド                 | 4,136,516,843円   |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)                 | 3,989,965,379円   |
| 国内債券セクション(ラップ向け)                         | 3,680,298,852円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型)    | 3,536,108,102円   |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)           | 3,513,029,714円   |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)            | 3,221,373,956円   |
| eMAXIS バランス(8資産均等型)                      | 2,365,605,066円   |

## ○損益の状況 (2019年5月14日～2020年5月12日)

| 項 目                | 当 期              |
|--------------------|------------------|
|                    | 円                |
| (A) 配当等収益          | 4,923,899,054    |
| 受取利息               | 4,926,126,375    |
| 支払利息               | △ 2,227,321      |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 4,979,230,706  |
| 売買益                | 1,783,604,269    |
| 売買損                | △ 6,762,835,575  |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 3,760,840      |
| 取引益                | 68,725,980       |
| 取引損                | △ 72,486,820     |
| (D) 保管費用等          | △ 5,789          |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 59,098,281     |
| (F) 前期繰越損益金        | 157,935,569,429  |
| (G) 追加信託差損益金       | 111,148,756,794  |
| (H) 解約差損益金         | △104,667,584,968 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 164,357,642,974  |
| 次期繰越損益金(I)         | 164,357,642,974  |

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

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

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

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

## 外国債券インデックスマザーファンド

### 《第19期》決算日2020年5月12日

〔計算期間：2019年5月14日～2020年5月12日〕

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

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

### ○最近5期の運用実績

| 決 算 期           | 基 準 価 額  |        | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円換算ベース) |        | 債<br>組 入 比 率 | 債<br>先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|----------|--------|---------------------------------|--------|--------------|--------------|---------|
|                 | 期<br>騰 落 | 中<br>率 | 期<br>騰 落                        | 中<br>率 |              |              |         |
|                 | 円        | %      |                                 | %      | %            | %            | 百万円     |
| 15期(2016年5月12日) | 19,674   | △6.1   | 109,931.94                      | △6.2   | 98.9         | —            | 156,155 |
| 16期(2017年5月12日) | 19,894   | 1.1    | 111,054.04                      | 1.0    | 98.8         | —            | 132,430 |
| 17期(2018年5月14日) | 20,178   | 1.4    | 112,563.85                      | 1.4    | 98.9         | —            | 120,314 |
| 18期(2019年5月13日) | 20,412   | 1.2    | 113,996.81                      | 1.3    | 98.7         | —            | 137,361 |
| 19期(2020年5月12日) | 21,324   | 4.5    | 119,287.72                      | 4.6    | 98.6         | —            | 149,310 |

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額     | 騰 落 率  | F T S E 世界国債インデックス<br>(除く日本、<br>円換算ベース) |        | 債 券 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|-------------|--------|-----------------------------------------|--------|-------------|-----------|
|                     |             |        | 騰 落 率                                   | 騰 落 率  |             |           |
| (期 首)<br>2019年5月13日 | 円<br>20,412 | %<br>— | 113,996.81                              | %<br>— | %<br>98.7   | %<br>—    |
| 5月末                 | 20,456      | 0.2    | 114,188.44                              | 0.2    | 98.6        | —         |
| 6月末                 | 20,724      | 1.5    | 115,685.41                              | 1.5    | 98.5        | —         |
| 7月末                 | 20,786      | 1.8    | 115,950.32                              | 1.7    | 97.5        | —         |
| 8月末                 | 20,922      | 2.5    | 116,876.64                              | 2.5    | 97.9        | —         |
| 9月末                 | 21,023      | 3.0    | 117,408.61                              | 3.0    | 98.3        | —         |
| 10月末                | 21,229      | 4.0    | 118,313.83                              | 3.8    | 98.4        | —         |
| 11月末                | 21,240      | 4.1    | 118,546.99                              | 4.0    | 98.7        | —         |
| 12月末                | 21,339      | 4.5    | 118,980.17                              | 4.4    | 98.5        | —         |
| 2020年1月末            | 21,509      | 5.4    | 120,069.31                              | 5.3    | 98.4        | —         |
| 2月末                 | 21,764      | 6.6    | 121,401.29                              | 6.5    | 98.5        | —         |
| 3月末                 | 21,796      | 6.8    | 121,796.59                              | 6.8    | 98.5        | —         |
| 4月末                 | 21,381      | 4.7    | 119,329.72                              | 4.7    | 98.0        | —         |
| (期 末)<br>2020年5月12日 | 21,324      | 4.5    | 119,287.72                              | 4.6    | 98.6        | —         |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

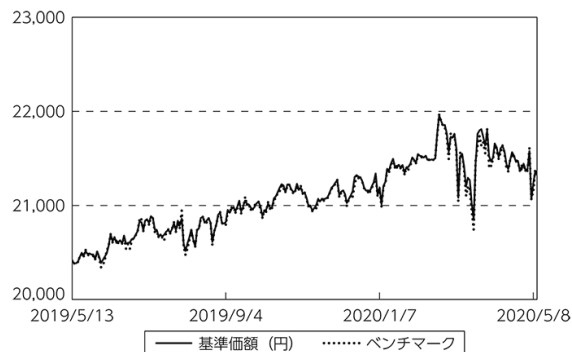
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.5%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

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

## 基準価額等の推移



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

●基準価額の主な変動要因  
(上昇要因)

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

●投資環境について

◎債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

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

◎為替市況

- ・期首に比べて米ドル、ユーロは対円で下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

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

●当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは4.6%の上昇になったため、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)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・評価時価差異要因※によるものです。

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

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年 5 月14日～2020年 5 月12日)

| 項 目                   | 当 期 |         | 項 目 の 概 要                       |
|-----------------------|-----|---------|---------------------------------|
|                       | 金 額 | 比 率     |                                 |
|                       | 円   | %       |                                 |
| (a) そ の 他 費 用         | 2   | 0.011   | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数    |
| ( 保 管 費 用 )           | (2) | (0.011) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| ( そ の 他 )             | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用              |
| 合 計                   | 2   | 0.011   |                                 |
| 期中の平均基準価額は、21,088円です。 |     |         |                                 |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2019年5月14日~2020年5月12日)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月14日～2020年5月12日)

利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|---------------------|---------------|-----------|---------------------|---------------|
|        | 百万円       | 百万円                 | %             | 百万円       | 百万円                 | %             |
| 為替直物取引 | 36,920    | 13,961              | 37.8          | 30,920    | 8,422               | 27.2          |

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

## ○組入資産の明細

(2020年5月12日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分     | 当 期 末                 |                       |                  |           |                    |           |           |          |
|---------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------|--------------------|-----------|-----------|----------|
|         | 額面金額                  | 評 価 額                 |                  | 組入比率      | うちBB格以下<br>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<br>573,360    | 千アメリカドル<br>643,922    | 千円<br>69,234,594 | %<br>46.4 | %<br>—             | %<br>21.0 | %<br>17.3 | %<br>8.0 |
| カナダ     | 千カナダドル<br>31,990      | 千カナダドル<br>37,068      | 2,834,629        | 1.9       | —                  | 0.9       | 0.7       | 0.3      |
| メキシコ    | 千メキシコペソ<br>225,130    | 千メキシコペソ<br>249,067    | 1,113,331        | 0.7       | —                  | 0.4       | 0.2       | 0.1      |
| ユーロ     | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |                  |           |                    |           |           |          |
| ドイツ     | 74,720                | 91,388                | 10,602,937       | 7.1       | —                  | 4.2       | 2.3       | 0.6      |
| イタリア    | 100,910               | 111,552               | 12,942,300       | 8.7       | —                  | 5.1       | 2.4       | 1.2      |
| フランス    | 102,840               | 125,138               | 14,518,558       | 9.7       | —                  | 6.7       | 2.4       | 0.6      |
| オランダ    | 19,710                | 24,530                | 2,846,004        | 1.9       | —                  | 1.3       | 0.4       | 0.2      |
| スペイン    | 60,760                | 72,274                | 8,385,249        | 5.6       | —                  | 3.8       | 1.2       | 0.6      |
| ベルギー    | 24,460                | 30,403                | 3,527,379        | 2.4       | —                  | 1.8       | 0.4       | 0.1      |
| オーストリア  | 15,180                | 18,816                | 2,183,038        | 1.5       | —                  | 1.0       | 0.3       | 0.1      |
| フィンランド  | 6,200                 | 6,921                 | 803,060          | 0.5       | —                  | 0.4       | 0.1       | 0.0      |
| アイルランド  | 8,270                 | 9,319                 | 1,081,302        | 0.7       | —                  | 0.5       | 0.2       | 0.0      |
| イギリス    | 千イギリスポンド<br>52,160    | 千イギリスポンド<br>74,698    | 9,878,880        | 6.6       | —                  | 5.4       | 1.1       | 0.1      |
| スウェーデン  | 千スウェーデンクローネ<br>32,570 | 千スウェーデンクローネ<br>36,997 | 401,792          | 0.3       | —                  | 0.2       | 0.1       | —        |
| ノルウェー   | 千ノルウェークローネ<br>30,660  | 千ノルウェークローネ<br>33,342  | 346,428          | 0.2       | —                  | 0.1       | 0.1       | 0.0      |
| デンマーク   | 千デンマーククローネ<br>36,130  | 千デンマーククローネ<br>46,864  | 729,213          | 0.5       | —                  | 0.4       | 0.0       | 0.1      |
| ポーランド   | 千ポーランドズロチ<br>30,230   | 千ポーランドズロチ<br>33,068   | 840,605          | 0.6       | —                  | 0.3       | 0.2       | 0.1      |
| オーストラリア | 千オーストラリアドル<br>36,920  | 千オーストラリアドル<br>42,500  | 2,941,472        | 2.0       | —                  | 1.3       | 0.5       | 0.1      |
| シンガポール  | 千シンガポールドル<br>7,880    | 千シンガポールドル<br>8,898    | 673,847          | 0.5       | —                  | 0.3       | 0.1       | 0.1      |
| マレーシア   | 千マレーシアリンギット<br>26,470 | 千マレーシアリンギット<br>28,964 | 715,704          | 0.5       | —                  | 0.3       | 0.1       | 0.1      |
| イスラエル   | 千イスラエルシェケル<br>14,800  | 千イスラエルシェケル<br>18,833  | 577,047          | 0.4       | —                  | 0.2       | 0.1       | 0.1      |
| 合 計     | —                     | —                     | 147,177,380      | 98.6      | —                  | 55.7      | 30.3      | 12.5     |

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

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

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

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

| 銘<br>柄 |      |                          | 当 期 末 |         |            |           |            |
|--------|------|--------------------------|-------|---------|------------|-----------|------------|
|        |      |                          | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額      |           | 償還年月日      |
|        |      |                          |       |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |            |
| アメリカ   |      |                          | %     | 千アメリカドル | 千アメリカドル    | 千円        |            |
|        | 国債証券 | 3.125 T-BOND 430215      | 3.125 | 4,000   | 5,373      | 577,718   | 2043/2/15  |
|        |      | 3.125 T-BOND 440815      | 3.125 | 4,450   | 6,015      | 646,786   | 2044/8/15  |
|        |      | 3.125 T-BOND 480515      | 3.125 | 2,610   | 3,622      | 389,457   | 2048/5/15  |
|        |      | 3.125 T-NOTE 281115      | 3.125 | 9,950   | 11,978     | 1,287,967 | 2028/11/15 |
|        |      | 3.375 T-BOND 440515      | 3.375 | 4,240   | 5,947      | 639,485   | 2044/5/15  |
|        |      | 3.625 T-BOND 430815      | 3.625 | 2,850   | 4,125      | 443,560   | 2043/8/15  |
|        |      | 3.625 T-BOND 440215      | 3.625 | 4,550   | 6,608      | 710,548   | 2044/2/15  |
|        |      | 3.75 T-BOND 410815       | 3.75  | 1,000   | 1,459      | 156,970   | 2041/8/15  |
|        |      | 3.75 T-BOND 431115       | 3.75  | 4,450   | 6,569      | 706,332   | 2043/11/15 |
|        |      | 3.875 T-BOND 400815      | 3.875 | 1,150   | 1,700      | 182,844   | 2040/8/15  |
|        |      | 4.25 T-BOND 390515       | 4.25  | 1,030   | 1,584      | 170,401   | 2039/5/15  |
|        |      | 4.25 T-BOND 401115       | 4.25  | 1,370   | 2,123      | 228,318   | 2040/11/15 |
|        |      | 4.375 T-BOND 391115      | 4.375 | 1,350   | 2,112      | 227,128   | 2039/11/15 |
|        |      | 4.375 T-BOND 400515      | 4.375 | 1,250   | 1,963      | 211,112   | 2040/5/15  |
|        |      | 4.375 T-BOND 410515      | 4.375 | 1,300   | 2,050      | 220,496   | 2041/5/15  |
|        |      | 4.5 T-BOND 390815        | 4.5   | 1,100   | 1,745      | 187,636   | 2039/8/15  |
|        |      | 4.625 T-BOND 400215      | 4.625 | 1,900   | 3,063      | 329,430   | 2040/2/15  |
|        |      | 4.75 T-BOND 410215       | 4.75  | 1,530   | 2,515      | 270,496   | 2041/2/15  |
|        |      | 5.25 T-BOND 281115       | 5.25  | 550     | 760        | 81,778    | 2028/11/15 |
|        |      | 5.25 T-BOND 290215       | 5.25  | 300     | 417        | 44,929    | 2029/2/15  |
|        |      | 5.5 T-BOND 280815        | 5.5   | 600     | 835        | 89,873    | 2028/8/15  |
|        |      | 6 T-BOND 260215          | 6.0   | 2,600   | 3,424      | 368,244   | 2026/2/15  |
|        |      | 6.25 T-BOND 230815       | 6.25  | 2,130   | 2,546      | 273,837   | 2023/8/15  |
|        |      | 8 T-BOND 211115          | 8.0   | 600     | 671        | 72,180    | 2021/11/15 |
| 小 計    |      |                          |       |         | 69,234,594 |           |            |
| カナダ    |      |                          |       | 千カナダドル  | 千カナダドル     |           |            |
|        | 国債証券 | 0.5 CAN GOVT 220301      | 0.5   | 1,500   | 1,506      | 115,236   | 2022/3/1   |
|        |      | 0.75 CAN GOVT 210901     | 0.75  | 3,120   | 3,140      | 240,175   | 2021/9/1   |
|        |      | 1 CAN GOVT 220901        | 1.0   | 2,350   | 2,389      | 182,759   | 2022/9/1   |
|        |      | 1 CAN GOVT 270601        | 1.0   | 1,200   | 1,244      | 95,195    | 2027/6/1   |
|        |      | 1.25 CAN GOVT 250301     | 1.25  | 600     | 625        | 47,821    | 2025/3/1   |
|        |      | 1.5 CAN GOVT 230601      | 1.5   | 850     | 882        | 67,476    | 2023/6/1   |
|        |      | 1.5 CAN GOVT 240901      | 1.5   | 2,000   | 2,099      | 160,542   | 2024/9/1   |
|        |      | 1.5 CAN GOVT 260601      | 1.5   | 970     | 1,034      | 79,121    | 2026/6/1   |
|        |      | 1.75 CAN GOVT 210501     | 1.75  | 1,100   | 1,116      | 85,365    | 2021/5/1   |
|        |      | 1.75 CAN GOVT 230301     | 1.75  | 800     | 833        | 63,765    | 2023/3/1   |
|        |      | 2 CAN GOVT 230901        | 2.0   | 2,400   | 2,535      | 193,926   | 2023/9/1   |
|        |      | 2 CAN GOVT 280601        | 2.0   | 900     | 1,007      | 77,028    | 2028/6/1   |
|        |      | 2 CAN GOVT 511201        | 2.0   | 1,160   | 1,417      | 108,432   | 2051/12/1  |
|        |      | 2.25 CAN GOVT 240301     | 2.25  | 800     | 858        | 65,665    | 2024/3/1   |
|        |      | 2.25 CAN GOVT 250601     | 2.25  | 1,300   | 1,422      | 108,788   | 2025/6/1   |
|        |      | 2.25 CAN GOVT 290601     | 2.25  | 890     | 1,026      | 78,522    | 2029/6/1   |
|        |      | 2.5 CAN GOVT 240601      | 2.5   | 1,500   | 1,631      | 124,791   | 2024/6/1   |
|        |      | 2.75 CAN GOVT 220601     | 2.75  | 850     | 893        | 68,329    | 2022/6/1   |
|        |      | 2.75 CAN GOVT 481201     | 2.75  | 860     | 1,187      | 90,838    | 2048/12/1  |
|        |      | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 2.75  | 310     | 479        | 36,686    | 2064/12/1  |
|        |      | 3.25 CAN GOVT 210601     | 3.25  | 800     | 825        | 63,139    | 2021/6/1   |

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

| 銘 柄  |      |                        | 当 期 末 |       |       |         |            |
|------|------|------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|      |      |                        | 利 率   | 額面金額  | 評 価 額 |         | 償還年月日      |
|      |      |                        |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ  |      |                        | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| ドイツ  | 国債証券 | 2 BUND 220104          | 2.0   | 1,500 | 1,568 | 182,000 | 2022/1/4   |
|      |      | 2 BUND 230815          | 2.0   | 1,450 | 1,583 | 183,718 | 2023/8/15  |
|      |      | 2.5 BUND 440704        | 2.5   | 1,880 | 3,104 | 360,189 | 2044/7/4   |
|      |      | 2.5 BUND 460815        | 2.5   | 2,030 | 3,441 | 399,306 | 2046/8/15  |
|      |      | 3.25 BUND 420704       | 3.25  | 1,030 | 1,828 | 212,104 | 2042/7/4   |
|      |      | 4 BUND 370104          | 4.0   | 1,690 | 2,934 | 340,482 | 2037/1/4   |
|      |      | 4.25 BUND 390704       | 4.25  | 1,650 | 3,106 | 360,421 | 2039/7/4   |
|      |      | 4.75 BUND 280704       | 4.75  | 930   | 1,344 | 155,940 | 2028/7/4   |
|      |      | 4.75 BUND 340704       | 4.75  | 2,040 | 3,567 | 413,849 | 2034/7/4   |
|      |      | 4.75 BUND 400704       | 4.75  | 1,190 | 2,415 | 280,193 | 2040/7/4   |
|      |      | 5.5 BUND 310104        | 5.5   | 1,290 | 2,136 | 247,874 | 2031/1/4   |
|      |      | 5.625 BUND 280104      | 5.625 | 1,250 | 1,860 | 215,912 | 2028/1/4   |
|      |      | 6.25 BUND 240104       | 6.25  | 1,130 | 1,422 | 165,093 | 2024/1/4   |
|      |      | 6.25 BUND 300104       | 6.25  | 750   | 1,254 | 145,514 | 2030/1/4   |
|      |      | 6.5 BUND 270704        | 6.5   | 1,200 | 1,827 | 212,058 | 2027/7/4   |
| イタリア | 国債証券 | 0.35 ITALY GOVT 211101 | 0.35  | 1,350 | 1,346 | 156,222 | 2021/11/1  |
|      |      | 0.35 ITALY GOVT 250201 | 0.35  | 1,500 | 1,435 | 166,542 | 2025/2/1   |
|      |      | 0.45 ITALY GOVT 210601 | 0.45  | 1,300 | 1,301 | 151,024 | 2021/6/1   |
|      |      | 0.65 ITALY GOVT 231015 | 0.65  | 2,700 | 2,673 | 310,156 | 2023/10/15 |
|      |      | 0.9 ITALY GOVT 220801  | 0.9   | 3,200 | 3,212 | 372,675 | 2022/8/1   |
|      |      | 0.95 ITALY GOVT 230315 | 0.95  | 1,980 | 1,985 | 230,335 | 2023/3/15  |
|      |      | 1.2 ITALY GOVT 220401  | 1.2   | 1,400 | 1,413 | 163,962 | 2022/4/1   |
|      |      | 1.25 ITALY GOVT 261201 | 1.25  | 1,550 | 1,521 | 176,536 | 2026/12/1  |
|      |      | 1.35 ITALY GOVT 220415 | 1.35  | 1,150 | 1,164 | 135,092 | 2022/4/15  |
|      |      | 1.35 ITALY GOVT 300401 | 1.35  | 2,300 | 2,191 | 254,227 | 2030/4/1   |
|      |      | 1.45 ITALY GOVT 220915 | 1.45  | 1,400 | 1,422 | 165,039 | 2022/9/15  |
|      |      | 1.45 ITALY GOVT 241115 | 1.45  | 1,600 | 1,614 | 187,272 | 2024/11/15 |
|      |      | 1.45 ITALY GOVT 250515 | 1.45  | 1,600 | 1,607 | 186,475 | 2025/5/15  |
|      |      | 1.45 ITALY GOVT 360301 | 1.45  | 750   | 671   | 77,857  | 2036/3/1   |
|      |      | 1.5 ITALY GOVT 250601  | 1.5   | 1,550 | 1,559 | 180,959 | 2025/6/1   |
|      |      | 1.6 ITALY GOVT 260601  | 1.6   | 2,000 | 2,010 | 233,235 | 2026/6/1   |
|      |      | 1.65 ITALY GOVT 320301 | 1.65  | 1,850 | 1,779 | 206,479 | 2032/3/1   |
|      |      | 1.85 ITALY GOVT 240515 | 1.85  | 850   | 873   | 101,303 | 2024/5/15  |
|      |      | 2 ITALY GOVT 251201    | 2.0   | 1,730 | 1,781 | 206,697 | 2025/12/1  |
|      |      | 2 ITALY GOVT 280201    | 2.0   | 1,800 | 1,840 | 213,509 | 2028/2/1   |
|      |      | 2.05 ITALY GOVT 270801 | 2.05  | 1,300 | 1,333 | 154,749 | 2027/8/1   |
|      |      | 2.1 ITALY GOVT 260715  | 2.1   | 1,350 | 1,393 | 161,689 | 2026/7/15  |
|      |      | 2.2 ITALY GOVT 270601  | 2.2   | 1,400 | 1,450 | 168,342 | 2027/6/1   |
|      |      | 2.25 ITALY GOVT 360901 | 2.25  | 1,260 | 1,252 | 145,351 | 2036/9/1   |
|      |      | 2.45 ITALY GOVT 330901 | 2.45  | 1,400 | 1,445 | 167,717 | 2033/9/1   |
|      |      | 2.45 ITALY GOVT 500901 | 2.45  | 1,080 | 1,023 | 118,799 | 2050/9/1   |
|      |      | 2.5 ITALY GOVT 241201  | 2.5   | 1,800 | 1,896 | 220,046 | 2024/12/1  |
|      |      | 2.5 ITALY GOVT 251115  | 2.5   | 1,410 | 1,488 | 172,647 | 2025/11/15 |
|      |      | 2.7 ITALY GOVT 470301  | 2.7   | 1,200 | 1,212 | 140,644 | 2047/3/1   |
|      |      | 2.8 ITALY GOVT 281201  | 2.8   | 1,550 | 1,673 | 194,120 | 2028/12/1  |
|      |      | 2.8 ITALY GOVT 670301  | 2.8   | 630   | 624   | 72,459  | 2067/3/1   |
|      |      | 2.95 ITALY GOVT 380901 | 2.95  | 1,250 | 1,341 | 155,593 | 2038/9/1   |

| 銘柄                     |      |                        | 当期末   |         |           |         |            |
|------------------------|------|------------------------|-------|---------|-----------|---------|------------|
|                        |      |                        | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額     |         | 償還年月日      |
|                        |      |                        |       |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ                    |      |                        | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円      |            |
| イタリア                   | 国債証券 | 3 ITALY GOVT 290801    | 3.0   | 550     | 602       | 69,933  | 2029/8/1   |
|                        |      | 3.1 ITALY GOVT 400301  | 3.1   | 590     | 642       | 74,502  | 2040/3/1   |
|                        |      | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25  | 1,150   | 1,270     | 147,439 | 2046/9/1   |
|                        |      | 3.45 ITALY GOVT 480301 | 3.45  | 1,190   | 1,359     | 157,743 | 2048/3/1   |
|                        |      | 3.5 ITALY GOVT 300301  | 3.5   | 1,700   | 1,937     | 224,800 | 2030/3/1   |
|                        |      | 3.75 ITALY GOVT 210501 | 3.75  | 1,800   | 1,860     | 215,825 | 2021/5/1   |
|                        |      | 3.75 ITALY GOVT 210801 | 3.75  | 3,000   | 3,120     | 362,044 | 2021/8/1   |
|                        |      | 3.75 ITALY GOVT 240901 | 3.75  | 1,500   | 1,656     | 192,130 | 2024/9/1   |
|                        |      | 3.85 ITALY GOVT 490901 | 3.85  | 920     | 1,123     | 130,331 | 2049/9/1   |
|                        |      | 4 ITALY GOVT 370201    | 4.0   | 2,050   | 2,496     | 289,609 | 2037/2/1   |
|                        |      | 4.5 ITALY GOVT 230501  | 4.5   | 2,300   | 2,542     | 294,975 | 2023/5/1   |
|                        |      | 4.5 ITALY GOVT 240301  | 4.5   | 2,120   | 2,385     | 276,722 | 2024/3/1   |
|                        |      | 4.5 ITALY GOVT 260301  | 4.5   | 1,450   | 1,691     | 196,274 | 2026/3/1   |
|                        |      | 4.75 ITALY GOVT 210901 | 4.75  | 3,000   | 3,166     | 367,426 | 2021/9/1   |
|                        |      | 4.75 ITALY GOVT 230801 | 4.75  | 1,700   | 1,904     | 220,958 | 2023/8/1   |
|                        |      | 4.75 ITALY GOVT 280901 | 4.75  | 2,000   | 2,458     | 285,232 | 2028/9/1   |
|                        |      | 4.75 ITALY GOVT 440901 | 4.75  | 1,220   | 1,662     | 192,928 | 2044/9/1   |
|                        |      | 5 ITALY GOVT 220301    | 5.0   | 1,500   | 1,617     | 187,618 | 2022/3/1   |
|                        |      | 5 ITALY GOVT 250301    | 5.0   | 1,920   | 2,247     | 260,710 | 2025/3/1   |
|                        |      | 5 ITALY GOVT 340801    | 5.0   | 2,310   | 3,076     | 356,897 | 2034/8/1   |
|                        |      | 5 ITALY GOVT 390801    | 5.0   | 1,620   | 2,231     | 258,924 | 2039/8/1   |
|                        |      | 5 ITALY GOVT 400901    | 5.0   | 2,050   | 2,829     | 328,241 | 2040/9/1   |
|                        |      | 5.25 ITALY GOVT 291101 | 5.25  | 2,100   | 2,709     | 314,334 | 2029/11/1  |
|                        |      | 5.5 ITALY GOVT 220901  | 5.5   | 1,150   | 1,273     | 147,763 | 2022/9/1   |
|                        |      | 5.5 ITALY GOVT 221101  | 5.5   | 2,200   | 2,451     | 284,377 | 2022/11/1  |
|                        |      | 5.75 ITALY GOVT 330201 | 5.75  | 1,730   | 2,415     | 280,223 | 2033/2/1   |
|                        |      | 6 ITALY GOVT 310501    | 6.0   | 2,530   | 3,511     | 407,376 | 2031/5/1   |
| 6.5 ITALY GOVT 271101  | 6.5  | 2,070                  | 2,758 | 320,078 | 2027/11/1 |         |            |
| 7.25 ITALY GOVT 261101 | 7.25 | 1,100                  | 1,482 | 171,994 | 2026/11/1 |         |            |
| 9 ITALY GOVT 231101    | 9.0  | 1,200                  | 1,526 | 177,111 | 2023/11/1 |         |            |
| フランス                   | 国債証券 | 0 O.A.T 220525         | —     | 2,700   | 2,730     | 316,794 | 2022/5/25  |
|                        |      | 0 O.A.T 230325         | —     | 3,100   | 3,148     | 365,258 | 2023/3/25  |
|                        |      | 0 O.A.T 250325         | —     | 2,000   | 2,040     | 236,737 | 2025/3/25  |
|                        |      | 0 O.A.T 291125         | —     | 2,100   | 2,103     | 244,049 | 2029/11/25 |
|                        |      | 0.25 O.A.T 261125      | 0.25  | 1,500   | 1,550     | 179,889 | 2026/11/25 |
|                        |      | 0.5 O.A.T 250525       | 0.5   | 2,750   | 2,878     | 333,977 | 2025/5/25  |
|                        |      | 0.5 O.A.T 260525       | 0.5   | 3,250   | 3,411     | 395,763 | 2026/5/25  |
|                        |      | 0.5 O.A.T 290525       | 0.5   | 2,200   | 2,312     | 268,337 | 2029/5/25  |
|                        |      | 0.75 O.A.T 280525      | 0.75  | 3,190   | 3,419     | 396,735 | 2028/5/25  |
|                        |      | 0.75 O.A.T 281125      | 0.75  | 3,100   | 3,327     | 386,023 | 2028/11/25 |
|                        |      | 1 O.A.T 251125         | 1.0   | 1,920   | 2,066     | 239,710 | 2025/11/25 |
|                        |      | 1 O.A.T 270525         | 1.0   | 2,900   | 3,148     | 365,340 | 2027/5/25  |
|                        |      | 1.25 O.A.T 340525      | 1.25  | 2,070   | 2,348     | 272,418 | 2034/5/25  |
|                        |      | 1.25 O.A.T 360525      | 1.25  | 2,730   | 3,104     | 360,232 | 2036/5/25  |
|                        |      | 1.5 O.A.T 310525       | 1.5   | 3,390   | 3,926     | 455,504 | 2031/5/25  |
|                        |      | 1.5 O.A.T 500525       | 1.5   | 1,180   | 1,424     | 165,274 | 2050/5/25  |
|                        |      | 1.75 O.A.T 230525      | 1.75  | 6,850   | 7,333     | 850,866 | 2023/5/25  |

| 銘柄   |      |                        | 当期末  |       |       |         |            |
|------|------|------------------------|------|-------|-------|---------|------------|
|      |      |                        | 利 率  | 額面金額  | 評 価 額 |         | 償還年月日      |
|      |      |                        |      |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ  |      |                        | %    | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| フランス | 国債証券 | 1.75 O.A.T 241125      | 1.75 | 2,900 | 3,193 | 370,539 | 2024/11/25 |
|      |      | 1.75 O.A.T 390625      | 1.75 | 2,370 | 2,926 | 339,492 | 2039/6/25  |
|      |      | 1.75 O.A.T 660525      | 1.75 | 1,270 | 1,719 | 199,551 | 2066/5/25  |
|      |      | 2 O.A.T 480525         | 2.0  | 1,840 | 2,444 | 283,645 | 2048/5/25  |
|      |      | 2.25 O.A.T 221025      | 2.25 | 3,850 | 4,117 | 477,680 | 2022/10/25 |
|      |      | 2.25 O.A.T 240525      | 2.25 | 2,740 | 3,046 | 353,469 | 2024/5/25  |
|      |      | 2.5 O.A.T 300525       | 2.5  | 2,950 | 3,690 | 428,134 | 2030/5/25  |
|      |      | 2.75 O.A.T 271025      | 2.75 | 3,270 | 3,996 | 463,649 | 2027/10/25 |
|      |      | 3 O.A.T 220425         | 3.0  | 5,500 | 5,882 | 682,518 | 2022/4/25  |
|      |      | 3.25 O.A.T 211025      | 3.25 | 1,600 | 1,687 | 195,795 | 2021/10/25 |
|      |      | 3.25 O.A.T 450525      | 3.25 | 1,960 | 3,146 | 365,007 | 2045/5/25  |
|      |      | 3.5 O.A.T 260425       | 3.5  | 2,550 | 3,135 | 363,773 | 2026/4/25  |
|      |      | 4 O.A.T 381025         | 4.0  | 1,840 | 3,001 | 348,192 | 2038/10/25 |
|      |      | 4 O.A.T 550425         | 4.0  | 1,440 | 2,862 | 332,088 | 2055/4/25  |
|      |      | 4 O.A.T 600425         | 4.0  | 1,310 | 2,736 | 317,491 | 2060/4/25  |
|      |      | 4.25 O.A.T 231025      | 4.25 | 3,590 | 4,191 | 486,300 | 2023/10/25 |
|      |      | 4.5 O.A.T 410425       | 4.5  | 2,560 | 4,579 | 531,328 | 2041/4/25  |
|      |      | 4.75 O.A.T 350425      | 4.75 | 2,400 | 3,968 | 460,415 | 2035/4/25  |
|      |      | 5.5 O.A.T 290425       | 5.5  | 2,750 | 4,131 | 479,354 | 2029/4/25  |
|      |      | 5.75 O.A.T 321025      | 5.75 | 2,220 | 3,758 | 436,055 | 2032/10/25 |
| オランダ | 国債証券 | 6 O.A.T 251025         | 6.0  | 3,700 | 4,998 | 579,936 | 2025/10/25 |
|      |      | 8.5 O.A.T 230425       | 8.5  | 1,300 | 1,648 | 191,222 | 2023/4/25  |
|      |      | 0 NETH GOVT 220115     | —    | 800   | 808   | 93,849  | 2022/1/15  |
|      |      | 0 NETH GOVT 240115     | —    | 1,250 | 1,280 | 148,508 | 2024/1/15  |
|      |      | 0.25 NETH GOVT 250715  | 0.25 | 1,350 | 1,408 | 163,451 | 2025/7/15  |
|      |      | 0.25 NETH GOVT 290715  | 0.25 | 400   | 420   | 48,834  | 2029/7/15  |
|      |      | 0.5 NETH GOVT 260715   | 0.5  | 1,350 | 1,436 | 166,606 | 2026/7/15  |
|      |      | 0.75 NETH GOVT 270715  | 0.75 | 1,180 | 1,282 | 148,813 | 2027/7/15  |
|      |      | 0.75 NETH GOVT 280715  | 0.75 | 1,330 | 1,454 | 168,764 | 2028/7/15  |
|      |      | 1.75 NETH GOVT 230715  | 1.75 | 1,000 | 1,077 | 125,026 | 2023/7/15  |
|      |      | 2 NETH GOVT 240715     | 2.0  | 950   | 1,055 | 122,502 | 2024/7/15  |
|      |      | 2.25 NETH GOVT 220715  | 2.25 | 900   | 958   | 111,162 | 2022/7/15  |
|      |      | 2.5 NETH GOVT 330115   | 2.5  | 1,730 | 2,323 | 269,573 | 2033/1/15  |
|      |      | 2.75 NETH GOVT 470115  | 2.75 | 980   | 1,680 | 194,934 | 2047/1/15  |
|      |      | 3.25 NETH GOVT 210715  | 3.25 | 1,600 | 1,671 | 193,933 | 2021/7/15  |
|      |      | 3.75 NETH GOVT 230115  | 3.75 | 300   | 336   | 38,985  | 2023/1/15  |
| スペイン | 国債証券 | 3.75 NETH GOVT 420115  | 3.75 | 1,300 | 2,357 | 273,462 | 2042/1/15  |
|      |      | 4 NETH GOVT 370115     | 4.0  | 1,490 | 2,506 | 290,780 | 2037/1/15  |
|      |      | 5.5 NETH GOVT 280115   | 5.5  | 1,150 | 1,677 | 194,651 | 2028/1/15  |
|      |      | 7.5 NETH GOVT 230115   | 7.5  | 650   | 794   | 92,162  | 2023/1/15  |
|      |      | 0.05 SPAIN GOVT 211031 | 0.05 | 1,000 | 1,003 | 116,474 | 2021/10/31 |
|      |      | 0.35 SPAIN GOVT 230730 | 0.35 | 1,100 | 1,113 | 129,165 | 2023/7/30  |
|      |      | 0.4 SPAIN GOVT 220430  | 0.4  | 1,500 | 1,517 | 176,092 | 2022/4/30  |
|      |      | 0.45 SPAIN GOVT 221031 | 0.45 | 1,450 | 1,471 | 170,748 | 2022/10/31 |
|      |      | 0.6 SPAIN GOVT 291031  | 0.6  | 2,100 | 2,069 | 240,158 | 2029/10/31 |
|      |      | 0.75 SPAIN GOVT 210730 | 0.75 | 2,600 | 2,632 | 305,394 | 2021/7/30  |
|      |      | 1 SPAIN GOVT 501031    | 1.0  | 600   | 509   | 59,085  | 2050/10/31 |

| 銘 柄  |      |                        | 当 期 末 |       |       |         |            |
|------|------|------------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|      |      |                        | 利 率   | 額面金額  | 評 価 額 |         | 償還年月日      |
|      |      |                        |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| ユーロ  |      |                        | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| スペイン | 国債証券 | 1.3 SPAIN GOVT 261031  | 1.3   | 1,950 | 2,060 | 239,004 | 2026/10/31 |
|      |      | 1.4 SPAIN GOVT 280430  | 1.4   | 1,500 | 1,591 | 184,592 | 2028/4/30  |
|      |      | 1.4 SPAIN GOVT 280730  | 1.4   | 1,900 | 2,015 | 233,831 | 2028/7/30  |
|      |      | 1.45 SPAIN GOVT 271031 | 1.45  | 2,100 | 2,234 | 259,259 | 2027/10/31 |
|      |      | 1.45 SPAIN GOVT 290430 | 1.45  | 1,320 | 1,403 | 162,828 | 2029/4/30  |
|      |      | 1.5 SPAIN GOVT 270430  | 1.5   | 1,450 | 1,550 | 179,928 | 2027/4/30  |
|      |      | 1.6 SPAIN GOVT 250430  | 1.6   | 1,800 | 1,923 | 223,109 | 2025/4/30  |
|      |      | 1.85 SPAIN GOVT 350730 | 1.85  | 850   | 931   | 108,084 | 2035/7/30  |
|      |      | 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95  | 1,900 | 2,078 | 241,156 | 2026/4/30  |
|      |      | 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 1.95  | 2,220 | 2,463 | 285,862 | 2030/7/30  |
|      |      | 2.15 SPAIN GOVT 251031 | 2.15  | 2,000 | 2,202 | 255,558 | 2025/10/31 |
|      |      | 2.35 SPAIN GOVT 330730 | 2.35  | 1,740 | 2,022 | 234,673 | 2033/7/30  |
|      |      | 2.7 SPAIN GOVT 481031  | 2.7   | 970   | 1,215 | 140,985 | 2048/10/31 |
|      |      | 2.75 SPAIN GOVT 241031 | 2.75  | 2,050 | 2,288 | 265,516 | 2024/10/31 |
|      |      | 2.9 SPAIN GOVT 461031  | 2.9   | 1,310 | 1,688 | 195,916 | 2046/10/31 |
|      |      | 3.45 SPAIN GOVT 660730 | 3.45  | 820   | 1,250 | 145,054 | 2066/7/30  |
|      |      | 3.8 SPAIN GOVT 240430  | 3.8   | 2,300 | 2,638 | 306,144 | 2024/4/30  |
|      |      | 4.2 SPAIN GOVT 370131  | 4.2   | 1,470 | 2,136 | 247,925 | 2037/1/31  |
|      |      | 4.4 SPAIN GOVT 231031  | 4.4   | 2,350 | 2,709 | 314,368 | 2023/10/31 |
|      |      | 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 4.65  | 2,050 | 2,517 | 292,134 | 2025/7/30  |
|      |      | 4.7 SPAIN GOVT 410730  | 4.7   | 1,550 | 2,489 | 288,862 | 2041/7/30  |
|      |      | 4.8 SPAIN GOVT 240131  | 4.8   | 1,300 | 1,529 | 177,510 | 2024/1/31  |
|      |      | 4.9 SPAIN GOVT 400730  | 4.9   | 1,300 | 2,111 | 244,995 | 2040/7/30  |
|      |      | 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 5.15  | 1,350 | 1,846 | 214,265 | 2028/10/31 |
|      |      | 5.15 SPAIN GOVT 441031 | 5.15  | 1,160 | 2,021 | 234,581 | 2044/10/31 |
|      |      | 5.4 SPAIN GOVT 230131  | 5.4   | 1,750 | 2,012 | 233,481 | 2023/1/31  |
|      |      | 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 5.75  | 2,850 | 4,434 | 514,502 | 2032/7/30  |
|      |      | 5.85 SPAIN GOVT 220131 | 5.85  | 1,850 | 2,042 | 237,004 | 2022/1/31  |
|      |      | 5.9 SPAIN GOVT 260730  | 5.9   | 1,450 | 1,938 | 224,887 | 2026/7/30  |
|      |      | 6 SPAIN GOVT 290131    | 6.0   | 1,800 | 2,603 | 302,102 | 2029/1/31  |
| ベルギー | 国債証券 | 0.2 BEL GOVT 231022    | 0.2   | 600   | 614   | 71,263  | 2023/10/22 |
|      |      | 0.5 BEL GOVT 241022    | 0.5   | 800   | 831   | 96,498  | 2024/10/22 |
|      |      | 0.8 BEL GOVT 250622    | 0.8   | 1,300 | 1,375 | 159,616 | 2025/6/22  |
|      |      | 0.8 BEL GOVT 270622    | 0.8   | 1,080 | 1,153 | 133,863 | 2027/6/22  |
|      |      | 0.8 BEL GOVT 280622    | 0.8   | 2,100 | 2,252 | 261,332 | 2028/6/22  |
|      |      | 0.9 BEL GOVT 290622    | 0.9   | 1,060 | 1,147 | 133,186 | 2029/6/22  |
|      |      | 1 BEL GOVT 260622      | 1.0   | 1,100 | 1,183 | 137,345 | 2026/6/22  |
|      |      | 1 BEL GOVT 310622      | 1.0   | 650   | 712   | 82,683  | 2031/6/22  |
|      |      | 1.25 BEL GOVT 330422   | 1.25  | 940   | 1,061 | 123,163 | 2033/4/22  |
|      |      | 1.45 BEL GOVT 370622   | 1.45  | 300   | 347   | 40,273  | 2037/6/22  |
|      |      | 1.6 BEL GOVT 470622    | 1.6   | 880   | 1,067 | 123,815 | 2047/6/22  |
|      |      | 1.7 BEL GOVT 500622    | 1.7   | 390   | 485   | 56,300  | 2050/6/22  |
|      |      | 1.9 BEL GOVT 380622    | 1.9   | 630   | 778   | 90,374  | 2038/6/22  |
|      |      | 2.15 BEL GOVT 660622   | 2.15  | 570   | 842   | 97,689  | 2066/6/22  |
|      |      | 2.25 BEL GOVT 230622   | 2.25  | 820   | 891   | 103,402 | 2023/6/22  |
|      |      | 2.25 BEL GOVT 570622   | 2.25  | 360   | 520   | 60,444  | 2057/6/22  |
|      |      | 2.6 BEL GOVT 240622    | 2.6   | 1,180 | 1,328 | 154,080 | 2024/6/22  |

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

| 銘柄   |        |                   |                          | 当期末   |          |          |             |             |
|------|--------|-------------------|--------------------------|-------|----------|----------|-------------|-------------|
|      |        |                   |                          | 利 率   | 額面金額     | 評 価 額    |             | 償還年月日       |
|      |        |                   |                          |       |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額      |             |
| ユーロ  |        |                   |                          | %     | 千ユーロ     | 千ユーロ     | 千円          |             |
|      | フィンランド | 国債証券              | 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75  | 530      | 658      | 76,419      | 2028/ 7 / 4 |
|      |        |                   | 4 FINNISH GOVT 250704    | 4.0   | 300      | 369      | 42,921      | 2025/ 7 / 4 |
|      | アイルランド | 国債証券              | 0 IRISH GOVT 221018      | —     | 250      | 252      | 29,276      | 2022/10/18  |
|      |        |                   | 0.4 IRISH GOVT 350515    | 0.4   | 320      | 313      | 36,415      | 2035/ 5 /15 |
|      |        |                   | 0.8 IRISH GOVT 220315    | 0.8   | 500      | 511      | 59,310      | 2022/ 3 /15 |
|      |        |                   | 0.9 IRISH GOVT 280515    | 0.9   | 1,200    | 1,279    | 148,481     | 2028/ 5 /15 |
|      |        |                   | 1 IRISH GOVT 260515      | 1.0   | 970      | 1,033    | 119,945     | 2026/ 5 /15 |
|      |        |                   | 1.1 IRISH GOVT 290515    | 1.1   | 700      | 759      | 88,166      | 2029/ 5 /15 |
|      |        |                   | 1.3 IRISH GOVT 330515    | 1.3   | 300      | 333      | 38,736      | 2033/ 5 /15 |
|      |        |                   | 1.35 IRISH GOVT 310318   | 1.35  | 230      | 256      | 29,733      | 2031/ 3 /18 |
|      |        |                   | 1.5 IRISH GOVT 500515    | 1.5   | 310      | 357      | 41,434      | 2050/ 5 /15 |
|      |        |                   | 1.7 IRISH GOVT 370515    | 1.7   | 400      | 470      | 54,586      | 2037/ 5 /15 |
|      |        |                   | 2 IRISH GOVT 450218      | 2.0   | 590      | 753      | 87,436      | 2045/ 2 /18 |
|      |        |                   | 2.4 IRISH GOVT 300515    | 2.4   | 800      | 973      | 112,906     | 2030/ 5 /15 |
|      |        |                   | 3.4 IRISH GOVT 240318    | 3.4   | 600      | 685      | 79,524      | 2024/ 3 /18 |
|      |        |                   | 3.9 IRISH GOVT 230320    | 3.9   | 400      | 448      | 52,072      | 2023/ 3 /20 |
|      |        |                   | 5.4 IRISH GOVT 250313    | 5.4   | 700      | 890      | 103,276     | 2025/ 3 /13 |
| 小 計  |        |                   |                          |       |          |          | 56,889,831  |             |
| イギリス |        |                   |                          |       | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド |             |             |
|      | 国債証券   | 0.5 GILT 220722   | 0.5                      | 1,100 | 1,112    | 147,117  | 2022/ 7 /22 |             |
|      |        | 0.625 GILT 250607 | 0.625                    | 1,500 | 1,541    | 203,820  | 2025/ 6 / 7 |             |
|      |        | 0.75 GILT 230722  | 0.75                     | 2,450 | 2,506    | 331,480  | 2023/ 7 /22 |             |
|      |        | 0.875 GILT 291022 | 0.875                    | 570   | 604      | 79,986   | 2029/10/22  |             |
|      |        | 1 GILT 240422     | 1.0                      | 1,700 | 1,763    | 233,242  | 2024/ 4 /22 |             |
|      |        | 1.25 GILT 270722  | 1.25                     | 1,770 | 1,913    | 253,098  | 2027/ 7 /22 |             |
|      |        | 1.5 GILT 260722   | 1.5                      | 1,660 | 1,808    | 239,176  | 2026/ 7 /22 |             |
|      |        | 1.5 GILT 470722   | 1.5                      | 1,940 | 2,386    | 315,671  | 2047/ 7 /22 |             |
|      |        | 1.625 GILT 281022 | 1.625                    | 2,150 | 2,415    | 319,392  | 2028/10/22  |             |
|      |        | 1.625 GILT 711022 | 1.625                    | 280   | 442      | 58,502   | 2071/10/22  |             |
|      |        | 1.75 GILT 220907  | 1.75                     | 3,000 | 3,121    | 412,810  | 2022/ 9 / 7 |             |
|      |        | 1.75 GILT 370907  | 1.75                     | 1,700 | 2,039    | 269,661  | 2037/ 9 / 7 |             |
|      |        | 1.75 GILT 490122  | 1.75                     | 930   | 1,215    | 160,763  | 2049/ 1 /22 |             |
|      |        | 1.75 GILT 570722  | 1.75                     | 1,250 | 1,782    | 235,698  | 2057/ 7 /22 |             |
|      |        | 2 GILT 250907     | 2.0                      | 780   | 862      | 114,053  | 2025/ 9 / 7 |             |
|      |        | 2.25 GILT 230907  | 2.25                     | 1,700 | 1,825    | 241,443  | 2023/ 9 / 7 |             |
|      |        | 2.5 GILT 650722   | 2.5                      | 1,440 | 2,637    | 348,792  | 2065/ 7 /22 |             |
|      |        | 2.75 GILT 240907  | 2.75                     | 510   | 569      | 75,295   | 2024/ 9 / 7 |             |
|      |        | 3.25 GILT 440122  | 3.25                     | 1,830 | 2,897    | 383,166  | 2044/ 1 /22 |             |
|      |        | 3.5 GILT 450122   | 3.5                      | 1,750 | 2,912    | 385,127  | 2045/ 1 /22 |             |
|      |        | 3.5 GILT 680722   | 3.5                      | 1,850 | 4,300    | 568,745  | 2068/ 7 /22 |             |
|      |        | 3.75 GILT 520722  | 3.75                     | 1,210 | 2,358    | 311,938  | 2052/ 7 /22 |             |
|      |        | 4 GILT 220307     | 4.0                      | 1,050 | 1,126    | 148,979  | 2022/ 3 / 7 |             |
|      |        | 4 GILT 600122     | 4.0                      | 1,110 | 2,527    | 334,274  | 2060/ 1 /22 |             |
|      |        | 4.25 GILT 271207  | 4.25                     | 980   | 1,280    | 169,401  | 2027/12/ 7  |             |
|      |        | 4.25 GILT 320607  | 4.25                     | 1,220 | 1,777    | 235,023  | 2032/ 6 / 7 |             |
|      |        | 4.25 GILT 360307  | 4.25                     | 1,290 | 2,028    | 268,231  | 2036/ 3 / 7 |             |
|      |        | 4.25 GILT 390907  | 4.25                     | 1,150 | 1,930    | 255,251  | 2039/ 9 / 7 |             |

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

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

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

| 銘<br>柄                        | 当 期 末 |            |            |             |            |
|-------------------------------|-------|------------|------------|-------------|------------|
|                               | 利 率   | 額面金額       | 評 価 額      |             | 償還年月日      |
|                               |       |            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額      |            |
| イスラエル                         | %     | 千イスラエルシェケル | 千イスラエルシェケル | 千円          |            |
| 国債証券 6.25 ISRAEL FIXED 261030 | 6.25  | 3,500      | 4,885      | 149,690     | 2026/10/30 |
| 小 計                           |       |            |            | 577,047     |            |
| 合 計                           |       |            |            | 147,177,380 |            |

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

○投資信託財産の構成

(2020年5月12日現在)

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 公社債          | 147,177,380 | 98.2  |
| コール・ローン等、その他 | 2,708,393   | 1.8   |
| 投資信託財産総額     | 149,885,773 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産（149,217,319千円）の投資信託財産総額（149,885,773千円）に対する比率は99.6%です。

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月12日現在)

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

<注記事項>

- ①期首元本額 67,295,786,020円  
 期中追加設定元本額 16,311,803,664円  
 期中一部解約元本額 13,586,558,254円  
 また、1口当たり純資産額は、期末21,324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 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)        | 26,414,882,933円 |
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド                | 10,200,387,984円 |
| eMAXIS 先進国債券インデックス                    | 5,122,242,114円  |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス               | 4,324,032,523円  |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)              | 2,779,451,871円  |
| MUKAM 外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)      | 2,640,109,093円  |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)         | 2,239,490,397円  |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)         | 2,047,844,821円  |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド              | 1,961,147,101円  |
| 海外債券セレクション(ラップ向け)                     | 1,612,485,673円  |
| eMAXIS バランス(8資産均等型)                   | 1,607,967,471円  |
| 外国債券インデックスファンドi(適格機関投資家限定)            | 1,547,760,325円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)       | 1,474,962,155円  |
| つみたて8資産均等バランス                         | 1,122,245,178円  |
| ファンド・マネジャー(海外債券)                      | 932,502,192円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)       | 634,889,113円    |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定成長型) | 527,920,565円    |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(成長型)   | 389,643,524円    |
| つみたて4資産均等バランス                         | 320,391,297円    |
| eMAXIS バランス(4資産均等型)                   | 254,438,953円    |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)             | 246,002,409円    |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(安定型)   | 212,749,942円    |
| eMAXIS バランス(波乗り型)                     | 204,923,110円    |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)   | 139,293,594円    |
| アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)       | 136,358,854円    |

○損益の状況 (2019年5月14日～2020年5月12日)

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

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

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

# 東証REIT指数マザーファンド

## 《第12期》決算日2021年1月26日

[計算期間：2020年1月28日～2021年1月26日]

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

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

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |       | 東証REIT指数<br>(配当込み) |       | 投資信託証券<br>組入比率 | 不動産投信<br>指数比率 | 純資産額   |
|-----------------|--------|-------|--------------------|-------|----------------|---------------|--------|
|                 | 期騰落    | 中率    | 期騰落                | 中率    |                |               |        |
|                 | 円      | %     |                    | %     | %              | %             | 百万円    |
| 8期(2017年1月26日)  | 27,236 | 13.6  | 3,399.04           | 13.4  | 97.9           | 2.3           | 16,983 |
| 9期(2018年1月26日)  | 26,965 | △1.0  | 3,362.92           | △1.1  | 98.4           | 1.9           | 21,644 |
| 10期(2019年1月28日) | 29,481 | 9.3   | 3,670.43           | 9.1   | 98.2           | 2.0           | 23,792 |
| 11期(2020年1月27日) | 36,432 | 23.6  | 4,533.90           | 23.5  | 98.4           | 1.6           | 35,177 |
| 12期(2021年1月26日) | 31,049 | △14.8 | 3,872.69           | △14.6 | 98.0           | 2.0           | 42,741 |

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

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | 東 証 R E I T 指 数<br>(配当込み) | 騰 落 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 | 不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|---------------------------|-------|-----------------|-----------------------|
|                     | 騰 落 率   | 騰 落 率 |                           |       |                 |                       |
| (期 首)<br>2020年1月27日 | 円       | %     |                           | %     | %               | %                     |
|                     | 36,432  | —     | 4,533.90                  | —     | 98.4            | 1.6                   |
| 1月末                 | 37,036  | 1.7   | 4,608.85                  | 1.7   | 98.6            | 1.4                   |
| 2月末                 | 33,901  | △ 6.9 | 4,218.40                  | △ 7.0 | 98.3            | 1.7                   |
| 3月末                 | 26,800  | △26.4 | 3,343.59                  | △26.3 | 97.1            | 3.3                   |
| 4月末                 | 26,558  | △27.1 | 3,313.25                  | △26.9 | 98.2            | 1.9                   |
| 5月末                 | 28,744  | △21.1 | 3,586.37                  | △20.9 | 98.6            | 1.4                   |
| 6月末                 | 28,256  | △22.4 | 3,525.99                  | △22.2 | 98.6            | 1.6                   |
| 7月末                 | 28,332  | △22.2 | 3,535.10                  | △22.0 | 98.1            | 1.9                   |
| 8月末                 | 29,936  | △17.8 | 3,735.15                  | △17.6 | 96.9            | 3.0                   |
| 9月末                 | 29,645  | △18.6 | 3,698.94                  | △18.4 | 97.3            | 2.6                   |
| 10月末                | 28,159  | △22.7 | 3,512.43                  | △22.5 | 98.0            | 2.1                   |
| 11月末                | 29,147  | △20.0 | 3,635.82                  | △19.8 | 98.1            | 2.0                   |
| 12月末                | 30,903  | △15.2 | 3,854.76                  | △15.0 | 98.3            | 1.6                   |
| (期 末)<br>2021年1月26日 | 31,049  | △14.8 | 3,872.69                  | △14.6 | 98.0            | 2.0                   |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

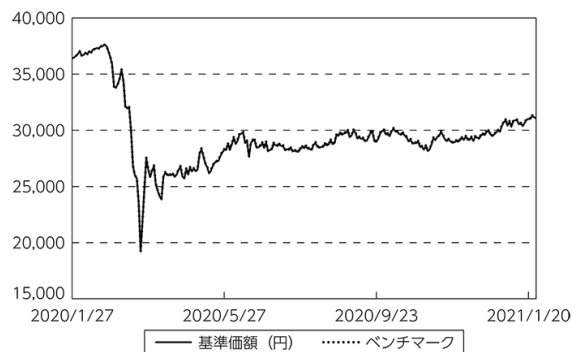
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.8%の下落となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

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

## 基準価額等の推移



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

## ●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

## ●投資環境について

## ◎国内REIT市況

- ・国内REIT市況は下落しました。
- ・新型コロナウイルスの世界的流行を受け、国内REIT市況は下落しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

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

## ●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは14.6%の下落となったため、乖離は△0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因※によるものです。

※留保金等が含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

## ○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 1 月28日～2021年 1 月26日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                                         |
|-----------------------|--------|------------|-------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                                                   |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円<br>2 | %<br>0.005 | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| ( 投 資 信 託 証 券 )       | (0)    | (0.001)    |                                                                   |
| ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )   | (1)    | (0.004)    |                                                                   |
| 合 計                   | 2      | 0.005      |                                                                   |
| 期中の平均基準価額は、29,458円です。 |        |            |                                                                   |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2020年1月28日～2021年1月26日)

## 投資信託証券

| 銘柄                      | 買 付                     |                          | 売 付         |              |
|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------|--------------|
|                         | 口 数                     | 金 額                      | 口 数         | 金 額          |
| エスコンジャパンリート投資法人         | 千口<br>0.484<br>( 0.014) | 千円<br>50,863<br>( 1,920) | 千口<br>0.103 | 千円<br>10,937 |
| サンケイリアルエステート投資法人        | 0.755                   | 70,694                   | 0.136       | 14,141       |
| S O S i L A 物流リート投資法人   | 1<br>( 0.057)           | 155,737<br>( 6,737)      | 0.182       | 22,136       |
| 日本アコモデーションファンド投資法人      | 0.748                   | 442,907                  | 0.273       | 171,947      |
| MCUBS MidCity投資法人       | 2                       | 208,456                  | 1           | 110,037      |
| 森ヒルズリート投資法人             | 2                       | 339,658                  | 0.946       | 142,707      |
| 産業ファンド投資法人              | 3                       | 537,295                  | 1           | 175,503      |
| アドバンス・レジデンス投資法人         | 1                       | 597,806                  | 0.774       | 244,223      |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 1                       | 242,841                  | 0.499       | 88,317       |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人      | 1                       | 391,847                  | 0.414       | 174,932      |
| GLP投資法人                 | 7                       | 1,176,229                | 2           | 291,647      |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人      | 0.937<br>( 0.009)       | 280,981<br>( 3,180)      | 0.339       | 106,903      |
| 日本プロロジスリート投資法人          | 3                       | 1,022,600                | 1           | 358,848      |
| 星野リゾート・リート投資法人          | 0.32                    | 136,182                  | 0.127       | 56,342       |
| One リート投資法人             | 0.325                   | 80,476                   | 0.127       | 35,260       |
| イオンリート投資法人              | 2                       | 244,419                  | 1           | 130,585      |
| ヒューリックリート投資法人           | 1                       | 233,056                  | 0.862       | 126,009      |
| 日本リート投資法人               | 0.676                   | 227,788                  | 0.264       | 101,527      |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人   | 13                      | 195,819                  | 5           | 90,430       |
| 日本ヘルスケア投資法人             | 0.031<br>(△ 0.16)       | 5,415<br>(△ 33,195)      | 0.021       | 4,179        |
| 積水ハウス・リート投資法人           | 6                       | 426,970                  | 2           | 178,227      |
| トーセイ・リート投資法人            | 0.469                   | 48,449                   | 0.178       | 19,700       |
| ケネディクス商業リート投資法人         | 0.791                   | 152,381                  | 0.382       | 78,387       |
| ヘルスケア&メディカル投資法人         | 0.448                   | 52,093                   | 0.177       | 21,293       |
| サムティ・レジデンシャル投資法人        | 0.416                   | 39,275                   | 0.196       | 18,889       |
| 野村不動産マスターファンド投資法人       | 6                       | 888,971                  | 2           | 394,247      |
| いちごホテルリート投資法人           | 0.384                   | 25,398                   | 0.134       | 10,396       |
| ラサールロジポート投資法人           | 2<br>( 0.304)           | 384,581<br>( 53,709)     | 0.757       | 119,194      |
| スターアジア不動産投資法人           | 1<br>( 2)               | 73,079<br>( 72,326)      | 0.489       | 31,953       |
| マリモ地方創生リート投資法人          | 0.203                   | 20,214                   | 0.099       | 10,228       |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人     | 0.958<br>( 0.03)        | 461,999<br>( 15,823)     | 0.227       | 108,247      |
| 大江戸温泉リート投資法人            | 0.348                   | 22,188                   | 0.17        | 11,247       |
| さくら総合リート投資法人            | 0.288<br>(△ 0.82)       | 20,835<br>(△ 72,326)     | 0.138       | 10,931       |
| 投資法人みらい                 | 2                       | 90,163                   | 1           | 47,051       |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人        | 0.48                    | 47,274                   | 0.261       | 26,917       |
| 三菱地所物流リート投資法人           | 0.512<br>( 0.021)       | 197,171<br>( 9,065)      | 0.16        | 60,618       |
| CRE ロジスティクスファンド投資法人     | 0.981                   | 144,851                  | 0.167       | 23,222       |
| ザイマックス・リート投資法人          | 0.337                   | 30,958                   | 0.118       | 12,029       |

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

(注) 金額は受渡代金。

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

## 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別       | 買 建    |        | 売 建   |       |
|-------------|--------|--------|-------|-------|
|             | 新規買付額  | 決 済 額  | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国内          | 百万円    | 百万円    | 百万円   | 百万円   |
| 不動産投信指数先物取引 | 13,851 | 13,423 | 149   | 152   |

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年1月28日～2021年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分         | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C    | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-------------|---------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
|             |               |                    |               |              |                    |               |
| 投資信託証券      | 百万円<br>19,708 | 百万円<br>7,595       | %<br>38.5     | 百万円<br>7,821 | 百万円<br>3,853       | %<br>49.3     |
| 不動産投信指数先物取引 | 14,004        | 11,154             | 79.6          | 13,572       | 10,223             | 75.3          |

## 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類    | 買 付 額      |
|--------|------------|
| 投資信託証券 | 百万円<br>732 |

## 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目              | 当 期     |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 1,890千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 1,086千円 |
| (B) / (A)        | 57.5%   |

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

## ○組入資産の明細

(2021年1月26日現在)

## 国内投資信託証券

| 銘柄                       | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |     |
|--------------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                          | 口 数     | 口 数   | 評 価 額     | 比 率 |
|                          | 千口      | 千口    | 千円        | %   |
| エスコンジャパンリート投資法人          | 0.318   | 0.713 | 88,198    | 0.2 |
| サンケイリアルエステート投資法人         | 0.449   | 1     | 107,974   | 0.3 |
| S O S i L A 物流リート投資法人    | —       | 1     | 144,751   | 0.3 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人       | 1       | 1     | 834,720   | 2.0 |
| MCUBS M i d C i t y 投資法人 | 3       | 5     | 499,196   | 1.2 |
| 森ヒルズリート投資法人              | 3       | 5     | 754,912   | 1.8 |
| 産業ファンド投資法人               | 3       | 6     | 1,186,530 | 2.8 |
| アドバンス・レジデンス投資法人          | 2       | 4     | 1,265,992 | 3.0 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人  | 1       | 2     | 517,687   | 1.2 |
| アクティビオ・プロパティーズ投資法人       | 1       | 2     | 913,748   | 2.1 |
| GLP 投資法人                 | 7       | 13    | 2,321,870 | 5.4 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人       | 1       | 1     | 553,134   | 1.3 |
| 日本プロロジスリート投資法人           | 4       | 6     | 2,195,165 | 5.1 |
| 星野リゾート・リート投資法人           | 0.471   | 0.664 | 337,976   | 0.8 |
| O n e リート投資法人            | 0.482   | 0.68  | 177,344   | 0.4 |
| イオンリート投資法人               | 3       | 4     | 604,012   | 1.4 |
| ヒューリックリート投資法人            | 2       | 3     | 539,596   | 1.3 |
| 日本リート投資法人                | 1       | 1     | 499,492   | 1.2 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人    | 19      | 28    | 397,199   | 0.9 |
| 日本ヘルスケア投資法人              | 0.15    | —     | —         | —   |
| 積水ハウス・リート投資法人            | 9       | 12    | 938,092   | 2.2 |
| トーセイ・リート投資法人             | 0.674   | 0.965 | 110,492   | 0.3 |
| ケネディクス商業リート投資法人          | 1       | 1     | 396,348   | 0.9 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人          | 0.66    | 0.931 | 125,405   | 0.3 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人         | 0.62    | 0.84  | 92,652    | 0.2 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人        | 9       | 14    | 2,154,444 | 5.0 |
| いちごホテルリート投資法人            | 0.513   | 0.763 | 52,189    | 0.1 |
| ラサールロジポート投資法人            | 2       | 4     | 788,616   | 1.8 |
| スターアジア不動産投資法人            | 1       | 4     | 218,994   | 0.5 |
| マリモ地方創生リート投資法人           | 0.305   | 0.409 | 45,971    | 0.1 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人      | 0.762   | 1     | 798,052   | 1.9 |
| 大江戸温泉リート投資法人             | 0.526   | 0.704 | 48,012    | 0.1 |
| さくら総合リート投資法人             | 0.67    | —     | —         | —   |
| 投資法人みらい                  | 3       | 4     | 188,008   | 0.4 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人         | 0.726   | 0.945 | 108,297   | 0.3 |
| 三菱地所物流リート投資法人            | 0.609   | 0.982 | 407,530   | 1.0 |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人    | 0.582   | 1     | 212,471   | 0.5 |
| ザイマックス・リート投資法人           | 0.449   | 0.668 | 67,601    | 0.2 |
| タカラレーベン不動産投資法人           | 0.878   | 1     | 123,627   | 0.3 |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人     | 0.478   | 1     | 223,005   | 0.5 |
| 日本ビルファンド投資法人             | 2       | 4     | 2,901,810 | 6.8 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人         | 3       | 4     | 2,613,437 | 6.1 |
| 日本リテールファンド投資法人           | 5       | 8     | 1,525,461 | 3.6 |
| オリックス不動産投資法人             | 6       | 8     | 1,461,293 | 3.4 |
| 日本プライムリアルティ投資法人          | 1       | 2     | 975,044   | 2.3 |
| プレミア投資法人                 | 2       | 3     | 498,930   | 1.2 |

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) エスコンジャパンリート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、SOS i LA物流リート投資法人、日本アコモデーションファン  
ド投資法人、MCUBS MidCity投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投  
資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリ  
ア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、Oneリート投資法人、イオンリー  
ト投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人、積水ハウス・リー  
ト投資法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、野村不動産マスター  
ファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラサールロジポート投資法人、スターアジア不動産投資法人、マリモ地方創生リー  
ト投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、投資法人みらい、森トラスト・ホテルリート投資法人、三菱地所物流リー  
ト投資法人、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、タカラレーベン不動産投資法人、伊藤忠アドバ  
ンス・ロジスティクス投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本リテールファンド投資法人、  
オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、プレミアム投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・  
ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラスト総合リート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア  
不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、ケネディクス・オフィ  
ス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急阪神リート投資法人、スターツプロシード投資法人、大  
和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、大和証券リビング投資法人、ジャパンエクスセレント投資法人、コンフォ  
リア・レジデンシャル投資法人(新)につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱UFJ銀行、三菱UFJ  
モルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで  
開示されている2020年7月31日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容

当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

## 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 |             |          | 当 期        | 末        |
|-----|-------------|----------|------------|----------|
|     |             |          | 買 建 額      | 売 建 額    |
| 国内  | 不動産投信指数先物取引 | 東証REIT指数 | 百万円<br>867 | 百万円<br>— |

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

(2021年1月26日現在)

| 区 分             | 当 期 | 末           |
|-----------------|-----|-------------|
|                 | 数   | 量           |
| 貸付有価証券<投資証券>総口数 |     | 口<br>58,204 |

## ○投資信託財産の構成

(2021年1月26日現在)

| 項 目          | 当 期              | 末         |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 投資証券         | 千円<br>41,902,242 | %<br>80.4 |
| コール・ローン等、その他 | 10,234,076       | 19.6      |
| 投資信託財産総額     | 52,136,318       | 100.0     |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月26日現在)

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

## &lt;注記事項&gt;

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

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

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

## ○損益の状況 (2020年1月28日～2021年1月26日)

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

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

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

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

# MUAM G-REITマザーファンド

## 《第15期》決算日2021年1月5日

[計算期間：2020年1月7日～2021年1月5日]

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

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

## ○最近5期の運用実績

| 決 算 期          | 基 準 価 額 |       | S & P 先 進 国<br>R E I T イ ン デ ッ ク ス<br>(除く日本、配当込み、円換算ベース) |       | 投 資 信 託 証 券<br>組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|----------------|---------|-------|----------------------------------------------------------|-------|------------------------|---------|
|                | 期 騰 落   | 中 率   | 期 騰 落                                                    | 中 率   |                        |         |
|                | 円       | %     |                                                          | %     | %                      | 百万円     |
| 11期(2017年1月5日) | 16,039  | 6.2   | 41,801.16                                                | 5.5   | 98.8                   | 18,949  |
| 12期(2018年1月5日) | 16,420  | 2.4   | 42,522.26                                                | 1.7   | 98.0                   | 18,551  |
| 13期(2019年1月7日) | 15,011  | △ 8.6 | 38,602.62                                                | △ 9.2 | 98.8                   | 19,712  |
| 14期(2020年1月6日) | 18,377  | 22.4  | 47,161.24                                                | 22.2  | 99.0                   | 30,217  |
| 15期(2021年1月5日) | 15,806  | △14.0 | 40,236.52                                                | △14.7 | 99.0                   | 40,409  |

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

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

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日              | 基 準 価 額 |        | S & P<br>R E I T イ<br>(除く日本、配当込<br>み、円換算ベース) | 先 進 国<br>ス<br>ン デ ッ ク ス<br>騰 落 率 | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 |
|--------------------|---------|--------|----------------------------------------------|----------------------------------|----------------------|
|                    | 円       | 騰 落 率  |                                              |                                  |                      |
| (期 首)<br>2020年1月6日 | 18,377  | %<br>— | 47,161.24                                    | %<br>—                           | %<br>99.0            |
| 1月末                | 18,923  | 3.0    | 48,553.04                                    | 3.0                              | 99.0                 |
| 2月末                | 17,805  | △ 3.1  | 45,640.42                                    | △ 3.2                            | 98.8                 |
| 3月末                | 13,378  | △27.2  | 34,126.01                                    | △27.6                            | 99.0                 |
| 4月末                | 14,298  | △22.2  | 36,418.41                                    | △22.8                            | 99.4                 |
| 5月末                | 14,433  | △21.5  | 36,769.78                                    | △22.0                            | 99.3                 |
| 6月末                | 14,590  | △20.6  | 37,151.26                                    | △21.2                            | 98.8                 |
| 7月末                | 14,857  | △19.2  | 37,787.41                                    | △19.9                            | 99.3                 |
| 8月末                | 15,317  | △16.7  | 39,001.97                                    | △17.3                            | 99.3                 |
| 9月末                | 14,683  | △20.1  | 37,350.97                                    | △20.8                            | 99.1                 |
| 10月末               | 14,203  | △22.7  | 36,104.61                                    | △23.4                            | 99.5                 |
| 11月末               | 15,983  | △13.0  | 40,687.85                                    | △13.7                            | 99.7                 |
| 12月末               | 16,149  | △12.1  | 41,107.17                                    | △12.8                            | 98.7                 |
| (期 末)<br>2021年1月5日 | 15,806  | △14.0  | 40,236.52                                    | △14.7                            | 99.0                 |

(注) 騰落率は期首比。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

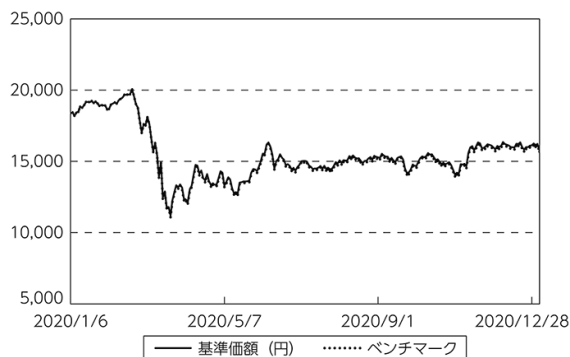
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ14.0%の下落となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

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

## 基準価額等の推移



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

## ●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

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

## ●投資環境について

### ◎外国REIT市況

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

### ◎為替市況

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

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

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

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

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・その他の要因によるものです。

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

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

## ○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 1 月 7 日～2021年 1 月 5 日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                                         |
|-----------------------|--------|------------|-------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                                                   |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円<br>4 | %<br>0.025 | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (株 式)                 | ( 0 )  | (0.000)    |                                                                   |
| (投 資 信 託 証 券)         | ( 4 )  | (0.025)    |                                                                   |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 3      | 0.022      | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金       |
| (株 式)                 | ( 0 )  | (0.000)    |                                                                   |
| (投 資 信 託 証 券)         | ( 3 )  | (0.022)    |                                                                   |
| (c) そ の 他 費 用         | 19     | 0.120      | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                                     |
| (保 管 費 用)             | ( 6 )  | (0.037)    | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用                                   |
| (そ の 他)               | (13)   | (0.082)    | 信託事務の処理等に要するその他諸費用（権利割当にかかる現地徴収税等）                                |
| 合 計                   | 26     | 0.167      |                                                                   |
| 期中の平均基準価額は、15,486円です。 |        |            |                                                                   |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2020年1月7日～2021年1月5日)

株式

|     |      | 買 付     |              | 売 付      |               |
|-----|------|---------|--------------|----------|---------------|
|     |      | 株 数     | 金 額          | 株 数      | 金 額           |
| 外 国 | アメリカ | 百株<br>— | 千アメリカドル<br>— | 百株<br>32 | 千アメリカドル<br>10 |

(注) 金額は受渡代金。

## 投資信託証券

| 銘   | 柄                            | 買 付          |                   | 売 付   |         |
|-----|------------------------------|--------------|-------------------|-------|---------|
|     |                              | 口 数          | 金 額               | 口 数   | 金 額     |
| 外 国 | アメリカ                         | 千口           | 千アメリカドル           | 千口    | 千アメリカドル |
|     | SITE CENTERS CORP            | 23           | 188               | 7     | 68      |
|     | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 78           | 2,064             | 12    | 352     |
|     | MACERICH CO/THE              | 9<br>( 1)    | 96<br>( 10)       | —     | —       |
|     | ACADIA REALTY TRUST          | 8            | 117               | —     | —       |
|     | AGREE REALTY CORP            | 9            | 592               | 0.629 | 42      |
|     | ALEXANDER'S INC              | 0.21         | 50                | —     | —       |
|     | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 20           | 3,182             | 5     | 789     |
|     | PROLOGIS INC                 | 100<br>( 22) | 8,906<br>( 2,013) | 18    | 1,794   |
|     | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES  | 20           | 692               | 4     | 158     |
|     | ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | —<br>(△ 13)  | —<br>( —)         | 1     | 3       |
|     | BRANDYWINE REALTY TRUST      | 19           | 205               | 2     | 27      |
|     | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 13           | 1,215             | 2     | 248     |
|     | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | —            | —                 | 31    | 6       |
|     | CEDAR REALTY TRUST INC       | —            | —                 | 17    | 12      |
|     | NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 25           | 902               | 4     | 169     |
|     | CORPORATE OFFICE PROPERTIES  | 14           | 337               | 2     | 55      |
|     | COUSINS PROPERTIES INC       | 21           | 650               | 3     | 125     |
|     | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO   | 20           | 107               | —     | —       |
|     | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 51           | 7,063             | 5     | 743     |
|     | EASTGROUP PROPERTIES INC     | 5            | 603               | 0.545 | 77      |
|     | EPR PROPERTIES               | 11           | 339               | 4     | 114     |
|     | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 25           | 1,524             | 8     | 554     |
|     | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 9            | 2,107             | 1     | 469     |
|     | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 16           | 1,629             | 3     | 366     |
|     | FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 9            | 784               | 2     | 178     |
|     | FIRST INDUSTRIAL REALTY TR   | 16           | 611               | 1     | 61      |
|     | GETTY REALTY CORP            | 5            | 135               | 0.993 | 30      |
|     | WELLTOWER INC                | 58           | 3,118             | 9     | 585     |
|     | HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 13           | 504               | 2     | 99      |
|     | SERVICE PROPERTIES TRUST     | 26           | 233               | 7     | 55      |
|     | EQUITY COMMONWEALTH          | 18           | 573               | 5     | 151     |
|     | KILROY REALTY CORP           | 14           | 883               | 2     | 128     |
|     | KITE REALTY GROUP TRUST      | 19           | 235               | 9     | 127     |
|     | LEXINGTON REALTY TRUST       | 40           | 414               | 3     | 33      |
|     | LTC PROPERTIES INC           | 4            | 173               | 0.778 | 29      |
|     | MACK-CALI REALTY CORP        | 13           | 207               | 3     | 58      |
|     | BOSTON PROPERTIES INC        | 20           | 1,879             | 4     | 410     |
|     | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 76           | 1,360             | 12    | 237     |
|     | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 15           | 1,801             | 3     | 388     |
|     | NATL HEALTH INVESTORS INC    | 6            | 382               | 1     | 93      |
|     | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 32           | 948               | 4     | 149     |

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

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

| 銘柄 |                              | 買付               |                   | 売付           |                  |
|----|------------------------------|------------------|-------------------|--------------|------------------|
|    |                              | 口数               | 金額                | 口数           | 金額               |
| 外国 | アメリカ                         | 千口               | 千アメリカドル           | 千口           | 千アメリカドル          |
|    | PARK HOTELS & RESORTS INC    | 32               | 379               | 6            | 89               |
|    | EQUITY RESIDENTIAL           | 46               | 2,794             | 10           | 605              |
|    | COLONY CAPITAL INC           | 73               | 179               | 24           | 68               |
|    | INVITATION HOMES INC         | 81               | 2,121             | 13           | 369              |
|    | JBG SMITH PROPERTIES         | 13               | 408               | 2            | 78               |
|    | ALEXANDER & BALDWIN INC      | 22               | 290               | —            | —                |
|    | GLADSTONE LAND CORP          | 1                | 24                | —            | —                |
|    | GLOBAL MEDICAL REIT INC      | 7                | 79                | 2            | 29               |
|    | VICI PROPERTIES INC          | 85               | 1,753             | 10           | 228              |
|    | AMERICOLD REALTY TRUST       | 30               | 1,023             | 4            | 155              |
|    | INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 8                | 157               | —            | —                |
|    | RETAIL VALUE INC             | 2<br>( 0.124)    | 29<br>( 4)        | —            | —                |
|    | BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A | 13               | 157               | 15           | 217              |
|    | FRONT YARD RESIDENTIAL CORP  | 6                | 65                | 2            | 39               |
|    | INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 4                | 475               | —            | —                |
|    | SAFEHOLD INC                 | 1                | 77                | —            | —                |
|    | AMERICAN FINANCE TRUST INC   | 18               | 145               | 3            | 29               |
|    | ESSENTIAL PROPERTIES REALTY  | 17               | 315               | —            | —                |
|    | ARA US HOSPITALITY TRUST     | 52<br>( —)       | 16<br>(△ 1)       | 149          | 44               |
|    | COREPOINT LODGING INC        | 6                | 23                | —            | —                |
|    | PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 2                | 36                | —            | —                |
|    | PRIME US REIT                | 64<br>( —)       | 49<br>(△ 2)       | 38           | 30               |
|    | NETSTREIT CORP               | 4                | 82                | —            | —                |
|    | CIM COMMERCIAL TRUST CORP    | 3                | 32                | —            | —                |
|    | KEPPEL PACIFIC OAK US REIT   | 203              | 149               | —            | —                |
|    | APARTMENT INCOME REIT CO     | —<br>( 47)       | —<br>( —)         | —            | —                |
|    | CTO REALTY GROWTH INC        | 1                | 62                | —            | —                |
|    | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 94               | 1,092             | 17           | 209              |
|    | LIBERTY PROPERTY TRUST       | 0.772<br>(△ 33)  | 48<br>(△ 2,013)   | —            | —                |
|    | PUBLIC STORAGE               | 20               | 4,204             | 3            | 744              |
|    | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 48               | 3,508             | 7            | 489              |
|    | VORNADO REALTY TRUST         | 20               | 814               | 4            | 153              |
|    | KIMCO REALTY CORP            | 50               | 593               | 2            | 30               |
|    | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 18               | 3,018             | 3            | 519              |
|    | APARTMENT INVT & MGMT CO -A  | 19<br>( 10)      | 715<br>( 340)     | 2<br>( 11)   | 89<br>( —)       |
|    | 小計                           | 3,658<br>(△ 268) | 116,968<br>( 429) | 901<br>( 30) | 21,209<br>( 664) |
|    | カナダ                          |                  | 千カナダドル            |              | 千カナダドル           |
|    | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 2                | 79                | —            | —                |
|    | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 11               | 249               | 3            | 74               |

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

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

| 銘柄 |                              | 買付              |               | 売付    |            |
|----|------------------------------|-----------------|---------------|-------|------------|
|    |                              | 口数              | 金額            | 口数    | 金額         |
| 外国 | イギリス                         | 千口              | 千イギリスポンド      | 千口    | 千イギリスポンド   |
|    | HAMMERSON PLC-NIL PAID-RTS   | —<br>( 1,024)   | —<br>( —)     | 1,024 | 82         |
|    | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 93              | 583           | 7     | 46         |
|    | INTU PROPERTIES PLC          | 329             | 23            | 530   | 20         |
|    | PRIMARY HEALTH PROPERTIES    | 176             | 267           | 15    | 25         |
|    | SEGRO PLC                    | 177             | 1,524         | 28    | 253        |
|    | WORKSPACE GROUP PLC          | 20              | 145           | 3     | 28         |
|    | SHAFESBURY PLC               | 53              | 303           | 3     | 20         |
|    | BIG YELLOW GROUP PLC         | 20              | 203           | —     | —          |
|    | DERWENT LONDON PLC           | 15              | 451           | 1     | 45         |
|    | LONDONMETRIC PROPERTY PLC    | 132             | 277           | 20    | 47         |
|    | HANSTEEN HOLDINGS PLC        | —               | —             | 90    | 105        |
|    | RDI REIT PLC                 | 27              | 25            | —     | —          |
|    | SAFESTORE HOLDINGS PLC       | 24              | 170           | 2     | 20         |
|    | TRITAX BIG BOX REIT PLC      | 247             | 338           | 48    | 79         |
|    | ASSURA PLC                   | 357             | 278           | —     | —          |
|    | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 117             | 50            | —     | —          |
|    | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 94              | 65            | 27    | 20         |
|    | REGIONAL REIT LTD            | 83              | 65            | —     | —          |
|    | CAPITAL & REGIONAL PLC       | —<br>(△ 68)     | —<br>( —)     | 7     | 3          |
|    | NEWRIVER REIT PLC            | 109             | 82            | 85    | 64         |
|    | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC   | 69              | 66            | —     | —          |
|    | UNITE GROUP PLC/THE          | 50              | 456           | —     | —          |
|    | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC   | 108             | 112           | —     | —          |
|    | LXI REIT PLC                 | 57              | 66            | —     | —          |
|    | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT  | 149             | 93            | 77    | 50         |
|    | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING  | 46              | 41            | —     | —          |
|    | PICTON PROPERTY INCOME LTD   | 136             | 96            | 80    | 61         |
|    | AEW UK REIT PLC              | 29              | 18            | 39    | 25         |
|    | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE | 288             | 465           | 17    | 33         |
|    | BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS | 307             | 217           | 41    | 25         |
|    | CUSTODIAN REIT PLC           | 125             | 116           | —     | —          |
|    | GCP STUDENT LIVING PLC       | 147             | 197           | —     | —          |
|    | SUPERMARKET INCOME REIT PLC  | 223             | 242           | 27    | 29         |
|    | STANDARD LIFE INV PROP INC   | 126             | 67            | —     | —          |
|    | 小計                           | 5,383<br>( 785) | 8,181<br>( —) | 2,239 | 1,262      |
|    | オーストラリア                      |                 | 千オーストラリアドル    |       | 千オーストラリアドル |
|    | VICINITY CENTRES             | 768             | 1,206         | 197   | 276        |
|    | ABACUS PROPERTY GROUP        | 67              | 181           | 20    | 54         |
|    | INGENIA COMMUNITIES GROUP    | 71              | 324           | 27    | 129        |
|    | CHARTER HALL GROUP           | 56              | 567           | 1     | 21         |
|    | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 58              | 138           | 15    | 52         |
|    | CROMWELL PROPERTY GROUP      | 176             | 167           | —     | —          |
|    | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 158             | 364           | —     | —          |

|        | 銘柄                           | 買付             |                | 売付  |             |
|--------|------------------------------|----------------|----------------|-----|-------------|
|        |                              | 口数             | 金額             | 口数  | 金額          |
| 外国     | オーストラリア                      | 千口             | 千オーストラリアドル     | 千口  | 千オーストラリアドル  |
|        | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 36             | 120            | —   | —           |
|        | NATIONAL STORAGE REIT        | 164            | 295            | 24  | 45          |
|        | GDI PROPERTY GROUP           | 60             | 61             | —   | —           |
|        | APN INDUSTRIA REIT           | 39             | 94             | 17  | 43          |
|        | SCENTRE GROUP                | 705            | 1,640          | 144 | 347         |
|        | ARENA REIT                   | 36             | 87             | —   | —           |
|        | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS   | 25             | 77             | —   | —           |
|        | AVENTUS GROUP                | 115            | 286            | —   | —           |
|        | WAYPOINT REIT                | 153            | 400            | —   | —           |
|        | CHARTER HALL LONG WALE REIT  | 77             | 364            | 3   | 15          |
|        | CENTURIA OFFICE REIT         | 47             | 86             | —   | —           |
|        | RURAL FUNDS GROUP            | 48             | 96             | —   | —           |
|        | IRONGATE GROUP               | 160            | 209            | —   | —           |
|        | CENTURIA INDUSTRIAL REIT     | 152            | 482            | —   | —           |
|        | HOME CONSORTIUM              | 44             | 174            | —   | —           |
|        | CENTURIA CAPITAL GROUP       | 163            | 366            | —   | —           |
|        | HOMECO DAILY NEEDS REIT      | 77             | 94             | —   | —           |
|        |                              | ( 22)          | ( —)           |     |             |
|        | GPT GROUP                    | 248            | 1,061          | 22  | 95          |
|        | MIRVAC GROUP                 | 545            | 1,276          | 117 | 294         |
|        | STOCKLAND                    | 310            | 1,078          | 57  | 232         |
|        | DEXUS                        | 115            | 1,119          | —   | —           |
|        | BWP TRUST                    | 69             | 255            | 13  | 43          |
|        | CHARTER HALL RETAIL REIT     | 82             | 275            | —   | —           |
|        | GOODMAN GROUP                | 232            | 3,552          | 27  | 444         |
|        | 小計                           | 5,070<br>( 22) | 16,509<br>( —) | 691 | 2,096       |
| 国      | ニュージーランド                     |                | 千ニュージーランドドル    |     | 千ニュージーランドドル |
|        | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 41             | 121            | —   | —           |
|        | KIWI PROPERTY GROUP LTD      | 170            | 183            | —   | —           |
|        | GOODMAN PROPERTY TRUST       | 126            | 281            | —   | —           |
|        | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 115            | 190            | —   | —           |
|        | ARGOSY PROPERTY LTD          | 162            | 197            | 77  | 102         |
|        | 小計                           | 615            | 974            | 77  | 102         |
|        | 香港                           |                | 千香港ドル          |     | 千香港ドル       |
|        | LINK REIT                    | 283            | 18,972         | 58  | 3,884       |
|        | CHAMPION REIT                | 191            | 818            | —   | —           |
|        | PROSPERITY REIT              | 93             | 244            | —   | —           |
|        | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 175            | 658            | —   | —           |
| シンガポール | SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST  | 198            | 782            | 68  | 261         |
|        | FORTUNE REIT                 | 296            | 2,067          | 108 | 752         |
|        | 小計                           | 1,236          | 23,544         | 234 | 4,898       |
|        | シンガポール                       |                | 千シンガポールドル      |     | 千シンガポールドル   |
|        | SUNTEC REIT                  | 259            | 368            | 48  | 69          |
|        |                              | ( —)           | (△ 1)          |     |             |

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

| 銘柄 |                               | 買付                |                    | 売付               |                   |
|----|-------------------------------|-------------------|--------------------|------------------|-------------------|
|    |                               | 口数                | 金額                 | 口数               | 金額                |
| 外  | シンガポール                        | 千口                | 千シンガポールドル          | 千口               | 千シンガポールドル         |
|    | KEPPEL DC REIT                | 203               | 523                | 46               | 122               |
|    | FRASERS LOGISTICS & COMMERCI  | 367<br>( 223)     | 457<br>( 243)      | 62<br>( -)       | 79<br>( 7)        |
|    | EC WORLD REIT                 | 76                | 51                 | -                | -                 |
|    | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME  | 40                | 31                 | -                | -                 |
|    | LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL    | 261<br>( -)       | 189<br>(△ 1)       | -                | -                 |
|    | IREIT GLOBAL                  | 158               | 106                | -                | -                 |
|    | IREIT GLOBAL-RIGHTS           | -<br>( 44)        | -<br>( 5)          | 44<br>( -)       | 4<br>( 5)         |
|    | CAPITALAND INTEGRATED COMMER  | 439<br>( 590)     | 876<br>( 1,317)    | 160              | 323               |
|    | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT  | 507<br>( -)       | 1,528<br>(△ 22)    | 123              | 386               |
| 国  | 小計                            | 8,877<br>( 1,995) | 10,012<br>( 1,483) | 1,708<br>(1,002) | 2,349<br>( 1,831) |
|    | 韓国                            |                   | 千韓国ウォン             |                  | 千韓国ウォン            |
|    | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD     | 9                 | 62,665             | -                | -                 |
|    | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS | -<br>( 0.798)     | -<br>( -)          | 0.798            | 270               |
|    | LOTTE REIT CO LTD             | 23                | 136,630            | -                | -                 |
|    | MIRAE ASIA PAC REAL EST-1     | 24                | 96,035             | -                | -                 |
|    | IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD   | 9                 | 42,987             | -                | -                 |
|    | JR REIT XXVII                 | 34                | 183,469            | -                | -                 |
|    | 小計                            | 100<br>( 0.798)   | 521,788<br>( -)    | 0.798            | 270               |
|    | イスラエル                         |                   | 千イスラエルシェケル         |                  | 千イスラエルシェケル        |
|    | REIT 1 LTD                    | 21                | 343                | -                | -                 |
|    | 小計                            | 21                | 343                | -                | -                 |

(注) 金額は受渡代金。

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

## ○株式売買比率

(2020年1月7日～2021年1月5日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年1月7日～2021年1月5日)

利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        | 百万円       | 百万円                | %             | 百万円       | 百万円                | %             |
| 為替直物取引 | 16,830    | 570                | 3.4           | 3,658     | 21                 | 0.6           |

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

○組入資産の明細

(2021年1月5日現在)

外国株式

2021年1月5日現在の組入れはございません。

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

## 外国投資信託証券

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

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

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

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

| 銘 柄                          |               | 期首(前期末) |     | 当 期 末  |         |     |
|------------------------------|---------------|---------|-----|--------|---------|-----|
|                              |               | 口 数     | 口 数 | 評 価 額  |         | 比 率 |
|                              |               |         |     | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |     |
| (カナダ)                        |               | 千口      | 千口  | 千カナダドル | 千円      | %   |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME |               | 9       | 15  | 222    | 17,969  | 0.0 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT |               | 13      | 26  | 322    | 26,011  | 0.1 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME |               | 5       | 9   | 742    | 59,931  | 0.1 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST |               | 12      | 21  | 281    | 22,743  | 0.1 |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE |               | 12      | 23  | 299    | 24,135  | 0.  |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI |               | 4       | 6   | 99     | 8,056   | 0.0 |
| CHOICE PROPERTIES REIT       |               | 30      | 50  | 649    | 52,426  | 0.1 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR |               | 13      | 16  | 250    | 20,217  | 0.1 |
| PLAZA RETAIL REIT            |               | —       | 14  | 54     | 4,411   | 0.0 |
| SLATE GROCERY REIT           |               | 5       | 8   | 101    | 8,149   | 0.0 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE |               | 10      | 16  | 276    | 22,321  | 0.1 |
| SLATE OFFICE REIT            |               | 5       | 13  | 56     | 4,530   | 0.0 |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI |               | 14      | 24  | 327    | 26,427  | 0.1 |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E |               | 9       | 16  | 101    | 8,219   | 0.0 |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE  |               | 3       | 5   | 99     | 8,043   | 0.0 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN |               | —       | 34  | 463    | 37,412  | 0.1 |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I |               | —       | 12  | 233    | 18,873  | 0.0 |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E |               | —       | 5   | 58     | 4,752   | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 306     | 549 | 9,464  | 763,558 |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 24      | 27  | —      | <1.9%>  |     |
| (ユーロ…ドイツ)                    |               |         |     | 千ユーロ   |         |     |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG       |               | 32      | 56  | 812    | 102,727 | 0.3 |
| HAMBORNER REIT AG            |               | 15      | 21  | 191    | 24,160  | 0.1 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 47      | 77  | 1,003  | 126,888 |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2       | 2   | —      | <0.3%>  |     |
| (ユーロ…イタリア)                   |               |         |     |        |         |     |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ |               | 8       | 13  | 49     | 6,260   | 0.0 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 8       | 13  | 49     | 6,260   |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1       | 1   | —      | <0.0%>  |     |
| (ユーロ…フランス)                   |               |         |     |        |         |     |
| GECINA SA                    |               | 11      | 17  | 2,187  | 276,513 | 0.7 |
| KLEPIERRE                    |               | 43      | 63  | 1,143  | 144,575 | 0.4 |
| COVIVIO                      |               | 9       | 15  | 1,117  | 141,319 | 0.3 |
| MERCIALYS                    |               | 5       | 13  | 96     | 12,155  | 0.0 |
| ICADE                        |               | 5       | 10  | 630    | 79,660  | 0.2 |
| ALTAREA                      |               | 0.785   | 1   | 174    | 22,089  | 0.1 |
| CARMILA                      |               | —       | 14  | 169    | 21,481  | 0.1 |
| 小 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 75      | 136 | 5,519  | 697,796 |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 6       | 7   | —      | <1.7%>  |     |
| (ユーロ…オランダ)                   |               |         |     |        |         |     |
| EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV   |               | 8       | 10  | 162    | 20,597  | 0.1 |
| NSI NV                       |               | 3       | 5   | 182    | 23,019  | 0.1 |
| VASTNED RETAIL NV            |               | 4       | 6   | 151    | 19,189  | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    |               | 28      | 43  | 2,659  | 336,245 | 0.8 |

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

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

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

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

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

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2021年1月5日現在)

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

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

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月5日現在)

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

<注記事項>

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

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

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

○損益の状況 (2020年1月7日～2021年1月5日)

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

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

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